

# 渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金 2018 年半年度报告

2018 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：2018 年 8 月 29 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 2018 年 8 月 27 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 2018 年 02 月 11 日（基金合同生效日）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.....	12
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>13</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
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.....	17
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>18</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
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.....	18
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.....	18
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>19</b>
6.1 资产负债表.....	19
6.2 利润表.....	20

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
6.4 报表附注.....	22
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>46</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	46
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	46
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.....	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
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.....	50
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.....	51
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.....	51
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.....	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
7.12 投资组合报告附注.....	52
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>54</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
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.....	54
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	55
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>56</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>57</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	57
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.....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
10.4 基金投资策略的改变.....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
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.....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57
10.8 其他重大事件.....	58

---

<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>60</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 .....	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	60
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>61</b>
12.1 备查文件目录.....	61
12.2 存放地点.....	61
12.3 查阅方式.....	61

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

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	-	
基金主代码	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	29,548,543.80 份	
基金合同存续期	-	
基金份额上市的证券交易所	-	
上市日期	-	
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
下属分级基金场内简称:	-	-
下属分级基金的交易代码:	005429	005430
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	20,967,783.04 份	8,580,760.76 份

### 2.2 基金产品说明

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：集中投资于某一期附近附近的债券 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>

### 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

### 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。

### 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。

### 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。

(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，

	<p>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>本基金将通过对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>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	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。	
	渤海汇金睿选混合 A	渤海汇金睿选混合 C
下属分级基金的风险收益特征	-	-

### 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	周磊	郭明
	联系电话	010-68784298	010-66105798
	电子邮箱	shenkeji@msn.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-651-5988/ 400-651-1717	95588
传真		022-23861651	010-66105799
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	易会满



## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="https://www.bhhjamc.com">https://www.bhhjamc.com</a>
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

基金级别	渤海汇金睿选混合 A	渤海汇金睿选混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年2月11日 - 2018年6月30日)	报告期(2018年2月11日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	1,193,812.44	694,095.62
本期利润	1,206,527.82	684,672.14
加权平均基金份额本期利润	0.0148	0.0123
本期加权平均净值利润率	1.47%	1.22%
本期基金份额净值增长率	1.76%	1.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
期末可供分配利润	360,593.26	116,720.89
期末可供分配基金份额利润	0.0172	0.0136
期末基金资产净值	21,337,242.70	8,701,112.65
期末基金份额净值	1.0176	1.0140
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	1.76%	1.40%

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以实现部分的孰低数。

4、本基金合同于 2018 年 2 月 11 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

渤海汇金睿选混合 A

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

自基金合同生效起至今	1.76%	0.06%	-0.83%	0.33%	2.59%	-0.27%
------------	-------	-------	--------	-------	-------	--------

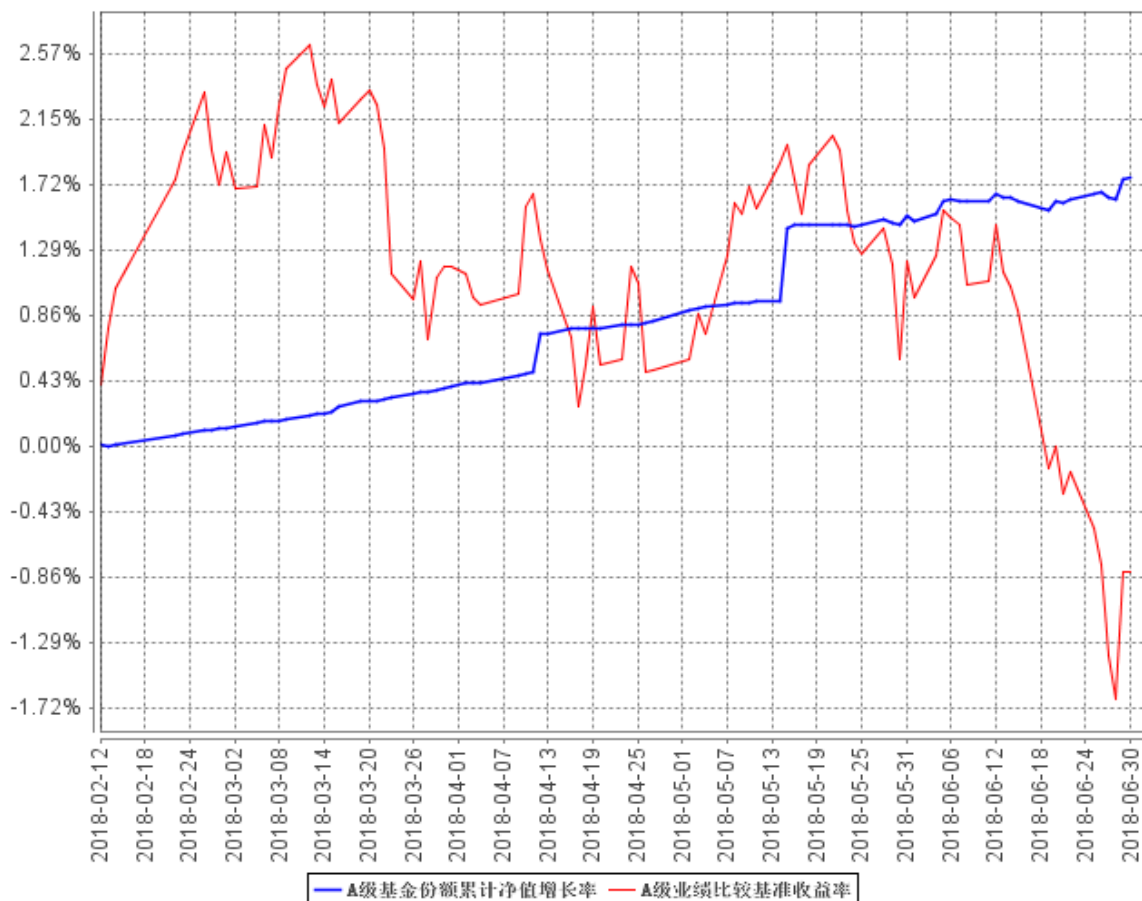
## 渤海汇金睿选混合 C

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
自基金合同生效起至今	1.40%	0.04%	-0.83%	0.33%	2.23%	-0.29%

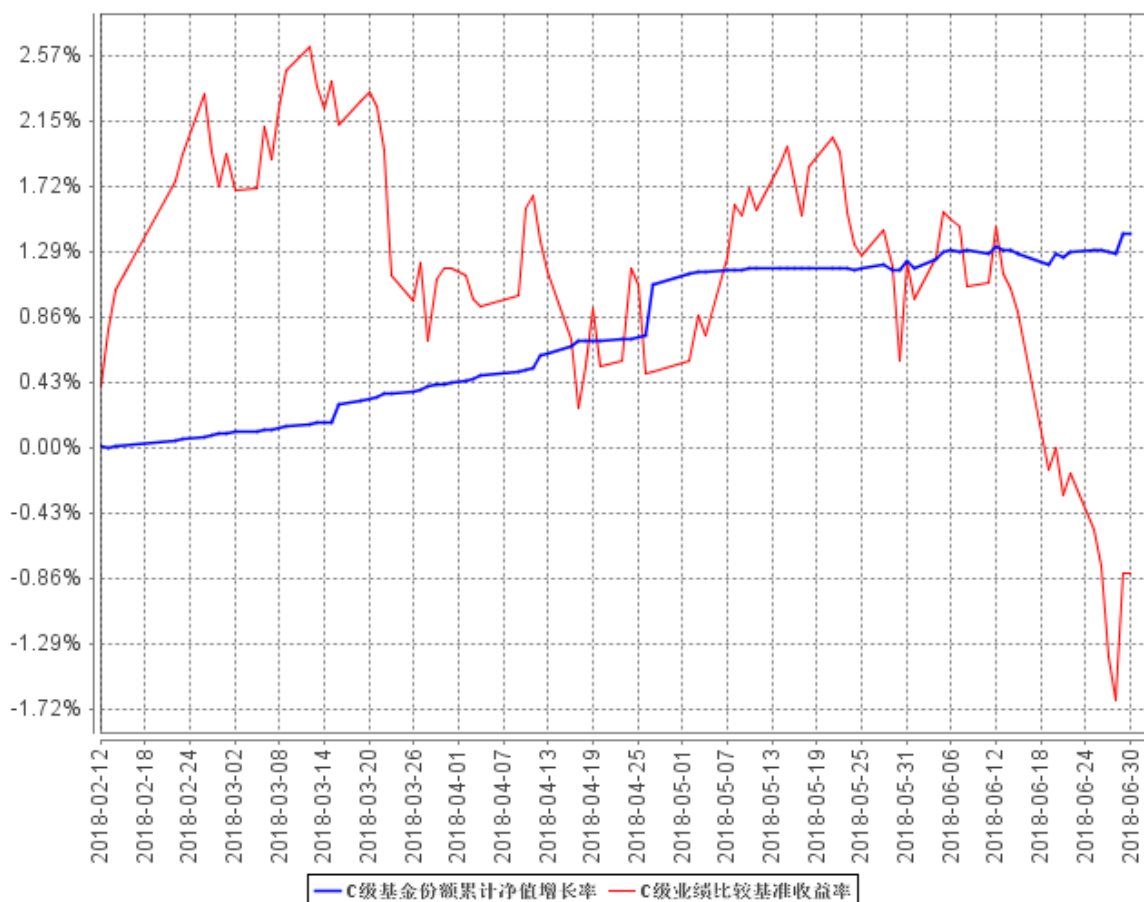
注：业绩比较基准：上证国债指数收益率×70%+沪深 300 指数收益率×30%。

### 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

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、本基金合同生效日为 2018 年 2 月 11 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2、自基金成立日起 6 个月内为建仓期，截至报告期末，本基金尚处于建仓期。

### 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 2018 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 4 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。

#### 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 2 月 11 日	-	14	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 月起担任渤海汇金汇添金货币市场基金基金经理。2018 年 2 月起任渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金基金经理。
李杨	本基金的基金经理	2018 年 2 月 11 日	-	1	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 月起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。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。2018 年 2 月起任渤海汇金睿选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。

## 4.2 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 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，并通过恒生 O32 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 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

2018 年上半年，国内经济依旧保持韧性，经济数据仅小幅下降，通胀保持温和。与经济数据相比，金融数据在前期去杠杆的大方向下，呈现出断崖式回落。政策和资金方面，在货币政策和宏观审慎的双支柱调控框架下，货币政策以调整经济结构、缓冲外围不确定性加大冲击实体经济、防范处置风险带来的风险为目的，在上半年已出现边际调整。具体在操作来看，央行 3 次定向降准，MLF 担保品扩容，MLF 超额投放。综合内外因素，造成债券市场走势的分化，利率债和高评级信用债表现强势，收益大幅下行。中低评级信用债收益上升并且失去流动性，信用利差拉大。10 年国债和十年国开上半年收益率分别回落 43bps 和 62bps。如果从年内高点测算的话分别回落 53bps 和 90bps。

由于上半年信用风险事件频出，在投资运作上以低风险的银行存单和高评级短久期信用债券为主要投资品种。保持净值稳定增长的同时，降低信用敞口，规避信用风险。

基于对整体市场环境及大类资产的风险分析，期间对于权益资产始终保持谨慎建仓的原则，并优选能够抵御市场风险的优质股票标的进行配置，从而保障了整体资产净值的稳定。

#### 4.4.2 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 1.0176 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.76%；截至本报告期末渤海汇金睿选混合 C 基金份额净值为 1.0140 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.40%；同期业绩比较基准收益率为-0.83%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年拉动经济的主要动力在于外需，而目前中美贸易冲突的影响并未在贸易数据上得以体现，反而由于贸易商较为悲观事先进口带动上半年进口数据的大幅增加，而随着冲突带来的影响逐渐显现，下半年进出口数据难以继续向好，而在地产调控并未放松、基建低位等的背景下，经济面临较大的下行压力；财政政策方面，一方面财政支出方面支撑基建托底，全口径下 1.3% 的基建经济无疑是目前拖累经济的重要因素，下半年可能依托基建对经济有所支撑，另一方面，通过减税降费拉动居民消费和企业利润，财政政策可能从支出和收入两个角度同时发力提振经济；货币政策方面，从上半年央行的操作来看，央行并未跟随美联储加息，且通过定向降准支持“债转股”和小微企业融资，预期下半年还有降准等宽松措施，流动性维持“合理充裕”的水平。

债券市场方面，受风险偏好降低的影响，投资者的需求将向利率债倾斜，因此利率债存在机会，但要注意触及关键压力点位时可能会带来的回调。信用债方面，市场“嫌贫爱富”“嫌长爱短”的配置偏好不会变，信用风险依旧是下半年信用债投资的主体，更值得注意的是三季度股权质押到期，房地产企业的相关风险，主要投资配置思路还是中短久期、高评级。可转债方面，关注转股价格下修带来的交易机会，谨慎参与一级市场打新，精选稀缺优质标的参与。

权益行业配置方面，下半年受益于原油价格上涨的石油石化、受益于人民币贬值的纺织服装以及电子和计算机中受益于贸易战相关的自主可控品种料将有较好的表现。而消费升级和产业升级是未来很长一段时期内最确定和最具有持续性的主线，前者以医药、食品饮料、餐饮旅游、保险等为代表，后者主要集中在芯片、航空航天、核电等高端制造。

#### 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历。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**

本基金为发起式基金，且截至本报告期末，本基金基金合同生效未满 3 年，暂不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

## § 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睿选混合型发起式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，渤海汇金睿选混合型发起式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睿选混合型发起式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。本报告期内，渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金未进行利润分配。

### 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睿选混合型发起式证券投资基金 2018 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：渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	96,915.73	-
结算备付金		700,492.44	-
存出保证金		1,802.51	-
交易性金融资产	6.4.7.2	13,290,059.30	-
其中：股票投资		631,862.80	-
基金投资		-	-
债券投资		12,658,196.50	-
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	15,800,000.00	-
应收证券清算款		7,613.51	-
应收利息	6.4.7.5	285,242.71	-
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		30,182,126.20	-
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2017 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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		20,118.14	-
应付管理人报酬		30,903.06	-
应付托管费		5,150.55	-
应付销售服务费		4,535.08	-
应付交易费用	6.4.7.7	7,563.13	-

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	75,500.89	-
负债合计		143,770.85	-
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	29,548,543.80	-
未分配利润	6.4.7.10	489,811.55	-
所有者权益合计		30,038,355.35	-
负债和所有者权益总计		30,182,126.20	-

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，渤海汇金睿选混合 A 基金份额净值 1.0176 元，基金份额总额 20,967,783.04 份；渤海汇金睿选混合 C 基金份额净值 1.0140 元，基金份额总额 8,580,760.76 份。渤海汇金睿选混合份额总额合计为 29,548,543.80 份。

## 6.2 利润表

会计主体：渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金

本报告期：2018 年 2 月 11 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 2 月 11 日(基 金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		2,877,606.72	-
1.利息收入		2,826,865.62	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,227,196.22	-
债券利息收入		868,091.72	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		731,577.68	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-590,243.20	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-593,757.00	-
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	-	-
股利收益	6.4.7.16	3,513.80	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	3,291.90	-

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	637,692.40	-
<b>减：二、费用</b>		986,406.76	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	653,509.36	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	108,918.21	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	133,295.61	-
4. 交易费用	6.4.7.19	5,662.99	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		2,314.79	-
7. 其他费用	6.4.7.20	82,705.80	-
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,891,199.96	-
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,891,199.96	-

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金

本报告期：2018年2月11日(基金合同生效日)至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018年2月11日(基金合同生效日)至2018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）	285,984,563.38	-	285,984,563.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,891,199.96	1,891,199.96
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）	-256,436,019.58	-1,401,388.41	-257,837,407.99
其中：1.基金申购款	218.99	1.01	220.00

2. 基金赎回款	-256,436,238.57	-1,401,389.42	-257,837,627.99
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)	-	-	0.00
五、期末所有者权益(基金净值)	29,548,543.80	489,811.55	30,038,355.35
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-	-
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)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	-	-	-

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>徐海军</u>	<u>周里勇</u>	<u>徐长莹</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金经中国证券监督管理委员会证监许可[2017]第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》核准，由渤海汇金证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币285,960,172.45元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2017)第1128号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《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合同》于2017年12月28日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为285,984,563.38份基金份额，其中认购资金利息折合24,390.93份基金份额。本基金的基金管理人为渤海汇金证券资产管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本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（包括主板、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、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单等货币市场工具、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比例不超过40%，其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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不低于基金资产净值的5%。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金业绩比较基准：上证国债指数收益率×70%+沪深300指数收益率×30%。

### 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》、《渤海汇金睿选混合型发起式证

券投资基金合同》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 2018 年 2 月 11 日（基金合同生效日）至 2018 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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 2 月 11 日（基金合同生效日）至 2018 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 重要会计政策和会计估计

### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2018 年 2 月 11 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日止期间。

### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。



#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产

与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按

照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 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[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》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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。

(2) 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，股票的股息、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。

(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。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得

税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

## 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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	96,915.73
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：	96,915.73

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	636,263.90	631,862.80	-4,401.10
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	2,007,366.50	2,002,596.50
	银行间市场	10,643,137.00	10,655,600.00
	合计	12,650,503.50	12,658,196.50
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	13,286,767.40	13,290,059.30	3,291.90

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 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 2018年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	15,800,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	15,800,000.00	-

##### 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 2018年6月30日
应收活期存款利息	19.03
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	315.30
应收债券利息	280,984.71
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	3,922.87
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.80
合计	285,242.71

#### 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 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	2,825.21

银行间市场应付交易费用	4,737.92
合计	7,563.13

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	37.81
预提费用	75,463.08
合计	75,500.89

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

渤海汇金睿选混合 A		
项目	本期 2018年2月11日(基金合同生效日)至2018年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	140,755,966.61	140,755,966.61
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-119,788,183.57	-119,788,183.57
- 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	20,967,783.04	20,967,783.04

金额单位：人民币元

渤海汇金睿选混合 C		
项目	本期 2018年2月11日(基金合同生效日)至2018年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	145,228,596.77	145,228,596.77
本期申购	218.99	218.99
本期赎回(以“-”号填列)	-136,648,055.00	-136,648,055.00
- 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	8,580,760.76	8,580,760.76

注：申购含红利再投、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

渤海汇金睿选混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	1,193,812.44	12,715.38	1,206,527.82
本期基金份额交易产生的变动数	-833,219.18	-3,848.98	-837,068.16
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-833,219.18	-3,848.98	-837,068.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	360,593.26	8,866.40	369,459.66

单位：人民币元

渤海汇金睿选混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	694,095.62	-9,423.48	684,672.14
本期基金份额交易产生的变动数	-577,374.73	13,054.48	-564,320.25
其中：基金申购款	1.04	-0.03	1.01
基金赎回款	-577,375.77	13,054.51	-564,321.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	116,720.89	3,631.00	120,351.89

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年2月11日(基金合同生效日)至2018年6月30日
活期存款利息收入	36,923.27
定期存款利息收入	1,185,631.95
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	4,634.04
其他	6.96
合计	1,227,196.22



**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**

注：本基金本报告期内无股票投资收益。

**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 2018年2月11日(基金合同生效日)至2018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	-593,757.00
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	-593,757.00

**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 2018年2月11日(基金合同生效日)至2018年 6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	125,040,936.74
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	122,685,062.00
减：应收利息总额	2,949,631.74
买卖债券差价收入	-593,757.00

**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。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：无

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2018年2月11日(基金合同生效日)至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,513.80
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,513.80

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年2月11日(基金合同生效日)至2018年6月30日
------	--------------------------------------

1. 交易性金融资产	3,291.90
——股票投资	-4,401.10
——债券投资	7,693.00
——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	3,291.90

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年2月11日(基金合同生效日)至2018年 6月30日
基金赎回费收入	637,692.40
合计	637,692.40

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年2月11日(基金合同生效日)至2018年 6月30日
交易所市场交易费用	2,902.99
银行间市场交易费用	2,760.00
合计	5,662.99

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年2月11日(基金合同生效日)至2018 年6月30日
审计费用	34,567.40
信息披露费	31,895.68

其他费用	400.00
银行汇划费用	6,842.72
银行间账户维护费	9,000.00
合计	82,705.80

#### 6.4.7.21 分部报告

-

### 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	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

### 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 2018年2月11日(基金合同生效日)至	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
-------	----------------------------	---------------------------------

	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	623,943.90	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 2018 年 2 月 11 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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	22,016,576.30	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 2018 年 2 月 11 日(基金合同生效 日)至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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	761,101,000.00	100.00%	-	-

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期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 2018 年 2 月 11 日(基金合同生效日)至 2018 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	2,825.21	100.00%	2,825.21	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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

## 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	上年度可比期间
	2018 年 2 月 11 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	653,509.36	-
其中：支付销售机构的客户维护费	89,654.81	-

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 1.2%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×1.2%/当年天数。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 2 月 11 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	108,918.21	-

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 0.20%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×0.20%/当年天数。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2018 年 2 月 11 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	渤海汇金睿选混合 A	渤海汇金睿选混合 C	合计
渤海汇金	-	133,295.61	133,295.61
工商银行	-	-	-
合计	-	-	-
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	渤海汇金睿选混合 A	渤海汇金睿选混合 C	合计
--	---------------	------------	----

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给渤海汇金，再由渤海汇金计算并支付给各基金销售机构。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.60%。其计算公式为：日销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 0.60% / 当年天数。

#### 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 2018 年 2 月 11 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日	
	渤海汇金睿选混合 A	渤海汇金睿选混合 C
基金合同生效日(2018 年 2 月 11 日)持有的基金份额	10,000,444.49	-
期初持有的基金份额	10,000,444.49	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,000,444.49	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	33.8400%	-

项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	渤海汇金睿选混合 A	渤海汇金睿选混合 C
基金合同生效日(2018 年 2 月 11 日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	-

期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-
-----------------------	---	---

#### 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 A 类及 C 类基金份额的情况。

#### 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 2018 年 2 月 11 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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
中国工商银行股份有限公司	96,915.73	36,923.27	-	-

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：无。

#### 6.4.12 期末（2018 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建立了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，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金管理人通过严格的交易对手评级制度和分散化投资方式防范信用风险，本基金在银行间同业市场进行交易时，根据交易对手在公司交易对手库中的评级设定相应的交易比例指标，并对证券交割方式进行限制，以控制相应的交易对手信用风险。本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。

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：本基金报告期期末无按短期信用评级列示债券投资

**6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：本基金报告期期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

**6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

注：本基金报告期期末无按短期信用评级列示的同业存单。

**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 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	2,002,596.60	-
合计	2,002,596.60	-

注：未评级部分包括国债和政策性金融债

**6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：本基金报告期期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资

**6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
AAA	10,655,600.00	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	10,655,600.00	-

**6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。风险管理的目标是确保基金组合资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度。

### 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 2018 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。

本基金主要投资于交易所以及银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。投资管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，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 2018 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	96,915.73	-	-	-	-	-	96,915.73
结算备付金	700,492.44	-	-	-	-	-	700,492.44
存出保证金	1,802.51	-	-	-	-	-	1,802.51
交易性金融资产	-	-5,871,600.00	6,785,600.00	996.50	-	-631,862.80	13,290,059.30

买入返售金融资产	15,800,000.00	-	-	-	-	-	15,800,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	7,613.51	7,613.51
应收利息	-	-	-	-	-	285,242.71	285,242.71
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	16,599,210.68	5,871,600.00	6,785,600.00	996.50	-924,719.02	-	30,182,126.20
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	20,118.14	20,118.14
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	30,903.06	30,903.06
应付托管费	-	-	-	-	-	5,150.55	5,150.55
应付销售服务费	-	-	-	-	-	4,535.08	4,535.08
应付交易费用	-	-	-	-	-	7,563.13	7,563.13
其他负债	-	-	-	-	-	75,500.89	75,500.89
负债总计	-	-	-	-	-	143,770.85	143,770.85
利率敏感度缺口	16,599,210.68	5,871,600.00	6,785,600.00	996.50	-780,948.17	-	30,038,355.35
上年度末 2017 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							
负债							

#### 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（2018 年 6 月 30 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率上升 25 个基点	30,554.14	-
2. 市场利率下降 25 个基点	-30,538.06		

#### 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。

#### 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 2018年6月30日		上年度末 2017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	631,862.80	2.10	-	-
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	631,862.80	2.10	-	-

#### 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（2018年6月30日）	上年度末（2017年12月31日）
	1. 市场利率上升5个基点	35,585.68	-
2. 市场利率下降5个基点	-35,585.68	-	

#### 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	631,862.80	2.09
	其中：股票	631,862.80	2.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,658,196.50	41.94
	其中：债券	12,658,196.50	41.94
	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	15,800,000.00	52.35
	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	797,408.17	2.64
8	其他各项资产	294,658.73	0.98
9	合计	30,182,126.20	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	8,892.00	0.03
B	采矿业	-	-
C	制造业	493,239.80	1.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	52,533.00	0.17
G	交通运输、仓储和邮政业	1,778.00	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	27,256.00	0.09

J	金融业	11,716.00	0.04
K	房地产业	6,194.00	0.02
L	租赁和商务服务业	2,347.50	0.01
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	25,870.50	0.09
R	文化、体育和娱乐业	2,036.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	631,862.80	2.10

### 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	600519	贵州茅台	200	146,292.00	0.49
2	000661	长春高新	200	45,540.00	0.15
3	600436	片仔癀	200	22,386.00	0.07
4	603986	兆易创新	200	21,704.00	0.07
5	603650	彤程新材	1,000	21,460.00	0.07
6	600276	恒瑞医药	230	17,424.80	0.06
7	603883	老百姓	200	16,632.00	0.06
8	000858	五粮液	200	15,200.00	0.05
9	000963	华东医药	300	14,475.00	0.05
10	000418	小天鹅 A	200	13,870.00	0.05
11	300347	泰格医药	200	12,374.00	0.04
12	300226	上海钢联	200	11,970.00	0.04
13	601318	中国平安	200	11,716.00	0.04
14	600486	扬农化工	200	11,186.00	0.04
15	600771	广誉远	200	10,992.00	0.04
16	000333	美的集团	200	10,444.00	0.03
17	002371	北方华创	200	9,934.00	0.03

18	000651	格力电器	200	9,430.00	0.03
19	603019	中科曙光	200	9,174.00	0.03
20	300122	智飞生物	200	9,148.00	0.03
21	300450	先导智能	300	9,072.00	0.03
22	002714	牧原股份	200	8,892.00	0.03
23	600885	宏发股份	280	8,377.60	0.03
24	300015	爱尔眼科	250	8,072.50	0.03
25	002179	中航光电	200	7,800.00	0.03
26	300413	快乐购	200	7,588.00	0.03
27	002415	海康威视	200	7,426.00	0.02
28	300003	乐普医疗	200	7,336.00	0.02
29	600760	中航沈飞	200	7,208.00	0.02
30	002727	一心堂	200	6,490.00	0.02
31	002422	科伦药业	200	6,420.00	0.02
32	603899	晨光文具	200	6,338.00	0.02
33	601155	新城控股	200	6,194.00	0.02
34	601100	恒立液压	280	5,846.40	0.02
35	002044	美年健康	240	5,424.00	0.02
36	600867	通化东宝	220	5,273.40	0.02
37	600845	宝信软件	200	5,270.00	0.02
38	600588	用友网络	200	4,902.00	0.02
39	000977	浪潮信息	200	4,770.00	0.02
40	600741	华域汽车	200	4,744.00	0.02
41	300408	三环集团	200	4,700.00	0.02
42	002236	大华股份	200	4,510.00	0.02
43	002475	立讯精密	200	4,508.00	0.02
44	002311	海大集团	200	4,220.00	0.01
45	601012	隆基股份	240	4,005.60	0.01
46	000786	北新建材	200	3,706.00	0.01
47	600426	华鲁恒升	200	3,518.00	0.01
48	002640	跨境通	200	3,004.00	0.01
49	002024	苏宁易购	200	2,816.00	0.01
50	300316	晶盛机电	200	2,658.00	0.01
51	300059	东方财富	200	2,636.00	0.01
52	300296	利亚德	200	2,576.00	0.01
53	002202	金风科技	200	2,528.00	0.01
54	300253	卫宁健康	200	2,478.00	0.01
55	002127	南极电商	250	2,347.50	0.01
56	300251	光线传媒	200	2,036.00	0.01



57	601111	中国国航	200	1,778.00	0.01
58	601933	永辉超市	200	1,528.00	0.01
59	002013	中航机电	200	1,514.00	0.01

## 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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	145,540.00	0.48
2	000661	长春高新	42,752.00	0.14
3	603986	兆易创新	24,188.00	0.08
4	600436	片仔癀	22,882.00	0.08
5	600276	恒瑞医药	16,839.00	0.06
6	000858	五粮液	15,304.90	0.05
7	603883	老百姓	15,099.00	0.05
8	000963	华东医药	14,926.00	0.05
9	000418	小天鹅 A	12,948.00	0.04
10	603650	彤程新材	12,320.00	0.04
11	601318	中国平安	12,314.00	0.04
12	300226	上海钢联	12,084.00	0.04
13	600486	扬农化工	12,077.00	0.04
14	600771	广誉远	11,722.00	0.04
15	300347	泰格医药	10,836.00	0.04
16	002714	牧原股份	10,615.00	0.04
17	000333	美的集团	10,268.00	0.03
18	300450	先导智能	10,138.00	0.03
19	002371	北方华创	9,688.00	0.03
20	603019	中科曙光	9,651.00	0.03

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。  
2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项的“累计买入金额”按买卖成交金额（成交价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本报告期本基金未卖出股票。

### 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	636,263.90
卖出股票收入（成交）总额	-

### 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	2,001,600.00	6.66
2	央行票据	-	-
3	金融债券	996.50	0.00
	其中：政策性金融债	996.50	0.00
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	10,655,600.00	35.47
9	其他	-	-
10	合计	12,658,196.50	42.14

### 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	111815068	18 民生银行 CD068	60,000	5,871,600.00	19.55
2	111786794	17 杭州银行 CD210	50,000	4,784,000.00	15.93
3	019585	18 国债 03	20,000	2,001,600.00	6.66
4	018006	国开 1702	10	996.50	0.00

## 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

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

### 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

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

**7.12.1 声明本基金投资的前十名证券 的发行主体本期是否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。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明。**

无。

**7.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明。**

否。

### 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	1,802.51
2	应收证券清算款	7,613.51
3	应收股利	-
4	应收利息	285,242.71
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	294,658.73

#### **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

份额级别	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
渤海汇金睿选混合 A	213	98,440.30	10,000,444.49	47.69%	10,967,338.55	52.31%
渤海汇金睿选混合 C	129	66,517.53	0.00	0.00%	8,580,760.76	100.00%
合计	342	86,399.25	10,000,444.49	33.84%	19,548,099.31	66.16%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	渤海汇金睿选混合 A	381,745.36	1.2919%
	渤海汇金睿选混合 C	-	-
	合计	381,745.36	1.2919%

### 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	份额级别	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	渤海汇金睿选混合 A	0~10
	渤海汇金睿选混合 C	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开	渤海汇金睿选混合 A	0~10

放式基金	渤海汇金睿选混合 C	-
	合计	0~10

#### 8.4 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	33.84	10,000,444.49	33.84	自合同生效之日起不少于三年
基金管理人高级管理人员	59,961.40	0.20	-	-	-
基金经理等人员	49,950.05	0.17	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,110,355.94	34.22	10,000,444.49	33.84	自合同生效之日起不少于三年

## § 9 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
基金合同生效日（2018 年 2 月 11 日）基金份 额总额	140,755,966.61	145,228,596.77
本报告期期初基金份额总额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购 份额	-	218.99
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎 回份额	119,788,183.57	136,648,055.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变 动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	20,967,783.04	8,580,760.76



## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 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

本报告期内，本基金管理人、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

本报告期内，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

报告期内基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为其审计机构。本报告期应支付普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用 34,567.40 元。该审计机构为本基金提供审计服务的期间为基金成立日(2018 年 2 月 11 日)起至本报告期末,不满一年。

### 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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
渤海证券	2	623,943.90	100.00%	2,825.21	100.00%	-

### 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	22,016,576.30	100.00%	761,101,000.00	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	渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金费率优惠的活动公告	上海证券报、公司网站	2018年1月9日
2	关于渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金延长募集期的公告	上海证券报、公司网站	2018年2月5日
3	渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金基金合同生效公告	上海证券报、公司网站	2018年2月12日
4	渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	上海证券报、公司网站	2018年3月12日
5	关于旗下渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金在直销柜台开展赎回费率优惠活动的公告	上海证券报、公司网站	2018年3月14日
6	关于旗下渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金开展直销柜台费率优惠活动的公告	上海证券报、公司网站	2018年3月14日
7	关于旗下渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金参加工商银行基金申购费率优惠	上海证券报、公司网站	2018年3月14日

	活动的公告		
8	渤海汇金证券资产管理有限公司关于参加天天基金网、好买网费率优惠活动的公告	上海证券报、公司网站	2018 年 3 月 14 日
9	关于旗下渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金继续参加工商银行基金申购费率优惠活动的公告	上海证券报、公司网站	2018 年 3 月 30 日
10	渤海汇金证券资产管理有限公司关于参加上海基煜基金销售有限公司优惠活动的公告	上海证券报、公司网站	2018 年 4 月 26 日
11	关于渤海汇金证券资产管理有限公司增加上海基煜基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	上海证券报、公司网站	2018 年 4 月 26 日
12	渤海汇金证券资产管理有限公司关于参加天津国美基金销售有限公司费率优惠活动的公告	上海证券报、公司网站	2018 年 5 月 25 日
13	关于渤海汇金证券资产管理有限公司增加天津国美基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	上海证券报、公司网站	2018 年 5 月 25 日
14	渤海汇金证券资产管理有限公司关于参加东海证券股份有限公司费率优惠活动的公告	上海证券报、公司网站	2018 年 6 月 5 日
15	关于渤海汇金证券资产管理有限公司增加东海证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	上海证券报、公司网站	2018 年 6 月 5 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	1	20180515-20180630	10,000,444.49	0.00	0.00	10,000,444.49	34%
	2	20180427-20180514	19,999,000.00	0.00	19,999,000.00	0.00	0%
	3	20180412-20180514	29,999,000.00	0.00	29,999,000.00	0.00	0%
	4	20180316-20180411	50,001,222.22	0.00	50,001,222.22	0.00	0%
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。

### 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。

### 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

2018 年 8 月 29 日