

# 渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资 基金招募说明书(更新)摘要

## 重要提示

本基金募集申请已于 2018 年 2 月 28 日获中国证监会证监许可【2018】371 号文准予募集注册。本基金的基金合同于 2018 年 7 月 20 日正式生效。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景和收益等作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。

本基金投资于证券期货市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资有风险，投资者在投资本基金前，请认真阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，自主判断基金的投资价值，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，承担基金投资中出现的各类风险。投资本基金可能遇到的风险包括：投资于本基金的特有风险，如量化模型风险、投资特定品种的特有风险、巨额赎回风险、基金合同终止风险等；证券市场整体环境引发的系统性风险；个别证券特有的非系统性风险；大量赎回或暴跌导致的流动性风险；基金投资过程中产生的操作风险；因交收违约和投资债券引发的信用风险等。本基金的具体运作特点详见基金合同和招募说明书的约定。本基金的一般风险及特有风险详见本招募说明书的“风险揭示”部分。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并按监管要求履行相关程序。

基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。此外，本基金以 1 元初始面值进行募集，在市场波动等因素的影响下，存在单位份额净值跌破 1 元初始面值的风险。

本基金是一只混合型基金，预期风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，属于中高风险水平的投资品种。

基金不同于银行储蓄与债券，基金投资人有可能获得较高的收益，也有可能损失本金。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过 50% 的除外。本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2019 年 7 月 20 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2019 年 6 月 30 日（未经审计）。

## 第一部分基金管理人

### 一、基金管理人概况

名称：渤海汇金证券资产管理有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 a 栋 201 室

办公地址：深圳市南山区海岸大厦西座 2901、2913 室

成立日期：2016 年 5 月 18 日

法定代表人：徐海军

注册资本：11 亿元人民币

联系人：魏文婷

联系电话：010—68784295

股权结构：

股 东

出资额

（万元人民币）

出资比例

（%）

渤海证券股份有限公司 110, 000 100

合 计 110, 000 100

经营范围：证券资产管理、公开募集证券投资基金管理业务

## 二、主要人员情况

### 1、董事会成员基本情况

徐海军先生，董事长、代履职总经理，南开大学法学硕士。1996 年参加工作，历任南方证券天津解放路营业部业务员、南方证券天津分公司资产保全部副经理；2001 年 3 月至 2007 年 6 月，任渤海证券股份有限公司法律事务部经理、北京总部总经理等职；2007 年 6 月至 2017 年 6 月，任渤海证券股份有限公司合规总监、首席风险官兼风险控制总部总经理；2017 年 7 月至 2017 年 9 月任渤海证券股份有限公司合规总监、财务总监；2017 年 9 月至今任渤海证券股份有限公司财务总监。2016 年 9 月至 2017 年 7 月，兼任渤海汇金证券资产管理有限公司合规总监、首席风险官；2017 年 7 月至 2017 年 9 月，兼任渤海汇金证券资产管理有限公司合规总监；2017 年 9 月起至今，兼任渤海汇金证券资产管理有限公司董事长；2019 年 4 月 26 日起至今，代履职海汇金证券资产管理有限公司总经理。

屈艳霞女士，董事、副总经理兼市场总监，中央财经大学金融学学士。逾 15 年证券从业经历，10 年资产管理业务经验。2010 年起进入渤海证券股份有限公司任资产管理总部副总经理兼营销总监；2014 年 3 月起，任渤海证券股份有限公司基金管理总部副总经理（主持工作）。2016 年 7 月起至今，任渤海汇金证券资产管理有限公司副总经理兼市场总监。

赵颖女士，董事，南开大学工商管理硕士。2011 年进入渤海证券股份有限公司任人力资源总部总经理；2012 年 11 月至 2015 年 4 月，任渤海证券股份有限公司研究所所长兼人力资源总部总经理；2015 年 4 月至 2018 年 8 月，任渤海证券股份有限公司人力资源总部总经理；2017 年 9 月份起，任渤海证券股份有限公司债券融资总部总经理，2017 年 12 月份至 2018 年 10 月，兼任渤海证券股份有限公司债权业务总监；2016 年 7 月起至今，兼任渤海汇金证券资产管理有限公司董事。

刘嫣女士，董事、合规总监，大连海事大学法学硕士。2001 年进入渤海证券股份有限公司，逾 15 年证券业法务与风险管理经验。2001 年起历任渤海证券股份有限公司总裁办法律事务部副经理、风险控制总部法律事务部经理、风险控制总部副总经理、公司首席律师；2015 年 6 月起，任渤海证券股份有限公司法律合规总部总经理；2017 年 9 月至 2018 年 9 月，任渤海证券股份有限公司合规总监兼法律合规总部总经理。2018 年 9 月起，任渤海证券股份有限公司合规总监兼合规管理总部总经理。2016 年 7 月起，兼任渤海汇金证券资产管理有限公司董事；2017 年 9 月起至今，兼任渤海汇金证券资产管理有限公司合规总监。

### 2、监事基本情况

刘彤先生，监事，南开大学工商管理硕士。2002 年 7 月进入渤海证券股份有限公司，曾担任渤海证券股份有限公司法律合规总部副总经理兼合规管理一部经理、公司律师。2018 年 9 月起，任渤海证券股份有限公司合规管理总部副总经理。2017 年 5 月起至今，兼任渤海汇金证券资产管理有限公司监事。

### 3、高级管理人员基本情况

徐海军先生，董事长、代履职总经理，南开大学法学硕士。1996 年参加工作，历任南方证券天津解放路营业部业务员、南方证券天津分公司资产保全部副经理；2001 年 3 月至 2007 年 6 月，任渤海证券股份有限公司

公司法律事务部经理、北京总部总经理等职；2007年6月至2017年6月，任渤海证券股份有限公司合规总监、首席风险官兼风险控制总部总经理；2017年7月至2017年9月任渤海证券股份有限公司合规总监、财务总监；2017年9月至今任渤海证券股份有限公司财务总监。2016年9月至2017年7月，兼任渤海汇金证券资产管理有限公司合规总监、首席风险官；2017年7月至2017年9月，兼任渤海汇金证券资产管理有限公司合规总监；2017年9月起至今，兼任渤海汇金证券资产管理有限公司董事长；2019年4月26日起至今，代履职海汇金证券资产管理有限公司总经理。

屈艳霞女士，董事、副总经理兼市场总监，中央财经大学金融学学士。逾15年证券从业经历，10年资产管理业务经验。2010年起进入渤海证券股份有限公司任资产管理总部副总经理兼营销总监；2014年3月起，任渤海证券股份有限公司基金管理总部副总经理（主持工作）。2016年7月起至今，任渤海汇金证券资产管理有限公司副总经理兼市场总监。

周里勇先生，董事会秘书、副总经理兼财务负责人，南开大学经济学学士、中国人民大学工商管理硕士。从事证券投资研究及相关领域的管理工作近二十年，实践经验非常丰富。2010年起进入渤海证券股份有限公司任证券投资总部负责人。2016年7月起至今，任渤海汇金证券资产管理有限公司副总经理，先后兼任投资一部总经理、证券投资部总经理；2017年7月起至今，兼任渤海汇金证券资产管理有限公司财务负责人。2018年7月起，兼任渤海汇金证券资产管理有限公司董事会秘书。

刘嫣女士，董事、合规总监，大连海事大学法学硕士。2001年进入渤海证券股份有限公司，逾15年证券业法务与风险管理经验。2001年起历任渤海证券股份有限公司总裁办法律事务部副经理、风险控制总部法律事务部经理、风险控制总部副总经理、公司首席律师；2015年6月起，任渤海证券股份有限公司法律合规总部总经理；2017年9月至2018年9月，任渤海证券股份有限公司合规总监兼法律合规总部总经理。2018年9月起，任渤海证券股份有限公司合规总监兼合规管理总部总经理。2016年7月起，兼任渤海汇金证券资产管理有限公司董事；2017年9月起至今，兼任渤海汇金证券资产管理有限公司合规总监。

李颖女士，首席风险官，天津财经学院会计系国际会计专业毕业，在职攻读南开大学金融系金融学专业研究生，获取硕士学位。本科毕业后在天津会计师事务所（后改制为天津津源会计师事务所、五洲联合会计师事务所）从事审计，任项目经理、部门经理、报告终身复核人。2001年进入渤海证券股份有限公司，历任财务总部总经理助理、副总经理、总经理；2015年3月，任渤海证券股份有限公司财务负责人；2017年7月起，任渤海证券股份有限公司首席风险官兼风险控制总部总经理。2017年7月起至今，兼任渤海汇金证券资产管理有限公司首席风险官。

#### 4、本基金拟任基金经理

何翔先生，南开大学数学学士、金融学硕士，于2017年11月08日完成了注册程序（中基协基注[2017]5143号）。2004年2月至2013年10月就职于渤海证券股份有限公司研究所，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，现任公募投资总监、公募投资部经理。

林思先生，南开大学金融工程硕士，于2017年11月08日完成了注册程序（中基协基注[2017]5141号）。2011年7月至2013年10月就职于渤海证券股份有限公司研究所，任金融工程分析师。2013年10月至2016年8月就职于渤海证券股份有限公司基金管理总部，任基金经理助理。2016年8月加入渤海汇金证券资产管理有限公司公募投资部，任基金经理。

#### 5、投资决策委员会成员

主任委员：

屈艳霞女士，副总经理，简历同上。

委员：

何翔先生，简历同上。

李杨女士，天津财经大学国际经济与贸易学士。2011年9月至2014年4月就职于包商银行金融市场部，任债券交易员。2014年5月至2016年8月就职于天津银行金融市场部，任债券交易员。2016年9月加入渤海汇金证券资产管理有限公司公募投资部，任基金经理。

张研女士，风险控制部风控经理，西南财经大学本科。具有 10 年以上证券从业经验，获得中国证券业协会颁发的证券从业资格证书和中国证券投资基金业协会颁发的基金从业资格证书。2007 年—2015 年曾在新时代证券财务部任职。2015 年内调到新时代证券的风险控制部，主要负责资产管理业务的风控阈值管理、合同文本审核和主动管理型产品立项审核。2017 年 4 月份加入渤海汇金证券资产管理有限公司，负责公募基金风险控制管理工作。

谢晓冬先生，研究部副总经理，天津财经大学金融学硕士。9 年证券从业经验，获得中国证券业协会颁发的证券从业资格证书和中国证券投资基金业协会颁发的基金从业资格证书。2010 年 07 月至 2015 年 01 月就职于渤海证券股份有限公司研究所，任研究员。2015 年 01 月至 2016 年 8 月就职于渤海证券股份有限公司资产管理总部，任研究员。2016 年 8 月加入渤海汇金证券资产管理有限公司，先后在研究部任研究员、投资一部任投资经理、公募投资部任基金经理，现任研究部副总经理。

## 6、上述人员之间不存在近亲属关系。

### 第二部分基金托管人

#### 一、基金托管人基本情况

##### （一）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：陈四清

注册资本：人民币 34,932,123.46 万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

##### （二）主要人员情况

截至 2018 年 12 月，中国工商银行资产托管部共有员工 202 人，平均年龄 33 岁，95% 以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

##### （三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、qfii 资产、qdii 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、qdii 专户资产、escrow 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2018 年 12 月，中国工商银行共托管证券投资基金 923 只。自 2003 年以来，本行连续十五年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 64 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

### 第三部分相关服务机构

#### 一、基金份额发售机构

##### 1、直销服务：

名称：渤海汇金证券资产管理有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 a 栋 201 室

客户服务部地址：天津市南开区滨水西道 8 号

成立日期：2016 年 5 月 18 日

法定代表人：徐海军

联系人：谭如雁

电话：022-23861525

传真：022-23861510

网址：<https://www.bhhjamc.com>

客服电话：4006515988，4006511717

## 2、其他销售机构：

### (1) 中国工商银行股份有限公司

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：陈四清

电话：010-66107370

传真：010-66107738

网址：<http://www.icbc.com.cn/>

客服电话：95588

### (2) 渤海证券股份有限公司

办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

法定代表人：王春峰

电话：022-28451922

传真：022-28451892

网址：<http://www.ewww.com.cn/>

客服电话：4006515988

### (3) 上海好买基金销售有限公司

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

法定代表人：杨文斌

联系人：王诗琦

电话：021-20613999

传真：021-68596919

网址：<https://www.howbuy.com/>

客服电话：4007009665

### (4) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦

法定代表人：其实

联系人：丁姗姗

电话：010-65980380

传真：021-54509953

网址：<http://fund.eastmoney.com/>

客服电话：4001818188

### (5) 民生证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 a 座 16-18 层

办公地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 a 座 16-20 层

法定代表人：冯鹤年

联系人：韩秀萍

电话：010—85127609

传真：010—85127917

网址：<http://www.msq.com/>

客服电话：95376 / 400—619—8888

(6) 上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）

办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人：王翔

联系人：李关洲

电话：021—65370077

传真：021—55085991

网站：[www.jiyufund.com.cn](http://www.jiyufund.com.cn)

客服电话：400—820—5369

(7) 天津国美基金销售有限公司

注册地址：天津经济技术开发区第一大街 79 号 msdc1—28 层 2801

办公地址：北京市朝阳区霄云路 26 号鹏润大厦 b 座 9 层

法定代表人：丁东华

联系人：许艳

电话：010—59287105

网址：<https://www.gomefund.com/>

客服电话：400—111—0889

(8) 东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 楼

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：赵俊

联系人：王一彦

电话：021—20333910

传真：021—50498825

网址：<http://www.longone.com.cn/>

客服电话：95531、4008888588

(9) 北京恒宇天泽基金销售有限公司

注册地址：北京市延庆区延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 883 室

办公地址：北京市东城区东滨河路乙 1 号航星园 8 号楼（东半楼）9 层

法定代表人：梁越

联系人：王东

电话：13001936144

网址：<https://www.1314fund.com/>

客服电话：400—188—8848

(10) 民商基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区北京东路 666 号 h 区（东座）6 楼 a31 室

办公地址：上海市浦东新区张杨路 707 号生命人寿大厦 32 楼，200120

法定代表人：贲惠琴

联系人：董筱爽

网址：<http://www.msftec.com/>

客服电话：021-50206003

(11) 北京唐鼎耀华基金销售有限公司

注册地址：北京市延庆区延庆经济开发区百泉街10号2栋236室

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街19号a座1504/1505室

法定代表人：张冠宇

联系人：王丽敏

电话：010-85932810

网址：<http://www.tdyhfund.com>

客服电话：400-819-9868

(12) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街188号鸿安国际大厦

法定代表人：王常青

联系人：刘芸

电话：010-85156310

网址：<https://www.csc108.com>

客服电话：4008-888-108

(13) 上海联泰基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室

办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8座3层

法定代表人：尹彬彬

联系人：陈东

电话：021-52822063

网址：<http://www.66liantai.com/>

客服电话：400-118-1188

(14) 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：张志刚

联系人：唐静

电话：010-83252182

网址：<http://www.cindasc.com/>

客服电话：95321

(15) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址：上海市浦东新区东方路1267号

法定代表人：张跃伟

联系人：党敏

电话：021-20691935

网址：<http://www.erichfund.com/>

客服电话：400-820-2899

(16) 嘉实财富管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层 5312-15 单元

办公地址：北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 a 座 6 层

法定代表人：赵学军

联系人：李雯

电话：010-60842306

网址：<https://www.harvestwm.cn/>

客服电话：400-021-8850

（17）深圳前海财厚基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 a 栋 201 室

办公地址：深圳市南山区深圳湾科技生态园三区 11 栋 a 座 3608 室

法定代表人：杨艳平

联系人：胡闻智

电话：0755-22676026

网址：<http://www.caiho.cn>

客服电话：400-1286-800

（18）中证金牛（北京）投资咨询有限公司

注册地址：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

办公地址：北京市宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 a 座 5 层

法定代表人：钱昊旻

联系人：毛健

电话：010-59336550

网址：<http://www.jnlc.com/>

客服电话：4008909998

（19）北京植信基金销售有限公司

注册地址：北京市密云区兴盛南路 8 号院 2 号楼 106 室-67

办公地址：北京朝阳区四惠盛世龙源国食苑 10 号楼

法定代表人：于龙

联系人：张喆

电话：010-56075718

网址：<https://www.zhixin-inv.com/>

客服电话：4006-802-123

（20）宜信普泽（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号楼 soho 现代城 c 座 18 层 1809

法定代表人：戎兵

联系人：张得仙

电话：17610275787

网址：<https://www.yixinfund.com/>

客服电话：400-6099-200

（21）北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

法定代表人：钟斐斐

联系人：侯芳芳



电话：15910450297

网址：<https://danjuanapp.com/>

客服电话：400—1599—288

具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。

## 二、登记机构

名称：渤海汇金证券资产管理有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号a栋201室

办公地址：天津市南开区宾水西道8号

法定代表人：徐海军

联系人：魏文婷

电话：010—68784295

传真：010—68784289

网址：<https://www.bhhjmc.com>

## 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：俞卫锋

电话：021—31358666

传真：021—31358600

联系人：陆奇

经办律师：安冬、陆奇

## 四、审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：中国上海自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址：中国北京朝阳区东三环中路7号财富中心a座26层

法定代表人：李丹

电话：010—65338888

经办注册会计师：李铁英、朱辉

联系人：朱辉

## 第四部分基金的名称

本基金名称：渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金

## 第五部分基金的类型

本基金类型：混合型证券投资基金

## 第六部分基金的投资目标

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。

## 第七部分基金的投资方向

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（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券等）、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具（含同业存单）、资产支持证券、债券回购、权证、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的0%—95%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%；股指期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

如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。

#### 第八部分基金的投资策略

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。

##### 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。

##### 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。

##### 3、量化股票投资策略：

（1）多因子选股策略：通过对股票历史数据的数量化分析，充分挖掘影响股票价格的因子，通过检验各类因子的有效性以及因子之间的关联度，对各类因子打分挑选出有效的因子组合，并结合风险和收益特征构建多因子模型，筛选出收益预期较高且风险可控的股票组合。本基金使用的因子不仅包括公司盈利能力、成长性、一致预期、估值等基本因子，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指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、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。

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。

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。

#### 6、资产支持证券投资策略：

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。

#### 7、权证投资策略

本基金将在严格控制风险、保障基金财产安全的前提下对权证进行投资。本基金将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。

#### 第九部分基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为： $60\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 40\% \times \text{上证国债指数收益率}$

#### 第十部分基金的风险收益特征

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。

#### 第十一部分基金投资组合报告

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。

基金托管人根据基金合同规定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。

本投资组合报告所载数据截至 2019 年 6 月 30 日（未经审计）。

#### 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 9,654,943.34 56.85

其中：股票 9,654,943.34 56.85

2 基金投资 — —

3 固定收益投资 5,315,669.50 31.30

其中：债券 5,315,669.50 31.30

资产支持证券 — —

4 贵金属投资 — —

5 金融衍生品投资 — —

6 买入返售金融资产 800,000.00 4.71

其中：买断式回购的买入返售金融资产

— —

7 银行存款和结算备付金合计 859, 782. 82 5. 06

8 其他资产 352, 923. 84 2. 08

9 合计 16, 983, 319. 50 100. 00

## 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 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 139, 923. 00 0. 83

b 采矿业 1, 894, 019. 00 11. 24

c 制造业 4, 683, 511. 84 27. 79

d

电力、热力、燃气及水生产和供应业

148, 526. 00 0. 88

e 建筑业 122, 195. 00 0. 73

f 批发和零售业 385, 231. 00 2. 29

g 交通运输、仓储和邮政业 155, 218. 80 0. 92

h 住宿和餐饮业 — —

i

信息传输、软件和信息技术服务业

943, 034. 20 5. 60

j 金融业 328, 581. 20 1. 95

k 房地产业 211, 540. 00 1. 26

l 租赁和商务服务业 37, 800. 00 0. 22

m 科学研究和技术服务业 72, 854. 00 0. 43

n 水利、环境和公共设施管理业 122, 394. 00 0. 73

o 居民服务、修理和其他服务业 — —

p 教育 — —

q 卫生和社会工作 162, 195. 30 0. 96

r 文化、体育和娱乐业 193, 988. 00 1. 15

s 综合 53, 932. 00 0. 32

合计 9, 654, 943. 34 57. 29

### 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。

### 3. 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 002237 恒邦股份 19, 100 319, 161. 00 1. 89

2 600547 山东黄金 6, 700 275, 839. 00 1. 64

3 600489 中金黄金 26, 300 270, 101. 00 1. 60

4 601899 紫金矿业 67, 000 252, 590. 00 1. 50

5	601069	西部黄金	15,700,241,780.00	1.43
6	000975	银泰资源	18,200,240,058.00	1.42
7	300059	东方财富	10,760,145,798.00	0.87
8	002155	湖南黄金	13,200,132,924.00	0.79
9	600766	园城黄金	12,800,130,688.00	0.78
10	600311	荣华实业	26,100,125,019.00	0.74

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	4,291,272.40	25.46
2	央行票据	—	—
3	金融债券	1,021,000.00	6.06
其中：政策性金融债 1,021,000.00 6.06			
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	3,397,100.00	0.02
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	5,315,669.50	31.54

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	019303	13 国债 03 25,000 2,513,000.00	14.91
2	010303	03 国债(3) 11,470,160,075.80	6.88
3	018006	国开 1702 10,000 1,021,000.00	6.06
4	010107	21 国债(7) 6,000 617,280.00	3.66
5	127011	中鼎转 2 20 2,107.60	0.00

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。

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。

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。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码 名称

持仓量（买 /

卖）

合约市值

（元）

公允价值变

动（元）

风险说明

ic1909

中证500股指

期货1909

1 962, 720. 00 1, 440. 00 -

公允价值变动总额合计(元) 1, 440. 00

股指期货投资本期收益(元) 0. 00

股指期货投资本期公允价值变动(元) 1, 440. 00

## 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。

基金管理人针对股指期货交易制定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行,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。

## 10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 1) 本期国债期货投资政策

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。

### 2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码 名称

持仓量(买 /

卖)

合约市值

(元)

公允价值变

动(元)

风险指标说明

t1909

10年期国债

期货1909

2 1, 941, 550. 00 8, 350. 00 -

公允价值变动总额合计(元) 8, 350. 00

国债期货投资本期收益(元) 2, 087. 38

国债期货投资本期公允价值变动(元) 8, 350. 00

### 3) 本期国债期货投资评价

国债期货投资有效降低了基金净值波动,为基金的久期控制提供了更便利、更具有流动性的工具,为基金创造了一定的收益。

## 11. 投资组合报告附注

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。

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。

### 3) 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 187,698.04

2 应收证券清算款 100,184.11

3 应收股利 —

4 应收利息 65,041.69

5 应收申购款 —

6 其他应收款 —

7 待摊费用 —

8 其他 —

9 合计 352,923.84

### 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) 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。

### 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。

## 第十二部分基金业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。本基金合同生效日2018年7月20日，基金业绩数据截至2019年6月30日。

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

净值收

益率①

净值收

益率标

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

2018 / 7 / 20—2018 / 12 / 31 -0.90% 0.18% -6.38% 0.90% 5.48% -0.72%

2019 / 1 / 1—2019 / 6 / 30 9.14% 0.75% 16.79% 0.93% -7.65% -0.18%

自基金合同生效日(2018 / 7 / 20)

—2019 / 6 / 30

8.16% 0.55% 9.33% 0.92% -1.17% -0.37%

## 第十三部分基金费用与税收

## 一、与基金运作有关的费用

### (一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券/期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金的账户开户费用和账户维护费用；
- 9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### (二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$h=e \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

h为每日应计提的基金管理费

e为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$h=e \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

h为每日应计提的基金托管费

e为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第3—9项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

## 二、与基金销售有关的费用

### (一) 申购费

本基金申购费用由申购基金份额的投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

投资人申购基金份额时的申购费率如下表：

申购金额 申购费率

100万元（不含）以下 1.50%

100万元（含）—200万元（不含） 0.80%

200万元（含）—500万元（不含） 0.30%

500万元（含）以上 按笔固定收取1,000元 / 笔

在申购费按金额分档的情况下，如果投资者多次申购，申购费适用单笔申购金额所对应的费率。

### (二) 赎回费

本基金赎回费由赎回基金份额的投资者承担。



本基金基金份额的赎回费率如下表所示：

持有时间 赎回费率

7日（不含）以下 1.50%

7日（含）—30日（不含） 0.75%

30日（含）—180日（不含） 0.50%

180日（含）—365日（不含） 0.25%

365日（含）以上 0

投资者可将其持有的全部或部分基金份额赎回。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持有期少于30日（不含）的基金份额持有人所收取赎回费用全额计入基金财产；对持有期在30日以上（含）且少于90日（不含）的基金份额持有人所收取赎回费用总额的75%计入基金财产；对持有期在90日以上（含）且少于180日（不含）的基金份额持有人所收取赎回费用总额的50%计入基金财产；对持续持有期180日以上（含）的基金份额持有人所收取赎回费用总额的25%计入基金财产；赎回费未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划，定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以适当调低基金销售费率，或针对特定渠道、特定投资群体开展有差别的费率优惠活动。

当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### 四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

#### 第十四部分对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其它有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对本基金管理人于2019年3月5日公告的《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》进行了更新，主要更新的内容如下：

1. “重要提示”部分：明确了更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。
2. “第三部分基金管理人”部分：更新了基金管理人的相关信息。
3. “第四部分基金托管人”部分：更新了托管人的相关信息。
4. “第五部分相关服务机构”部分：更新了基金份额发售机构信息。
5. “第十部分基金投资组合报告”部分：更新了本基金2019年2季度投资组合报告内容。该部分内容均按有关规定编制，并经托管人复核。
6. “第十一部分基金的业绩”部分：更新了自基金生效日至2019年6月30日的基金业绩，该部分内容均按有关规定编制，并经托管人复核。
7. “第十八部分风险揭示”部分：新增“科创板股票投资风险”相关内容。
8. “第二十三部分其他应披露事项”部分：列示了本基金2019年1月21日至2019年7月20日期间披露

的涉及本基金及基金管理人的相关公告。

渤海汇金证券资产管理有限公司

二〇一九年九月二日