

# 渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资 基金 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 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：2021 年 3 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 2021 年 3 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。

本报告期为 2020 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 7         |
| 2.4 信息披露方式                              | 8         |
| 2.5 其他相关资料                              | 8         |
| <b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>          | <b>9</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 9         |
| 3.2 基金净值表现                              | 9         |
| 3.3 其他指标                                | 11        |
| 3.4 过去三年基金的利润分配情况                       | 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             | 14        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 15        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况                 | 15        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 15        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 16        |
| 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明        | 16        |
| 4.10 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      | 16        |
| <b>§5 托管人报告</b>                         | <b>17</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 17        |
| 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 | 17        |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 17        |
| <b>§6 审计报告</b>                          | <b>18</b> |
| 6.1 审计报告基本信息                            | 18        |
| 6.2 审计报告的基本内容                           | 18        |
| <b>§7 年度财务报表</b>                        | <b>21</b> |
| 7.1 资产负债表                               | 21        |
| 7.2 利润表                                 | 22        |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 23        |
| 7.4 报表附注                                | 24        |
| <b>§8 投资组合报告</b>                        | <b>53</b> |
| 8.1 期末基金资产组合情况                          | 53        |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合                      | 53        |
| 8.3 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       | 54        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 57        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 59        |

|  |           |
|--|-----------|
| 8.6 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 .....           | 59        |
| 8.7 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 .....        | 59        |
| 8.8 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 .....        | 59        |
| 8.9 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 .....           | 59        |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....                    | 59        |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....                    | 60        |
| 8.12 投资组合报告附注 .....                                | 60        |
| <b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>                          | <b>62</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                        | 62        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....                     | 62        |
| 9.3 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 .....            | 62        |
| 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 ..... | 62        |
| <b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>                         | <b>63</b> |
| <b>§11 重大事件揭示 .....</b>                            | <b>64</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                             | 64        |
| 11.2 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 .....             | 64        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....                  | 64        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                               | 64        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                        | 65        |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....                | 65        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                       | 65        |
| 11.8 其他重大事件 .....                                  | 66        |
| <b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>                    | <b>71</b> |
| 12.1 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 .....           | 71        |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                          | 71        |
| <b>§13 备查文件目录 .....</b>                            | <b>72</b> |
| 13.1 备查文件目录 .....                                  | 72        |
| 13.2 存放地点 .....                                    | 72        |
| 13.3 查阅方式 .....                                    | 72        |

## § 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   | 2,845,194.02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：<br/>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：<br/>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、流动性及风险特征，选择流动性较强、交易活跃的期

|        |   |
|--------|---|
|        | <p>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：<br/>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>7、权证投资策略<br/>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 | 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                          | 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                       |
|--------|----------------------|----------------------------|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) | 上海市黄浦区湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼 |
| 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、基金净值表现及利润分配情况

#### 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 | 2020 年       | 2019 年       | 2018年7月20日(基金合同生效日)-2018年12月31日 |
|---------------|--------------|--------------|---------------------------------|
| 本期已实现收益       | 1,943,099.96 | 2,751,635.52 | 663,685.85                      |
| 本期利润          | 1,581,435.71 | 4,421,598.40 | -189,035.87                     |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.4328       | 0.2184       | -0.0019                         |
| 本期加权平均净值利润率   | 33.16%       | 20.83%       | -0.18%                          |
| 本期基金份额净值增长率   | 41.71%       | 13.95%       | -0.90%                          |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2020 年末      | 2019 年末      | 2018 年末                         |
| 期末可供分配利润      | 1,707,562.97 | 857,110.82   | -543,663.19                     |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.6002       | 0.1264       | -0.0090                         |
| 期末基金资产净值      | 4,552,756.99 | 7,655,698.85 | 59,967,790.47                   |
| 期末基金份额净值      | 1.6002       | 1.1292       | 0.9910                          |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2020 年末      | 2019 年末      | 2018 年末                         |
| 基金份额累计净值增长率   | 60.02%       | 12.92%       | -0.90%                          |

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

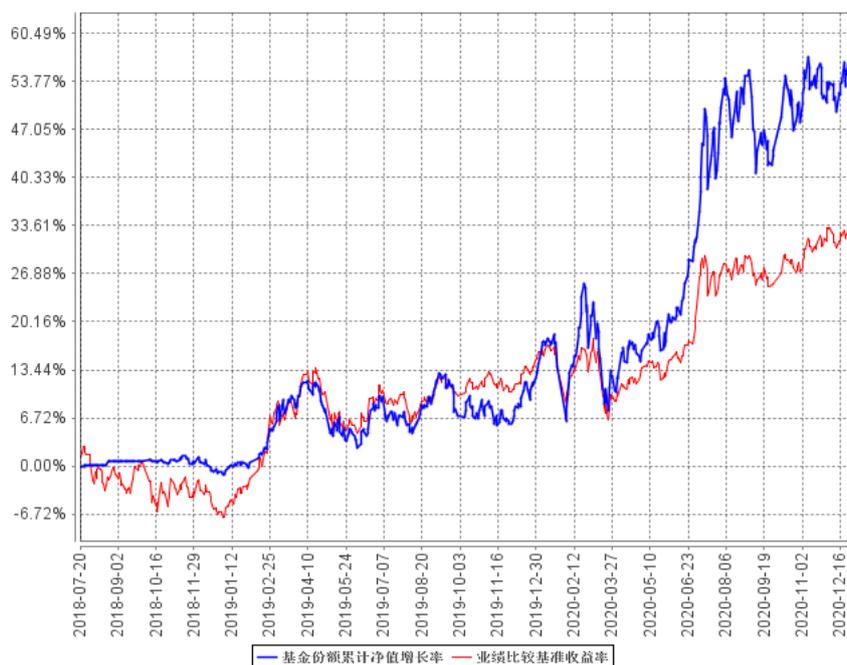
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | 11.09%   | 1.22%       | 8.20%      | 0.60%         | 2.89%  | 0.62% |
| 过去六个月      | 22.36%   | 1.48%       | 15.07%     | 0.81%         | 7.29%  | 0.67% |
| 过去一年       | 41.71%   | 1.48%       | 17.94%     | 0.86%         | 23.77% | 0.62% |
| 自基金合同生效起至今 | 60.02%   | 1.06%       | 35.72%     | 0.82%         | 24.30% | 0.24% |

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

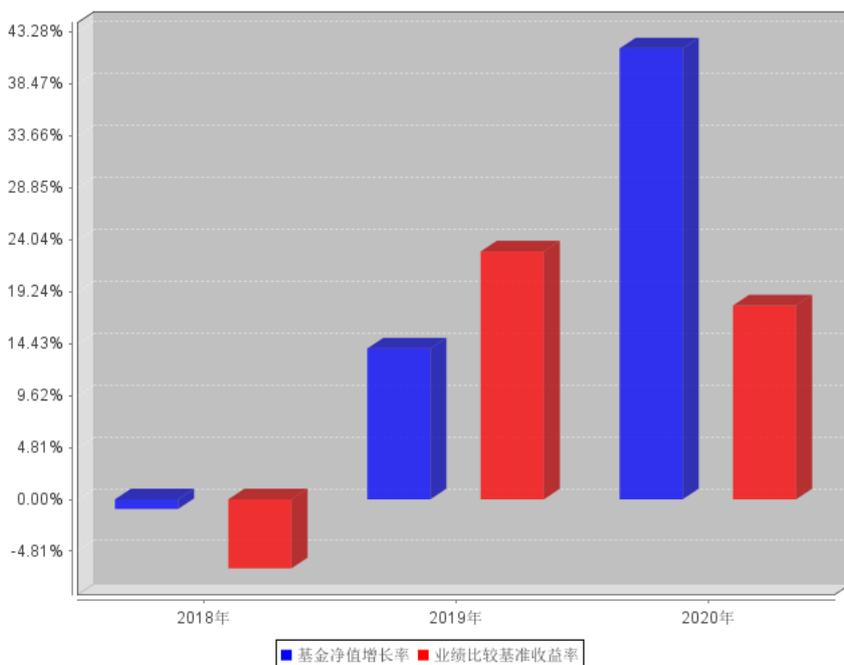
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2018 年 7 月 20 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度

进行折算。

### **3.3 其他指标**

注：无。

### **3.4 过去三年基金的利润分配情况**

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2020年12月31日，本基金管理人共管理6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。

#### 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      | -           | 16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。 |
| 林思 | 本基金的基金经理                 | 2018年7月20日      | 2020年10月29日 | 9年     | 南开大学金融工程硕士。2011年7月至2013  |

|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  | <p>年 10 月就职于渤海证券研究所，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。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 7 月至 2020 年 10 月担任渤海汇金量化汇盈混合基金基金经理。</p> |
|--|--|--|--|--|--|

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

#### 4.1.3 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

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

不涉及

### 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 公平交易制度和控制方法

按照中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司《渤海汇金证券资产管理有限公司公募业务公平交易制度》，以科学、制衡的投资决策体系，通过完善集中交易制

度、优化工作流程、加强技术手段，保证公平交易原则的实现，结合盘中实时监控，事后分析和信息披露等风险控制措施加强对于公平交易过程和结果的监督。

#### 4.3.2 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。

##### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

不涉及

#### 4.3.3 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

2020 年市场总体延续 2019 年牛市的走势，各主要指数上半年涨幅明显，下半年宽幅震荡。市场的走强，更多的还是来自于流动性驱动下估值的提升。具体来看，全年上证综指、沪深 300、中小板指、创业板指则分别上涨 12%、25%、41%、61%。行业方面，电气设备、休闲服务、食品饮料行业相对强势，而房地产、通信、建筑装饰领跌。我们在渤海汇金量化汇盈产品的投资运作中，一直坚持宏观分析与量化相结合的理念，并强化基金投资运作中资产配置的重要性。

2020 年，我们继续稳步提升量化汇盈中权益资产仓位，保持相对超配，并根据模型信号动态调整仓位大小。行业配置方面，量化汇盈坚持以长期向好的消费升级（食品饮料）、产业升级（医药生物）、科技创新（电子、计算机等）新经济相关行业进行配置，并借鉴资产配置思路辅以一定的避险行业对冲下行风险。选股方面，基金以多风格多策略量化选股模型为基础配置股票组合，避免了单一策略的周期影响，并定期对选股策略进行再平衡，在长时间维度上获取组合配置带来的投资收益。

#### 4.4.2 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 1.6002 元；本报告期基金份额净值增长率为 41.71%，业绩比较基准收益率为 17.94%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

往后看，十四五规划对于创新型经济的支持将长期影响中国经济的转型发展，短期国内宏观流动性环境继续保持相对稳定，国内经济较海外率先企稳改善、资本市场的持续制度性改革以及推进国内大循环的政策环境仍从多方面对权益市场形成支持，A 股市场中枢也将继续在震荡中稳步小幅抬升，市场的结构性机会仍将持续。行业上，甄选高景气行业的重要性更加突出，一些政策支持、产业趋势向上、业绩确定性高的行业有望取得较好表现。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的监察稽核工作以法律法规、行业规范和公司制度为依据，对基金的投资、交易、运营等环节，实施事前、事中和事后的风险管理，努力做到防范和控制风险，保证合法合规、健康持续经营，保护投资者合法权益。

本报告期内，主要监察稽核工作如下：

(1) 本基金管理人加快建设“合规、诚信、专业、稳健”的企业文化，完善制度建设及工作机制。加强对重大决策、新产品、新业务及重要业务活动等的合规审查工作，有效防范和化解了相关的合规风险。

按照监管要求，完成反洗钱工作报告及报表、洗钱风险自评估、非居民金融账户涉税尽职调查等工作。组织开展客户适当性管理、廉洁从业、债券投资交易等多项检查。组织开展新《证券法》解读、反洗钱专项等合规培训，增加合规培训覆盖面和培训力度，提升公司整体合规意识。

(2) 风险管理工作结合市场情况和监管要求，根据业务类型特点及风险管理的需要，不断完善风险管理体系。持续优化风险管理系统，确保相关风控指标监测及时准确。强化产品投资风险的监测、预警及排查，建立风险报告及应对机制。

(3) 稽核部门对公司业务、内部控制、风险管理等实施独立、客观的监督、评价和建议，完成基金经理离任稽核、专项稽核等工作。选聘会计师事务所开展原总经理的离任审计、公司信息系统运行安全和信息技术管理工作审计。

本报告期，基金管理人认真、严格地履行监察稽核职责，不断完善内部控制的制度体系和组织体系，提高监察稽核工作的规范性和有效性，努力防范和控制重大风险，切实保护基金份额持有人的利益。

#### 4.7 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。

#### **4.8 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。

#### **4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明**

无。

#### **4.10 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 2020 年 1 月 6 日至 2020 年 4 月 6 日连续 59 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 2020 年 12 月 31 日连续 458 个工作日基金资产净值低于五千万元，管理人已将该情况向证监会报告，鉴于本基金的运作情况，基金管理人的解决方案为：将不断完善已有持营方案，加大对本基金的持续营销。

## § 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量化汇盈灵活配置混合型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，渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型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量化汇盈灵活配置混合型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，渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本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量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金 2020 年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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

|            |                         |
|------------|-------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                       |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见                 |
| 审计报告编号     | 普华永道中天审字(2021)第 24028 号 |

### 6.2 审计报告的基本内容

|                 |   |
|-----------------|---|
| 审计报告标题          | 审计报告  |
| 审计报告收件人         | 渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人  |
| 审计意见            | <p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“渤海汇金量化汇盈混合基金”)的财务报表,包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表,2020 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了渤海汇金量化汇盈混合基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p> |
| 形成审计意见的基础       | <p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于渤海汇金量化汇盈混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>  |
| 强调事项            | -   |
| 其他事项            | -   |
| 其他信息            | -   |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | 渤海汇金量化汇盈混合基金的基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维   |

|                        |  |
|------------------------|--|
|                        | <p>护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估渤海汇金量化汇盈混合基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算渤海汇金量化汇盈混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督渤海汇金量化汇盈混合基金的财务报告过程。</p>  |
| <p>注册会计师对财务报表审计的责任</p> | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> |

|           |   |
|-----------|---|
|           | <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时, 根据获取的审计证据, 就可能对渤海汇金量化汇盈混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性, 审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露; 如果披露不充分, 我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而, 未来的事项或情况可能导致渤海汇金量化汇盈混合基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容, 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |
| 会计师事务所的名称 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)  |
| 注册会计师的姓名  | 李铁英 蔡雪薇   |
| 会计师事务所的地址 | 中国上海市黄浦区湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼  |
| 审计报告日期    | 2021 年 3 月 26 日   |

注: 会计师出具了无保留意见的审计报告, 投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

## 7.1 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：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                 |                                  |
| 银行存款            | 7.4.7.1    | 309,622.20                      | 59,871.92                        |
| 结算备付金           |            | 10,092.17                       | 39,932.62                        |
| 存出保证金           |            | 873.48                          | 2,570.79                         |
| 交易性金融资产         | 7.4.7.2    | 4,282,645.91                    | 7,161,278.70                     |
| 其中：股票投资         |            | 4,282,645.91                    | 6,045,093.30                     |
| 基金投资            |            | -                               | -                                |
| 债券投资            |            | -                               | 1,116,185.40                     |
| 资产支持证券投资        |            | -                               | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                               | -                                |
| 衍生金融资产          | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 买入返售金融资产        | 7.4.7.4    | -                               | 500,000.00                       |
| 应收证券清算款         |            | -                               | 387,522.53                       |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 36.90                           | 33,388.16                        |
| 应收股利            |            | -                               | -                                |
| 应收申购款           |            | 99.85                           | -                                |
| 递延所得税资产         |            | -                               | -                                |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                               | -                                |
| 资产总计            |            | 4,603,370.51                    | 8,184,564.72                     |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2020 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2019 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          | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                               | -                                |
| 应付证券清算款         |            | -                               | 186,610.59                       |
| 应付赎回款           |            | 1,090.78                        | 188,763.70                       |
| 应付管理人报酬         |            | 5,553.48                        | 10,051.43                        |
| 应付托管费           |            | 925.56                          | 1,675.24                         |
| 应付销售服务费         |            | -                               | -                                |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 3,040.96                        | 12,764.89                        |
| 应交税费            |            | -                               | 0.02                             |
| 应付利息            |            | -                               | -                                |

|               |          |              |              |
|---------------|----------|--------------|--------------|
| 应付利润          |          | -            | -            |
| 递延所得税负债       |          | -            | -            |
| 其他负债          | 7.4.7.8  | 40,002.74    | 129,000.00   |
| 负债合计          |          | 50,613.52    | 528,865.87   |
| <b>所有者权益：</b> |          |              |              |
| 实收基金          | 7.4.7.9  | 2,845,194.02 | 6,779,631.28 |
| 未分配利润         | 7.4.7.10 | 1,707,562.97 | 876,067.57   |
| 所有者权益合计       |          | 4,552,756.99 | 7,655,698.85 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 4,603,370.51 | 8,184,564.72 |

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.6002 元，基金份额总额 2,845,194.02 份。

## 7.2 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                     | 附注号        | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至<br>2020 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至<br>2019 年 12 月 31 日 |
|------------------------|------------|---|--|
| <b>一、收入</b>            |            | 1,787,990.07                              | 5,116,338.57                                   |
| 1. 利息收入                |            | 6,168.27                                  | 408,788.23                                     |
| 其中：存款利息收入              | 7.4.7.11   | 1,919.25                                  | 5,837.01                                       |
| 债券利息收入                 |            | 2,271.36                                  | 301,752.43                                     |
| 资产支持证券利息收入             |            | -   | -  |
| 买入返售金融资产收入             |            | 1,977.66                                  | 101,198.79                                     |
| 证券出借利息收入               |            | -   | -  |
| 其他利息收入                 |            | -   | -  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | 2,140,187.23                              | 3,000,525.89                                   |
| 其中：股票投资收益              | 7.4.7.12   | 2,118,721.84                              | 1,868,418.80                                   |
| 基金投资收益                 |            | -   | -  |
| 债券投资收益                 | 7.4.7.13   | -7,436.14                                 | 64,261.21                                      |
| 资产支持证券投资收益             | 7.4.7.13.5 | -   | -  |
| 贵金属投资收益                | 7.4.7.14   | -   | -  |
| 衍生工具收益                 | 7.4.7.15   | -   | 973,203.89                                     |
| 股利收益                   | 7.4.7.16   | 28,901.53                                 | 94,641.99                                      |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17   | -361,664.25                               | 1,669,962.88                                   |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -   | -  |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.18   | 3,298.82                                  | 37,061.57                                      |
| <b>减：二、费用</b>          |            | 206,554.36                                | 694,740.17                                     |
| 1. 管理人报酬               | 7.4.10.2.1 | 71,936.40                                 | 325,714.72                                     |
| 2. 托管费                 | 7.4.10.2.2 | 11,989.43                                 | 54,285.71                                      |
| 3. 销售服务费               | 7.4.10.2.3 | -   | -  |

|                            |          |              |              |
|----------------------------|----------|--------------|--------------|
| 4. 交易费用                    | 7.4.7.19 | 59,439.52    | 150,976.25   |
| 5. 利息支出                    |          | -            | -            |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | -            | -            |
| 6. 税金及附加                   |          | 0.01         | 3,503.55     |
| 7. 其他费用                    | 7.4.7.20 | 63,189.00    | 160,259.94   |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | 1,581,435.71 | 4,421,598.40 |
| 减：所得税费用                    |          | -            | -            |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | 1,581,435.71 | 4,421,598.40 |

### 7.3 所有者权益（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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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）                        | 6,779,631.28                                | 876,067.57   | 7,655,698.85  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -   | 1,581,435.71 | 1,581,435.71  |
| 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）      | -3,934,437.26                               | -749,940.31  | -4,684,377.57 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 502,639.45                                  | 197,280.88   | 699,920.33    |
| 2. 基金赎回款                               | -4,437,076.71                               | -947,221.19  | -5,384,297.90 |
| 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）                        | 2,845,194.02                                | 1,707,562.97 | 4,552,756.99  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 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）                        | 60,511,453.66  | -543,663.19   | 59,967,790.47  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -              | 4,421,598.40  | 4,421,598.40   |
| 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）      | -53,731,822.38 | -3,001,867.64 | -56,733,690.02 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 1,109,280.11   | 79,179.62     | 1,188,459.73   |
| 2. 基金赎回款                               | -54,841,102.49 | -3,081,047.26 | -57,922,149.75 |
| 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）                        | 6,779,631.28   | 876,067.57    | 7,655,698.85   |

注：此处为 PDF 文件中的章节数或者页数。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

|            |           |            |
|------------|-----------|------------|
| <u>麻众志</u> | <u>赵猛</u> | <u>刘云鹏</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    |

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金(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[2018]第 371 号《关于准予渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》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《渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型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 234,005,295.59 元,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(2018)第 0493 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金合同》于 2018 年 7 月 20 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 234,129,606.83 份基金份额,其中认购资金利息折合 124,311.24 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《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《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》的规定，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)。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。

本财务报表由本基金的基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司于 2021 年 3 月 26 日批准报出。

#### 7.4.2 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 7.4.4 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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年度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 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本期会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

##### 7.4.4.1 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。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 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股票投资和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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，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应付管理人报酬和其他各类应付款项等。

##### 7.4.4.4 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和金融负债，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或资产支持证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和金融负债，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。

#### 7.4.4.5 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、资产支持证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；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行

调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 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。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。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。

#### 7.4.4.8 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)。

#### 7.4.4.9 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及由基金管理人缴纳的增值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或票面利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，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额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扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收

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。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬、托管费等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。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

本基金同一级别的每一基金份额享有同等分配权。在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%。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。

#### **7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 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，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)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)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债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 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。

### 7.4.5.2 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。

### 7.4.5.3 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。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》、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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款           | 309,622.20              | 59,871.92                |
| 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：            | 309,622.20              | 59,871.92                |

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日 |              |            |
|---------------|-------------------------|--------------|------------|
|               | 成本                      | 公允价值         | 公允价值变动     |
| 股票            | 3,827,069.00            | 4,282,645.91 | 455,576.91 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                       | -            | -          |
| 债券            | 交易所市场                   | -            | -          |
|               | 银行间市场                   | -            | -          |
|               | 合计                      | -            | -          |
| 资产支持证券        | -                       | -            | -          |
| 基金            | -                       | -            | -          |
| 其他            | -                       | -            | -          |
| 合计            | 3,827,069.00            | 4,282,645.91 | 455,576.91 |

| 项目            | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |              |              |
|---------------|--------------------------|--------------|--------------|
|               | 成本                       | 公允价值         | 公允价值变动       |
| 股票            | 5,221,837.40             | 6,045,093.30 | 823,255.90   |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                        | -            | -            |
| 债券            | 交易所市场                    | 1,122,200.14 | 1,116,185.40 |
|               | 银行间市场                    | -            | -            |
|               | 合计                       | 1,122,200.14 | 1,116,185.40 |
| 资产支持证券        | -                        | -            | -            |
| 基金            | -                        | -            | -            |
| 其他            | -                        | -            | -            |
| 合计            | 6,344,037.54             | 7,161,278.70 | 817,241.16   |

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 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<br>2020 年 12 月 31 日  |           |
|-------|--------------------------|-----------|
|       | 账面余额                     | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                        | -         |
| 银行间市场 | -                        | -         |
| 合计    | -                        | -         |
| 项目    | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |           |
|       | 账面余额                     | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 500,000.00               | -         |
| 银行间市场 | -                        | -         |
| 合计    | 500,000.00               | -         |

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 | 上年度末 |
|----|-----|------|
|----|-----|------|

|            | 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 12 月 31 日 |
|------------|------------------|------------------|
| 应收活期存款利息   | 32.28            | 26.56            |
| 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  | 4.18             | 19.03            |
| 应收债券利息     | -                | 33,341.36        |
| 应收资产支持证券利息 | -                | -                |
| 应收买入返售证券利息 | -                | -                |
| 应收申购款利息    | -                | -                |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                | -                |
| 应收出借证券利息   | -                | -                |
| 其他         | 0.44             | 1.21             |
| 合计         | 36.90            | 33,388.16        |

注：其他包括应收存出保证金利息。

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 3,040.96                | 12,764.89                |
| 银行间市场应付交易费用 | -                       | -                        |
| 合计          | 3,040.96                | 12,764.89                |

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                       | -                        |
| 应付赎回费       | 2.74                    | -                        |
| 应付证券出借违约金   | -                       | -                        |
| 预提费用        | 40,000.00               | 129,000.00               |
| 合计          | 40,002.74               | 129,000.00               |

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

|                | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |               |
|----------------|----------------------------------|---------------|
|                | 基金份额 (份)                         | 账面金额          |
| 上年度末           | 6,779,631.28                     | 6,779,631.28  |
| 本期申购           | 502,639.45                       | 502,639.45    |
| 本期赎回 (以“-”号填列) | -4,437,076.71                    | -4,437,076.71 |
| - 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            | 2,845,194.02                     | 2,845,194.02  |

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 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      |
|----------------|---------------|-------------|--------------|
| 上年度末           | 857,110.82    | 18,956.75   | 876,067.57   |
| 本期利润           | 1,943,099.96  | -361,664.25 | 1,581,435.71 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -811,753.19   | 61,812.88   | -749,940.31  |
| 其中：基金申购款       | 215,818.44    | -18,537.56  | 197,280.88   |
| 基金赎回款          | -1,027,571.63 | 80,350.44   | -947,221.19  |
| 本期已分配利润        | -             | -           | -            |
| 本期末            | 1,988,457.59  | -280,894.62 | 1,707,562.97 |

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期                               | 上年度可比期间                          |
|-----------|----------------------------------|----------------------------------|
|           | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 |
| 活期存款利息收入  | 1,460.52                         | 2,843.14                         |
| 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 | 438.22                           | 2,928.73                         |
| 其他        | 20.51                            | 65.14                            |
| 合计        | 1,919.25                         | 5,837.01                         |

### 7.4.7.12 股票投资收益

#### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2020年1月1日至2020年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年12<br>月31日 |
|------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 2,118,721.84                    | 1,868,418.80                         |
| 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               | 2,118,721.84                    | 1,868,418.80                         |

#### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2020年1月1日至2020<br>年12月31日 | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019<br>年12月31日 |
|------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 24,883,055.60                   | 48,816,348.03                        |
| 减：卖出股票成本总额 | 22,764,333.76                   | 46,947,929.23                        |
| 买卖股票差价收入   | 2,118,721.84                    | 1,868,418.80                         |

#### 7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无股票投资收益——证券出借差价收入。

### 7.4.7.13 债券投资收益

#### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>2020年1月1日至2020<br>年12月31日 | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年<br>12月31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 | -7,436.14                       | 64,261.21                            |
| 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                            | -7,436.14                       | 64,261.21                            |

**7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2020年1月1日至2020<br>年12月31日 | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年<br>12月31日 |
|-------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 1,150,350.51                    | 43,022,660.88                        |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,122,200.14                    | 42,194,043.06                        |
| 减：应收利息总额                | 35,586.51                       | 764,356.61                           |
| 买卖债券差价收入                | -7,436.14                       | 64,261.21                            |

**7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无债券投资收益-赎回差价收入。

**7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无债券投资收益-申购差价收入。

**7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.14 贵金属投资收益****7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无贵金属投资收益。

**7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无贵金属投资收益。

**7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无贵金属投资收益。

**7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无贵金属投资收益。

**7.4.7.15 衍生工具收益****7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无衍生工具收益。

## 7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

单位：人民币元

| 项目        | 本期收益金额                | 上年度可比期间收益金额           |
|-----------|-----------------------|-----------------------|
|           | 2020年1月1日至2020年12月31日 | 2019年1月1日至2019年12月31日 |
| 国债期货投资收益  | -                     | 32,621.36             |
| 股指期货-投资收益 | -                     | 940,582.53            |

## 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期                    | 上年度可比期间               |
|---------------|-----------------------|-----------------------|
|               | 2020年1月1日至2020年12月31日 | 2019年1月1日至2019年12月31日 |
| 股票投资产生的股利收益   | 28,901.53             | 94,641.99             |
| 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            | 28,901.53             | 94,641.99             |

## 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期                    | 上年度可比期间               |
|------------------------|-----------------------|-----------------------|
|                        | 2020年1月1日至2020年12月31日 | 2019年1月1日至2019年12月31日 |
| 1. 交易性金融资产             | -361,664.25           | 1,421,482.88          |
| ——股票投资                 | -367,678.99           | 1,507,275.72          |
| ——债券投资                 | 6,014.74              | -85,792.84            |
| ——资产支持证券投资             | -                     | -                     |
| ——贵金属投资                | -                     | -                     |
| ——其他                   | -                     | -                     |
| 2. 衍生工具                | -                     | 248,480.00            |
| ——权证投资                 | -                     | -                     |
| 期货投资                   | -                     | 248,480.00            |
| 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                     | -361,664.25           | 1,669,962.88          |

**7.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2020年1月1日至2020年12月31日 | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年12月31日 |
|---------|-----------------------------|----------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 3,298.82                    | 37,061.57                        |
| 合计      | 3,298.82                    | 37,061.57                        |

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。

**7.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2020年1月1日至2020年12月31日 | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年12月31日 |
|-----------|-----------------------------|----------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 59,439.52                   | 150,626.25                       |
| 银行间市场交易费用 | -                           | 350.00                           |
| 交易基金产生的费用 | -                           | -                                |
| 其中：申购费    | -                           | -                                |
| 赎回费       | -                           | -                                |
| 合计        | 59,439.52                   | 150,976.25                       |

**7.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2020年1月1日至2020年12月31日 | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年12月31日 |
|----------|-----------------------------|----------------------------------|
| 审计费用     | 40,000.00                   | 40,000.00                        |
| 信息披露费    | -                           | 80,000.00                        |
| 证券出借违约金  | -                           | -                                |
| 银行汇划费用   | 1,189.00                    | 3,059.94                         |
| 其他费用     | 1,000.00                    | 600.00                           |
| 银行间账户维护费 | 21,000.00                   | 36,600.00                        |
| 合计       | 63,189.00                   | 160,259.94                       |

**7.4.7.21 分部报告**

无。

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 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。

### 7.4.8.2 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。

## 7.4.9 关联方关系

| 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。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2020年1月1日至2020年12月31日 |                      | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年12月31日 |                      |
|-------|-----------------------------|----------------------|----------------------------------|----------------------|
|       | 成交金额                        | 占当期股票<br>成交总额的<br>比例 | 成交金额                             | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例 |
| 渤海证券  | 46,196,773.46               | 100.00%              | 91,522,042.32                    | 100.00%              |

#### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2020年1月1日至2020年12月31日 |                      | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年12月31日 |                      |
|-------|-----------------------------|----------------------|----------------------------------|----------------------|
|       | 成交金额                        | 占当期债券<br>成交总额的<br>比例 | 成交金额                             | 占当期债券<br>成交总额的比<br>例 |
| 渤海证券  | 94,765.38                   | 100.00%              | 15,153,575.40                    | 100.00%              |

### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2020年1月1日至2020年12月31日 |                            | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年12月31日 |                            |
|-------|-----------------------------|----------------------------|----------------------------------|----------------------------|
|       | 回购成交金额                      | 占当期债券<br>回购<br>成交总额的<br>比例 | 回购成交金额                           | 占当期债券<br>回购<br>成交总额的比<br>例 |
| 渤海证券  | 22,700,000.00               | 100.00%                    | 239,501,000.00                   | 100.00%                    |

### 7.4.10.1.4 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。

### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2020年1月1日至2020年12月31日      |                |           |                  |
|-------|----------------------------------|----------------|-----------|------------------|
|       | 当期<br>佣金                         | 占当期佣金<br>总量的比例 | 期末应付佣金余额  | 占期末应付佣<br>金总额的比例 |
| 渤海证券  | 30,457.49                        | 100.00%        | 3,040.96  | 100.00%          |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年12月31日 |                |           |                  |
|       | 当期<br>佣金                         | 占当期佣金<br>总量的比例 | 期末应付佣金余额  | 占期末应付佣<br>金总额的比例 |
| 渤海证券  | 93,038.90                        | 100.00%        | 12,764.89 | 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。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2020年1月1日至2020年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年12月31<br>日 |
|-----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 71,936.40                       | 325,714.72                           |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 36,328.28                       | 206,864.09                           |

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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2020年1月1日至2020年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年12月31<br>日 |
|----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 11,989.43                       | 54,285.71                            |

注：支付基金托管人工商业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。

#### 7.4.10.2.3 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。

#### 7.4.10.3 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。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 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<br>2020年1月1日至2020年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年12月<br>31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                | 189,455.93                      | 339,592.49                           |

|                     |            |            |
|---------------------|------------|------------|
| 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      | 123,635.93 | 150,136.56 |
| 报告期末持有的基金份额         | 65,820.00  | 189,455.93 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 2.31%      | 2.79%      |

注：本基金的申购费率适用于所有基金投资人，赎回费率适用于所有基金份额持有人。

#### 7.4.10.5.2 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：本基金本报告期内及上年度可比期间内无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 7.4.10.6 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<br>2020年1月1日至2020年12月31日 |            | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年12月31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                        | 309,622.20 | 1,460.52                         | 59,871.92 |

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。

#### 7.4.10.7 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。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2020年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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。

##### 7.4.12.2 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。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 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。

#### 7.4.12.3.2 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。

### 7.4.12.4 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。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 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奉行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。

### 7.4.13.2 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均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流程，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。

本基金的债券投资按债券的存续期限划分为短期债券投资和长期债券投资，存续期限在一年及一年以内的为短期债券投资，存续期限在一年以上的为长期债券投资。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。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

#### 7.4.13.2.4 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<br>2020年12月31日 | 上年度末<br>2019年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA    | -                  | -                   |
| AAA 以下 | -                  | 2,257.40            |
| 未评级    | -                  | 1,113,928.00        |
| 合计     | -                  | 1,116,185.40        |

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。

#### **7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：无。

#### **7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注：无。

### **7.4.13.3 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 2020 年 12 月 31 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(2019 年 12 月 31 日：同)。

#### **7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析**

注：无。

#### **7.4.13.3.2 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%。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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。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 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有流动性受限资产(2019 年 12 月 31 日：同)。

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。

#### **7.4.13.4 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。

##### **7.4.13.4.1 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、债券投资及买入返售金融资产等。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2020年12月31日  | 6个月以内        | 6个月<br>-1年 | 1-5年      | 5年以上     | 不计息          | 合计           |
|---------------------|--------------|------------|-----------|----------|--------------|--------------|
| 资产                  |              |            |           |          |              |              |
| 银行存款                | 309,622.20   | -          | -         | -        | -            | 309,622.20   |
| 结算备付金               | 10,092.17    | -          | -         | -        | -            | 10,092.17    |
| 存出保证金               | 873.48       | -          | -         | -        | -            | 873.48       |
| 交易性金融资产             | -            | -          | -         | -        | 4,282,645.91 | 4,282,645.91 |
| 应收利息                | -            | -          | -         | -        | 36.90        | 36.90        |
| 应收申购款               | -            | -          | -         | -        | 99.85        | 99.85        |
| 资产总计                | 320,587.85   | -          | -         | -        | 4,282,782.66 | 4,603,370.51 |
| 负债                  |              |            |           |          |              |              |
| 应付赎回款               | -            | -          | -         | -        | 1,090.78     | 1,090.78     |
| 应付管理人报酬             | -            | -          | -         | -        | 5,553.48     | 5,553.48     |
| 应付托管费               | -            | -          | -         | -        | 925.56       | 925.56       |
| 应付交易费用              | -            | -          | -         | -        | 3,040.96     | 3,040.96     |
| 其他负债                | -            | -          | -         | -        | 40,002.74    | 40,002.74    |
| 负债总计                | -            | -          | -         | -        | 50,613.52    | 50,613.52    |
| 利率敏感度缺口             | 320,587.85   | -          | -         | -        | 4,232,169.14 | 4,552,756.99 |
| 上年度末<br>2019年12月31日 | 6个月以内        | 6个月<br>-1年 | 1-5年      | 5年以上     | 不计息          | 合计           |
| 资产                  |              |            |           |          |              |              |
| 银行存款                | 59,871.92    | -          | -         | -        | -            | 59,871.92    |
| 结算备付金               | 39,932.62    | -          | -         | -        | -            | 39,932.62    |
| 存出保证金               | 2,570.79     | -          | -         | -        | -            | 2,570.79     |
| 交易性金融资产             | 1,021,326.00 | -          | 91,674.00 | 3,185.40 | 6,045,093.30 | 7,161,278.70 |
| 买入返售金融资             | 500,000.00   | -          | -         | -        | -            | 500,000.00   |

|         |              |   |           |          |              |              |
|---------|--------------|---|-----------|----------|--------------|--------------|
| 产       |              |   |           |          |              |              |
| 应收证券清算款 | -            | - | -         | -        | 387,522.53   | 387,522.53   |
| 应收利息    | -            | - | -         | -        | 33,388.16    | 33,388.16    |
| 资产总计    | 1,623,701.33 | - | 91,674.00 | 3,185.40 | 6,466,003.99 | 8,184,564.72 |
| 负债      |              |   |           |          |              |              |
| 应付证券清算款 | -            | - | -         | -        | 186,610.59   | 186,610.59   |
| 应付赎回款   | -            | - | -         | -        | 188,763.70   | 188,763.70   |
| 应付管理人报酬 | -            | - | -         | -        | 10,051.43    | 10,051.43    |
| 应付托管费   | -            | - | -         | -        | 1,675.24     | 1,675.24     |
| 应付交易费用  | -            | - | -         | -        | 12,764.89    | 12,764.89    |
| 应交税费    | -            | - | -         | -        | 0.02         | 0.02         |
| 其他负债    | -            | - | -         | -        | 129,000.00   | 129,000.00   |
| 负债总计    | -            | - | -         | -        | 528,865.87   | 528,865.87   |
| 利率敏感度缺口 | 1,623,701.33 | - | 91,674.00 | 3,185.40 | 5,937,138.12 | 7,655,698.85 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 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（2020年12月31日）            | 上年度末（2019年12月31日） |
|    | 市场利率上升 25 个基点      | -                           | 340.61            |
|    | 市场利率下降 25 个基点      | -                           | -331.81           |

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2020年12月31日 |                          | 上年度末<br>2019年12月31日 |                       |
|---------------|--------------------|--------------------------|---------------------|-----------------------|
|               | 公允价值               | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                | 占基金资<br>产净值比<br>例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 4,282,645.91       | 94.07                    | 6,045,093.30        | 78.96                 |
| 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            | 4,282,645.91       | 94.07                    | 6,045,093.30        | 78.96                 |

#### 7.4.13.4.3.2 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（2020年12月31日）            | 上年度末（2019年12月31日） |
|            | 业绩比较基准上升5%           | 132,697.27                  | 168,838.82        |
| 业绩比较基准下降5% | -132,697.27          | -168,838.82                 |                   |

#### 7.4.13.4.4 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。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 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。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 4,282,645.91 元，无属于第二层次或第三层次的余额(于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 6,045,093.30 元，属于第二层次的余额为人民币 1,116,185.40 元，无属于第三层次的余额)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

##### (d) 不以公允价值计量的金融工具

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，其账面价值与公允

价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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              | 4,282,645.91 | 93.03         |
|    | 其中：股票             | 4,282,645.91 | 93.03         |
| 2  | 基金投资              | -            | -             |
| 3  | 固定收益投资            | -            | -             |
|    | 其中：债券             | -            | -             |
|    | 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      | 319,714.37   | 6.95          |
| 8  | 其他各项资产            | 1,010.23     | 0.02          |
| 9  | 合计                | 4,603,370.51 | 100.00        |

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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         | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|--------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 30,840.00    | 0.68          |
| B  | 采矿业              | 162,575.00   | 3.57          |
| C  | 制造业              | 2,833,040.88 | 62.23         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 296,463.00   | 6.51          |
| E  | 建筑业              | -            | -             |
| F  | 批发和零售业           | 18,038.00    | 0.40          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 101,713.00   | 2.23          |
| H  | 住宿和餐饮业           | -            | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 203,545.00   | 4.47          |
| J  | 金融业              | 264,149.00   | 5.80          |
| K  | 房地产业             | 28,700.00    | 0.63          |
| L  | 租赁和商务服务业         | 103,087.00   | 2.26          |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 51,024.00    | 1.12          |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 79,722.00    | 1.75          |

|   |               |              |       |
|---|---------------|--------------|-------|
| 0 | 居民服务、修理和其他服务业 | -            | -     |
| P | 教育            | -            | -     |
| Q | 卫生和社会工作       | 109,749.03   | 2.41  |
| R | 文化、体育和娱乐业     | -            | -     |
| S | 综合            | -            | -     |
|   | 合计            | 4,282,645.91 | 94.07 |

### 8.2.2 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。

### 8.3 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 | 100    | 199,800.00 | 4.39         |
| 2  | 601899 | 紫金矿业 | 17,500 | 162,575.00 | 3.57         |
| 3  | 600809 | 山西汾酒 | 200    | 75,058.00  | 1.65         |
| 4  | 300750 | 宁德时代 | 200    | 70,222.00  | 1.54         |
| 5  | 688981 | 中芯国际 | 1,100  | 63,525.00  | 1.40         |
| 6  | 603298 | 杭叉集团 | 2,900  | 60,929.00  | 1.34         |
| 7  | 002056 | 横店东磁 | 3,900  | 59,241.00  | 1.30         |
| 8  | 000858 | 五粮液  | 200    | 58,370.00  | 1.28         |
| 9  | 002594 | 比亚迪  | 300    | 58,290.00  | 1.28         |
| 10 | 603339 | 四方科技 | 5,200  | 57,824.00  | 1.27         |
| 11 | 603128 | 华贸物流 | 6,200  | 57,598.00  | 1.27         |
| 12 | 600036 | 招商银行 | 1,300  | 57,135.00  | 1.25         |
| 13 | 300782 | 卓胜微  | 100    | 57,054.00  | 1.25         |
| 14 | 600031 | 三一重工 | 1,600  | 55,968.00  | 1.23         |
| 15 | 600276 | 恒瑞医药 | 500    | 55,730.00  | 1.22         |
| 16 | 600763 | 通策医疗 | 200    | 55,304.00  | 1.21         |
| 17 | 601100 | 恒立液压 | 488    | 55,144.00  | 1.21         |
| 18 | 300015 | 爱尔眼科 | 727    | 54,445.03  | 1.20         |
| 19 | 600436 | 片仔癀  | 200    | 53,502.00  | 1.18         |
| 20 | 603899 | 晨光文具 | 600    | 53,136.00  | 1.17         |
| 21 | 002258 | 利尔化学 | 2,500  | 52,250.00  | 1.15         |
| 22 | 002138 | 顺络电子 | 2,100  | 51,492.00  | 1.13         |
| 23 | 601615 | 明阳智能 | 2,700  | 51,246.00  | 1.13         |
| 24 | 000883 | 湖北能源 | 13,000 | 50,440.00  | 1.11         |
| 25 | 600008 | 首创股份 | 17,600 | 49,808.00  | 1.09         |

|    |        |      |       |           |      |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 26 | 000544 | 中原环保 | 7,100 | 49,771.00 | 1.09 |
| 27 | 002039 | 黔源电力 | 3,200 | 49,312.00 | 1.08 |
| 28 | 601139 | 深圳燃气 | 6,800 | 49,232.00 | 1.08 |
| 29 | 000333 | 美的集团 | 500   | 49,220.00 | 1.08 |
| 30 | 002939 | 长城证券 | 3,800 | 48,906.00 | 1.07 |
| 31 | 002534 | 杭锅股份 | 5,300 | 48,813.00 | 1.07 |
| 32 | 002271 | 东方雨虹 | 1,250 | 48,500.00 | 1.07 |
| 33 | 600900 | 长江电力 | 2,500 | 47,900.00 | 1.05 |
| 34 | 002475 | 立讯精密 | 824   | 46,242.88 | 1.02 |
| 35 | 600309 | 万华化学 | 500   | 45,520.00 | 1.00 |
| 36 | 002878 | 元隆雅图 | 2,200 | 45,232.00 | 0.99 |
| 37 | 300403 | 汉宇集团 | 7,100 | 45,156.00 | 0.99 |
| 38 | 000661 | 长春高新 | 100   | 44,891.00 | 0.99 |
| 39 | 002298 | 中电兴发 | 4,800 | 44,784.00 | 0.98 |
| 40 | 002352 | 顺丰控股 | 500   | 44,115.00 | 0.97 |
| 41 | 002921 | 联诚精密 | 2,200 | 42,944.00 | 0.94 |
| 42 | 300760 | 迈瑞医疗 | 100   | 42,600.00 | 0.94 |
| 43 | 603359 | 东珠生态 | 2,600 | 41,574.00 | 0.91 |
| 44 | 002241 | 歌尔股份 | 1,100 | 41,052.00 | 0.90 |
| 45 | 002787 | 华源控股 | 6,500 | 40,690.00 | 0.89 |
| 46 | 000001 | 平安银行 | 2,100 | 40,614.00 | 0.89 |
| 47 | 002434 | 万里扬  | 4,500 | 40,140.00 | 0.88 |
| 48 | 601012 | 隆基股份 | 420   | 38,724.00 | 0.85 |
| 49 | 300664 | 鹏鹞环保 | 5,100 | 38,148.00 | 0.84 |
| 50 | 300677 | 英科医疗 | 200   | 33,630.00 | 0.74 |
| 51 | 002142 | 宁波银行 | 900   | 31,806.00 | 0.70 |
| 52 | 600887 | 伊利股份 | 700   | 31,059.00 | 0.68 |
| 53 | 600585 | 海螺水泥 | 600   | 30,972.00 | 0.68 |
| 54 | 000651 | 格力电器 | 500   | 30,970.00 | 0.68 |
| 55 | 002714 | 牧原股份 | 400   | 30,840.00 | 0.68 |
| 56 | 600588 | 用友网络 | 700   | 30,709.00 | 0.67 |
| 57 | 601633 | 长城汽车 | 800   | 30,248.00 | 0.66 |
| 58 | 603187 | 海容冷链 | 500   | 30,000.00 | 0.66 |
| 59 | 002821 | 凯莱英  | 100   | 29,914.00 | 0.66 |
| 60 | 002315 | 焦点科技 | 1,800 | 29,736.00 | 0.65 |
| 61 | 002027 | 分众传媒 | 3,000 | 29,610.00 | 0.65 |
| 62 | 300122 | 智飞生物 | 200   | 29,582.00 | 0.65 |
| 63 | 601066 | 中信建投 | 700   | 29,400.00 | 0.65 |
| 64 | 002415 | 海康威视 | 600   | 29,106.00 | 0.64 |

|     |        |      |       |           |      |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 65  | 600660 | 福耀玻璃 | 600   | 28,830.00 | 0.63 |
| 66  | 000002 | 万科 A | 1,000 | 28,700.00 | 0.63 |
| 67  | 002884 | 凌霄泵业 | 1,200 | 28,680.00 | 0.63 |
| 68  | 002812 | 恩捷股份 | 200   | 28,356.00 | 0.62 |
| 69  | 601888 | 中国中免 | 100   | 28,245.00 | 0.62 |
| 70  | 300124 | 汇川技术 | 300   | 27,990.00 | 0.61 |
| 71  | 603185 | 上机数控 | 200   | 27,690.00 | 0.61 |
| 72  | 000596 | 古井贡酒 | 100   | 27,200.00 | 0.60 |
| 73  | 603259 | 药明康德 | 200   | 26,944.00 | 0.59 |
| 74  | 601318 | 中国平安 | 300   | 26,094.00 | 0.57 |
| 75  | 603267 | 鸿远电子 | 200   | 25,752.00 | 0.57 |
| 76  | 300454 | 深信服  | 100   | 24,801.00 | 0.54 |
| 77  | 300595 | 欧普康视 | 300   | 24,576.00 | 0.54 |
| 78  | 300759 | 康龙化成 | 200   | 24,080.00 | 0.53 |
| 79  | 600132 | 重庆啤酒 | 200   | 23,798.00 | 0.52 |
| 80  | 002304 | 洋河股份 | 100   | 23,599.00 | 0.52 |
| 81  | 600690 | 海尔智家 | 800   | 23,368.00 | 0.51 |
| 82  | 603501 | 韦尔股份 | 100   | 23,110.00 | 0.51 |
| 83  | 000568 | 泸州老窖 | 100   | 22,616.00 | 0.50 |
| 84  | 600885 | 宏发股份 | 400   | 21,688.00 | 0.48 |
| 85  | 600563 | 法拉电子 | 200   | 21,510.00 | 0.47 |
| 86  | 002706 | 良信股份 | 700   | 21,448.00 | 0.47 |
| 87  | 600845 | 宝信软件 | 300   | 20,694.00 | 0.45 |
| 88  | 603638 | 艾迪精密 | 300   | 20,682.00 | 0.45 |
| 89  | 002641 | 永高股份 | 3,200 | 20,416.00 | 0.45 |
| 90  | 600079 | 人福医药 | 600   | 20,328.00 | 0.45 |
| 91  | 603338 | 浙江鼎力 | 200   | 20,238.00 | 0.44 |
| 92  | 603039 | 泛微网络 | 200   | 20,192.00 | 0.44 |
| 93  | 603288 | 海天味业 | 100   | 20,054.00 | 0.44 |
| 94  | 601799 | 星宇股份 | 100   | 20,050.00 | 0.44 |
| 95  | 601865 | 福莱特  | 500   | 19,950.00 | 0.44 |
| 96  | 603986 | 兆易创新 | 100   | 19,750.00 | 0.43 |
| 97  | 603345 | 安井食品 | 100   | 19,287.00 | 0.42 |
| 98  | 300470 | 中密控股 | 400   | 19,040.00 | 0.42 |
| 99  | 300059 | 东方财富 | 600   | 18,600.00 | 0.41 |
| 100 | 603416 | 信捷电气 | 200   | 18,168.00 | 0.40 |
| 101 | 603939 | 益丰药房 | 200   | 18,038.00 | 0.40 |
| 102 | 603129 | 春风动力 | 100   | 17,419.00 | 0.38 |
| 103 | 300623 | 捷捷微电 | 400   | 17,400.00 | 0.38 |

|     |        |      |     |           |      |
|-----|--------|------|-----|-----------|------|
| 104 | 603806 | 福斯特  | 200 | 17,080.00 | 0.38 |
| 105 | 002507 | 涪陵榨菜 | 400 | 16,920.00 | 0.37 |
| 106 | 300378 | 鼎捷软件 | 600 | 16,350.00 | 0.36 |
| 107 | 002410 | 广联达  | 200 | 15,748.00 | 0.35 |
| 108 | 002032 | 苏泊尔  | 200 | 15,598.00 | 0.34 |
| 109 | 603606 | 东方电缆 | 600 | 14,970.00 | 0.33 |
| 110 | 600201 | 生物股份 | 700 | 14,623.00 | 0.32 |
| 111 | 300767 | 震安科技 | 200 | 14,600.00 | 0.32 |
| 112 | 300529 | 健帆生物 | 200 | 13,564.00 | 0.30 |
| 113 | 002242 | 九阳股份 | 400 | 12,816.00 | 0.28 |
| 114 | 601336 | 新华保险 | 200 | 11,594.00 | 0.25 |
| 115 | 002129 | 中环股份 | 300 | 7,650.00  | 0.17 |
| 116 | 603520 | 司太立  | 100 | 6,583.00  | 0.14 |
| 117 | 600438 | 通威股份 | 100 | 3,844.00  | 0.08 |
| 118 | 600089 | 特变电工 | 300 | 3,045.00  | 0.07 |
| 119 | 300310 | 宜通世纪 | 100 | 531.00    | 0.01 |

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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  | 300690 | 双一科技 | 192,573.00 | 2.52            |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 184,473.00 | 2.41            |
| 3  | 300443 | 金雷股份 | 176,634.00 | 2.31            |
| 4  | 002560 | 通达股份 | 134,521.00 | 1.76            |
| 5  | 600745 | 闻泰科技 | 133,798.04 | 1.75            |
| 6  | 002028 | 思源电气 | 129,508.00 | 1.69            |
| 7  | 002258 | 利尔化学 | 113,913.00 | 1.49            |
| 8  | 603606 | 东方电缆 | 110,223.00 | 1.44            |
| 9  | 300019 | 硅宝科技 | 107,547.00 | 1.40            |
| 10 | 002869 | 金溢科技 | 106,201.00 | 1.39            |
| 11 | 601615 | 明阳智能 | 105,540.00 | 1.38            |
| 12 | 002493 | 荣盛石化 | 103,778.00 | 1.36            |
| 13 | 000661 | 长春高新 | 103,647.00 | 1.35            |
| 14 | 002214 | 大立科技 | 102,215.00 | 1.34            |
| 15 | 002567 | 唐人神  | 101,992.00 | 1.33            |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 16 | 002415 | 海康威视 | 101,316.00 | 1.32 |
| 17 | 300601 | 康泰生物 | 101,145.00 | 1.32 |
| 18 | 002107 | 沃华医药 | 100,780.00 | 1.32 |
| 19 | 002705 | 新宝股份 | 100,018.00 | 1.31 |
| 20 | 300617 | 安靠智电 | 98,975.00  | 1.29 |

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。

#### 8.4.2 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  | 300690 | 双一科技 | 236,921.00 | 3.09           |
| 2  | 600547 | 山东黄金 | 200,348.44 | 2.62           |
| 3  | 300443 | 金雷股份 | 194,072.00 | 2.54           |
| 4  | 000975 | 银泰黄金 | 191,329.80 | 2.50           |
| 5  | 002237 | 恒邦股份 | 180,861.00 | 2.36           |
| 6  | 601069 | 西部黄金 | 176,128.00 | 2.30           |
| 7  | 600519 | 贵州茅台 | 173,001.00 | 2.26           |
| 8  | 000661 | 长春高新 | 160,601.00 | 2.10           |
| 9  | 002028 | 思源电气 | 157,819.00 | 2.06           |
| 10 | 600988 | 赤峰黄金 | 155,735.00 | 2.03           |
| 11 | 600745 | 闻泰科技 | 140,379.00 | 1.83           |
| 12 | 601899 | 紫金矿业 | 139,706.00 | 1.82           |
| 13 | 600489 | 中金黄金 | 135,218.00 | 1.77           |
| 14 | 002560 | 通达股份 | 132,088.00 | 1.73           |
| 15 | 300059 | 东方财富 | 129,394.48 | 1.69           |
| 16 | 300124 | 汇川技术 | 127,623.00 | 1.67           |
| 17 | 300601 | 康泰生物 | 125,749.00 | 1.64           |
| 18 | 002709 | 天赐材料 | 124,499.00 | 1.63           |
| 19 | 002493 | 荣盛石化 | 122,376.00 | 1.60           |
| 20 | 002311 | 海大集团 | 122,131.00 | 1.60           |

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。

#### 8.4.3 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 | 21,369,565.36 |
|--------------|---------------|

|              |               |
|--------------|---------------|
| 卖出股票收入（成交）总额 | 24,883,055.60 |
|--------------|---------------|

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。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 8.6 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 8.7 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。

### 8.8 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。

### 8.9 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。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 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 |
|-------------------|----|----------|---------|-----------|------|
| -                 | -  | -        | -       | -         | -    |
| 公允价值变动总额合计（元）     |    |          |         |           | 0.00 |
| 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） |    |          |         |           | 0.00 |

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 8.10.2 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 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。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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。

### 8.12.2 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。

### 8.12.3 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   | 873.48   |
| 2  | 应收证券清算款 | -        |
| 3  | 应收股利    | -        |
| 4  | 应收利息    | 36.90    |
| 5  | 应收申购款   | 99.85    |
| 6  | 其他应收款   | -        |
| 7  | 待摊费用    | -        |
| 8  | 其他      | -        |
| 9  | 合计      | 1,010.23 |

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 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。

### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额         | 占总份<br>额比例 |
| 231          | 12,316.86     | 65,820.00 | 2.31%      | 2,779,374.02 | 97.69%     |

### 9.2 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 | 551,962.22 | 19.40%   |

### 9.3 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<br>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             |

### 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

注：不涉及，期末无兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理。

**§ 10 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              | 6,779,631.28   |
| 本报告期基金总申购份额               | 502,639.45     |
| 减:本报告期基金总赎回份额             | 4,437,076.71   |
| 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              | 2,845,194.02   |

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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 2020 年 1 月 17 日发布公告，自 2020 年 1 月 15 日起，原副总经理、财务总监周里勇先生离任，赵猛先生担任渤海汇金证券资产管理有限公司的财务负责人（财务总监）。

2、本基金管理人于 2020 年 7 月 31 日发布公告，自 2020 年 7 月 30 日起，王琦先生担任渤海汇金证券资产管理有限公司的副总经理。

3、本基金管理人于 2020 年 7 月 31 日发布公告，自 2020 年 7 月 30 日起，李耀光先生担任渤海汇金证券资产管理有限公司的副总经理。

4、本基金管理人于 2020 年 8 月 19 日发布公告，自 2020 年 8 月 18 日起，李江先生担任渤海汇金证券资产管理有限公司的首席信息官。

5、本基金管理人于 2020 年 8 月 28 日发布公告，自 2020 年 8 月 26 日起，麻众志先生新任渤海汇金证券资产管理有限公司总经理，盛况女士离任。

6、本基金管理人于 2020 年 8 月 28 日发布公告，自 2020 年 8 月 27 日起，盛况女士担任渤海汇金证券资产管理有限公司的副总经理。

7、本基金管理人于 2020 年 12 月 31 日发布公告，自 2020 年 12 月 30 日起，渤海汇金证券资产管理有限公司的董事长由徐海军先生变更为刘嫣女士。

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。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司管理的一只单一资产管理计划，针对应付未付的管理费，通过北京市西城区人民法院向委托人建盈投资有限公司提起诉讼申请。截止报告期末，尚未开庭审理。此事项不会对管理人的公募基金管理业务带来不利影响。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内未发生基金投资策略的改变。

## 11.5 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 40,000.00 元。截至本报告期末,该审计机构已为本基金提供审计服务 2 年 5 个月。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

2020 年 11 月,管理人渤海汇金证券资产管理有限公司收到证监会出具的《关于对渤海汇金证券资产管理有限公司采取出具警示函措施的决定》([2020]70 号),主要涉及投资银行类业务内部控制待完善,公司已积极完成整改反馈。此事项不会对管理人的公募基金管理业务带来不利影响。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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<br>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<br>成交总额的比<br>例 | 佣金        | 占当期佣金<br>总量的比例 |    |
| 渤海证券 | 2          | 46,196,773.46 | 100.00%              | 30,457.49 | 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证券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。

## 11.7.2 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 | 94,765.38 | 100.00%      | 22,700,000.00 | 100.00%        | -    | -            |

## 11.8 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  | 2020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、财务负责人)变更公告 | 证券时报、公司网站 | 2020年1月17日 |
| 2  | 渤海汇金证券资产管理有限公司旗下全部基金2019年第4季度报告的提示性公告      | 证券时报      | 2020年1月17日 |
| 3  | 渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金2019年第4季度报告           | 公司网站      | 2020年1月17日 |
| 4  | 渤海汇金证券资产管理有限公司旗下全部基金2019年度报告的提示性公告         | 证券时报      | 2020年3月27日 |
| 5  | 渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金2019年度报告              | 公司网站      | 2020年3月27日 |
| 6  | 渤海汇金证券资产管理有限公司旗下全部基金2020年第1季度报告的提示性公告      | 证券时报      | 2020年4月22日 |
| 7  | 渤海汇金量化汇盈灵活配置混合                             | 公司网站      | 2020年4月22日 |

|    |   |           |                 |
|----|---|-----------|-----------------|
|    | 型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告                                  |           |                 |
| 8  | 关于旗下部分基金增加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告             | 证券时报、公司网站 | 2020 年 4 月 24 日 |
| 9  | 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及摘要(更新)（2020 年第 1 号）提示性公告     | 证券时报      | 2020 年 5 月 13 日 |
| 10 | 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（2020 年第 1 号）           | 公司网站      | 2020 年 5 月 13 日 |
| 11 | 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)（2020 年第 1 号）             | 公司网站      | 2020 年 5 月 13 日 |
| 12 | 关于旗下部分基金增加大连网金基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠的公告                 | 证券时报、公司网站 | 2020 年 5 月 15 日 |
| 13 | 渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加阳光人寿保险股份有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告 | 证券时报、公司网站 | 2020 年 6 月 11 日 |
| 14 | 关于旗下部分基金增加北京肯特瑞基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告              | 证券时报、公司网站 | 2020 年 6 月 29 日 |
| 15 | 渤海汇金证券资产管理有限公司旗下全部基金 2020 年第 2 季度报告的提示性公告               | 证券时报      | 2020 年 7 月 21 日 |

|    |  |           |                  |
|----|--|-----------|------------------|
| 16 | 渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 2 季度报告   | 公司网站      | 2020 年 7 月 21 日  |
| 17 | 2020 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  | 证券时报、公司网站 | 2020 年 7 月 31 日  |
| 18 | 2020 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  | 证券时报、公司网站 | 2020 年 7 月 31 日  |
| 19 | 2020 年度渤海汇金证券资产管理有限公司高级管理人员（首席信息官）变更公告 | 证券时报、公司网站 | 2020 年 8 月 19 日  |
| 20 | 2020 年度渤海汇金证券资产管理有限公司高级管理人员（总经理）变更公告   | 证券时报、公司网站 | 2020 年 8 月 28 日  |
| 21 | 2020 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  | 证券时报、公司网站 | 2020 年 8 月 28 日  |
| 22 | 渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金 2020 年中期报告       | 公司网站      | 2020 年 8 月 31 日  |
| 23 | 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）      | 证券时报、公司网站 | 2020 年 8 月 31 日  |
| 24 | 渤海汇金证券资产管理有限公司旗下全部基金 2020 年中期报告的提示性公告  | 证券时报      | 2020 年 9 月 1 日   |
| 25 | 渤海汇金证券资产管理有限公司旗下全部基金 2020 年第 3 季度报     | 证券时报      | 2020 年 10 月 28 日 |

|    |   |           |                  |
|----|---|-----------|------------------|
|    | 告的提示性公告   |           |                  |
| 26 | 渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 3 季度报告                      | 公司网站      | 2020 年 10 月 28 日 |
| 27 | 渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加喜鹊财富基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告   | 公司网站      | 2020 年 10 月 30 日 |
| 28 | 渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加喜鹊财富基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告   | 证券时报      | 2020 年 10 月 31 日 |
| 29 | 渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告                             | 证券时报、公司网站 | 2020 年 10 月 31 日 |
| 30 | 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)(2020 年第 2 号)及产品概要(更新)提示性公告 | 证券时报      | 2020 年 11 月 2 日  |
| 31 | 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      | 2020 年 11 月 2 日  |
| 32 | 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)(2020 年第 2 号)               | 公司网站      | 2020 年 11 月 2 日  |
| 33 | 渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加北京汇成基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告   | 证券时报、公司网站 | 2020 年 11 月 2 日  |

|    |   |           |             |
|----|---|-----------|-------------|
| 34 | 2020年度渤海汇金证券资产管理<br>有限公司高级管理人员(董事长)<br>变更公告 | 证券时报、公司网站 | 2020年12月31日 |
|----|---|-----------|-------------|

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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

注：无。

### 12.2 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。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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。

### 13.2 存放地点

基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司处。

### 13.3 查阅方式

上述文件可在渤海汇金证券资产管理有限公司网站或中国证监会基金电子披露网站上查阅，或者在营业时间内到渤海汇金证券资产管理有限公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司。

客服电话：400-651-5988/400-651-1717

管理人网站：<https://www.bhhjamc.com>

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

渤海汇金证券资产管理有限公司

2021年3月31日