

渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：渤海汇金证券资产管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经董事会审议，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	8
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	9
§3 主要财务指标和基金净值表现	10
3.1 主要会计数据和财务指标	10
3.2 基金净值表现	10
3.3 其他指标	12
§4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	17
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	18
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	18
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	19
6.1 资产负债表	19
6.2 利润表	20

6.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
6.4 报表附注	22
§7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	46
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	51
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	51
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	51
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	52
§8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	53
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	54
§9 开放式基金份额变动	55
§10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8 其他重大事件	57

§11 影响投资者决策的其他重要信息	60
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金	
基金简称	渤海汇金睿选混合	
场内简称	-	
基金主代码	005429	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 2 月 11 日	
基金管理人	渤海汇金证券资产管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	12,864,800.72 份	
基金合同存续期	-	
基金份额上市的证券交易所	-	
上市日期	-	
下属分级基金的基金简称:	渤海汇金睿选混合 A	渤海汇金睿选混合 C
下属分级基金场内简称:	-	-
下属分级基金的交易代码:	005429	005430
报告期末下属分级基金的份额总额	11,535,392.73 份	1,329,407.99 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为投资者实现超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	<p>本基金通过对国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素进行综合分析，构建和调整固定收益证券投资组合，力求获得稳健的投资收益。</p> <p>1、收益率曲线策略： 与权益资产定价不同、固定收益类资产的定价是二维的，即权益资产的价格为一个点，固定资产的价格为一条收益率曲线，根据曲线的形态变化，对应不同的操作策略，如曲线增陡、曲线扁平、蝶式策略、曲线骑乘等。</p> <p>2、组合选择策略： 根据收益率曲线的不同形态，构建不同风险收益特征的组合： 哑铃型组合：配置期限结构两端的债券，利用短期债券保证组合的流动性，利用长期限的债券提高整个组合的收益水平 子弹型组合：集中投资于某一期限附近的债券 阶梯型组合：当收益率曲线的凸起部分是均匀分布时，集中投资于这几个凸起部分所在年期的债券</p> <p>3、杠杆策略： 杠杆的应用可分为以下几种： 息差杠杆：利用回购放大规模，通过久期错配，套取融资利率与标的资产的到期收益率息差 久期杠杆：通过对个券的久期控制，在有限的组合规模下满足不同的目标利率</p>

敞口

4、可转债投资策略

本基金一方面将对发债主体的信用基本面进行深入挖掘以明确该可转债的债底保护，防范信用风险，另一方面，还会进一步分析公司的盈利和成长能力以确定可转债中长期的上涨空间。本基金将借鉴信用债的基本面研究，从行业基本面、公司的行业地位、竞争优势、财务稳健性、盈利能力、治理结构等方面进行考察，精选财务稳健、信用违约风险小的可转债进行投资。

5、国债期货投资策略

国债期货作为利率衍生品的一种,有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定,以套期保值为目的,结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系,对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控,在最大限度保证基金资产安全的基础上,力求实现基金资产的长期稳定增值。国债期货相关投资遵循法律法规及中国证监会的规定。

6、股票投资策略

(1) 行业配置策略: 通过跟踪并量化各行业的景气度、盈利能力、分析师的盈利预期、行业估值等基本面信息, 结合行业指数的波动指标、动量变化指标等捕捉最具有投资价值的行业。以此构建行业轮动模型动态调整权益资产中行业配置, 提升具有投资价值行业的比例, 降低投资价值较低的行业比例, 实现相对较优的行业配置, 获取行业配置的超额阿尔法收益。

(2) 多因子选股策略: 通过对股票历史数据的数量化分析, 建立影响股票价格的因子库。通过对各类因子打分构建多因子模型, 筛选出收益预期较高的股票组合。本基金使用的因子不仅包括公司盈利能力、成长性、一致预期、估值等基本面类因子, 同时也包括股票价格波动相关的各类技术指标, 例如价格波动率、成交量、动量趋势、超买超卖等。本基金通过对量化模型中各类因子的持续跟踪来监控因子的有效性, 根据市场状况结合因子变化趋势, 动态选取最优因子构建股票多头组合。

(3) 统计套利选股策略: 基于均值回归的思想, 通过分析历史数据统计投资标的之间存在的稳定性关系。当标的之间的价格波动导致既定关系出现偏离时, 这种趋势大概率在未来会得到修正, 便会出现套利机会。借助计算机自动捕捉套利机会, 挑选历史上大概率跑赢市场的股票组合, 以相对较高的成功概率进场套利。

(4) 事件套利选股策略: 通过跟踪分析对投资者行为产生一定影响, 可造成市场短期价格波动的事件来获取超额投资收益。此类事件包括但不限于定向增发、股东增持、股权激励、业绩公告、资产注入等, 相关事件信息要素均由上市公司公告等公开渠道获得。

7、股指期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则, 以套期保值为主要目的, 在风险可控的前提下, 本着谨慎原则参与股指期货的投资。本基金将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征, 选择流动性较高的、交易活跃的期货合约进行空头或多头套期保值, 以管理投资组合的系统性风险, 提高资金使用效率。

8、资产支持证券投资策略

本基金将通过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

	<p>过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。同时在严格控制风险的情况下，综合运用多个策略和研究方法，选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p> <p>9、权证投资策略</p> <p>本基金将在严格控制风险、保障基金财产安全的前提下对权证进行投资。本基金将通过对权证标的证券基本面研究，采取市场公认的权证定价模型作为权证投资的价值基准，同时充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征进行谨慎投资。此外根据权证衍生工具的特征，通过权证与标的证券组合投资，以期改善组合的风险收益。</p>	
业绩比较基准	上证国债指数收益率×70%+沪深 300 指数收益率×30%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中高风险水平的投资品种。	
	渤海汇金睿选混合 A	渤海汇金睿选混合 C
下属分级基金的风险收益特征	-	-

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		渤海汇金证券资产管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	麻众志	郭明
	联系电话	010-68784289	010-66105799
	电子邮箱	mazz@bhjq.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-651-5988/ 400-651-1717	95588
传真		022-23861651	010-66105798
注册地址		深圳市前海深港合作区桂湾五路 128 号前海深港基金小镇对冲基金中心 506	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市前海深港合作区桂湾五路 128 号前海深港基金小镇对冲基金中心 506	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518054	100140
法定代表人		刘嫣	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	https://www.bhhjmc.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	渤海汇金证券资产管理有限公司	天津市南开区宾水西道 8 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	渤海汇金睿选混合 A	渤海汇金睿选混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	1,122,341.10	750,961.12
本期利润	1,223,437.20	778,968.25
加权平均基金份额本期利润	0.1089	0.1423
本期加权平均净值利润率	8.40%	11.44%
本期基金份额净值增长率	8.85%	8.58%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
期末可供分配利润	3,622,898.30	380,502.18
期末可供分配基金份额利润	0.3141	0.2862
期末基金资产净值	15,526,204.04	1,752,171.26
期末基金份额净值	1.3460	1.3180
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	34.60%	31.80%

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

渤海汇金睿选混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.08%	0.36%	-0.51%	0.25%	1.59%	0.11%
过去三个月	3.95%	0.37%	1.70%	0.29%	2.25%	0.08%
过去六个月	8.85%	0.43%	1.46%	0.40%	7.39%	0.03%
过去一年	16.92%	0.47%	9.35%	0.40%	7.57%	0.07%
过去三年	32.27%	0.33%	24.48%	0.41%	7.79%	-0.08%
自基金合同生效起至今	34.60%	0.31%	23.45%	0.40%	11.15%	-0.09%

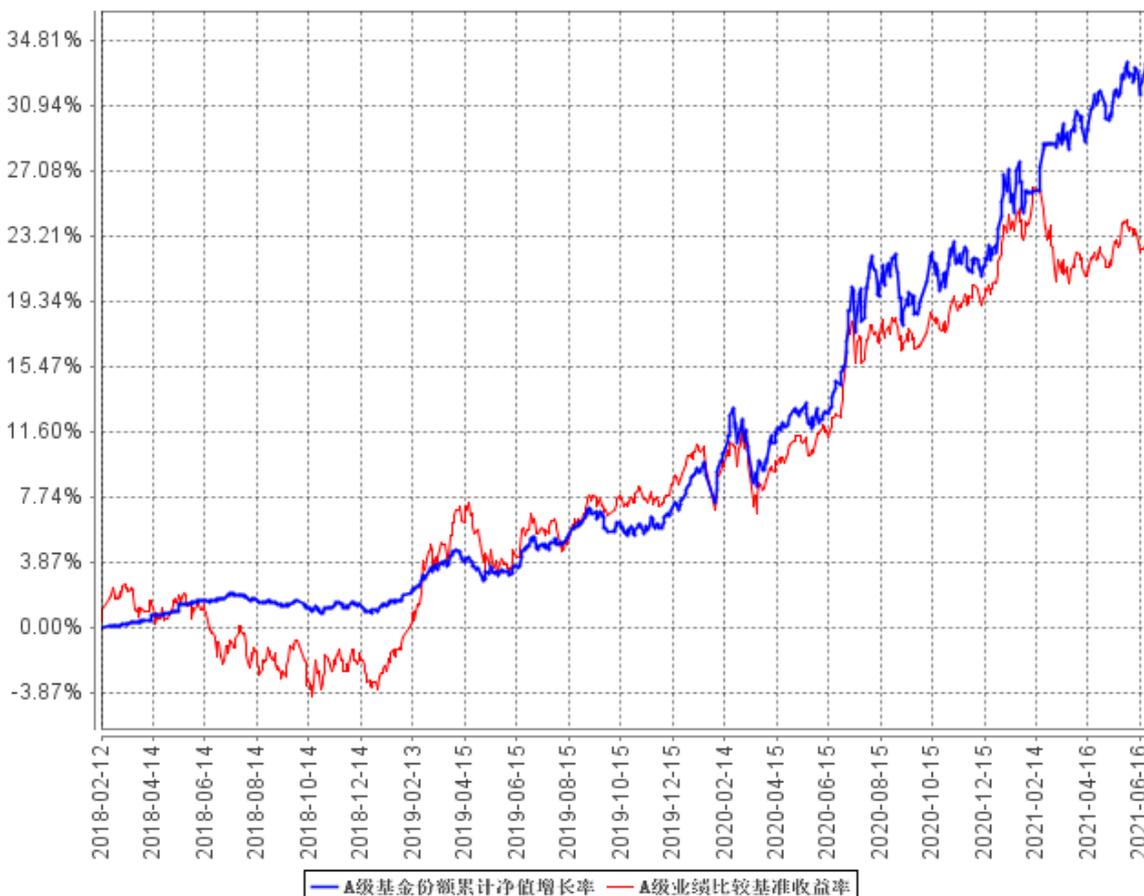
渤海汇金睿选混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.03%	0.36%	-0.51%	0.25%	1.54%	0.11%
过去三个月	3.80%	0.37%	1.70%	0.29%	2.10%	0.08%
过去六个月	8.58%	0.43%	1.46%	0.40%	7.12%	0.03%
过去一年	16.29%	0.47%	9.35%	0.40%	6.94%	0.07%
过去三年	29.98%	0.33%	24.48%	0.41%	5.50%	-0.08%
自基金合同生效起至今	31.80%	0.31%	23.45%	0.40%	8.35%	-0.09%

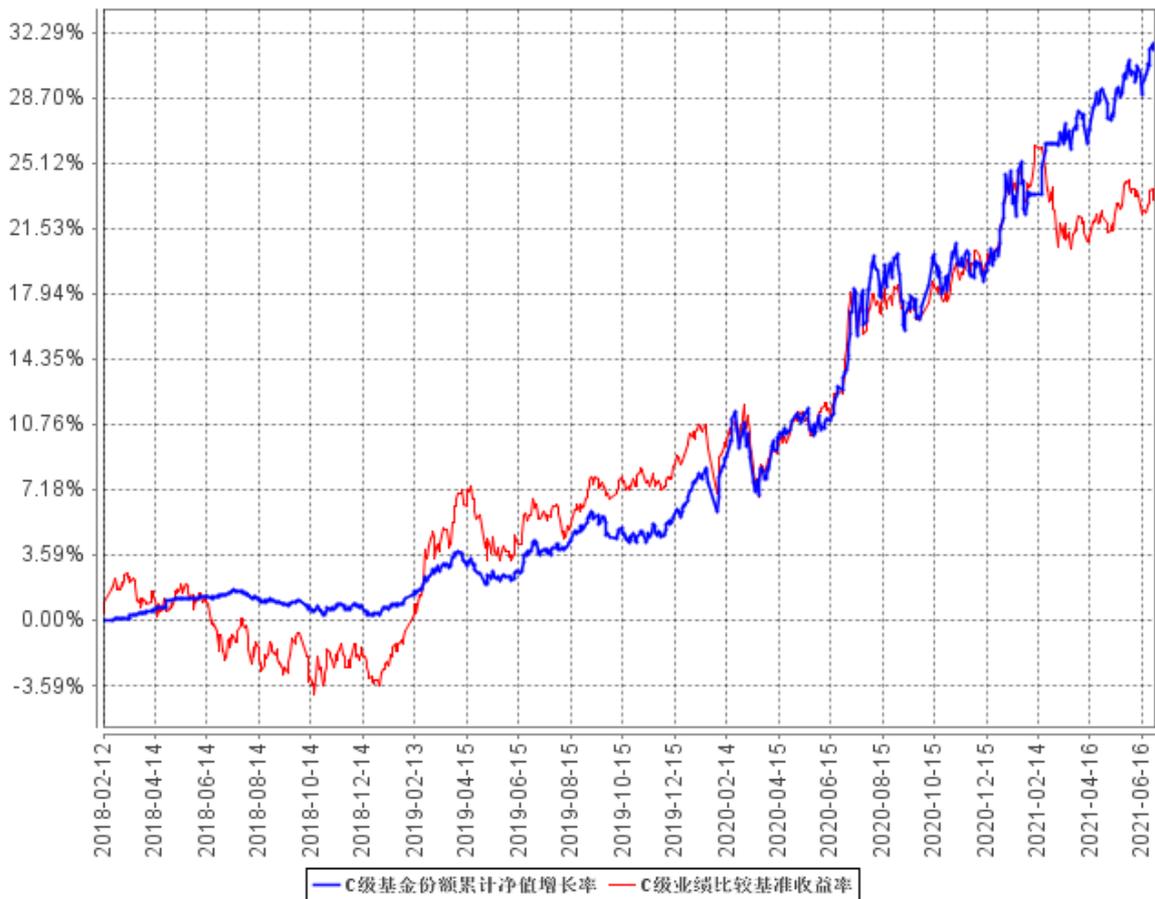
注：业绩比较基准：上证国债指数收益率×70%+沪深 300 指数收益率×30%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

3.3 其他指标

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

渤海汇金证券资产管理有限公司（简称渤海汇金、渤海汇金资管）前身为渤海证券资产管理总部，经中国证监会证监许可[2016]3 号文批准，成立于 2016 年 5 月 18 日。注册地为深圳，注册资本为 11 亿元，业务范围为证券资产管理、公开募集证券投资基金管理业务，是渤海证券股份有限公司的全资子公司。

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 7 只公募基金：渤海汇金汇添金货币市场基金、渤海汇金汇增利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、渤海汇金汇添益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金、渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金、渤海汇金汇裕 87 个月定期开放债券型证券投资基金、渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何翔	本基金的基金经理、公募投资总监、公募投资部总经理	2018 年 2 月 11 日	-	17 年	南开大学数学学士、金融学硕士。2004 年 2 月至 2013 年 10 月就职于渤海证券研究所，任金融工程部经理。2013 年 10 月至 2016 年 8 月就职于渤海证券基金管理总部，任投资研究部经理。2016 年 8 月加入渤海汇金证券资产管理有限公司公募投资部，任公募投资总监。2017 年 7 月至 2018 年 12 月 10 日担任渤海汇金汇添金货币市场基金基金经理。2018 年 2 月起担任渤海汇金睿选混合基金基金经理。2018 年 7 月起担任渤海汇金量化汇盈混合基金基金经理。2021 年 3 月起担任渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金基金经理。

李杨	本基金的基金经理	2018 年 2 月 11 日	-	4 年	天津财经大学经济学学士。2011 年 10 月到 2014 年 4 月，在包商银行股份有限公司任债券交易员，2014 年 5 月到 2016 年 8 月，在天津银行股份有限公司任债券交易员，2016 年 9 月至今，在渤海汇金证券资产管理有限公司任基金经理。2017 年 8 月起任渤海汇金汇添金货币市场基金基金经理。2017 年 12 月起任渤海汇金汇增利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2017 年 12 月起任渤海汇金汇添益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2018 年 2 月起担任渤海汇金睿选混合基金基金经理。2020 年 11 月起担任渤海汇金汇裕 87 个月定开基金基金经理。
----	----------	-----------------	---	-----	--

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

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及《渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金基金合同》等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合在获得投资信息、投资建议和实时投资决策方面享有公平的机会。交易员按最优原则，对投资指令进行综合平衡，保证交易在各资产组合间的公平执行，保证各类投资人得到公平对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，报告期内，本基金未发现异常交易行为，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易不存在成交的单边交易量超过该证券交易当日成交量的 5% 的情形。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

债券收益上半年呈现冲高回落态势。年初主要交易逻辑包括全球通胀预期、海外疫情控制及疫苗接种进度超预期，以及资金面的波动，指标 10 年国债冲高到 3.29%。后期随着资金面宽松，信用收缩导致机构配置力量足，疫情后国内经济跌深反弹的惯性接近尾声，基本面对债券收益的不利影响逐渐弱化，收益率从高位回落，6 月末指标 10 年国债收于 3.10% 附近。报告期内，主要持仓品种仍然是交易所利率债，维持中性久期，无信用风险敞口。

2021 年上半年 A 股市场先扬后抑，随后震荡上行。春节前各类工业品持续涨价，海内外疫情防控得力，市场盈利预期改善，年初基金发行再创新高共同驱动市场上涨；春节后，通胀担忧加剧，资金流出权重白马股带动市场调整，风险偏好开始下降。进入一季报披露期后，业绩高增的个股受业绩超预期影响开启反弹。五一节后，伴随大宗商品、航运等周期品的加速涨价，周期股在节后引领市场。抱团权重在震荡中寻找合适的估值定位，小市值也在震荡中逐渐回归。具体来看，上半年上证综指、沪深 300、中小 100、创业板指分别上涨 3.40%、0.24%、3.66%、17.22%。行业方面，电气设备、钢铁、化工相对强势，而家用电器、非银金融、国防军工表现较差。我们在渤海汇金睿选产品的投资运作中，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。

上半年经济向潜在增长率回归，经济边际放缓是市场的一致预期，但不会出现阶段性快速下行的风险。国内流动性依然保持稳定，美国就业修复趋势的不确定性将持续影响美国的货币政策，进而放大对风险资产的影响。而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，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。

在上半年，我们坚定看好震荡格局中，部分权益资产较为确定的、高速的业绩增长所带来的市场结构性机会，动态调整睿选中权益仓位配置比例。行业配置方面，睿选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。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

截至本报告期末渤海汇金睿选混合 A 基金份额净值为 1.3460 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.85%；截至本报告期末渤海汇金睿选混合 C 基金份额净值为 1.3180 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.58%；同期业绩比较基准收益率为 1.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

基本面，疫情后国内经济跌深反弹的惯性接近尾声，经济增速逐渐向新平台回归。通胀，PPI 高位触底后温和回落，通胀整体可控。供需看，财政全年额度已经明确，目前财政整体支出节奏较慢，下半年财政发力概率较大，供给对市场的影响需要警惕。资金面，超预期降准之后市场对于货币政策预期偏乐观，预计维持中性偏宽松的货币环境。后期需要关注央行降准对经济调节的效果以及全球范围内 DELTA 病毒的防御进展。降准之后长端收益已经下行了 15bps，如果后期基本面保持稳定，价格型货币政策工具运用的概率不大，债市再下一城的可能性也相对较小，将维持一个收益低位震荡的格局。

权益方面，展望三季度，预计市场将维持震荡的格局，操作策略上依然要“重结构、轻指数”。在流动性的靴子落地之后，成长将成为市场的主要动力，持续业绩主导。从时间点来看，中报披露期市场将再次面临业绩的考验，优胜劣汰，预计波动较大，同时预计四季度美国货币政策将会有较为明确的信号，此时市场也将会有大的波动。不过一旦美国货币政策转向的靴子落地，反而会给市场提供更好的长期机会，未来市场主要的驱动力在于业绩增长将更加确定。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会，委员由投资负责人、研究负责人、产品设计负责人、财务负责人、运营保障负责人、风险控制部和法律合规部负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。

基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。公募投资部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括但不限于上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司，中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同（第十六部分基金的收益与分配中三、基金收益分配原则）的约定，报告期内本基金未实施利润分配，符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式基金，截至 2021 年 2 月 11 日，本基金基金合同生效已满 3 年。基金合同满 3 年后的报告期内，未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人的情况。本基金自 2021 年 2 月 22 日至 2021 年 6 月 30 日连续 88 个工作日基金资产净值低于 5000 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：将不断完善持续营销方案，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睿选混合型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金的管理人渤海汇金证券资产管理有限公司在渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内，渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对渤海汇金证券资产管理有限公司编制和披露的渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金 2021 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	209,555.87	88,243.93
结算备付金		404,918.96	64,055.76
存出保证金		2,725.38	929.96
交易性金融资产	6.4.7.2	13,596,123.50	13,693,481.96
其中：股票投资		5,626,683.50	4,870,942.36
基金投资		-	-
债券投资		7,969,440.00	8,822,539.60
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	3,000,000.00	-
应收证券清算款		355.89	-
应收利息	6.4.7.5	150,954.35	153,159.95
应收股利		-	-
应收申购款		43,904.31	40.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		17,408,538.26	13,999,911.56
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		89,072.01	-
应付管理人报酬		17,086.19	13,953.24
应付托管费		2,847.71	2,325.53
应付销售服务费		888.54	333.57
应付交易费用	6.4.7.7	1,286.81	3,329.69
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	18,981.70	40,000.00
负债合计		130,162.96	59,942.03
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	12,864,800.72	11,282,700.28
未分配利润	6.4.7.10	4,413,574.58	2,657,269.25
所有者权益合计		17,278,375.30	13,939,969.53
负债和所有者权益总计		17,408,538.26	13,999,911.56

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，渤海汇金睿选混合 A 基金份额净值 1.3460 元，基金份额总额 11,535,392.73 份；渤海汇金睿选混合 C 基金份额净值 1.3180 元，基金份额总额 1,329,407.99 份。渤海汇金睿选混合份额总额合计为 12,864,800.72 份。

6.2 利润表

会计主体：渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		2,241,524.32	972,839.05
1.利息收入		437,247.22	177,176.10
其中：存款利息收入	6.4.7.11	6,268.10	712.42
债券利息收入		383,708.55	170,953.24
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		47,270.57	5,510.44
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		710,364.63	91,576.13
其中：股票投资收益	6.4.7.12	811,208.48	66,773.02
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-127,185.82	6,040.47
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	533.98
股利收益	6.4.7.16	26,341.97	18,228.66
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	129,103.23	703,643.90
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	964,809.24	442.92
减：二、费用		239,118.87	138,170.15
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	162,561.68	80,207.21
2. 托管费	6.4.10.2.2	27,093.62	13,367.85
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	4,065.04	2,195.04
4. 交易费用	6.4.7.19	20,206.29	3,432.35
5. 利息支出		849.04	-
其中：卖出回购金融资产支出		849.04	-
6. 税金及附加		603.72	1.92
7. 其他费用	6.4.7.20	23,739.48	38,965.78
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,002,405.45	834,668.90
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,002,405.45	834,668.90

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	11,282,700.28	2,657,269.25	13,939,969.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,002,405.45	2,002,405.45
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）	1,582,100.44	-246,100.12	1,336,000.32
其中：1.基金申购款	158,063,186.68	37,247,293.21	195,310,479.89
2.基金赎回款	-156,481,086.24	-37,493,393.33	-193,974,479.57
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)	12,864,800.72	4,413,574.58	17,278,375.30
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	12,775,753.07	1,025,785.46	13,801,538.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	834,668.90	834,668.90
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)	-1,085,126.45	-102,904.28	-1,188,030.73
其中：1.基金申购款	32,681.99	3,337.28	36,019.27
2.基金赎回款	-1,117,808.44	-106,241.56	-1,224,050.00
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)	11,690,626.62	1,757,550.08	13,448,176.70

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]第1193号《关于准予渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由渤海汇金证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开

放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 285,960,172.45 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2018)第 0120 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 2 月 11 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 285,984,563.38 份基金份额，其中认购资金利息折合 24,390.93 份基金份额。本基金的基金管理人为渤海汇金证券资产管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10,000,444.49 基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别，称为 A 类基金份额；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，并从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单等货币市场工具、权证、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例不超过 40%，其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金业绩比较基准：上证国债指数收益率×70%+沪深 300 指数收益率×30%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,发起式基金的基金合同生效三年后,若基金资产净值低于人民币两亿元的,基金合同自动终止。本基金的基金合同于 2021 年 2 月 11 日生效满三年,当日基金资产净值高于人民币两亿元,故本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
活期存款	209,555.87
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：	209,555.87

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	4,986,400.57	5,626,683.50	640,282.93
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	7,969,440.00	-35,681.43
	银行间市场	-	-
	合计	7,969,440.00	-35,681.43
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	12,991,522.00	13,596,123.50	604,601.50

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	3,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	3,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	115.54
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	157.60
应收债券利息	150,680.01
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	1.20
合计	150,954.35

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,286.81
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,286.81

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	64.71
应付证券出借违约金	-
预提费用	18,916.99
合计	18,981.70

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

渤海汇金睿选混合 A	
项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,730,231.00	10,730,231.00
本期申购	2,063,933.33	2,063,933.33
本期赎回(以“-”号填列)	-1,258,771.60	-1,258,771.60
- 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	11,535,392.73	11,535,392.73

金额单位：人民币元

渤海汇金睿选混合 C		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	552,469.28	552,469.28
本期申购	155,999,253.35	155,999,253.35
本期赎回(以“-”号填列)	-155,222,314.64	-155,222,314.64
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,329,407.99	1,329,407.99

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

渤海汇金睿选混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,256,236.86	282,896.68	2,539,133.54
本期利润	1,122,341.10	101,096.10	1,223,437.20
本期基金份额交易产生的变动数	244,320.34	-16,079.77	228,240.57
其中：基金申购款	634,309.20	-9,221.47	625,087.73
基金赎回款	-389,988.86	-6,858.30	-396,847.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,622,898.30	367,913.01	3,990,811.31

单位：人民币元

渤海汇金睿选混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	103,549.52	14,586.19	118,135.71
本期利润	750,961.12	28,007.13	778,968.25
本期基金份额交易产生的变动数	-474,008.46	-332.23	-474,340.69
其中：基金申购款	38,597,693.88	-1,975,488.40	36,622,205.48
基金赎回款	-39,071,702.34	1,975,156.17	-37,096,546.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	380,502.18	42,261.09	422,763.27

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	5,248.31
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	1,003.25
其他	16.54
合计	6,268.10

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	811,208.48
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	811,208.48

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	9,643,592.93

减：卖出股票成本总额	8,832,384.45
买卖股票差价收入	811,208.48

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益-证券出借差价收入。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-127,185.82
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	-127,185.82

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	139,127,523.63
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	136,042,942.82
减：应收利息总额	3,211,766.63
买卖债券差价收入	-127,185.82

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益**6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	26,341.97
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	26,341.97

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	129,103.23
——股票投资	207,174.59
——债券投资	-78,071.36
——资产支持证券投资	-

——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	129,103.23

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	964,809.24
合计	964,809.24

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

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	18,531.29
银行间市场交易费用	1,675.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	20,206.29

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	9,916.99
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费用	1,722.49
其他费用	100.00

银行间账户维护费	12,000.00
合计	23,739.48

6.4.7.21 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本报告报出日，本基金无需说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
渤海汇金证券资产管理有限公司（“渤海汇金资管”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
渤海证券股份有限公司（“渤海证券”）	基金管理人的独资股东、基金销售机构

注：1、本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
渤海证券	19,024,543.93	100.00%	2,038,316.70	100.00%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
渤海证券	11,667,203.00	100.00%	1,532,101.00	100.00%

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
渤海证券	173,500,000.00	100.00%	46,600,000.00	100.00%

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
渤海证券	7,084.08	100.00%	1,286.81	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
渤海证券	2,191.48	100.00%	964.56	100.00%

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	162,561.68	80,207.21
其中：支付销售机构的客户维护费	6,262.38	5,136.09

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 1.2% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.2% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	27,093.62	13,367.85

注：支付基金托管人工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	渤海汇金睿选混合 A	渤海汇金睿选混合 C	合计
渤海汇金资管	-	4,065.04	4,065.04
合计	-	4,065.04	4,065.04
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	渤海汇金睿选混合 A	渤海汇金睿选混合 C	合计
渤海汇金资管	-	2,195.04	2,195.04
合计	-	2,195.04	2,195.04

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

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

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

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	渤海汇金睿选混合 A	渤海汇金睿选混合 C
基金合同生效日（2018 年 2 月 11 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,000,444.49	-
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	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,444.49	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	86.69%	-

项目	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

	渤海汇金睿选混合 A	渤海汇金睿选混合 C
基金合同生效日（2018 年 2 月 11 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,000,444.49	-
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	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,444.49	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	89.88%	-

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。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金 A 类及 C 类基金份额的情况。

6.4.10.6 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	209,555.87	5,248.31	113,093.66	409.84

注：本基金的活期银行存款由基金托管人工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，理论上其风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。日常经营活动中本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

本基金的基金管理人建立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，确定相应置信程度并计算风险价值，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在托管人，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	729,927.00
合计	-	729,927.00

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

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	7,969,440.00	8,092,612.60
合计	7,969,440.00	8,092,612.60

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

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量(2020 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%。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 6.4.12。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% (2020 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。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金及买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						

银行存款	209,555.87	-	-	-	-	209,555.87
结算备付金	404,918.96	-	-	-	-	404,918.96
存出保证金	2,725.38	-	-	-	-	2,725.38
交易性金融资产	4,511,100.00	2,023,600.00	506,750.00	927,990.00	5,626,683.50	13,596,123.50
买入返售金融资产	3,000,000.00	-	-	-	-	3,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	355.89	355.89
应收利息	-	-	-	-	150,954.35	150,954.35
应收申购款	-	-	-	-	43,904.31	43,904.31
资产总计	8,128,300.21	2,023,600.00	506,750.00	927,990.00	5,821,898.05	17,408,538.26
负债	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	89,072.01	89,072.01
应付管理人报酬	-	-	-	-	17,086.19	17,086.19
应付托管费	-	-	-	-	2,847.71	2,847.71
应付销售服务费	-	-	-	-	888.54	888.54
应付交易费用	-	-	-	-	1,286.81	1,286.81
其他负债	-	-	-	-	18,981.70	18,981.70
负债总计	-	-	-	-	130,162.96	130,162.96
利率敏感度缺口	8,128,300.21	2,023,600.00	506,750.00	927,990.00	5,691,735.09	17,278,375.30
上年度末 2020年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	88,243.93	-	-	-	-	88,243.93
结算备付金	64,055.76	-	-	-	-	64,055.76
存出保证金	929.96	-	-	-	-	929.96
交易性金融资产	729,927.00	2,929,470.00	3,716,942.60	1,446,200.00	4,870,942.36	13,693,481.96
应收利息	-	-	-	-	153,159.95	153,159.95
应收申购	-	-	-	-	40.00	40.00

款						
资产总计	883,156.65	2,929,470.00	3,716,942.60	1,446,200.00	5,024,142.31	13,999,911.56
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	13,953.24	13,953.24
应付托管费	-	-	-	-	2,325.53	2,325.53
应付销售服务费	-	-	-	-	333.57	333.57
应付交易费用	-	-	-	-	3,329.69	3,329.69
其他负债	-	-	-	-	40,000.00	40,000.00
负债总计	-	-	-	-	59,942.03	59,942.03
利率敏感度缺口	883,156.65	2,929,470.00	3,716,942.60	1,446,200.00	4,964,200.28	13,939,969.53

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	市场利率上升25个基点	-14,348.20	-42,652.12
	市场利率下降25个基点	14,636.35	45,884.98

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例(%)
交易性金融资产-股票投资	5,626,683.50	32.56	4,870,942.36	34.94
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	5,626,683.50	32.56	4,870,942.36	34.94

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	103,565.61	75,072.37
业绩比较基准下降5%	-103,565.61	-75,072.37	

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析财务报表的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	5,626,683.50	32.32
	其中：股票	5,626,683.50	32.32
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,969,440.00	45.78
	其中：债券	7,969,440.00	45.78
	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	3,000,000.00	17.23
	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	614,474.83	3.53
8	其他各项资产	197,939.93	1.14
9	合计	17,408,538.26	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	42,574.00	0.25
B	采矿业	84,588.00	0.49
C	制造业	4,348,493.00	25.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	72,744.00	0.42
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	77,539.00	0.45
G	交通运输、仓储和邮政业	40,620.00	0.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	78,960.00	0.46
J	金融业	242,111.20	1.40
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	120,520.00	0.70
M	科学研究和技术服务业	131,535.60	0.76
N	水利、环境和公共设施管理业	125,642.60	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	261,356.10	1.51
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,626,683.50	32.56

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	400	213,920.00	1.24
2	600519	贵州茅台	100	205,670.00	1.19
3	002271	东方雨虹	3,300	182,556.00	1.06
4	300760	迈瑞医疗	300	144,015.00	0.83
5	002241	歌尔股份	3,300	141,042.00	0.82
6	300015	爱尔眼科	1,945	138,056.10	0.80
7	601012	隆基股份	1,540	136,813.60	0.79
8	600436	片仔癀	300	134,490.00	0.78
9	300059	东方财富	4,080	133,783.20	0.77
10	603259	药明康德	840	131,535.60	0.76
11	603501	韦尔股份	400	128,800.00	0.75
12	600763	通策医疗	300	123,300.00	0.71
13	300124	汇川技术	1,650	122,529.00	0.71
14	000661	长春高新	300	116,100.00	0.67
14	002415	海康威视	1,800	116,100.00	0.67
15	002475	立讯精密	2,500	115,000.00	0.67
16	002119	康强电子	6,200	102,796.00	0.59
17	600309	万华化学	900	97,938.00	0.57
18	601100	恒立液压	1,100	94,512.00	0.55
19	300014	亿纬锂能	900	93,537.00	0.54
20	300122	智飞生物	500	93,365.00	0.54
21	002978	安宁股份	1,400	84,588.00	0.49
22	688363	华熙生物	300	83,358.00	0.48
23	600276	恒瑞医药	1,200	81,564.00	0.47
24	688111	金山办公	200	78,960.00	0.46

25	300896	爱美客	100	78,888.00	0.46
26	600031	三一重工	2,700	78,489.00	0.45
27	300755	华致酒行	1,900	77,539.00	0.45
28	300040	九洲集团	8,400	76,692.00	0.44
29	002594	比亚迪	300	75,300.00	0.44
30	600660	福耀玻璃	1,300	72,605.00	0.42
31	000568	泸州老窖	300	70,782.00	0.41
32	688199	久日新材	1,600	69,056.00	0.40
33	002075	沙钢股份	6,200	67,642.00	0.39
34	002579	中京电子	6,360	67,098.00	0.39
35	300502	新易盛	2,100	65,625.00	0.38
36	002641	永高股份	9,400	64,860.00	0.38
37	603588	高能环境	4,420	64,001.60	0.37
38	601766	中国中车	10,500	63,840.00	0.37
39	300673	佩蒂股份	2,850	63,441.00	0.37
40	603568	伟明环保	2,700	61,641.00	0.36
41	300843	胜蓝股份	2,400	61,320.00	0.35
42	300058	蓝色光标	10,000	60,500.00	0.35
43	601888	中国中免	200	60,020.00	0.35
44	000858	五粮液	200	59,578.00	0.34
45	002971	和远气体	3,400	59,500.00	0.34
46	300999	金龙鱼	700	59,472.00	0.34
47	603899	晨光文具	700	59,192.00	0.34
48	002921	联诚精密	3,770	58,321.90	0.34
49	002283	天润工业	10,400	57,616.00	0.33
50	603416	信捷电气	900	57,123.00	0.33
51	002993	奥海科技	1,300	56,615.00	0.33
52	300693	盛弘股份	3,150	56,511.00	0.33
53	688981	中芯国际	900	55,638.00	0.32
54	600036	招商银行	1,000	54,190.00	0.31
55	603949	雪龙集团	3,800	53,884.00	0.31
56	600900	长江电力	2,600	53,664.00	0.31
57	600887	伊利股份	1,400	51,562.00	0.30
58	000932	华菱钢铁	7,800	51,480.00	0.30
59	603288	海天味业	390	50,290.50	0.29
60	000651	格力电器	900	46,890.00	0.27
61	600690	海尔智家	1,800	46,638.00	0.27
62	603486	科沃斯	200	45,616.00	0.26
63	000333	美的集团	600	42,822.00	0.25

64	002714	牧原股份	700	42,574.00	0.25
65	002352	顺丰控股	600	40,620.00	0.24
66	601318	中国平安	600	38,568.00	0.22
67	600905	三峡能源	3,000	19,080.00	0.11
68	601528	瑞丰银行	1,000	15,570.00	0.09

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002271	东方雨虹	247,913.00	1.78
2	600519	贵州茅台	199,721.00	1.43
3	601012	隆基股份	189,308.00	1.36
4	601888	中国中免	177,023.00	1.27
5	000661	长春高新	176,174.00	1.26
6	300750	宁德时代	170,445.00	1.22
7	000568	泸州老窖	160,037.00	1.15
8	002415	海康威视	144,823.00	1.04
9	688111	金山办公	143,218.00	1.03
10	000333	美的集团	140,777.00	1.01
11	002352	顺丰控股	128,652.00	0.92
12	002241	歌尔股份	125,422.00	0.90
13	300122	智飞生物	124,775.00	0.90
14	600763	通策医疗	123,700.00	0.89
15	300760	迈瑞医疗	114,429.00	0.82
16	000858	五粮液	113,405.00	0.81
17	603158	腾龙股份	107,854.00	0.77
18	603501	韦尔股份	107,661.00	0.77
19	002799	环球印务	106,676.00	0.77
20	603288	海天味业	106,403.00	0.76

注：本项的“累计买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
----	------	------	----------	-----------------

1	600519	贵州茅台	234,453.00	1.68
2	601899	紫金矿业	182,423.00	1.31
3	002271	东方雨虹	181,837.50	1.30
4	601012	隆基股份	172,181.98	1.24
5	601888	中国中免	158,066.00	1.13
6	002352	顺丰控股	154,784.00	1.11
7	000333	美的集团	150,230.65	1.08
8	600809	山西汾酒	150,026.00	1.08
9	603901	永创智能	128,970.00	0.93
10	000568	泸州老窖	128,728.00	0.92
11	000858	五粮液	126,665.00	0.91
12	002594	比亚迪	126,155.00	0.90
13	600763	通策医疗	123,523.00	0.89
14	300543	朗科智能	112,869.00	0.81
15	300750	宁德时代	112,588.90	0.81
16	603326	我乐家居	107,952.00	0.77
17	603811	诚意药业	106,568.00	0.76
18	002799	环球印务	105,562.00	0.76
19	300541	先进数通	102,714.00	0.74
20	002931	锋龙股份	102,400.00	0.73

注：本项的“累计卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	9,380,951.00
卖出股票收入（成交）总额	9,643,592.93

注：本项的“买入股票成本(成交)总额”及“卖出股票收入(成交)总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	2,937,740.00	17.00
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,031,700.00	29.12
	其中：政策性金融债	5,031,700.00	29.12
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-

6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,969,440.00	46.12

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	108604	国开 1805	30,000	3,008,100.00	17.41
2	018006	国开 1702	20,000	2,023,600.00	11.71
3	010107	21 国债(7)	15,000	1,503,000.00	8.70
4	019601	18 国债 19	9,000	927,990.00	5.37
5	010303	03 国债(3)	5,000	506,750.00	2.93

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

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。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

无。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注**7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形**

无。

7.12.2 本基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况

无。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,725.38
2	应收证券清算款	355.89
3	应收股利	-
4	应收利息	150,954.35
5	应收申购款	43,904.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	197,939.93

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
渤海汇金睿选混合 A	384	30,040.09	10,000,526.18	86.69%	1,534,866.55	13.31%
渤海汇金睿选混合 C	416	3,195.69	0.00	0.00%	1,329,407.99	100.00%
合计	785	16,388.28	10,000,526.18	77.74%	2,864,274.54	22.26%

注：期末有 15 名基金份额持有人同时持有渤海汇金睿选混合 A 份额和渤海汇金睿选混合 C 份额。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	渤海汇金睿选混合 A	100,098.49	0.87%
	渤海汇金睿选混合 C	1,866.98	0.14%
	合计	101,965.47	0.79%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	渤海汇金睿选混合 A	0~10
	渤海汇金睿选混合 C	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	渤海汇金睿选混合 A	0~10
	渤海汇金睿选混合 C	-
	合计	0~10

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,444.49	77.73	10,000,444.49	77.73	自合同生效之日起不少于三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	49,950.05	0.39	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,050,394.54	78.12	10,000,444.49	77.73	自合同生效之日起不少于三年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	渤海汇金睿选混 合 A	渤海汇金睿选混 合 C
基金合同生效日（2018 年 2 月 11 日）基金份 额总额	140,755,966.61	145,228,596.77
本报告期期初基金份额总额	10,730,231.00	552,469.28
本报告期基金总申购份额	2,063,933.33	155,999,253.35
减：本报告期基金总赎回份额	1,258,771.60	155,222,314.64
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	11,535,392.73	1,329,407.99

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金基金管理人重大人事变动：

1、本基金管理人于 2021 年 3 月 20 日发布公告，自 2021 年 3 月 19 日起，渤海汇金证券资产管理有限公司的副总经理李耀光先生离任。

2、本基金管理人于 2021 年 4 月 22 日发布公告，自 2021 年 4 月 20 日起，齐朝晖先生担任渤海汇金证券资产管理有限公司的代理党总支书记。

上述人事变动已按相关规定备案、公告。

本基金基金托管人重大人事变动：

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受到稽查或者处罚情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
渤海证券	2	19,024,543.93	100.00%	7,084.08	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、报告的及时性及服务质量；交易佣金收费合理。

(2) 选择程序：基金管理人根据以上标准对不同券商进行综合评价，然后根据评价选择券商，与其签订协议租用交易单元。

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

4、本基金本报告期内无新增券商交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
渤海证券	11,667,203.00	100.00%	173,500,000.00	100.00%	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下部分基金增加和耕传承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	证券日报、公司网站	2021 年 1 月 19 日
2	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下部分基金在京东肯特瑞基金销售有限公司开通基金定投业务的公告	证券日报、公司网站	2021 年 1 月 21 日
3	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下全部基金 2020 年第 4 季度报告的提示性公告	证券日报	2021 年 1 月 22 日
4	渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	公司网站	2021 年 1 月 22 日
5	关于渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金销售费率优惠的公告	证券日报、公司网站	2021 年 2 月 9 日

6	关于旗下部分基金增加上海利得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	证券日报、公司网站	2021 年 2 月 24 日
7	关于旗下部分基金增加珠海盈米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	证券日报、公司网站	2021 年 2 月 26 日
8	关于旗下部分基金增加浙江同花顺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	证券日报、公司网站	2021 年 2 月 26 日
9	关于旗下部分基金参加华瑞保险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	证券日报、公司网站	2021 年 3 月 17 日
10	2021 年度渤海汇金证券资产管理有限公司高级管理人员（副总经理）变更公告	证券日报、公司网站	2021 年 3 月 20 日
11	关于旗下部分基金在部分三方代销平台开通基金定投业务的公告	证券日报、公司网站	2021 年 3 月 23 日
12	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下全部基金 2020 年度报告的提示性公告	证券日报	2021 年 3 月 31 日
13	渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金 2020 年年度报告	公司网站	2021 年 3 月 31 日
14	2021 年度渤海汇金证券资产管理有限公司高级管理人员变更公告	证券日报、公司网站	2021 年 4 月 22 日
15	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下全部基金 2021 年第一季度报告的提示性公告	证券日报	2021 年 4 月 22 日
16	渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金 2021 年第一季度报告	公司网站	2021 年 4 月 22 日
17	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下 6 只基金招募说明书（更新）及基金产品资料概要（更新）提示性公告	证券日报	2021 年 5 月 13 日
18	渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要（更新）	公司网站	2021 年 5 月 13 日

19	渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金招募说明书(更新)(2021年第1号)	公司网站	2021年5月13日
20	关于旗下部分基金在渤海证券股份有限公司开通基金定期定额投资业务及参与基金费率优惠活动的公告	证券日报、公司网站	2021年5月31日
21	关于旗下部分基金增加上海万得为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	证券日报、公司网站	2021年6月28日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20210101-20210208 20210219-20210630	10,000,444.49	0.00	0.00	10,000,444.49	77.73%
	2	20210208-20210208	0.00	16,204,829.04	16,204,829.04	0.00	0.00%
	3	20210209-20210221	0.00	48,614,487.12	48,614,487.12	0.00	0.00%
	4	20210209-20210221	0.00	40,512,072.60	40,512,072.60	0.00	0.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

报告期内，本基金存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。由此可能导致的特有风险主要包括：

1. 单一大额投资者大额赎回对基金净值波动的影响。
2. 单一大额投资者大额赎回时为应对赎回证券变现产生的冲击成本的风险。
3. 单一大额投资者退出后，可能出现迷你基金的情形，可能影响投资目标的实现。
4. 单一大额投资者可能对持有人大会施加重大影响。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金报告期内，本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金设立的文件；
- 2、《渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 6、渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金在指定报刊上的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司处。

12.3 查阅方式

上述文件可在渤海汇金证券资产管理有限公司网站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 8 月 31 日