

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

2020 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：2020 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 2020 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 2020 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.....	9
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.....	11
§4 管理人报告	12
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.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	39
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.12 投资组合报告附注.....	47
§8 基金份额持有人信息.....	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
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.....	48
§9 开放式基金份额变动.....	49
§10 重大事件揭示.....	50
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
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.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件.....	51
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	53

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	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	53
§12 备查文件目录.....	54
12.1 备查文件目录.....	54
12.2 存放地点.....	54
12.3 查阅方式.....	54

§ 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	3,125,694.88 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： 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： 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、

	<p>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。</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：</p> <p>本基金将通过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</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	赵猛	郭明
	联系电话	022-28453215	010-66105799
	电子邮箱	zhaom@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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	https://www.bhhjamc.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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年1月1日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	493,153.18
本期利润	689,251.27
加权平均基金份额本期利润	0.1564
本期加权平均净值利润率	13.37%
本期基金份额净值增长率	15.82%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	703,358.28
期末可供分配基金份额利润	0.2250
期末基金资产净值	4,087,918.08
期末基金份额净值	1.3078
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	30.78%

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

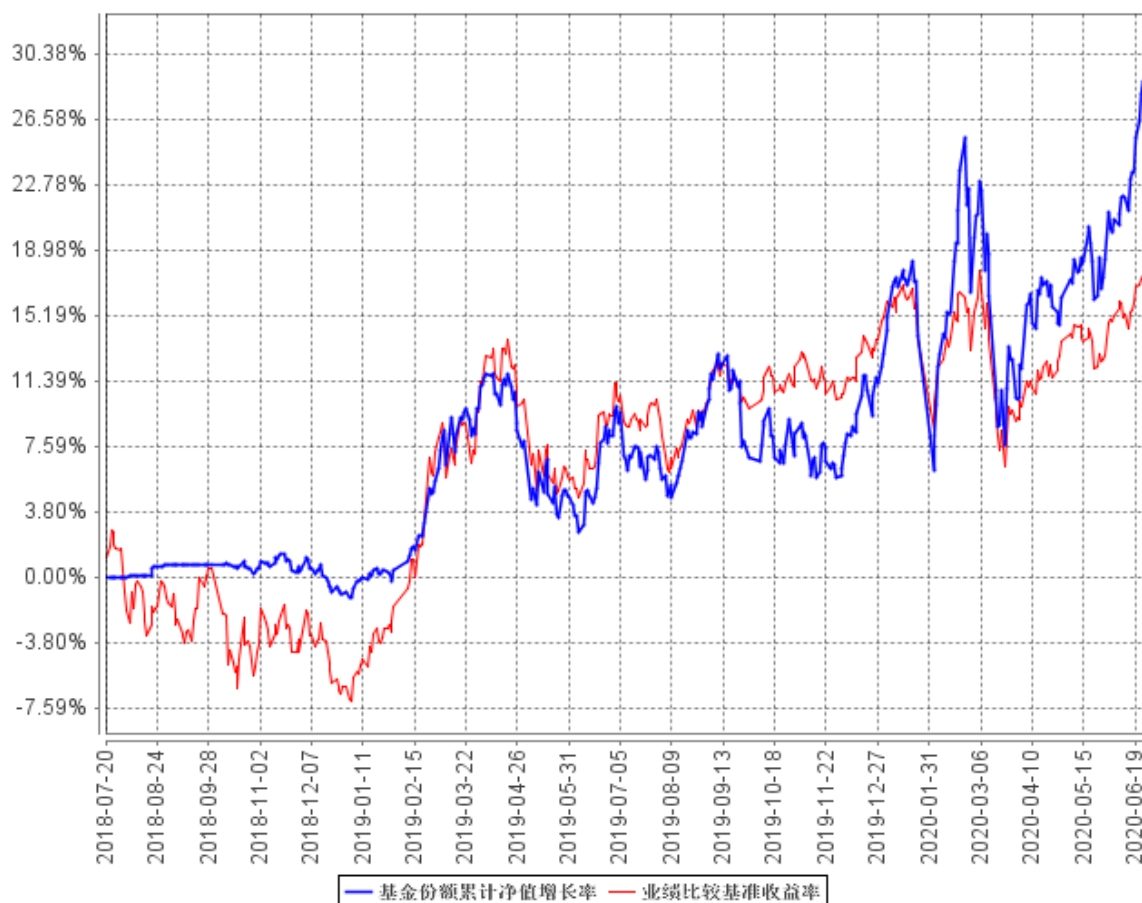
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	10.40%	0.82%	4.50%	0.54%	5.90%	0.28%
过去三个月	18.50%	0.97%	7.91%	0.54%	10.59%	0.43%
过去六个月	15.82%	1.50%	2.50%	0.90%	13.32%	0.60%
过去一年	20.91%	1.17%	7.88%	0.73%	13.03%	0.44%
自基金合同生效起至今	30.78%	0.92%	17.95%	0.83%	12.83%	0.09%

注：业绩比较基准：上证国债指数收益率×40%+沪深300指数收益率×60%。

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



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

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6月30日，本基金管理人共管理5只基金：渤海汇金汇添金货币市场基金、渤海汇金汇增利3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、渤海汇金汇添益3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金、渤海汇金量化汇盈灵活配置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	-	8年	南开大学金融工程硕士。2011年7月至2013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 月起担任渤海汇金量化汇盈混合基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

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 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。报告期内，本基金未发生异常交易行为，本公司所有投资组合参与的交易所公

开竞价同日反向交易不存在成交较少的单边交易量超过该证券交易当日成交量的 5% 的情形。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年权益市场进入了大幅波动期。2 月，疫情出现导致大幅度下跌，但是之后在流动性支持和维护金融市场稳定的情况下，科技板块大幅度上涨。3 月开始，海外市场大幅度暴跌反映新冠肺炎在全球蔓延，生物医药和食品饮料等板块重新取得了相对的优势。5 月，在一季度的经济和上市公司业绩数据公布之后，市场出现了温和的反弹。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。

从我们跟踪的股债估值相对优势模型来看，指标在一季度持续上行，一季度末股票相对债券资产的优势已达到历史极值区域，权益资产长期估值优势不断凸显。进入二季度指标从高点回落，权益市场温和上涨。在整个上半年，我们维持量化汇盈中权益资产相对超配不变，并根据模型信号动态调整仓位大小。在全球主要经济体持续宽松的大趋势下，避险资产价格也如我们预期震荡上行，为量化汇盈贡献一定收益的同时亦对冲了市场下行的风险。上半年我们保持相对均衡的风格配置，以新经济行业板块为我们的主要选股空间。风格因子方面，反转、低盈利因子在上半年各个月份持续贡献正向超额收益，其他风格因子月度表现各异。量化汇盈在因子的配置中，着重因子长期的历史表现，尽量降低风险因子对组合收益的影响。

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 1.3078 元；本报告期基金份额净值增长率为 15.82%，业绩比较基准收益率为 2.50%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，市场仍是结构性行情主导，预计整体的下行风险不大，但回升的步伐可能不会过快，主要是挖掘个股，把握结构性牛市。盈利呈现修复状态，经济有望逐级恢复常态。流动性整体维持宽松，但边际上进一步宽松可能较小，货币政策强调精准滴灌，更多的要关注宽信用带来的实体经济的恢复。估值方虽然不贵，但也难言存在明显的低估，高估值的板块可能面临一定风险。后续市场的核心影响因素是趋势和变量的斜率，盈利恢复程度是关键因素。上半年风险偏好和流动性是导致市场整体涨跌的主要因素，两会之后市场转向关注政策的实施和经济及企业盈利的修复情况，市场将会更多关注各行业边际的改善。宽信用是当前 A 股的核心支撑、盈利改善是后续市场的核心驱动。

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 6 月 30 日连续 332 个工作日基金资产净值低于五千万，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量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金 2020 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：渤海汇金量化汇盈灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	396,148.40	59,871.92
结算备付金		33,520.81	39,932.62
存出保证金		1,178.74	2,570.79
交易性金融资产	6.4.7.2	3,725,635.81	7,161,278.70
其中：股票投资		3,725,635.81	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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	500,000.00
应收证券清算款		-	387,522.53
应收利息	6.4.7.5	55.15	33,388.16
应收股利		-	-
应收申购款		6,037.11	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		4,162,576.02	8,184,564.72
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 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		-	186,610.59
应付赎回款		33,545.67	188,763.70
应付管理人报酬		4,780.22	10,051.43
应付托管费		796.73	1,675.24
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	6,577.64	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	6.4.7.8	28,957.68	129,000.00
负债合计		74,657.94	528,865.87
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	3,125,694.88	6,779,631.28
未分配利润	6.4.7.10	962,223.20	876,067.57
所有者权益合计		4,087,918.08	7,655,698.85
负债和所有者权益总计		4,162,576.02	8,184,564.72

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3078 元，基金份额总额 3,125,694.88 份。

6.2 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 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		803,031.21	4,504,468.02
1.利息收入		5,475.58	359,067.72
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,226.56	4,474.29
债券利息收入		2,271.36	259,392.66
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,977.66	95,200.77
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		601,116.04	2,519,442.64
其中：股票投资收益	6.4.7.12	587,434.78	1,549,049.37
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-7,436.14	33,200.50
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	-	873,116.51
股利收益	6.4.7.16	21,117.40	64,076.26
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	196,098.09	1,593,419.86
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	341.50	32,537.80
减：二、费用		113,779.94	473,799.47
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	38,772.38	245,490.79
2. 托管费	6.4.10.2.2	6,462.10	40,915.08

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	29,376.67	99,633.77
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	3,143.23
7. 其他费用	6.4.7.20	39,168.78	84,616.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		689,251.27	4,030,668.55
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		689,251.27	4,030,668.55

6.3 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 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	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）	-	689,251.27	689,251.27
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）	-3,653,936.40	-603,095.64	-4,257,032.04
其中：1.基金申购款	166,855.20	37,010.21	203,865.41
2.基金赎回款	-3,820,791.60	-640,105.85	-4,460,897.45
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）	3,125,694.88	962,223.20	4,087,918.08
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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)	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)	-	4,030,668.55	4,030,668.55
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)	-44,928,483.64	-2,215,804.05	-47,144,287.69
其中：1.基金申购款	352,874.09	21,955.58	374,829.67
2.基金赎回款	-45,281,357.73	-2,237,759.63	-47,519,117.36
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)	15,582,970.02	1,271,201.31	16,854,171.33

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：

徐海军

 赵猛

 刘云鹏

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。

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 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年 1 月 1 日至 2020 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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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[2004]78号《财政部国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税，对存款利息收入不征收增值税。金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

(2) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%和 2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

(3) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(4) 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。

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 2020年6月30日
----	-------------------

活期存款	396,148.40
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：	396,148.40

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,712,296.56	3,725,635.81	1,013,339.25
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	2,712,296.56	3,725,635.81	1,013,339.25

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

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 2020 年 6 月 30 日

应收活期存款利息	40.25
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	14.40
应收债券利息	-
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	0.50
合计	55.15

6.4.7.6 其他资产

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 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	6,577.64
银行间市场应付交易费用	-
合计	6,577.64

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	66.90
应付证券出借违约金	-
预提费用	28,890.78
合计	28,957.68

6.4.7.9 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 6 月 30 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	166,855.20	166,855.20
本期赎回(以“-”号填列)	-3,820,791.60	-3,820,791.60
- 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	3,125,694.88	3,125,694.88

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

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	493,153.18	196,098.09	689,251.27
本期基金份额交易产生的变动数	-646,905.72	43,810.08	-603,095.64
其中：基金申购款	35,634.09	1,376.12	37,010.21
基金赎回款	-682,539.81	42,433.96	-640,105.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	703,358.28	258,864.92	962,223.20

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	949.41
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	265.44
其他	11.71
合计	1,226.56

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	10,318,471.12
减：卖出股票成本总额	9,731,036.34
买卖股票差价收入	587,434.78

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 2020年1月1日至2020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	-7,436.14
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

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 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,150,350.51
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,122,200.14
减：应收利息总额	35,586.51
买卖债券差价收入	-7,436.14

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

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**

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

无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

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

本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

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
	2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	21,117.40
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	21,117.40

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	196,098.09

——股票投资	190,083.35
——债券投资	6,014.74
——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	196,098.09

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	341.50
合计	341.50

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	29,376.67
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	29,376.67

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	19,890.78
信息披露费	-

证券出借违约金	-
银行汇划费用	678.00
其他费用	600.00
银行间账户维护费	18,000.00
合计	39,168.78

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 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	17,495,284.12	100.00%	49,759,325.00	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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	94,765.38	100.00%	10,956,650.40	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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	22,700,000.00	100.00%	209,100,000.00	100.00%

6.4.10.1.4 权证交易

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 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	17,505.78	100.00%	6,577.64	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	61,887.71	100.00%	30,455.65	100.00%

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 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	38,772.38	245,490.79
其中：支付销售机构的客户维护费	20,534.26	159,566.68

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	6,462.10	40,915.08

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 0.25%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。

6.4.10.2.3 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。

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

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

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。

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

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	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 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	-
报告期末持有的基金份额	65,820.00	339,592.49
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.11%	2.18%

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

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		上年度可比期间	
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		2019 年 1 月 1 日至 2019 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	396,148.40	1,226.56	85,785.27	2,089.18

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

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

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2020 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

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

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

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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。

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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金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，违约风险可能性很小。

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

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

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 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	-	2,257.40
AAA 以下	-	-
-	-	-
未评级	-	1,113,928.00
合计	-	1,116,185.40

注：未评级债券为国债及政策性金融债等免评级债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

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。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

本基金为混合型基金，于 2020 年 6 月 30 日，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，评估结果显示本基金组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	396,148.40	-	-	-	-	-	396,148.40
结算备付金	33,520.81	-	-	-	-	-	33,520.81

存出保证金	1,178.74	-	-	-	-	-	1,178.74
交易性金融资产	-	-	-	-	-	3,725,635.81	3,725,635.81
应收利息	-	-	-	-	-	55.15	55.15
应收申购款	-	-	-	-	-	6,037.11	6,037.11
资产总计	430,847.95	-	-	-	-	3,731,728.07	4,162,576.02
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	33,545.67	33,545.67
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,780.22	4,780.22
应付托管费	-	-	-	-	-	796.73	796.73
应付交易费用	-	-	-	-	-	6,577.64	6,577.64
其他负债	-	-	-	-	-	28,957.68	28,957.68
负债总计	-	-	-	-	-	74,657.94	74,657.94
利率敏感度缺口	430,847.95	-	-	-	-	3,657,070.13	4,087,918.08
上年度末 2019年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
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	2,257.40	-	91,674.00	928.00	6,045,093.30	7,161,278.70
买入返售金融资产	500,000.00	-	-	-	-	-	500,000.00
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	2,257.40	-	91,674.00	928.00	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	2,257.40	-	91,674.00	928.00	5,937,138.12	7,655,698.85

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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	市场利率上升 25 个基点	-	0.03
	市场利率下降 25 个基点	-	-0.03

注：单位：万元

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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。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 2020年6月30日		上年度末 2019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	3,725,635.81	91.14	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	3,725,635.81	91.14	6,045,093.30	78.96
----	--------------	-------	--------------	-------

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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	1.27	16.88
业绩比较基准下降 5%	1.27	-16.88	

注：单位：万元。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析财务报表的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,725,635.81	89.50
	其中：股票	3,725,635.81	89.50
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	429,669.21	10.32
8	其他各项资产	7,271.00	0.17
9	合计	4,162,576.02	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	16,052.00	0.39
B	采矿业	595,695.80	14.57
C	制造业	2,106,758.26	51.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	53,353.40	1.31
E	建筑业	24,943.00	0.61
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	45,055.00	1.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	459,009.20	11.23
J	金融业	160,217.40	3.92
K	房地产业	30,540.00	0.75
L	租赁和商务服务业	30,806.00	0.75
M	科学研究和技术服务业	67,791.60	1.66
N	水利、环境和公共设施管理业	8,932.00	0.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	13,875.00	0.34
Q	卫生和社会工作	75,187.15	1.84
R	文化、体育和娱乐业	37,420.00	0.92
S	综合	-	-
	合计	3,725,635.81	91.14

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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	000661	长春高新	400	174,120.00	4.26
2	600519	贵州茅台	100	146,288.00	3.58
3	000975	银泰黄金	7,200	112,896.00	2.76
4	600547	山东黄金	2,740	100,338.80	2.45
5	601899	紫金矿业	19,600	86,240.00	2.11
6	002237	恒邦股份	5,800	79,286.00	1.94
7	601069	西部黄金	5,300	73,299.00	1.79
8	600988	赤峰黄金	6,000	71,400.00	1.75
9	600489	中金黄金	7,600	69,464.00	1.70
10	300059	东方财富	3,432	69,326.40	1.70
11	300760	迈瑞医疗	200	61,140.00	1.50
12	300750	宁德时代	300	52,308.00	1.28
13	002821	凯莱英	200	48,600.00	1.19
14	601100	恒立液压	600	48,120.00	1.18
15	603288	海天味业	360	44,784.00	1.10
16	300015	爱尔眼科	1,027	44,623.15	1.09
17	603127	昭衍新药	420	44,154.60	1.08
18	600570	恒生电子	390	42,003.00	1.03
19	300454	深信服	200	41,192.00	1.01
20	600745	闻泰科技	300	37,785.00	0.92
21	300450	先导智能	800	36,968.00	0.90
22	002155	湖南黄金	4,600	36,248.00	0.89
23	600276	恒瑞医药	384	35,443.20	0.87
24	002410	广联达	500	34,850.00	0.85
25	000858	五粮液	200	34,224.00	0.84

26	300613	富瀚微	300	33,990.00	0.83
27	002916	深南电路	200	33,504.00	0.82
28	002869	金溢科技	500	33,040.00	0.81
29	603986	兆易创新	140	33,027.40	0.81
30	300601	康泰生物	200	32,432.00	0.79
31	002475	立讯精密	624	32,042.40	0.78
32	600766	园城黄金	4,400	31,592.00	0.77
33	600756	浪潮软件	1,700	31,450.00	0.77
34	601888	中国中免	200	30,806.00	0.75
35	600346	恒力石化	2,200	30,800.00	0.75
36	300315	掌趣科技	4,200	30,786.00	0.75
37	300347	泰格医药	300	30,564.00	0.75
38	300122	智飞生物	300	30,045.00	0.73
39	002474	榕基软件	4,200	29,946.00	0.73
40	600809	山西汾酒	200	29,000.00	0.71
41	002734	利民股份	1,900	28,443.00	0.70
42	000895	双汇发展	600	27,654.00	0.68
43	300014	亿纬锂能	570	27,274.50	0.67
44	300033	同花顺	200	26,616.00	0.65
45	300124	汇川技术	700	26,593.00	0.65
46	300724	捷佳伟创	300	26,559.00	0.65
47	601012	隆基股份	620	25,252.60	0.62
48	300308	中际旭创	400	25,200.00	0.62
49	600887	伊利股份	800	24,904.00	0.61
50	600030	中信证券	1,000	24,110.00	0.59
51	300253	卫宁健康	1,040	23,857.60	0.58
52	600746	江苏索普	3,600	23,328.00	0.57
53	300413	芒果超媒	350	22,820.00	0.56
54	601318	中国平安	300	21,420.00	0.52
55	002032	苏泊尔	300	21,300.00	0.52
56	603338	浙江鼎力	280	21,215.60	0.52
57	300136	信维通信	400	21,208.00	0.52
58	300142	沃森生物	400	20,944.00	0.51
59	600588	用友网络	442	19,492.20	0.48
60	300408	三环集团	700	19,390.00	0.47
61	600844	丹化科技	6,100	19,337.00	0.47
62	002555	三七互娱	400	18,720.00	0.46
63	300383	光环新网	700	18,249.00	0.45
64	002624	完美世界	300	17,292.00	0.42

65	002371	北方华创	100	17,091.00	0.42
66	600436	片仔癀	100	17,025.00	0.42
67	000651	格力电器	300	16,971.00	0.42
68	600031	三一重工	900	16,884.00	0.41
69	603899	晨光文具	300	16,380.00	0.40
70	300357	我武生物	260	16,185.00	0.40
71	600585	海螺水泥	300	15,873.00	0.39
72	300088	长信科技	1,400	15,680.00	0.38
73	300676	华大基因	100	15,591.00	0.38
74	002605	姚记科技	400	15,200.00	0.37
75	600309	万华化学	300	14,997.00	0.37
76	600009	上海机场	200	14,414.00	0.35
77	002311	海大集团	300	14,277.00	0.35
78	601137	博威合金	900	14,076.00	0.34
79	300433	蓝思科技	500	14,020.00	0.34
80	603019	中科曙光	364	13,977.60	0.34
81	002558	巨人网络	800	13,920.00	0.34
82	002607	中公教育	500	13,875.00	0.34
83	300115	长盈精密	600	13,710.00	0.34
84	002568	百润股份	300	13,596.00	0.33
85	600036	招商银行	400	13,488.00	0.33
86	002007	华兰生物	260	13,028.60	0.32
87	603218	日月股份	700	12,810.00	0.31
88	002803	吉宏股份	510	12,719.40	0.31
89	603208	江山欧派	130	12,662.00	0.31
90	002801	微光股份	300	12,585.00	0.31
91	600490	鹏欣资源	3,900	12,285.00	0.30
92	603416	信捷电气	300	11,958.00	0.29
93	300394	天孚通信	200	11,910.00	0.29
94	300017	网宿科技	1,400	11,886.00	0.29
95	300839	博汇股份	500	11,705.00	0.29
96	300009	安科生物	650	11,635.00	0.28
97	002608	江苏国信	1,800	11,340.00	0.28
98	002893	华通热力	1,170	11,255.40	0.28
99	000531	穗恒运 A	1,500	11,250.00	0.28
100	300003	乐普医疗	300	10,956.00	0.27
101	600882	妙可蓝多	300	10,887.00	0.27
102	002557	洽洽食品	200	10,838.00	0.27
103	002507	涪陵榨菜	300	10,803.00	0.26

104	603788	宁波高发	600	10,758.00	0.26
105	600064	南京高科	1,100	10,692.00	0.26
106	002016	世荣兆业	1,600	10,464.00	0.26
107	601677	明泰铝业	1,200	10,416.00	0.25
108	002465	海格通信	800	10,352.00	0.25
109	300628	亿联网络	150	10,239.00	0.25
110	300113	顺网科技	400	10,160.00	0.25
111	600167	联美控股	700	10,038.00	0.25
112	300418	昆仑万维	400	9,984.00	0.24
113	600760	中航沈飞	300	9,846.00	0.24
114	300024	机器人	700	9,569.00	0.23
115	000088	盐田港	1,600	9,472.00	0.23
116	600900	长江电力	500	9,470.00	0.23
117	300226	上海钢联	120	9,432.00	0.23
118	603313	梦百合	400	9,412.00	0.23
119	000667	美好置业	3,400	9,384.00	0.23
120	000538	云南白药	100	9,381.00	0.23
121	002508	老板电器	300	9,333.00	0.23
122	300571	平治信息	200	9,240.00	0.23
123	002935	天奥电子	390	9,227.40	0.23
124	000568	泸州老窖	100	9,112.00	0.22
125	600177	雅戈尔	1,500	8,940.00	0.22
126	300070	碧水源	1,100	8,932.00	0.22
127	002101	广东鸿图	1,300	8,931.00	0.22
128	300065	海兰信	900	8,856.00	0.22
129	002775	文科园林	1,800	8,766.00	0.21
130	300251	光线传媒	800	8,728.00	0.21
131	002299	圣农发展	300	8,700.00	0.21
132	600498	烽火通信	300	8,673.00	0.21
133	601211	国泰君安	500	8,630.00	0.21
134	002050	三花智控	390	8,541.00	0.21
135	600201	生物股份	300	8,352.00	0.20
136	600741	华域汽车	400	8,316.00	0.20
137	600939	重庆建工	2,300	8,257.00	0.20
138	601601	中国太保	300	8,175.00	0.20
139	603860	中公高科	300	8,046.00	0.20
140	600990	四创电子	200	7,940.00	0.19
141	600970	中材国际	1,500	7,920.00	0.19
142	300146	汤臣倍健	400	7,876.00	0.19

143	300496	中科创达	100	7,770.00	0.19
144	603156	养元饮品	360	7,740.00	0.19
145	600837	海通证券	600	7,548.00	0.18
146	601688	华泰证券	400	7,520.00	0.18
147	300715	凯伦股份	200	7,456.00	0.18
148	300316	晶盛机电	300	7,422.00	0.18
149	600097	开创国际	800	7,352.00	0.18
150	600066	宇通客车	600	7,320.00	0.18
151	600548	深高速	800	7,312.00	0.18
152	600873	梅花生物	1,600	7,264.00	0.18
153	300274	阳光电源	500	7,195.00	0.18
154	601088	中国神华	500	7,180.00	0.18
155	600690	海尔智家	400	7,080.00	0.17
156	600426	华鲁恒升	400	7,072.00	0.17
157	600028	中国石化	1,800	7,038.00	0.17
158	000429	粤高速 A	1,000	6,990.00	0.17
159	600377	宁沪高速	700	6,867.00	0.17
160	300073	当升科技	200	6,614.00	0.16
161	600660	福耀玻璃	300	6,261.00	0.15
162	002493	荣盛石化	500	6,150.00	0.15
163	300666	江丰电子	100	5,968.00	0.15
164	002225	濮耐股份	1,400	5,922.00	0.14
165	300027	华谊兄弟	1,600	5,872.00	0.14
166	300134	大富科技	400	5,592.00	0.14
167	300072	三聚环保	1,300	5,564.00	0.14
168	300098	高新兴	900	5,454.00	0.13
169	600802	福建水泥	500	5,430.00	0.13
170	000672	上峰水泥	200	4,722.00	0.12
171	300180	华峰超纤	41	350.96	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	603127	昭衍新药	97,726.00	1.28
2	002414	高德红外	85,638.00	1.12

3	600745	闻泰科技	77,987.00	1.02
4	002821	凯莱英	74,324.00	0.97
5	603160	汇顶科技	64,814.00	0.85
6	002869	金溢科技	63,137.00	0.82
7	000661	长春高新	60,100.00	0.79
8	300139	晓程科技	59,542.00	0.78
9	002214	大立科技	58,422.00	0.76
10	300454	深信服	56,520.00	0.74
11	300730	科创信息	55,562.00	0.73
12	300487	蓝晓科技	54,515.00	0.71
13	002312	三泰控股	54,510.00	0.71
14	002415	海康威视	54,126.00	0.71
15	002475	立讯精密	53,193.00	0.69
16	300202	聚龙股份	52,942.00	0.69
17	300761	立华股份	52,514.00	0.69
18	002410	广联达	52,498.00	0.69
19	603501	韦尔股份	52,495.00	0.69
20	600267	海正药业	52,450.00	0.69

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	002414	高德红外	103,619.90	1.35
2	600547	山东黄金	96,543.00	1.26
3	601069	西部黄金	96,514.00	1.26
4	601899	紫金矿业	82,376.00	1.08
5	002475	立讯精密	81,943.00	1.07
6	600988	赤峰黄金	75,575.00	0.99
7	002237	恒邦股份	75,533.00	0.99
8	000975	银泰黄金	75,091.00	0.98
9	603127	昭衍新药	73,565.00	0.96
10	002821	凯莱英	71,902.00	0.94
11	600489	中金黄金	65,526.00	0.86
12	002413	雷科防务	64,617.00	0.84

13	600570	恒生电子	63,775.00	0.83
14	300529	健帆生物	62,662.00	0.82
15	300139	晓程科技	62,419.00	0.82
16	603501	韦尔股份	61,845.00	0.81
17	002214	大立科技	61,030.00	0.80
18	002299	圣农发展	56,417.00	0.74
19	300059	东方财富	55,984.00	0.73
20	000662	*ST 天夏	55,937.00	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	7,221,495.50
卖出股票收入（成交）总额	10,318,471.12

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

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

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

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

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

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	1,178.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	55.15
5	应收申购款	6,037.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,271.00

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

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

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
222	14,079.71	65,820.00	2.11%	3,059,874.88	97.89%

注：由于四舍五入的原因，户均持有份额与总份额之间可能存在尾差。

8.2 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	615,064.88	19.68%

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	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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 9 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	166,855.20
减：本报告期基金总赎回份额	3,820,791.60
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	3,125,694.88

§ 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：

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）。

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。

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

本报告期内，投资策略无变化

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	17,495,284.12	100.00%	17,505.78	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、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	94,765.38	100.00%	22,700,000.00	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	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型证券投资基金2020年第1季度报告	公司网站	2020年4月22日
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	证券时报	2020年5月13日

	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		
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

§ 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

无。

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。

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

2020 年 8 月 31 日