

渤海汇金证券资产管理有限公司

**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)摘要  
(2020年第1号)**

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

截止日：2020年3月30日

## 重要提示

本基金募集申请已于 2017 年 07 月 10 日获中国证监会证监许可（2017）1193 号文准予募集注册。本基金的基金合同于 2018 年 2 月 11 日正式生效。

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

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

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

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并按监管要求履行相关程序。

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

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决

---

---

策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负责。此外,本基金以 1 元初始面值进行募集,在市场波动等因素的影响下,存在单位份额净值跌破 1 元初始面值的风险。

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

基金不同于银行储蓄与债券,基金投资人有可能获得较高的收益,也有可能损失本金。除基金管理人固有资金、公司高级管理人员及基金经理等人员出资外,本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%,但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过 50%的除外。

本招募说明书关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容,将不晚于 2020 年 9 月 1 日起执行。

本招募说明书已经本基金托管人复核。

基金招募说明书每年度至少更新一次,本招募说明书所载内容截止日为 2020 年 3 月 30 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2019 年 12 月 31 日(财务数据未经审计)。

## 第一部分基金管理人

### 一、基金管理人概况

名称：渤海汇金证券资产管理有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室

办公地址：深圳市南山区海岸大厦西座2901、2913室

成立日期：2016年5月18日

法定代表人：徐海军

联系电话：010-68784295

传真：010-68784289

注册资本：11亿元人民币

联系人：魏文婷

股权结构：

股东	出资额 (万元人民币)	出资比例 (%)
渤海证券股份有限公司	110,000	100
合计	110,000	100

经营范围：证券资产管理、公开募集证券投资基金管理业务

### 二、主要人员情况

#### 1、董事会成员基本情况

徐海军先生：董事长，1973年出生，南开大学法学硕士。1996年参加工作，先后任南方证券天津解放路营业部业务员、南方证券天津分公司资产保全部副经理；2001年调入渤海证券公司，先后任资深律师、总裁办副主任兼法律部经理、北京总部总经理、总裁助理、合规总监、风险控制总部总经理、首席风险官等职务。2016年8月起兼任渤海汇金合规总监、首席风险官。2017年7月开始，不再担任渤海汇金首席风险官。2017年9月起，不再担任渤海汇金合规总监，任渤海证券财务总监兼渤海汇金董事长。

刘嫣女士：董事、合规总监，1975年出生，南开大学法学系国际经济法专业法学学士、大连海事大学法学系国际经济法专业硕士研究生，律师，天津市证

券业纠纷人民调解委员会主任。2001年12月进入渤海证券，先后任总裁办公室法律事务部副经理、风险控制总部法律事务部经理、公司首席律师兼风险控制总部副总经理、首席律师兼法律合规总部总经理等职务。2016年6月任渤海汇金董事，2017年9月，被渤海证券董事会聘任为合规总监同时兼任渤海汇金合规总监。

马彦平先生，董事，1972年出生，南开大学产业经济专业博士研究生（在职攻读）。1994年参加工作，历任中国人民银行天津分行副处长、处长，中国人民银行地市中心支行党委书记、行长，中国人民银行天津分行营业管理部党委委员、副主任等职务。2018年10月进入渤海证券工作，先后任渤海证券人力资源总监、行政总监兼人力资源总部总经理、总裁办公室主任、董事会办公室主任。2019年2月起不再兼任渤海证券董事会办公室主任，2019年10月起兼任渤海汇金董事。2019年12月不再兼任渤海证券人力资源部总经理。

盛况女士，董事，总经理，1976年出生。同济大学经济管理学院工商管理硕士（在职攻读）。1997年参加工作，任国泰君安证券股份有限公司常州广化街营业部交易员。2002年8月进入渤海证券，先后任渤海证券苏州景德路证券营业部交易部经理、营销部经理、副总经理、副总经理（主持工作）、总经理，渤海证券营销中心（经纪业务总部）副总经理，江苏分公司总经理。2019年10月起任渤海汇金总经理。

赵猛先生，董事，董事会秘书，1977年出生，西北政法学院经济法专业学士。2000年参加工作，任天津银行信贷员。2001年12月进入渤海证券，先后任渤海证券主办律师、董事长秘书、开发区第一大街营业部副总经理、合规部经理、稽核总部稽核一部经理、资产管理总部风控总监、副总经理。2016年5月起任渤海汇金总经理助理兼风控合规总部总经理。2019年7月起任渤海汇金北京分公司负责人，2019年10月任公司高级管理人员同时不再担任法律合规部总经理、风险控制部总经理。2019年12月聘任为渤海汇金第二届董事会秘书。2020年1月兼任渤海汇金财务总监。

## 2、监事基本情况

刘彤先生，监事，南开大学工商管理硕士。2002年7月进入渤海证券股份有限公司，曾担任渤海证券股份有限公司法律合规总部副总经理兼合规管理一部

经理、公司律师。2018年9月起，任渤海证券股份有限公司合规管理总部副总经理。2017年5月起至今，兼任渤海汇金证券资产管理有限公司监事。

### 3、高级管理人员基本情况

徐海军先生：董事长，1973年出生，南开大学法学硕士。1996年参加工作，先后任南方证券天津解放路营业部业务员、南方证券天津分公司资产保全部副经理；2001年调入渤海证券公司，先后任资深律师、总裁办副主任兼法律部经理、北京总部总经理、总裁助理、合规总监、风险控制总部总经理、首席风险官等职务。2016年8月起兼任渤海汇金合规总监、首席风险官。2017年7月开始，不再担任渤海汇金首席风险官。2017年9月起，不再担任渤海汇金合规总监，任渤海证券财务总监兼渤海汇金董事长。

李颖女士：首席风险官，1971年出生，天津财经学院会计系国际会计专业毕业，在职攻读南开大学金融系金融学专业研究生，获取硕士学位。本科毕业后在天津会计师事务所（后改制为天津津源会计师事务所、五洲联合会计师事务所）从事审计，任项目经理、部门经理、报告终身复核人。2001年进入渤海证券，在财务总部任总经理助理、副总经理、总经理。2015年3月，经董事会聘任为渤海证券高级管理人员，先后任财务负责人、财务总监。2017年7月开始，任渤海证券首席风险官（高级管理人员），不再担任财务总监。同时兼渤海汇金首席风险官。

刘嫣女士：董事、合规总监，1975年出生，南开大学法学系国际经济法专业法学学士、大连海事大学法学系国际经济法专业硕士研究生，律师，天津市证券业纠纷人民调解委员会主任。2001年12月进入渤海证券，先后任总裁办公室法律事务部副经理、风险控制总部法律事务部经理、公司首席律师兼风险控制总部副总经理、首席律师兼法律合规总部总经理等职务。2016年6月任渤海汇金董事，2017年9月，被渤海证券董事会聘任为合规总监同时兼任渤海汇金合规总监。

盛况女士，董事，总经理，1976年出生。同济大学经济管理学院工商管理硕士（在职攻读）。1997年参加工作，任国泰君安证券股份有限公司常州广化街营业部交易员。2002年8月进入渤海证券，先后任渤海证券司苏州景德路证券营业部交易部经理、营销部经理、副总经理、副总经理（主持工作）、总经理，

渤海证券营销中心（经纪业务总部）副总经理，江苏分公司总经理。2019年10月起任渤海汇金总经理。

赵猛先生，董事，董事会秘书，1977年出生，西北政法学院经济法专业学士。2000年参加工作，任天津银行信贷员。2001年12月进入渤海证券，先后任渤海证券主办律师、董事长秘书、开发区第一大街营业部副总经理、合规部经理、稽核总部稽核一部经理、资产管理总部风控总监、副总经理。2016年5月起任渤海汇金总经理助理兼风控合规总部总经理。2019年7月起任渤海汇金北京分公司负责人，2019年10月任公司高级管理人员同时不再担任法律合规部总经理、风险控制部总经理。2019年12月聘任为渤海汇金第二届董事会秘书。2020年1月兼任渤海汇金财务总监。

#### 4、本基金拟任基金经理

何翔先生，南开大学数学学士、金融学硕士。2004年2月至2013年9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，现任公募投资总监、公募投资部经理。

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

#### 5、投资决策委员会成员

主任委员：

王琦先生，公募业务条线负责人，中国人民银行金融研究所博士、CQF、对外经贸大学统计学院硕士生导师，逾15年证券投资管理经验。2010年加入银华基金管理有限公司，2011年担任基金经理；2012年至2017年，任职于方正证券资管、九州证券资管负责投资管理相关工作；2017年8月至2019年8月，担任长安基金管理有限公司、华宝证券有限责任公司部门总经理；2019年8月至今，任渤海汇金证券资产管理有限公司公募业务条线负责人。

委员：

何翔先生，简历同上。

李杨女士，简历同上。

张研女士，风险控制部风控经理，西南财经大学本科。具有 10 年以上证券从业经验，获得中国证券业协会颁发的证券从业资格证书和中国基金业协会颁发的基金从业资格证书。2008 年至 2015 年曾在新时代证券财务部任职。2015 年内调到新时代证券的风险控制部，主要负责资产管理业务的风控阈值管理、合同文本审核和主动管理型产品立项审核。2017 年 4 月份加入渤海汇金证券资产管理有限公司，负责公募基金风险控制管理工作。

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

谢婷女士，中国人民大学硕士。2007 年 7 月至 2010 年 3 月，就职于北京金融培训中心。2010 年 7 月至 2018 年 5 月，就职于银华基金管理有限公司，先后任营销策划岗、产品经理。2018 年 6 月至 2019 年 9 月，就职于旷腾（上海）投资有限公司产品部总监。2019 年 10 月加入渤海汇金证券资产管理有限公司产品设计部，现任高级产品经理。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

## 第二部分基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### （一）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：陈四清

注册资本：人民币 35,640,625.7089 万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明



## （二）主要人员情况

截至 2019 年 9 月，中国工商银行资产托管部共有员工 208 人，平均年龄 33 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

## （三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2019 年 9 月，中国工商银行共托管证券投资基金 1006 只。自 2003 年以来，本行连续十六年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 68 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

## 第三部分相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### 1、直销服务：

名称：渤海汇金证券资产管理有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室

客户服务地址：天津市南开区宾水西道 8 号

成立日期：2016 年 5 月 18 日

法定代表人：徐海军

联系人：谭如雁

电话：022-23861525

传真：022-23861510

网址：<https://www.bhhjamc.com>

客服电话：4006515988，4006511717

## 2、其他销售机构：

### （1）中国工商银行股份有限公司

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：陈四清

电话：010-66107370

传真：010-66107738

网址：<http://www.icbc.com.cn/>

客服电话：95588

### （2）渤海证券股份有限公司

办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

法定代表人：安志勇电话：022-28451922

传真：022-28451892

网址：<http://www.ewww.com.cn/>

客服电话：4006515988

### （3）上海好买基金销售有限公司

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

法定代表人：杨文斌

联系人：王诗琦

电话：021-20613999

传真：021-68596919

网址：<https://www.howbuy.com/>

---

客服电话：4007009665

（4）上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦

法定代表人：其实

联系人：丁珊珊

电话：010-65980380

传真：021-54509953

网址：<http://fund.eastmoney.com/>

客服电话：4001818188

（5）民生证券股份有限公司

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

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

法定代表人：冯鹤年

联系人：韩秀萍

电话：010-85127609

传真：010-85127917

网址：<http://www.msza.com/>

客服电话：95376/400-619-8888

（6）上海基煜基金销售有限公司

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

办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人：王翔

联系人：李关洲

电话：021-65370077

传真：021-55085991

网址：<https://www.jiyufund.com.cn/>

客服电话：400-820-5369

(7) 天津国美基金销售有限公司

注册地址：天津经济技术开发区第一大街 79 号 MSDC1-28 层 2801

办公地址：北京市朝阳区霄云路 26 号鹏润大厦 B 座 9 层

法定代表人：丁东华

联系人：许艳

电话：010-59287105

网址：<https://www.gomefund.com/>

客服电话：400-111-0889

(8) 东海证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区东方路 1928 号 301 室办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：钱俊文联系人：王一彦

电话：021-20333910

传真：021-50498825

网址：<http://www.longone.com.cn/>

客服电话：95531、4008888588

(9) 北京恒宇天泽基金销售有限公司

注册地址：北京市延庆区延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 883 室

办公地址：北京市东城区东滨河路乙 1 号航星园 8 号楼（东半楼）9 层

法定代表人：梁越

联系人：王东

电话：13001936144

网址：<https://www.1314fund.com/>

客服电话：4006369952

(10) 民商基金销售（上海）有限公司

注册地址：上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 A31 室

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

法定代表人：贲惠琴

联系人：董筱爽

---

网址：<http://www.msftec.com/>

客服电话：021-50206003

（11）北京唐鼎耀华基金销售有限公司

注册地址：北京市延庆区延庆经济开发区百泉街10号2栋236室

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街19号A座1504/1505室

法定代表人：张冠宇

联系人：王丽敏

电话：010-85932810

网址：<http://www.tdyhfund.com>

客服电话：400-819-9868

（12）中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街188号鸿安国际大厦

法定代表人：王常青

联系人：刘芸

电话：010-85156310

网址：<https://www.csc108.com>

客服电话：4008-888-108

（13）上海联泰基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室

办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8座3层

法定代表人：尹彬彬

联系人：陈东

电话：021-52822063

网址：<http://www.66liantai.com/>

客服电话：400-118-1188

（14）信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：肖林 联系人：唐静

电话：010-83252182

网址：<http://www.cindasc.com/>

客服电话：95321

（15）上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号

法定代表人：张跃伟

联系人：党敏

电话：021-20691935

网址：<http://www.erichfund.com/>

客服电话：400-820-2899

（16）嘉实财富管理有限公司

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

办公地址：北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层

法定代表人：赵学军

联系人：李雯

电话：010-60842306

网址：<https://www.harvestwm.cn/>

客服电话：400-021-8850

（17）深圳前海财厚基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室

办公地址：深圳市南山区深圳湾科技生态园三区 11 栋 A 座 3608 室

法定代表人：杨艳平

联系人：胡闻智

电话：0755-22676026

网址：<http://www.caiho.cn>

客服电话：400-1286-800

(18) 中证金牛（北京）投资咨询有限公司

注册地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室

办公地址：北京市宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层

法定代表人：钱昊旻

联系人：毛健

电话：010-59336550

网址：<http://www.jnlc.com/>

客服电话：4008909998

(19) 北京植信基金销售有限公司

注册地址：北京市密云区兴盛南路8号院2号楼106室-67

办公地址：北京朝阳区四惠盛世龙源国食苑10号楼

法定代表人：王军辉 联系人：张喆

电话：010-56075718

网址：<https://www.zhixin-inv.com/>

客服电话：4006-802-123

(20) 宜信普泽（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区西大望路1号9层公寓1008 办公地址：北京市朝阳区建国路88号楼soho现代城C座18层1809

法定代表人：戎兵

联系人：张得仙

电话：17610275787

网址：<https://www.yixinfund.com/>

客服电话：400-6099-200

(21) 北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区创远路34号院6号楼15层1501室 办公地址：北京市朝阳区创远路34号院6号楼15层1501室

法定代表人：钟斐斐

联系人：侯芳芳

电话：15910450297

---

网址：<https://danjuanapp.com/>

客服电话：400-1599-288

## 二、登记机构

名称：渤海汇金证券资产管理有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室

办公地址：天津市南开区宾水西道8号

法定代表人：徐海军

联系人：魏文婷

电话：010-68784295

传真：010-68784289

网址：<https://www.bhhjamc.com>

## 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：俞卫锋

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：陆奇

经办律师：安冬、陆奇

## 四、审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所：中国上海自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址：中国北京朝阳区东三环中路7号财富中心A座26层

法定代表人：李丹

电话：010-65338888

经办注册会计师：李铁英、刘瑗

联系人：刘瑗



## 第四部分基金的名称

本基金名称：渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金

## 第五部分基金的类型

本基金类型：混合型发起式证券投资基金

## 第六部分基金的投资目标

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。

## 第七部分基金的投资方向

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、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。

## 第八部分基金的投资策略

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。

#### 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。

#### 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

#### 3、杠杆策略：

杠杆的应用可分为以下几种：

息差杠杆：利用回购放大规模，通过久期错配，套取融资利率与标的资产的到期收益率息差

久期杠杆：通过对个券的久期控制，在有限的组合规模下满足不同的目标利率敞口

#### 4、可转债投资策略

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

#### 5、国债期货投资策略

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析

体系，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。国债期货相关投资遵循法律法规及中国证监会的规定。

## 6、股票投资策略

(1) 行业配置策略：通过跟踪并量化各行业的景气度、盈利能力、分析师的盈利预期、行业估值等基本面信息，结合行业指数的波动指标、动量变化指标等捕捉最具有投资价值的行业。

以此构建行业轮动模型动态调整权益资产中行业配置，提升具有投资价值行业的比例，降低投资价值较低的行业比例，实现相对较优的行业配置，获取行业配置的超额阿尔法收益。

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

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

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

## 7、股指期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，在风险可控的前提下，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。

#### 9、权证投资策略

本基金将在严格控制风险、保障基金财产安全的前提下对权证进行投资。本基金将通过对权证标的证券基本面研究，采取市场公认的权证定价模型作为权证投资的价值基准，同时充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征进行谨慎投资。此外根据权证衍生工具的特征，通过权证与标的证券组合投资，以期改善组合的风险收益。

### 第九部分基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：上证国债指数收益率×70%+沪深 300 指数收益率×30%。

### 第十部分基金的风险收益特征

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中高风险水平的投资品种。

### 第十一部分基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏、并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人根据基金合同规定复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2019 年 12 月 31 日（未经审计）。

## 1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,862,820.93	20.63
	其中：股票	2,862,820.93	20.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,991,962.00	71.99
	其中：债券	9,991,962.00	71.99
	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	700,000.00	5.04
	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	143,956.62	1.04
8	其他资产	180,500.94	1.30
9	合计	13,879,240.49	100.00

## 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	50,923.40	0.37
B	采矿业	437,375.80	3.17
C	制造业	1,538,107.43	11.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,851.00	0.14
E	建筑业	12,987.00	0.09
F	批发和零售业	22,555.00	0.16
G	交通运输、仓储和邮政业	25,364.00	0.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	243,182.00	1.76
J	金融业	291,154.80	2.11
K	房地产业	34,434.00	0.25
L	租赁和商务服务业	11,077.00	0.08
M	科学研究和技术服务业	6,870.00	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	13,680.00	0.10

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	68,855.10	0.50
R	文化、体育和娱乐业	86,404.40	0.63
S	综合	-	-
	合计	2,862,820.93	20.74

## 2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	100	118,300.00	0.86
2	000661	长春高新	200	89,400.00	0.65
3	603986	兆易创新	400	81,956.00	0.59
4	601899	紫金矿业	16,700	76,653.00	0.56
5	600547	山东黄金	2,240	73,068.80	0.53
6	002237	恒邦股份	4,700	65,988.00	0.48
7	000975	银泰黄金	4,500	61,245.00	0.44
8	601069	西部黄金	3,900	58,890.00	0.43
9	600489	中金黄金	6,500	55,120.00	0.40
10	000858	五粮液	400	53,204.00	0.39

## 4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	4,519,800.00	32.75
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,472,162.00	39.65
	其中：政策性金融债	5,472,162.00	39.65
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	9,991,962.00	72.40
----	----	--------------	-------

#### 5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	018006	国开 1702	21,640	2,219,182.00	16.08
2	010107	21 国债 (7)	20,000	2,055,000.00	14.89
3	019601	18 国债 19	14,000	1,446,200.00	10.48
4	108604	国开 1805	14,000	1,419,740.00	10.29
5	018008	国开 1802	10,000	1,028,600.00	7.45

#### 6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

##### 2) 本基金投资股指期货的投资政策

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

## 10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 1) 本期国债期货投资政策

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。

### 2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值 (元)	公允价值变动 (元)	风险指标说明
公允价值变动总额合计(元)					-
国债期货投资本期收益(元)					-500.00
国债期货投资本期公允价值变动(元)					-

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 3) 本期国债期货投资评价

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

## 11. 投资组合报告附注

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

本报告期内未发现本基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查,未发现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

### 2) 本基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况

基金投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。



## 3) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	372.11
2	应收证券清算款	84.30
3	应收股利	-
4	应收利息	180,044.53
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	180,500.94

## 4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

## 5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 第十二部分基金业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。本基金合同生效日 2018 年 2 月 11 日，基金业绩数据截至 2019 年 12 月 31 日。

## 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

## 渤海汇金睿选混合 A

阶段	净值收 益率①	净值收 益率标 准差②	业绩比 较基准 收益率 ③	业绩比较 基准收 益率标 准差 ④	①—③	②—④
2018/02/11-2018/12/31	1.05%	0.07%	-3.24%	0.40%	4.29%	-0.33%

2019/1/1-2019/12/31	7.00%	0.17%	13.45%	0.37%	-6.45%	-0.20%
自基金合同生效日 (2018/02/11) -2019/12/31	8.12%	0.13%	9.78%	0.39%	-1.66%	-0.26%

## 渤海汇金睿选混合 C

阶段	净值收 益率①	净值收 益率标 准差②	业绩比 较基准 收益率 ③	业绩比 较基准收 益率标 准差 ④	①-③	②-④
2018/02/11-2018/12/31	0.40%	0.06%	-3.24%	0.40%	3.64%	-0.34%
2019/1/1-2019/12/31	6.33%	0.17%	13.45%	0.37%	-7.12%	-0.20%
自基金合同生效日 (2018/02/11) -2019/12/31	6.76%	0.13%	9.78%	0.39%	-3.02%	-0.26%

### 第十三部分基金费用与税收

#### 一、与基金运作有关费用

##### （一）基金费用的种类

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

##### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.2%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

## 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

## 3、基金销售服务费

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%。C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.60% 年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

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

上述“一、基金费用的种类”中第 4—10 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

## 二、与基金销售有关的费用

### （一）申购费

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

本基金采用金额申购方式，A 类基金份额的申购费率如下表：

申购金额	申购费率
100 万元（不含）以下	1.20%
100 万元（含）—300 万元（不含）	0.80%
300 万元（含）—500 万元（不含）	0.40%
500 万元（含）以上	按笔固定收取 1,000 元/笔

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

### （二）赎回费

本基金赎回费由赎回基金份额的基金份额持有人承担。

本基金采用份额赎回的方式，A 类基金份额和 C 类基金份额的赎回费率如下表：

#### A 类基金份额：

持有期限 (N)	赎回费率
$N < 7$ 日	1.50%
$7 \text{ 日} \leq N < 30$ 日	0.75%
$30 \text{ 日} \leq N < 365$ 日	0.50%
$365 \text{ 日} \leq N < 730$ 日	0.25%
$N \geq 730$ 日	0

#### C 类基金份额：

持有期限 (N)	赎回费率
$N < 7$ 日	1.50%
$7 \text{ 日} \leq N < 30$ 日	0.50%
$30 \text{ 日} \leq N < 365$ 日	0.25%
$N \geq 365$ 日	0

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

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

基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划，定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后，对投资者适当调整基金申购费率、赎回费率等相关费率。

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

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### 四、基金税收

根据相关税收规定，自 2018 年 1 月 1 日起，证券投资基金运营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% 的征税率缴纳增值税。管理人

将对本基金运营过程中产生的增值税及附加税费在基金财产中计提，并由管理人按照现行规定缴纳。具体公告见 2017 年 12 月 29 日基金管理人在公司网站发布的《渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下证券投资基金执行增值税政策的公告》。

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 第十四部分对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其它有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对本基金管理人于 2019 年 10 月 28 日公告的《渤海汇金睿选混合型发起式证券投资基金招募说明书》进行了更新，主要更新的内容如下：

1. “重要提示”部分：更新了重要提示中的相关信息。
2. “第三部分基金管理人”部分：更新了基金管理人的相关信息。
3. “第四部分基金托管人”部分：更新了托管人的相关信息。
4. “第五部分相关服务机构”部分：更新了基金份额发售机构相关信息、更新了审计基金财产的会计师事务所经办注册会计师、联系人的相关信息。
5. “第十部分基金投资组合报告”部分：更新了本基金 2019 年第 4 季度投资组合报告内容。该部分内容均按有关规定编制，并经托管人复核。
6. “第十一部分基金的业绩”部分：更新自基金生效日至 2019 年 12 月 31 日的基金业绩，该部分内容均按有关规定编制，并经托管人复核。
7. “第二十三部分其他应披露事项”部分：列示了本基金 2019 年 8 月 12 日至 2020 年 3 月 30 日期间披露的涉及本基金及基金管理人的相关公告。

渤海汇金证券资产管理有限公司

二〇二〇年五月十三日