渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金基金份额发售公告

基金管理人：渤海汇金证券资产管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

重要提示

1、渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）的募集已获中国证券监督管理委员会2020年11月20日证监许可【2020】3170号文准予注册，并于2021年9月8日经中国证监会机构部函【2021】2850号《关于渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金延期募集备案的回函》确认延期募集。中国证监会对本基金的注册并不代表中国证监会对本基金的风险和收益作出实质性判断、推荐或者保证。

2、本基金是契约型开放式、混合型发起式证券投资基金。

3、本基金的基金管理人为渤海汇金证券资产管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司，登记机构为渤海汇金证券资产管理有限公司（以下简称“本公司”或“本基金管理人”）。

4、本基金自2021年12月13日至2021年12月24日止，通过基金管理人指定的销售机构公开发售。

5、本基金募集对象包括符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、发起资金提供方、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

6、本基金的销售机构包括本公司直销和其他销售机构。其他销售机构具体请见“六、本次募集当事人或中介机构”之“（三）销售机构”的“2、其他销售机构”。

7、本基金为发起式基金，发起资金提供方认购本基金的总金额不少于1000万元人民币，且持有期限不少于3年，法律法规和监管机构另有规定的除外。

8、投资者欲认购本基金，需开立本基金管理人的开放式基金账户。若已经在本公司开立开放式基金账户的，则不需要再次办理开户手续。募集期内本公司直销机构及其他销售机构为投资者办理开户和认购手续。开户和认购申请可同时办理。

9、在本基金直销渠道进行认购时，投资人以金额申请，每个基金账户首笔认购的最低金额为人民币10元，每笔追加认购的最低金额为人民币10元。其他销售机构办理业务时以其相关规则为准，但不得低于上述最低认购金额。基金管理人可根据市场情况，调整本基金首笔认购和每笔追加认购的最低金额。如本基金单个投资人累计认购的基金份额数达到或者超过基金总份额的50%，基金管理人有权对该投资人的认购申请进行限制。基金管理人接受某笔或者某些认购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%，或者变相规避前述50%比例要求的，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分认购申请。投资人认购的基金份额数以基金合同生效后登记机构的确认结果为准。

10、发起资金提供方认购金额不低于1000万元人民币，认购的基金份额持有期限不少于三年。发起资金来源于基金管理人的股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员的资金。

11、有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额的具体数额以登记机构的记录为准。

12、投资人在基金募集期内可以多次认购基金份额，认购费按每笔认购申请单独计算。已受理的认购申请不允许撤销。

13、基金销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利，否则，由此产生的投资人任何损失由投资人自行承担。

14、本公告仅对本基金募集的有关事项和规定予以说明，投资者欲了解本基金的详细情况，请仔细阅读届时刊登在中国证监会规定媒介上和本公司指定销售机构网站上的《渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金招募说明书》。

15、本基金的招募说明书及本公告将同时发布在本公司网站（https://www.bhhjamc.com）。投资者亦可通过本公司网站下载基金申请表格和了解基金发售相关事宜。

16、募集期内，本基金还有可能新增或调整销售机构，请留意近期本公司及各销售机构的公告，或拨打本公司及各销售机构的客户服务电话咨询。

17、对未开设销售网点的地区的投资者，请拨打本公司的客户服务电话（400-651-5988，400-651-1717）或基金管理人指定的各销售机构的客户服务电话咨询购买事宜。

18、基金管理人可综合各种情况对基金份额的发售安排做适当调整，并予以公告。

19、基金管理人提示投资者充分了解基金投资的风险和收益特征，根据自身的风险承受能力，审慎选择适合自己的基金产品。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。

本基金为混合型基金，其预期风险和预期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。本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括市场风险、基金运作风险、本基金的特有风险、流动性风险以及其他风险等。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。本基金的风险详见招募说明书的“风险揭示”部分。

本基金采用证券经纪商交易结算模式，即本基金将通过基金管理人选定的证券经营机构进行场内交易和结算，该种交易结算模式可能存在操作风险、资金使用效率降低的风险、交易结算风险、投资信息安全保密风险、无法完成当日估值等风险。

基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资人购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

投资有风险，投资人在进行投资决策前，请仔细阅读《招募说明书》、《基金合同》、基金产品资料概要等信息披露文件，了解本基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资人的风险承受能力相适应。

基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。当投资人赎回时，所得可能会高于或低于投资人先前所支付的金额。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。基金管理人所管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负担。

一、本次基金募集基本情况

1、基金名称

渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金（基金份额简称和基金份额代码：渤海汇金量化成长混合，005536）

2、基金运作方式和类型

契约型开放式，混合型发起式证券投资基金

3、基金存续期限

不定期

4、基金份额初始面值

本基金基金份额发售面值为人民币1.00元

5、基金投资目标

本基金通过构建数量化投资策略，重点选择具备高成长潜力的优质上市公司，在严格控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。

6、基金的最低募集份额总额和最低募集金额

本基金为发起式基金，发起资金提供方认购本基金的总金额不少于1000万元人民币，且持有期限不少于3年，法律法规和监管机构另有规定的除外。

7、募集对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、发起资金提供方、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

8、销售机构

具体各销售机构和直销机构的联系方式请见“六、本次募集当事人或中介机构”的“（三）销售机构”的相关内容。如本次募集期间，新增代销机构或营业网点，将另行公告。

9、募集时间安排与基金合同生效

（1）本基金募集期限自基金份额发售之日起不超过3个月。

（2）本基金自2021年12月13日至2021年12月24日进行发售。如果在此期间届满时未达到招募说明书第七部分第一条规定的基金备案条件，基金可在募集期限内继续销售。基金管理人也可根据基金销售情况，在符合相关法律法规的情况下，在募集期限内适当延长或缩短基金发售时间，并及时公告。

（3）基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：

1）以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

2）在基金募集期限届满后30日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息（税后）；

3）如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

10、如遇突发事件及其它特殊情况，以上基金募集期的安排可以适当调整并及时公告。

二、认购方式与相关规定

1、认购方式

基金认购采用“金额认购、份额确认”的方式。

2、认购费率

认购本基金基金份额时所适用认购费率如下表所示：

	认购金额（M，含认购费）	认购费率
认购费	M<50万元	1.00%
	50万元≤M<100万元	0.80%
	100万元≤M<500万元	0.40%
	M≥500万元	按笔收取，1,000元/笔

本基金的认购费由提出认购基金份额申请并成功确认的投资人承担。基金认购费用不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等募集期间发生的各项费用。募集期间发生的信息披露费、会计师费和律师费等各项费用，不从基金财产中列支。若投资人重复认购本基金基金份额时，需按单笔认购金额对应的认购费率分别计算认购费用。

3、认购份额的计算方法

本基金认购份额的计算公式如下：

净认购金额=认购金额/（1+认购费率）

（注：对于适用固定金额认购费的认购，净认购金额=认购金额-固定认购费金额）

认购费用=认购金额-净认购金额

（注：对于适用固定金额认购费的认购，认购费用=固定认购费金额）

认购份额=（净认购金额+有效认购金额在募集期间产生的利息）/基金份额发售面值

例1：某投资人在认购期内投资2,000,000.00元认购本基金，认购费率为0.40%，假设这2,000,000.00元在认购期间产生的利息为200.00元，则其可得到的认购份额计算方法为：

净认购金额=2,000,000.00/（1+0.40%）=1,992,031.87元

认购费用=2,000,000.00-1,992,031.87=7,968.13元

认购份额=（1,992,031.87+200.00）/1.00=1,992,231.87份

即：投资人投资2,000,000.00元认购本基金，加上有效认购款在认购期内获得的利息，基金认购期结束后，投资人经确认的基金份额为1,992,231.87份。

4、认购份额计算结果保留到小数点后2位，小数点后2位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

三、开户与认购

（一）使用账户说明

投资者认购本基金应使用本公司的开放式基金账户。

1、已有本基金管理人开放式基金账户的投资者，不需重新办理开户。

2、尚无本基金管理人开放式基金账户的投资者，可直接在直销机构或本基金管理人指定的其他销售机构办理本公司开放式基金账户的开户。

3、已通过直销机构或本基金管理人指定的其他销售机构办理过本公司开放式基金账户注册手续的投资者，可在原处直接认购本基金。

4、已通过直销机构或本基金管理人指定的其他销售机构办理过本基金管理人开放式基金账户注册手续的投资者，拟通过其他销售机构或直销机构认购本基金的，须用已有的本基金管理人开放式基金账户在新的销售机构或直销网点处办理开放式基金账户登记确认后方可办理本基金的认购。

（二）账户使用注意事项

1、投资者需开立本基金管理人的开放式基金账户，方可直接认购本基金。

2、如同日在不同销售机构申请开立基金账户，可能导致开户失败。

（三）其他销售机构办理开户（或账户注册）和认购流程

其他销售机构包括银行和证券公司的开户和认购的相关程序以各机构相关规定为准。

（四）本公司直销机构办理开户（或账户登记）和认购流程

1、在本基金募集期间，本公司设在天津的直销现场服务及本公司官方网站网上直销系统接受投资人办理开户（或账户登记）、认购手续。

2、认购时间：基金份额发售日9:30至17:00（周六、周日和节假日不受理申请）。

3、直销现场服务认购程序：

（1）办理开户（或账户登记）：

投资人认购本基金，须开立本基金管理人开放式基金账户，如已开立则不需重新办理。

在基金募集期间，投资人的开户和认购申请可同时办理。开立基金账户时请注意：

1）个人投资者必须提供以下材料：

①由投资者本人填妥并签字的《账户类业务申请表（个人）》（如账户控制人或受益人非本人还需填写《个人客户身份识别信息表》并提供相关证明材料）；

②投资者本人有效身份证明原件及复印件（正反面）；

③投资者本人指定的银行储蓄账户（银行卡或银行存折）原件及复印件并在复印件标明银行账户信息（账号、户名）；

④由投资者本人填妥并签字的《投资人风险承受能力评估问卷（个人）》及《普通投资者风险承受能力评估结果及适当性匹配确认书》（如为普通投资者）；

⑤由投资者本人签字的《投资人权益须知》；

⑥由投资者本人签字的《个人税收居民身份证明文件》；

⑦由他人代办的还需提供填写合格并经申请人及代办人签字确认的《账户类业务申请表（个人）》；提供经公证的委托代办书；代办人有效身份证件及其签字复印件；

⑧本公司要求提供的其他材料。

本公司一般不接受法定年龄在十八周岁以下的人士作为基金账户的开户人、授权委托人、经办人；如果十八周岁以下的人士坚持要认（申）购本公司旗下未对投资者年龄做明确限制的开放式基金，本公司可以根据相关法律法规及基金合同约定，在履行相关手续后决定是否予以办理。

2）机构投资者必须提供以下材料：

①填妥并加盖单位公章和法定代表人（或授权代表）签章的《账户业务申请表（机构）》；

②加盖单位公章的营业执照（附有最新年检记录）或注册登记证书（正、副本）复印件；

③加盖单位公章的组织机构代码证（附有最新年检记录）、税务登记证复印件（如营业执照为统一社会信用代码可不提供）；

④加盖单位公章的指定银行出具（需银行盖章）的银行《开户许可证》或开户申请单或银行账户开户证明文件等的复印件。该银行账户将作为投资者认购、申购、赎回、分红、退款的唯一结算账户；

⑤填妥并加盖单位公章和法定代表人签章或负责人签章的《业务授权委托书》，如果为法定代表人授权代表签章，需有法定代表人对该授权代表的授权委托书原件（如无原件，需在复印件上加盖单位公章）；

⑥填妥并加盖单位公章的《机构客户印鉴卡》；

⑦加盖单位公章的授权经办人的有效身份证明复印件（正反面）；

⑧加盖单位公章的法定代表人的有效身份证复印件（正反面）；

⑨填妥并加盖公章的《投资人风险承受能力评估问卷（机构）》及《普通投资者风险承受能力评估结果及适当性匹配确认书》（如为普通投资者）；

⑩加盖公章的《投资人权益须知》；

⑪加盖公章的《机构税收居民身份声明文件》，消极非金融机构还须提供《控制人税收居民身份声明文件》；

⑫填妥并加盖公章的《非自然人客户受益所有人信息表》及相关证明材料；

⑬如有控股股东或者实际控制人的，还需提供控股股东或者实际控制人的有效证件复印件并加盖申请机构公章，或申请机构出具的控股股东证明书（若通过官方渠道（如全国企业信用信息公示系统等）可核实无需提供）；

⑭如需采用传真交易办理业务，还需签订《传真交易协议书》一式两份；

⑮如符合专业投资者资质需提供《专业投资者确认书》或《专业投资者申请表》及相关证明材料；

⑯境内合伙企业、非法人创业投资企业还需提供：

A.工商管理部门颁发的营业执照（或其他国家有权机关颁发的合伙组织成立证书）及组织机构代码证，非法人创业投资企业还须提交国家商务部颁发的《外商投资企业批准证书》或省级（含副省级城市）以上创业投资管理部门出具的创投企业备案文件证明的加盖公章复印件；

B.合伙协议或投资各方签署的创业投资企业合同及章程（需加盖企业公章）；

C. 加盖企业公章的执行事务合伙人或负责人有效身份证明文件复印件，加盖企业公章的执行事务合伙人或负责人对经办人的授权委托书（合伙企业执行事务合伙人，以合伙企业营业执照上的记载为准，有多名合伙企业执行事务合伙人的，由其中一名在授权书上签字；执行事务合伙人是法人或者其他组织的，由其委派代表在授权书上签字）；加盖企业公章的经办人身份证明文件复印件。

⑰本公司要求提供的其他材料。

3）产品投资者必须提供以下材料

①投资者如属于金融机构面向投资者发行的理财产品的，应提供加盖公章的该金融机构的营业执照、开展金融相关业务资格证明、机构法定代表人和授权经办人有效身份证件正反面复印件等证明资料；产品成立或备案证明文件；信托协议（首页+盖章页）或托管协议（首页+盖章页）或资产管理合同（首页+盖章页）或备忘录等资料；

②加盖单位公章的指定银行出具的银行《开户许可证》或《开立银行账户申请表》或《银行信息确认函》等银行账户信息证明文件复印件；

③填妥并加盖单位公章和法定代表人签章的《业务授权委托书》；

④填妥的《机构客户印鉴卡》；

⑤填妥并加盖公章的《账户类业务申请表（产品）》；

⑥填妥并加盖公章的《非自然人客户受益所有人信息表》及相关证明材料；

⑦加盖公章的《投资人权益须知》；

⑧《机构税收居民身份声明文件》（如消极非金融机构还需提供《控制人税收居民身份声明文件》）；

⑨如有控股股东或者实际控制人的，还需提供控股股东或实际控制人的有效证件复印件并加盖申请机构的公章或申请机构出具的证明书（若通过官方渠道（如全国企业信用信息公示系统等）可核实无需提供）；

⑩如符合专业投资者资质需提供《专业投资者确认书》或《专业投资者申请表》及相关证明材料；

⑪如需采用传真交易办理业务，还需签订《传真交易协议书》一式两份；

⑫填妥并加盖公章的《产品投资者资金来源声明文件》（如可识别投资者为公募产品或投资者已提供份额持有人名册且持有人均为自然人投资者或机构投资者可不提供）；

⑬填妥并加盖公章的《产品投资者资金来源声明文件》（如已提供份额持有人名册可不提供）

⑭本公司要求提供的其他材料。

4）合格境外机构投资者

对合格境外机构投资者（QFII），由托管人负责开立，需提供以下材料：

①提供填妥的《账户类业务申请表（托管类资产版）》。须同时加盖（R）QFII客户和托管人双方签章。托管人部分：托管人公章或部门章、法定代表人（或授权代表人）、经办人签章；（R）QFII客户部分：（R）QFII客户公章、负责人（或授权代表人）签章、经办人签章；

②托管人提供填妥的账户类《机构预留印鉴卡》一式两份；（R）QFII机构部提供填妥的交易类《机构预留印鉴卡》一式两份；

③托管人提供填妥并加盖托管人公章或部门章及法定代表人（或授权代表人）签章及被授权人签章的《业务授权委托书》；（R）QFII机构提供填妥并加盖单位公章和法定代表人或授权人签章及被授权人签章的《业务授权委托书》；

④(R)QFII机构提供填妥并加盖单位公章及经办人签章的《传真交易协议》一式两份；

⑤(R)QFII机构提供填妥并加盖单位公章的《风险承受能力评估问卷（机构）》；

⑥提供托管人加盖托管人公章或部门章的营业执照的复印件（如非统一社会信用代码还需提供加盖公章或部门章的组织机构代码证和税务登记证的复印件）；提供(R)QFII 机构加盖公章的有效注册文件的复印件；

⑦提供加盖托管部门章的指定银行出具的银行账户开户证明的复印件；

⑧托管人提供加盖托管人公章或部门章的法定代表人有效身份证明文件的正反面复印件；(R)QFII机构提供加盖公章的法定代表人或负责人有效身份证明文件的正反面复印件；

⑨托管人提供加盖托管人公章或部门章的经办人有效身份证明文件的正反面复印件；(R)QFII机构提供加盖公章的经办人有效身份证明文件的正反面复印件；

⑩托管人对托管部门负责人的授权书，复印件加盖托管人公章或部门章(如有)；

⑪托管人提供加盖托管人公章或部门章的负责人有效身份证明文件的正反面复印件（如有）；

⑫证监会或人民银行或国家外汇管理局关于批准托管人资格的批复的复印件（加盖托管人公章或部门章）；

⑬R)QFII 机构委托托管人办理基金账户业务的授权委托书或者托管合同的首页及盖章页；

⑭中国证监会颁发的证券投资业务许可证复印件（加盖(R)QFII机构的公章）；

⑮中国证监会颁发的关于合格境外机构投资者资格的批复的复印件（加盖（R）QFII机构的公章）；

⑯国家外汇管理局关于批准（R）QFII 的投资额度以及开立相关账户的批复的复印件（加盖(R)QFII机构的公章）；

⑰加盖公章的《客户反洗钱承诺书》；

⑱加盖公章的《投资人权益须知》；

⑲加盖公章的《机构税收居民身份声明文件》，消极非金融机构还须提供《控制人税收居民身份声明文件》；

⑳填妥并加盖公章的《非自然人客户受益所有人信息表》及相关证明材料；

㉑提供公司认为与基金账户开户有关的其它证明材料。

已在除本公司直销机构外其他销售机构开立基金账户的客户，需在直销机构开立交易账户（所需资料同开户）。

（2）认购基金

投资者申请认购本基金，应将足额认购资金以转账方式，划入本公司指定直销专户，并确保在当日17:00前到账，不接受除转账以外的其它交款方式。

1）个人投资者办理认购时必须提供以下材料：

①本人身份证件原件及复印件（第二代居民身份证）；

②填写合格并经申请人签字确认的《交易类业务申请表（个人）》；

③若委托他人代办，还须出示经公证的委托代办书及代办人的有效身份证件原件及复印件；

④认购时，如投资人风险承受能力评测超过有效期，需重新由投资者本人填妥并签字《投资人风险承受能力评估问卷（个人）》及《普通投资者风险承受能力评估结果及适当性匹配确认书》（如为普通投资者）；

⑤本公司要求提供的其他材料。

2）机构及产品投资者办理认购时必须提供以下材料：

①填写合格并加盖预留印鉴的《交易类业务申请表（机构）》；

②出示授权经办人有效身份证件原件，提供复印件（临柜客户）；

③认购时，如普通投资人风险承受能力测评超过有效期，需重新提交填妥并加盖公章的《投资人风险承受能力评估问卷（机构）》及《普通投资者风险承受能力评估结果及适当性匹配确认书》

④本公司要求提供的其他材料。

（3）投资者适当性管理工作

①投资者选择申请开户时直接成为专业投资者或从普通投资者转换为专业投资者，需要提供《专业投资者申请表》《投资知识测试》及相关财产、资质证明材料；

②通过直销服务新开户或以前没有做过风险承受能力测评的投资者或已进行风险承受能力测评但已过有效期的投资者需填写《投资人风险承受能力评估问卷》并填写《普通投资者风险承受能力评估结果及适当性匹配确认书》（如为普通投资者）；

③投资者风险承受能力的测评结果应与投资者希望购买的基金的风险等级匹配。

（4）交款

投资者需按照渤海汇金证券资产管理有限公司直销机构的规定，在办理认购前将足额资金汇入渤海汇金证券资产管理有限公司直销清算账户。

户名：渤海汇金证券资产管理有限公司
开户银行：工行津西梅江支行
银行账号：0302014429300023271
大额支付账号：102110001261

投资者在转账时须在用途中注明认购的基金名称、基金代码，并确保募集期间交易日提交认购申请当日17:00前到账。

投资者若未按上述规定划付资金，造成认购无效的，渤海汇金证券资产管理有限公司和直销清算账户的开户银行不承担任何责任。

若投资者当日未将足额资金划付到账，出现以下任一无效认购情形的，认购款项将在确认为无效认购后的三个工作日内划往投资者指定的资金结算账户，该退回款项产生的利息等损失由投资者自行承担：

①投资者划来资金，但没有使用转账方式的；

②投资者划来资金，但未办理开户手续或开户不成功的；

③投资者划来资金，但未在有效时间内交付的；

④投资者划来的认购资金少于其申请的认购金额的；

⑤投资者划来资金，但未办理认购手续的；

⑥本公司确认的其它无效资金。

造成无效认购的，渤海汇金证券资产管理有限公司和直销清算账户的开户银行不承担任何责任。

4、网上直销系统办理业务

个人投资者在登录本公司网站（https://www.bhhjamc.com）与本公司达成电子交易等相关协议，接受本公司有关服务条款并办理相关手续后，即可办理基金账户开立、基金认购、信息查询等各项业务，具体业务办理情况及业务规则请登录本公司网站查询。

四、清算与交割

1、本基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

2、若本基金的基金合同生效，则投资者缴纳的有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额的具体数额以登记机构的记录为准。

3、登记机构根据相关法律法规以及业务规则和基金合同的约定，办理本基金的权益登记。

五、基金的验资与基金合同的生效

本基金自基金份额发售之日起3个月内，在发起资金提供方认购本基金的总金额不少于1000万元，且承诺认购的基金份额持有期限不少于三年的条件下，基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在10日内聘请法定验资机构验资，验资报告需对发起资金提供方及其持有的基金份额进行专门说明，自收到验资报告之日起10日内，向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额的具体数额以登记机构的记录为准。有效认购款项利息折算的份额保留到小数点后两位，小数点两位以后的部分四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

如果募集期限届满，未满足基金备案条件，则基金募集失败。如基金募集失败，基金管理人应以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，在基金募集期限届满后30日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息（税后）。如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

六、本次募集当事人或中介机构

（一）基金管理人
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南山街道桂湾五路128号基金小镇对冲基金中心506
法定代表人：刘嫣
设立日期：2016年5月18日
批准设立机关及批准设立文号：中国证监会，证监许可[2016]3号
组织形式：有限责任公司（法人独资）
注册资本：11亿元人民币
存续期限：持续经营
联系电话：022-23861521

（二）基金托管人
名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）
住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
法定代表人：任德奇
成立时间：1987年3月30日
批准设立机关和设立文号：国务院国发(1986)字第81 号文和中国人民银行银发［1987］40号文
组织形式：股份有限公司
注册资本：742.63亿元人民币
存续期间：持续经营
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字［1998］25号

（三）销售机构

1、直销服务机构

（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南山街道桂湾五路128号基金小镇对冲基金中心506
直销业务办公地址：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：刘嫣
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）网上直销系统

投资者届时可登录本公司网站（https://www.bhhjamc.com）办理基金账户开立、基金认购、信息查询等业务，具体业务办理情况及业务规则请登录基金管理人网站查询。

2、其他销售机构：

（1）渤海证券股份有限公司
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
办公地址：天津市南开区宾水西道8号
法定代表人：安志勇
联系人：王星
电话：022-28451922
传真：022-28451892
网址：http://www.ewww.com.cn/
客服电话：4006515988

（2）上海好买基金销售有限公司
注册地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
办公地址：上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903～906室
法定代表人：杨文斌
联系人：王诗玙
电话：021-20613999
传真：021-68596919
网址：https://www.howbuy.com/
客服电话：4007009665

（3）上海天天基金销售有限公司
注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦
法定代表人：其实
联系人：丁姗姗
电话：010-65980380
传真：021-54509953
网址：http://fund.eastmoney.com/
客服电话：4001818188

（4）上海基煜基金销售有限公司
注册地址：上海市崇明县长兴镇潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区）
办公地址：上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室
法定代表人：王翔
联系人：李关洲
电话：021-65370077
传真：021-55085991
网站:www.jiyufund.com.cn
客服电话:400-820-5369

（5）东海证券股份有限公司
注册地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18楼
办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人：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

（6）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

（7）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

（8）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

（9）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

（10）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

（11）中证金牛（北京）基金销售有限公司
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

（12）宜信普泽（北京）基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
办公地址：北京市朝阳区建国路88号楼soho现代城C座18层1809
法定代表人：戎兵
联系人：张得仙
电话：17610275787
网址：https://www.yixinfund.com/
客服电话：400-6099-200

（13）北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
办公地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
法定代表人：钟斐斐
联系人：侯芳芳
电话：15910450297
网址：https://danjuanapp.com/
客服电话：400-1599-288

（14）阳光人寿保险股份有限公司
注册地址：海南省三亚市迎宾路360-1号三亚阳光金融广场16层
办公地址：北京市朝阳区朝阳门外大街乙12号院1号昆泰国际大厦12层
法定代表人：李科
联系人：杨超
电话：010-85632771
网址：www.sinosig.com
客服电话：95510

（15）北京汇成基金销售有限公司
注册地址：北京市西城区西直门外大街1号院2号楼17层 19C13
办公地址：北京市西城区西直门外大街1号院2号楼19层
法定代表人：王伟刚
联系人：王骁骁
电话：010-62680527
网址：www.hcfunds.com.cn
客服电话：400-619-9059

（16）京东肯特瑞基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区西三旗建材城中路12号17号平房157
办公地址：北京市海淀区西三旗建材城中路12号17号平房157
法定代表人：王苏宁
联系人：陈龙鑫
联系电话：010-89189058
网址：http://kenterui.jd.com/
客服电话：400 098 8511 (个人业务)；400 088 8816 (企业业务)

（17）和耕传承基金销售有限公司
注册地址：河南自贸试验区郑州片区(郑东)东风南路东康宁街北6号楼5楼503
办公地址：北京市西城区宣武门西大街甲127号大成大厦6层
法定代表人：李淑慧
联系人：胡静华
联系电话：0371-85518395
网址：www.hgccpb.com
客服电话：4000-555-671

（18）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司
注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路969号3幢5层599室
办公地址：上海市浦东新区南泉北路447号
法定代表人：祖国明
联系人：冷烽
联系电话：4000-766-123
网址：http://www.fund123.cn/
客服电话：4000-766-123

（19）华瑞保险销售有限公司
注册地址：上海市嘉定区南翔镇众仁路399号运通星财富广场1号楼B座13、14层
办公地址：上海市嘉定区南翔镇众仁路399号运通星财富广场1号楼B座13、14层
法定代表人：路昊
联系人：杨雅风
联系电话：021-68595717
网址：https://www.huaruisales.com/
客服电话：952303

（20）珠海盈米基金销售有限公司
注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔1201-1203室
法定代表人：肖雯
联系人：王宇昕
联系电话：020-89629011
网址：https://www.yingmi.cn/
客服电话：020-89629066

（21）上海万得基金销售有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座
法定代表人：黄祎
联系人：张戈
联系电话：13761050967
网址：https://www.windmoney.com.cn/
客服电话：4008210203

（22）奕丰基金销售有限公司
注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室
法定代表人：TEO WEE HOWE
联系人：叶键
联系电话：0755-89460507
网址：https://www.ifastps.com.cn/
客服电话：4006840500

（23）招商证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路111号
办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路111号
法定代表人：霍达
联系人：黄婵君
联系电话：86-755-82960167
网址：http://www.cmschina.com/
客服电话：95565

（24）一路财富（北京）基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区宝盛南路1号院20号楼9层101-14
办公地址：北京市海淀区宝盛南路1号院20号楼9层101-14
法定代表人：吴雪秀
联系人：陈彦娇
联系电话：010-88312977-8019
网址：https://www.yilucaifu.com/
客服电话：4000011566

（25）上海爱建基金销售有限公司
注册地址：上海市黄浦区西藏中路336号1806-13室
办公地址：上海市黄浦区西藏中路336号1806-13室
法定代表人：马金
联系人：黄子珈
联系电话：021-60608983
网址：www.ajwm.com.cn
客服电话：4008032733

（26）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

（27）喜鹊财富基金销售有限公司
注册地址：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1513室
办公地址：北京市朝阳区北苑路甲1号
法定代表人：王舰正
联系人：张萌
电话：010-58349088
网址：www.xiquefund.com
客服电话：4006997719

（28）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：北京市西城区宣武门西大街甲127号大成大厦6层
法定代表人：祝瑞敏
联系人：王薇安
联系电话：010-83252170
网址：http://www.cindasc.com/
客服电话：95321

（29）上海利得基金销售有限公司
注册地址：上海市虹口区东大名路1098号53楼
办公地址：上海市虹口区东大名路1098号53楼
法定代表人：李兴春
联系人：伍豪
联系电话：021-50585353
网址：https://www.mszq.com/
客服电话：95376

（30）深圳市前海排排网基金销售有限责任公司
注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址：深圳市福田区新洲南路2008号新洲同创汇3层D303号
法定代表人：杨柳
联系人：林丽
联系电话：0755-82779746
网址：http://www.simuwang.com/
客服电话：400-666-7388

（31）北京广源达信基金销售有限公司
注册地址：北京市西城区新街口外大街28号C座六层605室
办公地址：北京市朝阳区望京浦顶中心B座19层
法定代表人：齐剑辉
联系人：杨家明
联系电话：13810429012
网址：www.guangyuandaxin.com
客服电话：400-616-7531

（32）宁波银行同业易管家平台
注册地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路345号
办公地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路345号
法定代表人：陆华裕
联系人：马艺玮
联系电话：021-23262715
网址：http://www.nbcb.com.cn/
客服电话：95574

基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并在基金管理人网站公示。

（四）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南山街道桂湾五路128号基金小镇对冲基金中心506
办公地址：天津市南开区宾水西道8号
法定代表人：刘嫣
联系人：王琳
电话：022-23861520
传真：022-23861651
网址：https://www.bhhjamc.com

（五）律师事务所和经办律师
名称：上海市通力律师事务所
住所：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：韩炯
电话：021-31358666
传真：021-31358600
联系人：陆奇
经办律师：安冬、陆奇

（六）审计基金财产的会计师事务所
名称：德勤华永会计师事务所 (特殊普通合伙)
住所：上海市黄浦区延安东路222号30楼
办公地址：上海市黄浦区延安东路222号30楼
法定代表人：付建超
电话：021-61418888
经办注册会计师：曹丽娜 张冠楠
联系人：张冠楠

渤海汇金证券资产管理有限公司
2021年11月30日

渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告

渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金基金合同全文和招募说明书全文于2021年11月30日在本公司网站（https://www.bhhjamc.com）和中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）披露，供投资者查阅。如有疑问可拨打本公司客服电话（400-651-5988/400-651-1717）咨询。

本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，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。请充分了解本基金的风险收益特征，审慎做出投资决定。

特此公告。

渤海汇金证券资产管理有限公司
2021年11月30日

渤海汇金量化成长混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要

编制日期：2021年11月24日

送出日期：2021年11月30日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

基金简称	渤海汇金量化成长混合	基金代码	005536	
基金管理人	渤海汇金证券资产管理有限公司	基金托管人	交通银行股份有限公司	
基金合同生效日	–	上市交易所及上市日期	–	–
基金类型	混合型	交易币种	人民币	
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日	
基金经理	何翔	开始担任本基金基金经理的日期	–	
		证券从业日期	2005-01-05	

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

–

投资目标	本基金通过构建数量化投资策略，重点选择具备高成长潜力的优质上市公司，在严格控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资范围	本基金的投资范围主要为具有较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、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、央行票据、政府机构债券、地方政府债券、企业债、公司债、公开发行的次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券等）、股指期货、国债期货、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具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的相关规定。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。 基金的投资组合比例为：股票资产投资比例为基金资产的60%-95%；每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 如法律法规或监管机构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。
主要投资策略	本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	中证500指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险与预期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。

注：投资者欲了解本基金的详细情况，请仔细阅读本基金的《招募说明书》。本基金产品有风险，投资需谨慎。

（二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

–

（三）自基金合同生效以来/最近十年（孰短）基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

–

三、投资本基金涉及的费用

（一）基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

费用类型	份额(S)或金额(M)/持有期限(N)	收费方式/费率	备注
认购费	M〈500,000	1.00%	–
	500,000≤M〈1,000,000	0.80%	–
	1,000,000≤M〈5,000,000	0.40%	–
	M≥5,000,000	1000元/笔	–
申购费(前收费)	M〈500,000	1.20%	–
	500,000≤M〈1,000,000	1.00%	–
	1,000,000≤M〈5,000,000	0.60%	–
	M≥5,000,000	1000元/笔	–
赎回费	N〈7天	1.50%	–
	7天≤N〈30天	0.75%	–
	30天≤N〈180天	0.50%	–
	N≥180天	0	–

（二）基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率
管理费	1.20%
托管费	0.20%
销售服务费	–
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、审计费、律师费、诉讼费、仲裁费和公证费等；基金份额持有人大会费用；基金的证券/期货交易费用；基金的银行汇划费用；基金的账户开户费用和账户维护费用；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。

注：本基金费用的计算方法和支付方式详见本基金的《招募说明书》。本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

四、风险揭示与重要提示

（一）风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

投资本基金可能遇到的风险包括：市场风险、基金运作风险、本基金的特有风险、流动性风险及其他风险。

其中本基金的特有风险包括：

1、量化模型风险

本基金采用量化模型指导投资决策，因此定量方法的缺陷在一定程度上也会影响本基金的表现。定量方法的缺陷包括：（1）源数据错误或预处理过程中出现的错误可能直接影响量化模型的输出结果，形成数据风险；（2） 面对不断变换的市场环境，量化投资策略所遵循的模型理论均处于不断发展和完善的过程中；（3）在量化模型的具体设定中，核心参数假定的变动均可能影响整体效果的稳定性；（4）定量模型存在对历史数据的依赖。因此，在实际运作过程中，市场环境的变化可能导致遵循量化模型构建的投资组合在一定程度上无法达到预期的投资效果。

2、特定投资对象风险

（1）股指期货投资风险

1）基差风险

在使用股指期货对冲市场风险的过程中，基金财产可能因为股指期货合约与标的指数价格波动不一致而遭受基差风险。形成基差风险的潜在原因包括：

①需要对冲的风险资产与股指期货标的指数风险收益特征存在明显差异；

②因未知因素导致股指期货合约到期时基差严重偏离正常水平；

因存在基差风险，在进行股指期货合约展期的过程中，基金财产可能会承担股指期货合约之间的价差向不利方向变动而导致的展期风险。

2）杠杆风险

因股指期货采用保证金交易而存在杠杆，基金财产可能因此产生更大的收益波动。

3）到期日风险

股指期货合约到期时，基金财产如持有未平仓合约，中金所将按照交割结算价将基金持有的合约进行现金交割，基金将无法继续持有到期合约，具有到期日风险。

4）对手方风险

基金管理人运用基金财产投资于股指期货时，会尽力选择资信状况优良、风险控制能力强的期货公司作为经纪商，但不能杜绝在极端情况下，所选择的期货公司在交易过程中存在违法、违规经营行为或破产清算导致基金财产遭受损失。

5）盯市结算风险

股指期货采取保证金交易，保证金账户实行当日无负债结算制度，对资金管理要求较高。假如市场走势对本基金财产不利，期货经纪公司会按照期货经纪合同约定的时间和方式通知基金管理人追加保证金，以使基金能继续持有未平仓合约。如出现极端行情，市场持续向不利方向波动导致期货保证金不足，基金管理人又未能在规定时间内补足，按规定保证金账户将被强制平仓，甚至已缴付的所有保证金都不能弥补损失，从而导致基金财产出现超出预期的损失。

6）平仓风险

在某些市场情况下，基金财产可能会难以或无法将持有的未平仓合约平仓，例如，这种情况可能在市场达到涨跌停板时出现。出现这类情况，缴付的所有保证金有可能无法弥补全部损失，基金财产还必须承担由此导致的全部损失。

期货经纪公司或其客户保证金不足，又未能在规定的时间内补足，或因其他原因导致中金所对期货经纪公司的经纪账户强行平仓，基金财产可能因被连带强行平仓而遭受损失。

（2）投资国债期货的特有风险

1）信用风险，是指因交易对手无力履行合约义务而产生的风险。在国债期货合约中，即使敞口头寸没有市场风险，它仍有可能包含信用风险。信用风险包括交割前风险和交割风险。交割前风险即在合约到期前由于国债期货价格变动或者其他原因致使交易者蒙受较大亏损而无力履行合约义务的风险；交割风险即在合约到期日交易方履行了合约，但交易对手却未能履约的风险。

2）市场风险，是指国债期货产品价值对交易者产生不利影响的风险，即国债期货的交割发生逆向不利变动而带来价值损失的可能性。

3）操作风险，指因计算机系统不完善，内控制度不够健全和人员操作失误等原因，业务处理不能圆满进行的风险，以及由于没有建立灾害等紧急情况下的事务处理机制而导致业务停止的风险。对于国债期货这类衍生工具来说，由于其支付过程和价值计算都十分复杂，因此操作风险所导致的损失可能会很严重。

4）强制平仓风险或爆仓风险。国债期货实行当日无负债结算制度，当市场朝不利方向波动时，需要追加保证金，特别是当出现极端不利行情时，基差也可能出现不利变动，此时需要的保证金数额很可能超出正常值，如果不能及时采取措施增加保证金，期货头寸将被强行平仓，而相应的对冲策略也可能被迫提前终止，因此，本基金将面临由于市场波动导致追加保证金的风险，也面临着由于系统故障等原因不能及时追加保证金导致策略提前结束的风险，从而使得预期盈利不能兑现甚至导致不必要的净值损失。

（3）投资可转换债券和可交换债券的特定风险

可转换债券和可交换债券是指持有人可以在约定的时间内按照约定的价格将持有的债券转换为普通股票的债券，是兼具债券性质和权益性质的投资工具。可转换债券和可交换债券可能既面临发行人无法按期偿付本息的信用风险，也面临二级市场价格波动的风险。

（4）资产支持证券投资风险

本基金的投资范围包括资产支持证券，资产支持证券是一种债券性质的金融工具，风险主要包括资产风险及证券化风险。资产风险来源于资产本身，包括价格波动风险、流动性风险等；证券化风险主要包括信用评级风险、法律风险等。

3、本基金采用证券经纪商交易结算模式，即本基金将通过基金管理人选定的证券经营机构进行场内交易和结算，该种交易结算模式可能存在操作风险、资金使用效率降低的风险、交易结算风险、投资信息安全保密风险、无法完成当日估值等风险。

4、基金合同终止的风险

《基金合同》生效之日起三年后的对应日，若基金资产净值低于2亿元，基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。

《基金合同》生效满三年后继续存续的，连续50个工作日出现前述情形的，基金管理人将终止基金合同，并按照基金合同约定程序进行清算，此事项不需要召开基金份额持有人大会进行表决。

因此，基金份额持有人可能面临基金合同提前终止的风险。

（二）重要提示

中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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。

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

本基金的争议解决处理方式详见本基金基金合同的具体约定。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站［网址：https://www.bhhjamc.com］［客服电话：400-651-5988/400-651-1717］

1、基金合同、托管协议、招募说明书

2、定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告

3、基金份额净值

4、基金销售机构及联系方式

5、其他重要资料

六、其他情况说明

–