

渤海汇金证券资产管理有限公司旗下公募基金 通过证券公司证券交易及佣金支付情况 (2024 年度)

一、选择证券公司参与证券交易的标准和程序

(一) 选择证券公司的标准

1. 基础资质要求:

- (1) 财务状况良好: 具备良好的财务状况, 经营稳健。
- (2) 经营行为规范: 遵守相关法律法规, 经营行为规范。
- (3) 合规风控能力强: 具备较强的合规和风险控制能力。
- (4) 交易和研究服务能力强: 具备较强的交易执行能力和研究服务能力, 能够提供高质量的研究报告和投资建议。

2. 交易模式选择: 根据公司合规风控能力、信息系统建设、产品管理规模等, 合理选择“券商交易模式”或“租用交易单元模式”, 以降低交易成本。

3. 评分维度及权重

- (1) 研究及投资建议质量 (40%): 包括宏观研究 (20%)、行业及公司研究 (70%)、数量研究 (10%), 根据报告质量评分。
- (2) 报告的及时性 (30%): 包括宏观研究 (20%)、行业及公司研究 (70%)、数量研究 (10%), 根据报告时效性评分。
- (3) 服务质量 (20%): 涵盖需求响应速度、培训支持等。

(4) 交易成本及其他 (10%): 包括工具、数据服务、教育支持等。

(二) 证券公司选择程序

1. 初始

公募业务投资决策委员会 (以下简称“投决会”) 定期召开会议, 讨论席位调整及佣金分配事宜。

相关部门 (公募投资条线、研究部、集中交易部) 提交评分结果和券商候选人名单, 财务部提供佣金分配数据。

2. 评分与分组

由公募投资条线总监、研究部及集中交易部人员共同评分, 取平均分作为最终得分, 首先以自有交易席位为主, 同时选取 10 家券商作为基金的席位备选券商。

3. 券商按评分分为三组:

第一组: 固定为渤海证券。

第二组: 得分最高的 4 家券商。

第三组: 剩余券商。

4. 佣金分配规则

(1) 分配比例限制:

第一组单一券商佣金比例不超过当年所有基金证券交易佣金总额的 15% (若上一年末股票型、混合型基金规模合计不足 10 亿元, 佣金比例不超过当年所有基金证券交易佣金总额的 30%)。

第二组中的单一券商的佣金比例分配不应超过第一组单一券商佣金

的 2/3。

第三组中的单一券商的佣金比例分配不应超过第一组单一券商佣金的 1/3。

(2) 同一组内，佣金分配顺序与评分高低顺序一致，得分高者所得佣金应高于得分低者。

5.调整与监督

调整佣金比例或新增交易单元需向投决会提交书面申请。

实际分配量超计划时，券商将进入备选名单，直至比例降至正常水平。

禁止通过转换证券交易模式规避佣金比例限制。

二、交易量、交易佣金年度汇总及分配情况

(一) 租用证券公司交易单元进行证券投资及佣金支付情况

1. 股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

证券公司名称 ¹	被动股票型基金			其他类型基金			是否与管理人存在关联关系 ²
	股票交易成交金额	应支付该证券公司的股票交易佣金金额 ³	平均佣金费率 ⁴ (%)	股票交易成交金额	应支付该证券公司的股票交易佣金金额	平均佣金费率 (%)	
渤海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	是
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	否
合计	-	-	-	-	-	-	

注：渤海证券股份有限公司为基金管理人的独资股东。

2. 证券投资佣金支付及分配情况

金额单位：人民币元

证券公司名称 ⁵	应支付该证券公司的证券交易佣金金额 ⁶	占年度该交易模式证券交易佣金总额比例 (%)
渤海证券股份有限公司	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-
合计	-	-

注：渤海证券股份有限公司为基金管理人的独资股东。

¹ 列示租用其交易单元的所有境内证券公司名称，不论当期是否有交易。

² 填写“是”或者“否”，如存在关联关系，请在表格下方对关联关系具体情况备注说明。

³ 此处的佣金金额是指基金管理人在该模式下，通过证券公司进行股票交易的佣金发生额，保留至小数点后两位。

⁴ 平均佣金费率=应支付证券公司的股票交易佣金金额/股票交易成交金额，保留至小数点后两位。

⁵ 列示租用其交易单元的所有境内证券公司名称，不论当期是否有交易。

⁶ 此处的佣金金额是指基金管理人在该模式下，通过证券公司进行股票、债券、债券回购、权证、基金等各类证券交易的合计佣金发生额，保留至小数点后两位。

(二) 委托证券公司办理股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

证券公司名称 ⁷	被动股票型基金			其他类型基金			是否与管理人存在关联关系 ⁸
	股票交易成交金额	应支付该证券公司的股票交易佣金金额 ⁹	平均佣金费率(%)	股票交易成交金额	应支付该证券公司的股票交易佣金金额	平均佣金费率(%)	
渤海证券股份有限公司	-	-	-	416,104,297.58	161,334.95	0.39	是
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	否
招商证券股份有限公司	-	-	-	3,499,343.00	1,535.37	0.44	否
合计	-	-	-	419,603,640.58	162,870.32	0.39	

注：渤海证券股份有限公司为基金管理人的独资股东。

本报告首次披露，报告期为 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

⁷ 列示委托办理股票投资的所有境内证券公司名称，不论当期是否有交易。

⁸ 填写“是”或者“否”，如存在关联关系，请在表格下方对关联关系具体情况备注说明。

⁹ 此处的佣金金额是指基金管理人在该模式下，通过证券公司进行股票交易的佣金发生额，保留至小数点后两位。