

# 国金及第七天理财债券型证券投资基金 2018 年半年度报告

2018 年 6 月 30 日

基金管理人：国金基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 24 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 23 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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b>                       | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b>                          | <b>6</b>  |
| 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                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式                              | 7         |
| 2.5 其他相关资料                              | 7         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>                 | <b>8</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 8         |
| 3.2 基金净值表现                              | 8         |
| 3.3 其他指标                                | 9         |
| <b>§4 管理人报告</b>                         | <b>10</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 10        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 11        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 11        |
| 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             | 12        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 12        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 12        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 13        |
| 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       | 13        |
| <b>§5 托管人报告</b>                         | <b>14</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 14        |
| 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 | 14        |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见     | 14        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>               | <b>15</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 15        |

|  |           |
|--|-----------|
| 6.2 利润表.....                               | 16        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                    | 17        |
| 6.4 报表附注.....                              | 18        |
| <b>§7 投资组合报告.....</b>                      | <b>38</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                        | 38        |
| 7.2 债券回购融资情况.....                          | 38        |
| 7.3 基金投资组合平均剩余期限.....                      | 38        |
| 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....       | 39        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                  | 39        |
| 7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细.....    | 40        |
| 7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....        | 40        |
| 7.8 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..... | 41        |
| 7.9 投资组合报告附注.....                          | 41        |
| <b>§8 基金份额持有人信息.....</b>                   | <b>42</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                 | 42        |
| 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....                | 42        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....              | 42        |
| 8.4 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.....     | 42        |
| <b>§9 开放式基金份额变动.....</b>                   | <b>44</b> |
| <b>§10 重大事件揭示.....</b>                     | <b>45</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                      | 45        |
| 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.....      | 45        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....           | 45        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                        | 45        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....                 | 45        |
| 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.....         | 45        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....                | 45        |
| 10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....                | 46        |
| 10.9 其他重大事件.....                           | 46        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>             | <b>49</b> |

|  |           |
|--|-----------|
| 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..... | 49        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                 | 50        |
| <b>§12 备查文件目录.....</b>                   | <b>51</b> |
| 12.1 备查文件目录.....                         | 51        |
| 12.2 存放地点.....                           | 51        |
| 12.3 查阅方式.....                           | 51        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|              |                   |
|--------------|-------------------|
| 基金名称         | 国金及第七天理财债券型证券投资基金 |
| 基金简称         | 国金及第七天理财          |
| 场内简称         | -                 |
| 基金主代码        | 003002            |
| 前端交易代码       | -                 |
| 后端交易代码       | -                 |
| 基金运作方式       | 契约型开放式            |
| 基金合同生效日      | 2016 年 8 月 4 日    |
| 基金管理人        | 国金基金管理有限公司        |
| 基金托管人        | 中国民生银行股份有限公司      |
| 报告期末基金份额总额   | 354,961,709.40 份  |
| 基金合同存续期      | 不定期               |
| 基金份额上市的证券交易所 | -                 |
| 上市日期         | -                 |

注：无。

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 在严格控制投资风险和保持资产流动性的前提下，追求稳定的当期收益，力争获取高于业绩比较基准的投资收益。   |
| 投资策略   | 本基金的投资将以保证资产的安全性和流动性为基本原则，在对国内外宏观经济走势、财政政策、货币政策变动等因素充分评估的基础上，判断金融市场利率的走势，择优筛选并优化配置投资范围内的各种金融工具，进行积极的投资组合管理，将组合的平均剩余期限控制在合理的水平，提高基金的收益。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为：人民币七天通知存款税后利率。   |
| 风险收益特征 | 本基金为短期理财债券型基金，其预期收益和预期风险水平低于混合型基金、股票型基金和普通债券型基金，高于货币市场基金。  |

注：无。

### 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 | 国金基金管理有限公司 | 中国民生银行股份有限公司 |

|         |      |                                 |                       |
|---------|------|---------------------------------|-----------------------|
| 信息披露负责人 | 姓名   | 彭文敏                             | 罗菲菲                   |
|         | 联系电话 | 010-88005888                    | 010-58560666          |
|         | 电子邮箱 | pengwenmin@gfund.com            | tgbfxjdzx@cmbc.com.cn |
| 客户服务电话  |      | 4000-2000-18                    | 95568                 |
| 传真      |      | 010-88005666                    | 010-58560798          |
| 注册地址    |      | 北京市怀柔区府前街三号楼 3-6                | 北京市西城区复兴门内大街 2 号      |
| 办公地址    |      | 北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 层 | 北京市西城区复兴门内大街 2 号      |
| 邮政编码    |      | 100089                          | 100031                |
| 法定代表人   |      | 尹庆军                             | 洪崎                    |

## 2.4 信息披露方式

|                      |                         |
|----------------------|-------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称       | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》。 |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.gfund.com           |
| 基金半年度报告备置地点          | 基金管理人和基金托管人的办公场所        |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称         | 办公地址                            |
|--------|------------|---------------------------------|
| 注册登记机构 | 国金基金管理有限公司 | 北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 层 |

### § 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(2018年1月1日 - 2018年6月30日) |
|---------------|-----------------------------|
| 本期已实现收益       | 33,035,596.78               |
| 本期利润          | 33,035,596.78               |
| 本期净值收益率       | 2.3472%                     |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2018年6月30日)            |
| 期末基金资产净值      | 354,961,709.40              |
| 期末基金份额净值      | 1.0000                      |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2018年6月30日)            |
| 累计净值收益率       | 7.1124%                     |

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（不含公允价值变动收益）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，由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

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。

#### 3.2 基金净值表现

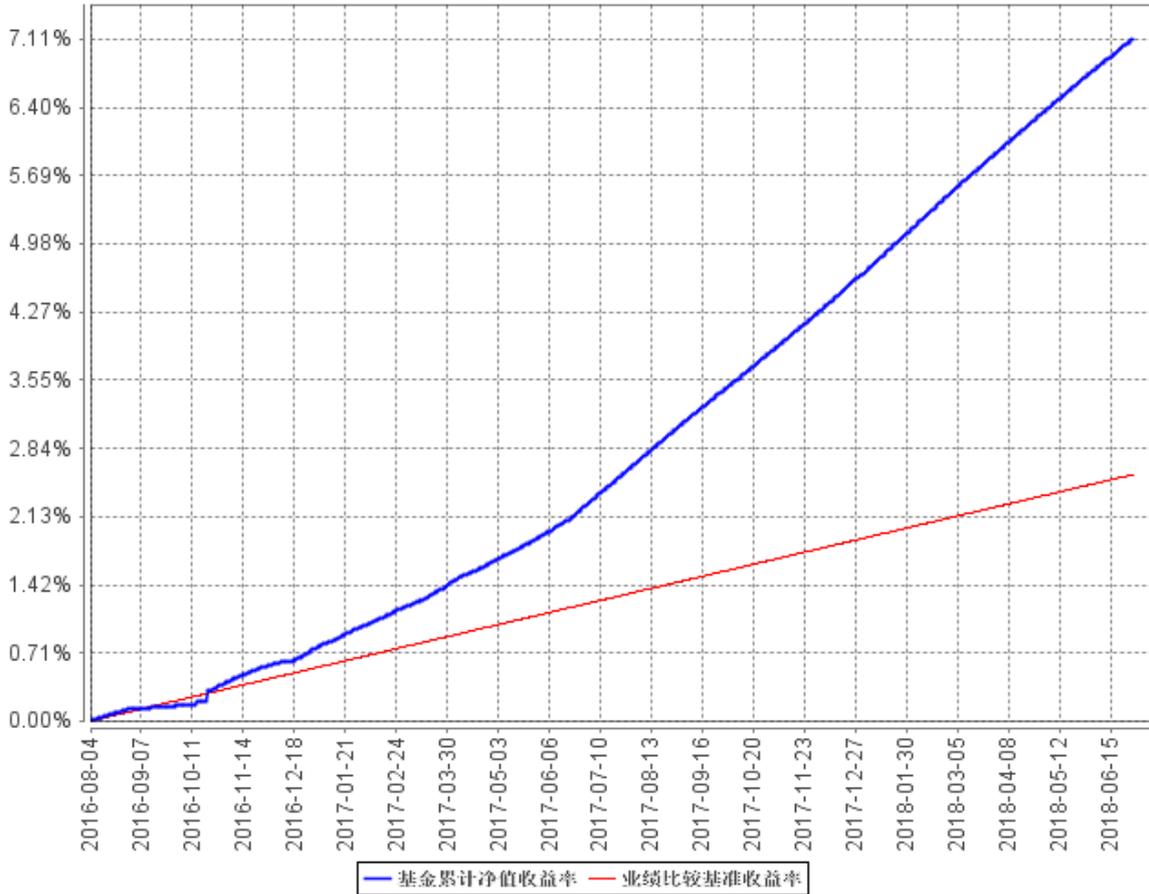
##### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差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     |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|---------|
| 过去一个月      | 0.3477%  | 0.0026%     | 0.1110%    | 0.0000%       | 0.2367% | 0.0026% |
| 过去三个月      | 1.1182%  | 0.0016%     | 0.3366%    | 0.0000%       | 0.7816% | 0.0016% |
| 过去六个月      | 2.3472%  | 0.0014%     | 0.6695%    | 0.0000%       | 1.6777% | 0.0014% |
| 过去一年       | 4.7557%  | 0.0011%     | 1.3500%    | 0.0000%       | 3.4057% | 0.0011% |
| 自基金合同生效起至今 | 7.1124%  | 0.0055%     | 2.5742%    | 0.0000%       | 4.5382% | 0.0055% |

注：本基金的业绩比较基准为：人民币七天通知存款利率(税后)

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为 2016 年 8 月 4 日至 2018 年 6 月 30 日。

### 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

国金基金管理有限公司（原名称为“国金通用基金管理有限公司”）经中国证券监督管理委员会（证监许可[2011]1661号）批准，于2011年11月2日成立，总部设在北京。2012年9月，公司的注册资本由1.6亿元人民币增加至2.8亿元人民币。2015年7月，公司名称由“国金通用基金管理有限公司”变更为“国金基金管理有限公司”。公司股东为国金证券股份有限公司、苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司、广东宝丽华新能源股份有限公司、涌金投资控股有限公司，股权比例分别为49%、19.5%、19.5%和12%。截至2018年6月30日，国金基金管理有限公司共管理11只开放式基金——国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金、国金沪深300指数增强证券投资基金、国金鑫盈货币市场证券投资基金、国金金腾货币市场证券投资基金、国金上证50指数分级证券投资基金、国金众赢货币市场证券投资基金、国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国金及第七天理财债券型证券投资基金、国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金、国金民丰回报6个月定期开放混合型证券投资基金、国金量化多策略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 |        |  |
| 徐艳芳 | 本基金基金经理，国金国鑫发起、国金众赢货币、国金民丰回报基金经 | 2016年8月4日       | -    | 10     | 徐艳芳女士，清华大学硕士。2005年10月至2012年6月历任皓天财经公关公司财经咨询师、英大泰和财产保险股份有限公司投资经理。2012年6月加入国金基金管理有限公司，历任投资研究部基金经理、固定收益投资部总经理兼基金经理；自2017年3月起任投资管理部总经理兼基金经理。 |

|  |                 |  |  |  |  |
|--|-----------------|--|--|--|--|
|  | 理, 投资管理<br>部总经理 |  |  |  |  |
|--|-----------------|--|--|--|--|

注：（1）任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期，首任基金经理的任职日期按基金合同生效日填写；（2）证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《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》、《国金及第七天理财债券型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，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利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

## 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，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《国金基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定，通过制度、流程和系统等方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下所有投资组合。在投资决策内部控制方面，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；在交易执行控制方面，通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；在行为监控和分析评估方面，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，确保做好公平交易的监控和分析。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况。

## 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

上半年经济基本面平稳运行，供需两端发生小幅度的背离。供给端工业生产出现集中的释放。需求端投资增速明显回落，其中房地产投资高位震荡，制造业投资缓慢修复，而基建投资增速明显下滑。除此之外，居民消费增速保持平稳，进出口的高增速超市场预期。通胀受食品价格拖累保持温和水平。海外方面，全球经济复苏势头有所放缓，美国相较于其他主要国家表现较好。政策方面，上半年央行已经实施的三次定向降准，确定了货币政策向中性偏宽松的方向微调。资金面在 4 月初配置盘提前进场的环境下利率快速回升到年初水平，6 月后在货币投放力度加大情况下，利率再度回落，跨季情况要好于往年。债券市场方面，利率债收益率受 4 月降准影响有所波动，大体维持下行趋势。信用债由于企业融资环境收缩，多只债项发生实质性违约事件，信用利差明显走阔。

组合在报告期内稳健操作，在严格控制流动性风险和信用风险的基础上，适时增加债券仓位并拉长久期，稳健提升组合的收益水平。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金份额净值收益率为 2.3472%，同期业绩比较基准收益率为 0.6695%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年预计供给增长接近尾声，经济下行压力增大。领先指标社融增速延续下行趋势，对整体经济形成约束。PMI 中生产、新订单双双下滑，预示着本轮复工需求接近尾声。基建投资增速进入底部区域，但财政下半年还有发力空间，对基建投资有所支撑。出口受全球经济放缓及中美贸易战升级影响，预计对于经济增长贡献减弱。通胀水平温和，食品价格涨幅较为乏力，油价温和回落。外部环境方面，贸易战对于全球经济增长带来一定的影响，不确定性上升。美国经济数据强劲，通胀抬升下，美债收益率还有进一步上行空间。国内资金面还将边际性改善，大体维持宽松局面。利率债收益率还有下行空间。信用利差还将维持高位，更看好高等级信用债。

## 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，本基金管理人按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会相关规定及基金合同关于估值的约定，严格执行内部估值控制程序，对基金所持有的投资品

种进行估值。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，估值委员会由公司督察长、投资总监、运营总监、清算业务负责人、研究部门负责人、风控业务负责人、合规业务负责人组成，可根据需要邀请产品托管行代表、公司独立董事、会计师事务所代表等外部人员参加。公司运营总监为公司基金估值委员会主席。运营支持部根据估值委员会的估值意见进行相关具体的估值调整或处理，并负责与托管行进行估值结果的核对，运营支持部业务人员复核后使用。基金经理作为估值委员会的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定，但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。本基金管理人参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

公司与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，并在运作期期末集中支付。

#### **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**

本报告期内，本基金无连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 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，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在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，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关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，本基金实施利润分配的金额为 33,035,596.78 元。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、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：国金及第七天理财债券型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2018 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 151,403,557.14                 | 790,131,710.83                   |
| 结算备付金           |            | -                              | -                                |
| 存出保证金           |            | -                              | -                                |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 219,494,958.17                 | 828,387,853.11                   |
| 其中：股票投资         |            | -                              | -                                |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 219,494,958.17                 | 828,387,853.11                   |
| 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    | 19,800,149.70                  | 158,800,478.20                   |
| 应收证券清算款         |            | -                              | -                                |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 3,221,948.94                   | 5,008,547.31                     |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | 1,221,993.95                   | -                                |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 395,142,607.90                 | 1,782,328,589.45                 |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2018 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2017 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      |            |                                |                                  |
| 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       |            | 39,659,780.17                  | 239,605,320.59                   |
| 应付证券清算款         |            | -                              | -                                |
| 应付赎回款           |            | -                              | -                                |
| 应付管理人报酬         |            | 146,416.00                     | 272,338.06                       |
| 应付托管费           |            | 36,604.04                      | 68,084.49                        |
| 应付销售服务费         |            | 7,320.83                       | 13,616.90                        |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 18,360.33                      | 30,397.93                        |

|               |          |                |                  |
|---------------|----------|----------------|------------------|
| 应交税费          |          | 5,846.98       | -                |
| 应付利息          |          | 7,752.58       | 256,526.91       |
| 应付利润          |          | 77,999.08      | 437,040.82       |
| 递延所得税负债       |          | -              | -                |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 220,818.49     | 225,300.00       |
| 负债合计          |          | 40,180,898.50  | 240,908,625.70   |
| <b>所有者权益：</b> |          |                |                  |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 354,961,709.40 | 1,541,419,963.75 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | -              | -                |
| 所有者权益合计       |          | 354,961,709.40 | 1,541,419,963.75 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 395,142,607.90 | 1,782,328,589.45 |

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.0000 元，基金份额总额 354,961,709.40 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国金及第七天理财债券型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                    | 附注号        | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至<br>2018 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至<br>2017 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|--|---|
| <b>一、收入</b>           |            | 37,835,197.43                            | 2,043,186.52                                  |
| 1.利息收入                |            | 37,780,232.95                            | 2,045,904.52                                  |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11   | 16,909,997.80                            | 727,333.63                                    |
| 债券利息收入                |            | 15,848,853.33                            | 592,974.89                                    |
| 资产支持证券利息收入            |            | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入            |            | 5,021,381.82                             | 725,432.80                                    |
| 其他利息收入                |            | -  | 163.20  |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |            | 54,964.48                                | -82,718.00                                    |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12   | -  | -   |
| 基金投资收益                |            | -  | -   |
| 债券投资收益                | 6.4.7.13   | 54,964.48                                | -82,718.00                                    |
| 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   | -  | -   |
| 股利收益                  | 6.4.7.16   | -  | -   |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17   | -  | -   |
| 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   | -  | 80,000.00                                     |
| <b>减：二、费用</b>         |            | 4,799,600.65                             | 325,512.85                                    |

|                            |            |                      |                     |
|----------------------------|------------|----------------------|---------------------|
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 1,400,729.01         | 97,445.57           |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 350,182.33           | 24,361.44           |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 70,036.46            | 4,872.31            |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.19   | -                    | -                   |
| 5. 利息支出                    |            | 2,713,425.82         | 84,464.40           |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 2,713,425.82         | 84,464.40           |
| 6. 税金及附加                   |            | 1,053.45             | -                   |
| 7. 其他费用                    | 6.4.7.20   | 264,173.58           | 114,369.13          |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | <b>33,035,596.78</b> | <b>1,717,673.67</b> |
| 减：所得税费用                    |            | -                    | -                   |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | <b>33,035,596.78</b> | <b>1,717,673.67</b> |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国金及第七天理财债券型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 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）                        | 1,541,419,963.75                      | -              | 1,541,419,963.75  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                     | 33,035,596.78  | 33,035,596.78     |
| 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）      | -1,186,458,254.35                     | -              | -1,186,458,254.35 |
| 其中：1.基金申购款                             | 1,111,148,880.28                      | -              | 1,111,148,880.28  |
| 2.基金赎回款                                | -2,297,607,134.63                     | -              | -2,297,607,134.63 |
| 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） | -                                     | -33,035,596.78 | -33,035,596.78    |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 354,961,709.40                        | -              | 354,961,709.40    |

| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 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）                        | 133,883,745.11                             | -             | 133,883,745.11  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 1,717,673.67  | 1,717,673.67    |
| 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）      | 435,018,930.66                             | -             | 435,018,930.66  |
| 其中：1.基金申购款                             | 607,771,483.23                             | -             | 607,771,483.23  |
| 2.基金赎回款                                | -172,752,552.57                            | -             | -172,752,552.57 |
| 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） | -  | -1,717,673.67 | -1,717,673.67   |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 568,902,675.77                             | -             | 568,902,675.77  |

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：

|              |              |              |
|--------------|--------------|--------------|
| _____<br>尹庆军 | _____<br>聂武鹏 | _____<br>于晓莲 |
| 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

国金及第七天理财债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），系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[2016]1487号文的核准，由国金基金管理有限公司于2016年7月22日至2016年8月1日向社会公开募集，基金合同于2016年8月4日生效。首次募集规模为200,807,602.85份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为国金基金管理有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括：现金，期限在一年以内（含一年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单，剩余期限（或回售期限）在397天以内（含

397 天) 的债券、资产支持证券、非金融企业债务融资工具, 以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金的业绩比较基准为: 人民币七天通知存款税后利率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制, 同时, 对于在具体会计核算和信息披露方面, 也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 5 号《货币市场基金信息披露特别规定》、《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>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.4.1 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。

##### 6.4.4.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

##### 6.4.4.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 6.4.5 税项

### 1. 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非

货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 5%，3%和 2%的比例缴纳。

### 2. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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。

### 3. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

## 6.4.6 重要财务报表项目的说明

### 6.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2018 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 1,403,557.14           |
| 定期存款           | 150,000,000.00         |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                      |
| 存款期限 1-3 个月    | 50,000,000.00          |
| 存款期限 3 个月以上    | 100,000,000.00         |
| 其他存款           | -                      |
| 合计：            | 151,403,557.14         |

### 6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目      | 本期末<br>2018 年 6 月 30 日 |      |      |     |
|---------|------------------------|------|------|-----|
|         | 摊余成本                   | 影子定价 | 偏离金额 | 偏离度 |
| 债 交易所市场 | -                      | -    | -    | -   |

|   |       |                |                |            |         |
|---|-------|----------------|----------------|------------|---------|
| 券 | 银行间市场 | 219,494,958.17 | 219,735,000.00 | 240,041.83 | 0.0676% |
|   | 合计    | 219,494,958.17 | 219,735,000.00 | 240,041.83 | 0.0676% |
|   | 资产支持券 | -              | -              | -          | -       |
|   | 合计    | 219,494,958.17 | 219,735,000.00 | 240,041.83 | 0.0676% |

注：偏离金额=影子定价-摊余成本；偏离度=偏离金额/摊余成本法确认的基金资产净值。

#### 6.4.6.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

#### 6.4.6.4 买入返售金融资产

##### 6.4.6.4.1 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<br>2018年6月30日 |           |
|-------|-------------------|-----------|
|       | 账面余额              | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                 | -         |
| 银行间市场 | 19,800,149.70     | -         |
| 合计    | 19,800,149.70     | -         |

##### 6.4.6.4.2 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买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2018年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息   | 197.81            |
| 应收定期存款利息   | 353,569.44        |
| 应收其他存款利息   | -                 |
| 应收结算备付金利息  | -                 |
| 应收债券利息     | 2,419,803.28      |
| 应收资产支持证券利息 | -                 |
| 应收买入返售证券利息 | 448,378.41        |
| 应收申购款利息    | -                 |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                 |
| 其他         | -                 |
| 合计         | 3,221,948.94      |

**6.4.6.6 其他资产**

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

**6.4.6.7 应付交易费用**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2018年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | -                 |
| 银行间市场应付交易费用 | 18,360.33         |
| 合计          | 18,360.33         |

**6.4.6.8 其他负债**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2018年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | -                 |
| 预提费用        | 220,818.49        |
| 合计          | 220,818.49        |

**6.4.6.9 实收基金**

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |                   |
|---------------|----------------------------|-------------------|
|               | 基金份额(份)                    | 账面金额              |
| 上年度末          | 1,541,419,963.75           | 1,541,419,963.75  |
| 本期申购          | 1,111,148,880.28           | 1,111,148,880.28  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -2,297,607,134.63          | -2,297,607,134.63 |
| - 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           | 354,961,709.40             | 354,961,709.40    |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

**6.4.6.10 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           | -              | -     | -              |
| 本期利润           | 33,035,596.78  | -     | 33,035,596.78  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -              | -     | -              |
| 其中：基金申购款       | -              | -     | -              |
| 基金赎回款          | -              | -     | -              |
| 本期已分配利润        | -33,035,596.78 | -     | -33,035,596.78 |
| 本期末            | -              | -     | -              |

#### 6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 10,416.55                  |
| 定期存款利息收入  | 16,894,749.90              |
| 其他存款利息收入  | -                          |
| 结算备付金利息收入 | -                          |
| 其他        | 4,831.35                   |
| 合计        | 16,909,997.80              |

#### 6.4.6.12 股票投资收益

##### 6.4.6.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本报告期无买卖股票差价收入。

#### 6.4.6.13 债券投资收益

##### 6.4.6.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>2018年1月1日至2018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 | 54,964.48                  |
| 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                            | 54,964.48                  |

**6.4.6.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 1,438,996,457.30           |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,434,693,388.72           |
| 减：应收利息总额                | 4,248,104.10               |
| 买卖债券差价收入                | 54,964.48                  |

**6.4.6.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期无债券赎回差价收入。

**6.4.6.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期无债券申购差价收入。

**6.4.6.13.5 资产支持证券投资收益**

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.6.14 贵金属投资收益****6.4.6.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.6.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本基金本报告期无买卖贵金属差价收入。

**6.4.6.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期无贵金属赎回差价收入。

**6.4.6.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期无贵金属申购差价收入。

**6.4.6.15 衍生工具收益****6.4.6.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

**6.4.6.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期期间无衍生工具收益。

**6.4.6.16 股利收益**

注：本基金本报告期无股利收益。

**6.4.6.17 公允价值变动收益**

注：本基金本报告期不存在公允价值变动收益。

**6.4.6.18 其他收入**

注：本基金本报告期无其他收入。

**6.4.6.19 交易费用**

注：本基金本报告期无交易费用。

**6.4.6.20 其他费用**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 审计费用      | 29,752.78                  |
| 信息披露费     | 148,765.71                 |
| 上清所帐户维护费  | 9,000.00                   |
| 其他        | 36,998.35                  |
| 上清所查询服务费  | 600.00                     |
| 银行费用      | 30,056.74                  |
| 中债债券账户维护费 | 9,000.00                   |
| 合计        | 264,173.58                 |

**6.4.6.21 分部报告**

无

**6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.7.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

**6.4.7.2 资产负债表日后事项**

截至财务报表批准日，除 6.4.5.1 增值税中披露的事项外，本基金无其他需要披露的资产负

债表日后事项。

## 6.4.8 关联方关系

### 6.4.8.1 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

本报告期未发生变化。

### 6.4.8.2 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               |
|--------------------|-----------------------|
| 国金基金管理有限公司         | 基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构 |
| 国金证券股份有限公司         | 基金管理人股东、基金代销机构        |
| 广东宝丽华新能源股份有限公司     | 基金管理人股东               |
| 苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司 | 基金管理人股东               |
| 涌金投资控股有限公司         | 基金管理人股东               |
| 上海国金理益财富基金销售有限公司   | 基金管理人的子公司             |
| 北京千石创富资本管理有限公司     | 基金管理人的子公司             |
| 中国民生银行股份有限公司       | 基金托管人                 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

### 6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.9.1.1 股票交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.9.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.9.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.9.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期末及上年可比期间无应支付关联方的佣金。

## 6.4.9.2 关联方报酬

### 6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30<br>日 |
|-----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 1,400,729.01                             | 97,445.57                                     |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 80,380.36                                | 14,125.26                                     |

注：1. 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.20% 年费率计提。管理费计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，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. 客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

### 6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30<br>日 |
|----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 350,182.33                               | 24,361.44                                     |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% / \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，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。

### 6.4.9.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

| 获得销售服务费<br>各关联方名称 | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日      |  |
|-------------------|--|--|
|                   | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |  |
| 国金基金管理有限公司        | 60,129.74                                  |  |
| 国金证券              | 3,685.62                                   |  |
| 合计                | 63,815.36                                  |  |
| 获得销售服务费<br>各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |  |
|                   | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |  |
| 国金基金管理有限公司        | 3,137.42                                   |  |
| 国金证券              | 761.48                                     |  |
| 合计                | 3,898.90                                   |  |

注：本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的 0.01% 的年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.01\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计算，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登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日      |        |      |          |      |                |           |
|--|--------|------|----------|------|----------------|-----------|
| 银行间市场交<br>易的<br>各关联方名称                     | 债券交易金额 |      | 基金逆回购    |      | 基金正回购          |           |
|  | 基金买入   | 基金卖出 | 交易金<br>额 | 利息收入 | 交易金额           | 利息支出      |
| 民生银行                                       | -      | -    | -        | -    | 990,576,000.00 | 95,883.15 |
| 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |        |      |          |      |                |           |
| 银行间市场交<br>易的<br>各关联方名称                     | 债券交易金额 |      | 基金逆回购    |      | 基金正回购          |           |
|  | 基金买入   | 基金卖出 | 交易金<br>额 | 利息收入 | 交易金额           | 利息支出      |

注：本基金上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（回购）交易。

#### 6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.9.4.1 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              |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
|                           | 2018年1月1日至2018年6月30日 | 2017年1月1日至2017年6月30日 |
| 基金合同生效日（2016年8月4日）持有的基金份额 | -                    | -                    |
| 期初持有的基金份额                 | 607,968.70           | -                    |
| 期间申购/买入总份额                | 14,325.11            | -                    |
| 期间因拆分变动份额                 | -                    | -                    |
| 减：期间赎回/卖出总份额              | -                    | -                    |
| 期末持有的基金份额                 | 622,293.81           | -                    |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例         | 0.1753%              | 0.0000%              |

注：基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

##### 6.4.9.4.2 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：本基金本报告期末未发生除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.9.5 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              |            |
|-----------|----------------------|--------------|----------------------|------------|
|           | 2018年1月1日至2018年6月30日 |              | 2017年1月1日至2017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     |
| 民生银行-活期存款 | 1,403,557.14         | 10,416.55    | 7,677,065.40         | 70,746.33  |
| 民生银行-定期存款 | 50,000,000.00        | 4,505,514.41 | 90,000,000.00        | 170,211.02 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国民生银行保管，按银行同业利率或约定的利率计息。

#### 6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.9.7 其他关联交易事项的说明

无

### 6.4.10 利润分配情况

金额单位：人民币元

| 已按再投资形式转实收基金  | 直接通过应付赎回款转出金额 | 应付利润本年变动    | 本期利润分配合计      | 备注 |
|---------------|---------------|-------------|---------------|----|
| 33,394,638.52 | -             | -359,041.74 | 33,035,596.78 | -  |

### 6.4.11 期末（2018年6月30日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本期末未持有认购新发/增发证券。

#### 6.4.11.2 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。

#### 6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 39,659,780.17 元，是以如下债券作为质押的：

金额单位：人民币元

| 债券代码      | 债券名称              | 回购到期日          | 期末估值单价 | 数量（张）   | 期末估值总额        |
|-----------|-------------------|----------------|--------|---------|---------------|
| 111898744 | 18 中德住房储蓄银行 CD027 | 2018 年 7 月 2 日 | 99.13  | 110,000 | 10,904,300.00 |
| 111818145 | 18 华夏银行 CD145     | 2018 年 7 月 2 日 | 99.20  | 300,000 | 29,760,000.00 |
| 合计        |                   |                |        | 410,000 | 40,664,300.00 |

##### 6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 6.4.12 金融工具风险及管理

#### 6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人的风险管理政策是通过事前充分到位的防范、事中实时有效的过程控制、事后完备可追踪的检查和反馈，将风险管理贯穿于投研运作的整个流程，从而使基金投资风险可测、可控、可承担，有效防范和化解投研业务的市场风险、信用风险、流动性风险及操作风险。

本基金管理人建立了董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险管理组织体系，合规风控部风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险控制委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

董事会负责公司整体风险的预防和控制，审核、监督公司风险控制制度的有效执行。董事会下设风险管理委员会，并制定《风险管理委员会议事规则》，规范其组成人员、职责、议事规则等事宜。

督察长负责公司及其投资组合运作的监察稽核工作，向董事会汇报。

总经理负责公司日常经营管理中的风险控制工作。总经理下设风险控制委员会，负责对公司经营及投资组合运作中的风险进行识别、评估和防控，负责对投资组合风险评估报告中提出的重大问题进行讨论和决定应对措施。公司制定《风险控制委员会议事规则》，规范其组成人员、职责、议事规则等事宜。

本基金管理人推行全员风险管理理念，公司各部门是风险管理的一线部门，公司各部门负责人是其部门风险管理的第一责任人，根据公司制度规定的各项作业流程和规范，加强对风险的控制。

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制，基金经理是本基金风险管理的第一责任人。

合规风控部监察稽核团队负责对风险控制制度的建立和落实情况进行监督，在职权范围内独立履行检查、评价、报告、建议职能；合规风控部风险管理团队独立于投资研究体系，负责落实具体的风险管理政策，对投资进行事前、事中及事后的风险管理。

#### 6.4.12.2 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，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。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进

行银行间同业市场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。

#### 6.4.12.2.1 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<br>2018 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | 30,002,196.20          | -                        |
| A-1 以下 | -                      | -                        |
| 未评级    | 50,193,423.65          | -                        |
| 合计     | 80,195,619.85          | -                        |

注：表中所列示的债券投资为短期融资券、超短期融资券及其他按短期信用评级的债券投资，其中超短期融资券无信用评级。

#### 6.4.12.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末未持有按短期信用评级的资产支持证券。

#### 6.4.12.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2018 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                      | -                        |
| A-1 以下 | -                      | -                        |
| 未评级    | 99,295,464.55          | 698,500,443.33           |
| 合计     | 99,295,464.55          | 698,500,443.33           |

注：表中所列示的同业存单无信用评级。

#### 6.4.12.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级的债券。

#### 6.4.12.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级的资产支持证券。

#### 6.4.12.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级的同业存单。

#### 6.4.12.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

#### 6.4.12.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无

#### 6.4.12.3.2 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严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例、份额持有人集中度、调整平均剩余期限和平均剩余存续期、压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本基金所持大部分证券为剩余期限较短、具有良好流动性的债券和货币市场工具，除在证券交易所的债券回购及返售交易，其余均在银行间同业市场交易，因此，除在 6.4.11 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），均能够及时变现。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。除附注 6.4.11.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.12.4 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。

##### 6.4.12.4.1 利率风险

利率风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来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。

本基金主要投资于交易所及银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，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。

## 6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2018 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                     | 1,403,557.14    | 100,000,000.00   | 50,000,000.00  | -     | -     | -             | 151,403,557.14   |
| 交易性金融资产                  | 59,962,464.02   | 79,336,874.30    | 80,195,619.85  | -     | -     | -             | 219,494,958.17   |
| 买入返售金融资产                 | 19,800,149.70   | -                | -              | -     | -     | -             | 19,800,149.70    |
| 应收利息                     | -               | -                | -              | -     | -     | 3,221,948.94  | 3,221,948.94     |
| 应收申购款                    | -               | -                | -              | -     | -     | 1,221,993.95  | 1,221,993.95     |
| 资产总计                     | 81,166,170.86   | 179,336,874.30   | 130,195,619.85 | -     | -     | 4,443,942.89  | 395,142,607.90   |
| 负债                       |                 |                  |                |       |       |               |                  |
| 卖出回购金融资产款                | 39,659,780.17   | -                | -              | -     | -     | -             | 39,659,780.17    |
| 应付管理人报酬                  | -               | -                | -              | -     | -     | 146,416.00    | 146,416.00       |
| 应付托管费                    | -               | -                | -              | -     | -     | 36,604.04     | 36,604.04        |
| 应付销售服务费                  | -               | -                | -              | -     | -     | 7,320.83      | 7,320.83         |
| 应付交易费用                   | -               | -                | -              | -     | -     | 18,360.33     | 18,360.33        |
| 应付利息                     | -               | -                | -              | -     | -     | 7,752.58      | 7,752.58         |
| 应交税费                     | -               | -                | -              | -     | -     | 5,846.98      | 5,846.98         |
| 应付利润                     | -               | -                | -              | -     | -     | 77,999.08     | 77,999.08        |
| 其他负债                     | -               | -                | -              | -     | -     | 220,818.49    | 220,818.49       |
| 负债总计                     | 39,659,780.17   | -                | -              | -     | -     | 521,118.33    | 40,180,898.50    |
| 利率敏感度缺口                  | 41,506,390.69   | 179,336,874.30   | 130,195,619.85 | -     | -     | -3,922,824.56 | 354,961,709.40   |
| 上年度末<br>2017 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                     | 10,131,710.83   | 720,000,000.00   | 60,000,000.00  | -     | -     | -             | 790,131,710.83   |
| 交易性金融资产                  | -               | 708,735,102.81   | 119,652,750.30 | -     | -     | -             | 828,387,853.11   |
| 买入返售金融资产                 | -               | 158,800,478.20   | -              | -     | -     | -             | 158,800,478.20   |
| 应收利息                     | -               | -                | -              | -     | -     | 5,008,547.31  | 5,008,547.31     |
| 资产总计                     | 10,131,710.83   | 1,587,535,581.01 | 179,652,750.30 | -     | -     | 5,008,547.31  | 1,782,328,589.45 |
| 负债                       |                 |                  |                |       |       |               |                  |
| 卖出回购金融资产款                | 239,605,320.59  | -                | -              | -     | -     | -             | 239,605,320.59   |
| 应付管理人报酬                  | -               | -                | -              | -     | -     | 272,338.06    | 272,338.06       |
| 应付托管费                    | -               | -                | -              | -     | -     | 68,084.49     | 68,084.49        |
| 应付销售服务费                  | -               | -                | -              | -     | -     | 13,616.90     | 13,616.90        |
| 应付交易费用                   | -               | -                | -              | -     | -     | 30,397.93     | 30,397.93        |
| 应付利息                     | -               | -                | -              | -     | -     | 256,526.91    | 256,526.91       |
| 应付利润                     | -               | -                | -              | -     | -     | 437,040.82    | 437,040.82       |
| 其他负债                     | -               | -                | -              | -     | -     | 225,300.00    | 225,300.00       |
| 负债总计                     | 239,605,320.59  | -                | -              | -     | -     | 1,303,305.11  | 240,908,625.70   |
| 利率敏感度缺口                  | -229,473,609.76 | 1,587,535,581.01 | 179,652,750.30 | -     | -     | -3,705,242.20 | 1,541,419,963.75 |

#### 6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |                                  |                                 |                        |
|----|----------------------------------|---------------------------------|------------------------|
| 假设 | 该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；         |                                 |                        |
|    | 假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变； |                                 |                        |
|    | 此项影响并未考虑管理层为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。  |                                 |                        |
| 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<br>影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |                                  | 本期末（2018 年 6 月 30 日）            | 上年度末（2017 年 12 月 31 日） |
|    | 利率+25 个基点                        | -150,220.15                     | -473,495.36            |
|    | 利率-25 个基点                        | 150,766.92                      | 474,970.63             |

#### 6.4.12.4.2 外汇风险

外汇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。

#### 6.4.12.4.3 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。

本基金主要投资于固定收益类金融工具，且以摊余成本进行后续计量，因此无重大其他价格风险。

##### 6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

注：无

##### 6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：本报告期末，本基金未持有交易性权益类投资，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.12.4.4 采用风险价值法管理风险

|                              |                   |                      |                        |
|------------------------------|-------------------|----------------------|------------------------|
| 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。 |                   |                      |                        |
| 假设                           | 1. 置信区间 -         |                      |                        |
|                              | 2. 观察期 -          |                      |                        |
| 分析                           | 风险价值<br>(单位：人民币元) | 本期末（2018 年 6 月 30 日） | 上年度末（2017 年 12 月 31 日） |

**6.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

无

## § 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  | 固定收益投资             | 219,494,958.17 | 55.55         |
|    | 其中: 债券             | 219,494,958.17 | 55.55         |
|    | 资产支持证券             | -              | -             |
| 2  | 买入返售金融资产           | 19,800,149.70  | 5.01          |
|    | 其中: 买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -             |
| 3  | 银行存款和结算备付金合计       | 151,403,557.14 | 38.32         |
| 4  | 其他各项资产             | 4,443,942.89   | 1.12          |
| 5  | 合计                 | 395,142,607.90 | 100.00        |

### 7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目           | 占基金资产净值的比例 (%) |                |
|----|--------------|----------------|----------------|
| 1  | 报告期内债券回购融资余额 | 11.22          |                |
|    | 其中: 买断式回购融资  | -              |                |
| 序号 | 项目           | 金额             | 占基金资产净值的比例 (%) |
| 2  | 报告期末债券回购融资余额 | 39,659,780.17  | 11.17          |
|    | 其中: 买断式回购融资  | -              | -              |

注: 报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

注: 在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

### 7.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目             | 天数 |
|----------------|----|
| 报告期末投资组合平均剩余期限 | 99 |

|                   |     |
|-------------------|-----|
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 110 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 43  |

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本基金合同约定：“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 127 天”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

### 7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限                 | 各期限资产占基金资产净值的比例 (%) | 各期限负债占基金资产净值的比例 (%) |
|----|------------------------|---------------------|---------------------|
| 1  | 30 天以内                 | 22.87               | 11.17               |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 2  | 30 天(含)—60 天           | 14.09               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 3  | 60 天(含)—90 天           | 36.44               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 4  | 90 天(含)—120 天          | 5.66                | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 5  | 120 天(含)—397 天(含)      | 31.02               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 合计 |                        | 110.08              | 11.17               |

### 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：本报告期末未发生投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

### 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 | 摊余成本 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------|------|---------------|
| 1  | 国家债券 | -    | -             |
| 2  | 央行票据 | -    | -             |

|    |                      |                |       |
|----|----------------------|----------------|-------|
| 3  | 金融债券                 | 40,003,873.77  | 11.27 |
|    | 其中：政策性金融债            | 40,003,873.77  | 11.27 |
| 4  | 企业债券                 | -              | -     |
| 5  | 企业短期融资券              | 80,195,619.85  | 22.59 |
| 6  | 中期票据                 | -              | -     |
| 7  | 同业存单                 | 99,295,464.55  | 27.97 |
| 8  | 其他                   | -              | -     |
| 9  | 合计                   | 219,494,958.17 | 61.84 |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | -              | -     |

### 7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称              | 债券数量(张) | 摊余成本          | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|-------------------|---------|---------------|---------------|
| 1  | 011800454 | 18 苏州国际 SCP002    | 300,000 | 30,102,205.84 | 8.48          |
| 2  | 041800192 | 18 河钢集 CP004      | 300,000 | 30,002,196.20 | 8.45          |
| 3  | 170308    | 17 进出 08          | 300,000 | 29,999,832.92 | 8.45          |
| 4  | 111818145 | 18 华夏银行 CD145     | 300,000 | 29,759,260.64 | 8.38          |
| 5  | 111810275 | 18 兴业银行 CD275     | 300,000 | 29,750,954.06 | 8.38          |
| 6  | 011800237 | 18 厦国贸 SCP003     | 200,000 | 20,091,217.81 | 5.66          |
| 7  | 111713073 | 17 浙商银行 CD073     | 200,000 | 19,958,590.25 | 5.62          |
| 8  | 111898744 | 18 中德住房储蓄银行 CD027 | 200,000 | 19,826,659.60 | 5.59          |
| 9  | 130415    | 13 农发 15          | 100,000 | 10,004,040.85 | 2.82          |

### 7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

| 项目                            | 偏离情况    |
|-------------------------------|---------|
| 报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数 | -       |
| 报告期内偏离度的最高值                   | 0.1063% |
| 报告期内偏离度的最低值                   | 0.0049% |

|                        |         |
|------------------------|---------|
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0357% |
|------------------------|---------|

注：本基金本报告期内未发生偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：本基金本报告期内未发生负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：本基金本报告期内未发生正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

## 7.8 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：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.9 投资组合报告附注

### 7.9.1

本基金采用固定份额净值，基金账面份额净值始终保持为人民币 1.00 元。

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内平均摊销，每日计提收益或损失。

### 7.9.2

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

### 7.9.3 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  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收利息    | 3,221,948.94 |
| 4  | 应收申购款   | 1,221,993.95 |
| 5  | 其他应收款   | -            |
| 6  | 待摊费用    | -            |
| 7  | 其他      | -            |
| 8  | 合计      | 4,443,942.89 |

### 7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

## § 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 |
| 11,606   | 30,584.33 | 21,621,543.66 | 6.09%  | 333,340,165.74 | 93.91% |

### 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

| 序号 | 持有人类别 | 持有份额（份）       | 占总份额比例 |
|----|-------|---------------|--------|
| 1  | 基金类机构 | 10,519,030.02 | 2.96%  |
| 2  | 其他机构  | 10,480,151.39 | 2.95%  |
| 3  | 个人    | 1,806,722.55  | 0.51%  |
| 4  | 个人    | 1,747,434.31  | 0.49%  |
| 5  | 个人    | 1,389,913.73  | 0.39%  |
| 6  | 个人    | 1,341,381.22  | 0.38%  |
| 7  | 个人    | 1,336,459.58  | 0.38%  |
| 8  | 个人    | 1,025,089.32  | 0.29%  |
| 9  | 个人    | 1,007,720.11  | 0.28%  |
| 10 | 个人    | 1,003,591.09  | 0.28%  |

### 8.3 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 | 1,987,443.23 | 0.5599%  |

### 8.4 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                | 0     |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                          |                  |
|--------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2016年8月4日）基金份额总额 | 200,807,602.85   |
| 本报告期期初基金份额总额             | 1,541,419,963.75 |
| 本报告期基金总申购份额              | 1,111,148,880.28 |
| 减：本报告期基金总赎回份额            | 2,297,607,134.63 |
| 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             | 354,961,709.40   |

注：1. 总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

2. 本报告期末，基金管理人持有本基金的份额为 622,293.81 份。基金管理人按照本基金《基金合同》及《招募说明书》规定的申购规则及申购费率办理申购业务，并已按照法规规定向中国证监会进行了报告。

## § 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

本基金托管人中国民生银行股份有限公司于 2018 年 4 月 19 日公告，根据工作需要，任命张庆先生担任本公司资产托管部总经理，主持资产托管部相关工作。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本期基金投资策略无重大变动。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务至今，本报告期内会计师事务所未发生改变。

### 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，基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
|      |        |      |             |           |            |    |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
|      |   |   | 例 |   |   |   |
| 华创证券 | 1 | - | - | - | - | - |

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定要求，本基金管理人在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向券商租用了基金专用交易席位。

(1) 基金专用交易席位的选择标准如下：

- ① 经营行为规范，在近一年内未出现重大违规行为；
- ② 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- ③ 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易需要；
- ④ 具有较强的研究能力，能及时、全面地提供高质量的宏观、策略、行业、上市公司、证券市场研究、固定收益研究、数量研究等报告及信息资讯服务；
- ⑤ 交易佣金收取标准合理。

(2) 基金专用交易席位的选择程序如下：

- ① 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；
- ② 本基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

### 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 |
| 华创证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |

### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本基金本报告期内不存在偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

### 10.9 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  | 《国金基金管理有限公司 2017 年 12 月 31 日基金净值公告》 | 指定披露媒体和本基金基金管理人网站 | 2018 年 1 月 2 日 |

|    |  |                   |                 |
|----|--|-------------------|-----------------|
| 2  | 《国金及第七天理财债券型证券投资基金 2017 年第 4 季度报告》             | 指定披露媒体和本基金基金管理人网站 | 2018 年 1 月 19 日 |
| 3  | 《关于国金及第七天理财债券型证券投资基金恢复申购和转换转入业务的公告》            | 指定披露媒体和本基金基金管理人网站 | 2018 年 1 月 20 日 |
| 4  | 《关于国金及第七天理财债券型证券投资基金暂停申购和转换转入业务的公告》            | 指定披露媒体和本基金基金管理人网站 | 2018 年 1 月 25 日 |
| 5  | 《国金及第七天理财债券型证券投资基金招募说明书(更新)》                   | 指定披露媒体和本基金基金管理人网站 | 2018 年 3 月 21 日 |
| 6  | 《国金及第七天理财债券型证券投资基金招募说明书(更新)摘要》                 | 指定披露媒体和本基金基金管理人网站 | 2018 年 3 月 21 日 |
| 7  | 《关于国金及第七天理财债券型证券投资基金恢复申购和转换转入业务公告》             | 指定披露媒体和本基金基金管理人网站 | 2018 年 3 月 21 日 |
| 8  | 《国金及第七天理财债券型证券投资基金 2017 年年度报告》                 | 指定披露媒体和本基金基金管理人网站 | 2018 年 3 月 27 日 |
| 9  | 《国金及第七天理财债券型证券投资基金 2017 年年度报告摘要》               | 指定披露媒体和本基金基金管理人网站 | 2018 年 3 月 27 日 |
| 10 | 《关于国金基金管理有限公司旗下部分证券投资基金修改基金合同的公告》              | 指定披露媒体和本基金基金管理人网站 | 2018 年 3 月 30 日 |
| 11 | 《国金及第七天理财债券型证券投资基金 2018 年第 1 季度报告》             | 指定披露媒体和本基金基金管理人网站 | 2018 年 4 月 21 日 |
| 12 | 《国金基金管理有限公司关于公司直销系统升级的公告》                      | 指定披露媒体和本基金基金管理人网站 | 2018 年 4 月 26 日 |
| 13 | 《国金基金管理有限公司关于代为履行基金经理职责的公告》                    | 指定披露媒体和本基金基金管理人网站 | 2018 年 4 月 28 日 |
| 14 | 《关于调整国金及第七天理财债券型证券投资基金个人投资者单日累计申购(含转换转入)金额的公告》 | 指定披露媒体和本基金基金管理人网站 | 2018 年 5 月 30 日 |
| 15 | 《关于增加国金及第七天理财债券型证券投资基金销售机构的公告》                 | 指定披露媒体和本基金基金管理人网站 | 2018 年 6 月 15 日 |
| 16 | 《国金基金管理有限公司关于增加凤凰金信(银川)基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告》   | 指定披露媒体和本基金基金管理人网站 | 2018 年 6 月 16 日 |
| 17 | 《关于增加国金及第七天理财                                  | 指定披露媒体和本基金基金      | 2018 年 6 月 23 日 |

|  |                   |       |  |
|--|-------------------|-------|--|
|  | 债券型证券投资基金销售机构的公告》 | 管理人网站 |  |
|--|-------------------|-------|--|

注：本报告期内，基金管理人按照《证券投资基金信息披露管理办法》的规定每个开放日公布基金每万份收益和 7 日年化收益率。

## § 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              | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 8 日, 2018 年 3 月 28 日至 2018 年 4 月 1 日, 2018 年 4 月 27 日至 2018 年 5 月 24 日, 2018 年 6 月 12 日至 2018 年 6 月 19 日 | 501,777,567.57 | 7,646,486.66   | 509,424,054.23 | 0.00       | 0.00% |
|  | 2              | 2018 年 6 月 20 日至 2018 年 6 月 26 日  | 0.00           | 101,889,351.05 | 101,889,351.05 | 0.00       | 0.00% |
| 个人   | -              | -   | -              | -              | -              | -          | -     |
| -  | -              | -   | -              | -              | -              | -          | -     |
| 产品特有风险   |                |   |                |                |                |            |       |
| <p>报告期内,本基金存在单一投资者持有份额占比达到或超过 20%的情形,由此可能导致的特有风险包括:产品流动性风险、巨额赎回风险以及净值波动风险等。本基金管理人将持续加强投资者集中度管理,审慎确认大额申购与大额赎回,同时进一步完善流动性风险管控机制,加强对基金份额持有人利益的保护。</p> |                |   |                |                |                |            |       |

注：申购份额包含红利再投资。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局于 2018 年 4 月发布的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》的有关要求，本基金在净值化管理等方面存在与该法规要求事项不符的情形，本基金将会在充分保护基金份额持有人利益的前提下，遵照监管机构的有关要求具体制定稳妥的安排。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、国金及第七天理财债券型证券投资基金基金合同；
- 3、国金及第七天理财债券型证券投资基金托管协议；
- 4、国金及第七天理财债券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；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

### 12.2 存放地点

本基金基金管理人的办公场所：北京海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 87 号 D 座 14 层。

### 12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的办公场所或基金管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：4000-2000-18

公司网址：www.gfund.com

国金基金管理有限公司

2018 年 8 月 24 日