

国金量化添利定期开放债券型发起式证券  
投资基金  
2019 年半年度报告

2019 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 27 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 26 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 2019 年 1 月 1 日起至 2019 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.....	7
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.....	12
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.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>46</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	46
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	46
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	52
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	52
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	53
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	53
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	53
7.11 投资组合报告附注.....	53
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>55</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	55
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	55
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>56</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>57</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	57
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.....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
10.4 基金投资策略的改变.....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
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.....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57
10.8 其他重大事件.....	58
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>60</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 .....	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	60
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>61</b>
12.1 备查文件目录.....	61
12.2 存放地点.....	61
12.3 查阅方式.....	61

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简称	国金量化添利
场内简称	-
基金主代码	006189
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型定期开放
基金合同生效日	2018 年 11 月 2 日
基金管理人	国金基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	106,465,149.89 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	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	<p>本基金在封闭期和开放期采取不同的投资策略。</p> <p>1、封闭期投资策略</p> <p>（1）债券投资策略</p> <p>债券类资产投资主要用于提高非股票资产的收益率，基金管理人将坚持价值投资的理念，严格控制风险，追求合理的回报。</p> <p>在债券投资方面，基金管理人将以宏观形势及利率分析为基础，依据国家经济发展规划量化核心基准参照指标和辅助参考指标，结合货币政策、财政政策的实施情况，以及国际金融市场基准利率水平及变化情况，预测未来基准利率水平变化趋势与幅度，进行定量评价。</p> <p>（2）股票投资策略</p> <p>本基金股票部分以“量化投资”为主要投资策略，“阿尔法多因子选股模型”进行股票选择并据此构建股票投资组合。在实际运行过程中将定期或不定期地进行修正，优化股票投资组合。</p> <p>2、开放期投资策略</p> <p>本基金以定期开放方式运作，即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。开放期内，基金规模将随着投资人对本基金份额的申购</p>

	与赎回而不断变化。因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性，以应付当时市场条件下的赎回要求，并降低资产的流动性风险，做好流动性管理。
业绩比较基准	中债总全价指数收益率×80%+中证 500 指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属于债券型基金，其风险和预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金及股票型基金。

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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈广龙	吴玉婷
	联系电话	010-88005888	021-52629999—212052
	电子邮箱	chenguanglong@gfund.com	015289@cib.com.cn
客户服务电话		4000-2000-18	95561
传真		010-88005666	021-62535823
注册地址		北京市怀柔区府前街三号楼 3-6	福州市湖东路 154 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	上海市江宁路 168 号兴业大厦 20 楼
邮政编码		100089	200041
法定代表人		尹庆军	高建平

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金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(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	4,279,958.71
本期利润	3,939,247.45
加权平均基金份额本期利润	0.0289
本期加权平均净值利润率	2.83%
本期基金份额净值增长率	2.93%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	3,538,600.07
期末可供分配基金份额利润	0.0332
期末基金资产净值	110,078,693.78
期末基金份额净值	1.0339
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	3.39%

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。

2. 期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分）。

3. 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。

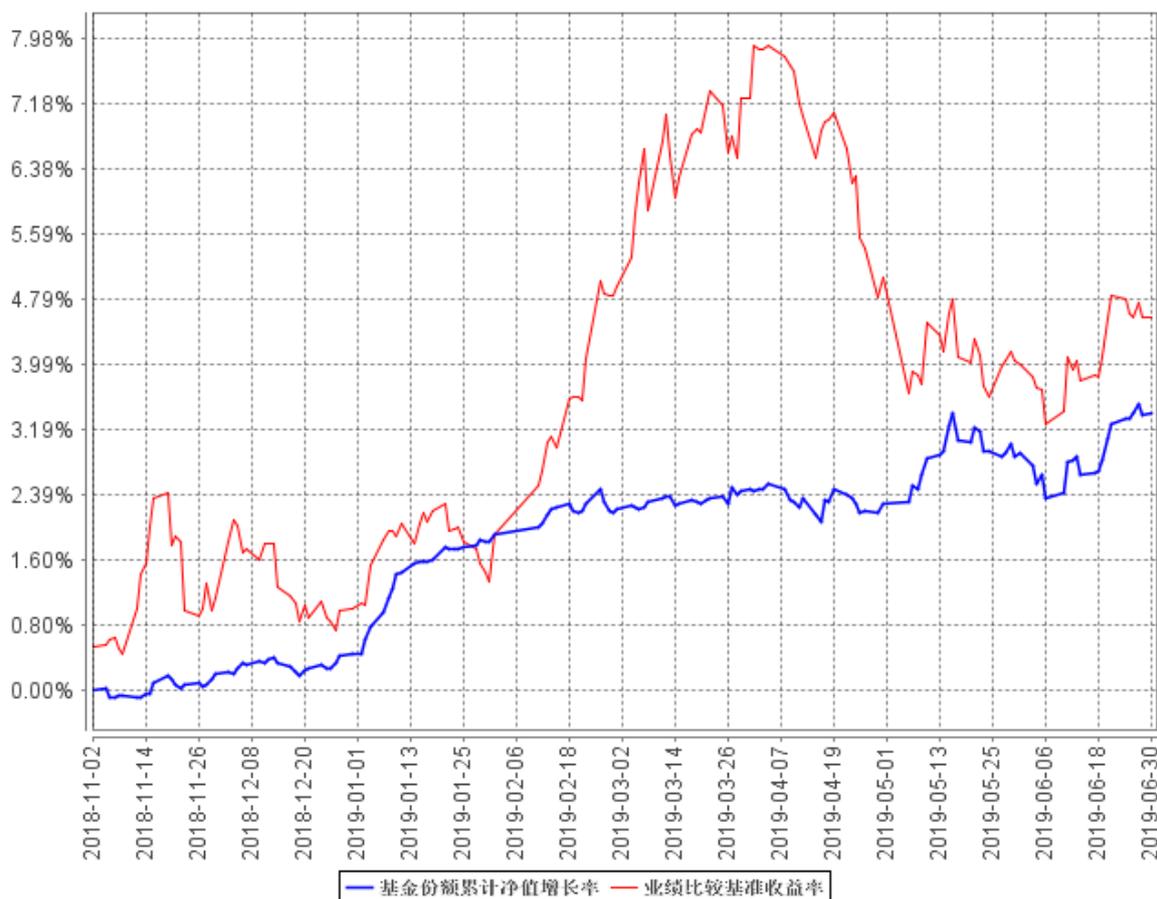
#### 3.2 基金净值表现

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.46%	0.16%	0.57%	0.24%	-0.11%	-0.08%
过去三个月	0.91%	0.14%	-2.50%	0.34%	3.41%	-0.20%
过去六个月	2.93%	0.11%	3.52%	0.34%	-0.59%	-0.23%
自基金合同生效起至今	3.39%	0.10%	4.58%	0.33%	-1.19%	-0.23%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同生效日为 2018 年 11 月 2 日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。

2、根据基金合同规定：基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金建仓期为 2018 年 11 月 2 日至 2019 年 5 月 1 日，建仓期结束时本产品各项资产配置比例符合合同约定。

### 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。公司注册资本为3.6亿元人民币，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2019年6月30日，国金基金管理有限公司共管理16只公募基金，具体包括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、国金金腾通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、国金量化多因子股票型证券投资基金、国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金、国金惠盈纯债债券型证券投资基金、国金惠鑫短债债券型证券投资基金、国金标普中国A股低波红利指数增强证券投资基金（LOF）。

#### 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		
尹海峰	本基金基金经理，研究部总经理	2019年2月12日	-	8	中央财经大学硕士。2011年7月至2016年6月历任中债资信评估有限责任公司信用评级部任研究员，泰康资产管理有限责任公司信用评级部担任信用评级研究总监、信用评级研究高级经理。2016年6月6日加入国金基金管理有限公司，历任固定收益部信用研究主管；现任研究部总经理。
徐艳芳	本基金基金经理，国金众赢货币、国金	2018年11月2日	-	11	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

	及第七天理财、国金民丰回报、国金国鑫发起、国金惠鑫短债基金经理, 固定收益投资部总经理				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; 现任固定收益投资部总经理兼基金经理。
杨雨龙	本基金基金经理, 国金量化多因子、国金鑫瑞灵活、国金量化多策略、国金民丰回报基金经理, 量化投资事业二部总经理	2018 年 11 月 2 日	-	10	杨雨龙先生, 北京大学硕士。2007 年 7 月至 2009 年 9 月在招商银行股份有限公司计划财务部任管理会计, 2009 年 10 月至 2011 年 9 月在博时基金管理有限公司交易部任股票交易员, 2011 年 10 月至 2014 年 7 月在兴业证券股份有限公司研究所任金融工程高级分析师, 2014 年 7 月至 2017 年 6 月在摩根士丹利华鑫基金管理有限公司任量化投资部副总监、基金经理。2017 年 6 月加入国金基金管理有限公司, 任量化投资事业二部总经理。

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》、《国金量化添利定期开放债券型发起式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

2019 年上半年国内经济增长呈现出稳步下行的走势。一季度内，基建投资在地方政府债券发行安排前置及项目审批速度加快等逆周期政策支持下继续托底经济，房地产投资得益于前期存量项目的施工推进仍处高位，尽管制造业投资有所放缓，但宽货币向宽信用政策传导效果正逐步体现，工业增长动能有支撑；进出口面临外需低迷的不利环境，叠加春节错位导致同比数据显著回落，贸易战背景下仍面临较大不确定性；居民部门收入增幅放缓且杠杆水平升至高位，消费整体表现一般，短期难以支撑经济；猪瘟疫情扩大化推动猪价不断攀升高位，市场通胀预期逐步升温。央行货币政策延续宽松基调，银行间流动性维持“合理充裕”，资金利率中枢处于低位，但公开市场操作开始降次减量，流动性净投放明显减少，货币市场利率波动性加大，反映出政策态度已有边际收紧迹象。二季度开始，宽信用政策效果显现，宏观经济数据和金融数据表现超预期，货币政策例会重提“总闸门”“防风险”回归中性，市场资金面整体趋紧，利空因素集中释放推动债市收益率快速上行。5 月份开始，中美贸易战升温、经济数据有所回落且资金面紧张得到缓解，市场走势得到修复。后期伴随外围经济衰退风险上升以及全球央行政策转向宽松，国内市场对基本面企稳出现分歧，潜在上升的通胀压力以及中美贸易战走向反复等因素持续扰动债市预期，债市收益率震荡下行。5 月下旬，包商银行被接管打破同场刚兑信仰，中小银行和非银机构融资压力增大，解杠杆倒逼低等级信用债异常成交明显增多，金融市场流动性结构和信用债市场明显分

层，信用交易和金融产品面临重新定价。尽管央行、证监会等监管机构在 6 月中下旬通过定向公开市场操作以及窗口指导等手段稳定市场情绪，缓解市场紧张局面，但信用分化已对市场格局产生深远影响。

在多空信号博弈的环境中，2019 年上半年国内债券市场总体表现为震荡格局。组合在报告期内采取稳健操作，严格管控流动性风险和信用风险，通过配置利率债和高等级高流动性信用债把握市场阶段性机会，推动组合收益水平获得提升。

#### 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 2.93%，同期业绩比较基准收益率为 3.52%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，我们认为 2019 年下半年的国内经济基本面下行可能性仍然较大。从内需来看，上半年基建和消费等经济动能已提前透支，受地方政府隐性债务不新增的政策红线约束基建托底效果预计有限；以汽车为代表的消费对经济拉动贡献开始减弱；由于缺乏需求支撑，制造业投资的内生增长动力预计不足；“房住不炒”再次得到了强调，“降低宏观经济对房地产行业依赖”的政策基调没有发生改变，陆续出台的针对房企信托贷款、银行贷款、美元债、供应链金融等多个融资渠道的监管政策将对下半年房地产投资形成掣肘；外需上观察，全球经济增长前景减缓，中美贸易摩擦问题扩散化、长期化导致出口面临的不确定性短期难以解决，总体来看 2019 年下半年经济增长仍有较大的下行压力。而市场资金面预计仍会维持宽松状态，资金成本维持较低位置。

基于以上分析，本基金认为债市有基本面和资金面的支撑，我们对下半年的债券市场继续看好。三季度投资策略上，本基金将维持适度杠杆水平，采取中性久期，在严格控制信用风险的前提下，对组合配置进行不断优化调整。

#### 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**

根据基金相关法律法规和基金合同，结合本基金实际运作情况，本报告期内，本基金未进行利润分配。

#### **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

本托管人依据《国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》与《国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》，自 2018 年 11 月 2 日起托管国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金（以下称本基金）的全部资产。

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

### 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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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：国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,490,084.57	6,523.81
结算备付金		1,596,788.09	3,885,865.57
存出保证金		26,394.24	7,326.37
交易性金融资产	6.4.7.2	163,945,474.11	193,308,421.20
其中：股票投资		10,394,282.11	-
基金投资		-	-
债券投资		153,551,192.00	193,308,421.20
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	-	-
应收证券清算款		308,829.82	54,204.59
应收利息	6.4.7.5	2,492,834.36	3,844,483.61
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		169,860,405.19	201,106,825.15
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 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		59,199,865.90	50,300,000.00
应付证券清算款		337,887.44	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		45,014.53	63,902.68
应付托管费		9,002.89	12,780.53
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	40,696.85	-
应交税费		15,761.42	17,153.88

应付利息		24,782.53	-9,159.09
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	108,699.85	33,385.00
负债合计		59,781,711.41	50,418,063.00
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	106,465,149.89	150,011,600.00
未分配利润	6.4.7.10	3,613,543.89	677,162.15
所有者权益合计		110,078,693.78	150,688,762.15
负债和所有者权益总计		169,860,405.19	201,106,825.15

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0339 元，基金份额总额 106,465,149.89 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		5,287,919.03	-
1.利息收入		4,344,365.72	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	44,501.40	-
债券利息收入		4,240,572.14	-
资产支持证券利息收入		59,241.77	-
买入返售金融资产收入		50.41	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,284,264.57	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-65,834.98	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,248,066.58	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	19,414.79	-
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	82,618.18	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-340,711.26	-
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	-	-
<b>减：二、费用</b>		1,348,671.58	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	347,366.44	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	69,473.31	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-

4. 交易费用	6.4.7.19	66,959.61	-
5. 利息支出		750,958.64	-
其中：卖出回购金融资产支出		750,958.64	-
6. 税金及附加		11,971.36	-
7. 其他费用	6.4.7.20	101,942.22	-
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		3,939,247.45	-
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		3,939,247.45	-

注：本基金基金合同自 2018 年 11 月 2 日起生效，无上年度可比期间数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	150,011,600.00	677,162.15	150,688,762.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,939,247.45	3,939,247.45
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）	-43,546,450.11	-1,002,865.71	-44,549,315.82
其中：1.基金申购款	1,455,849.89	36,687.42	1,492,537.31
2.基金赎回款	-45,002,300.00	-1,039,553.13	-46,041,853.13
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	106,465,149.89	3,613,543.89	110,078,693.78
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		



款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、债券回购、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）。

本基金投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，每次开放期前十五个工作日、开放期及开放期结束后十五个工作日的期间内，基金投资不受上述比例限。基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%。

开放期内，每个交易日日终在扣除国债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%。在封闭期内本基金不受上述 5%限制，但每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中债总全价指数收益率×80%+中证 500 指数收益率×20%。

#### 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（以下统称“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并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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 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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止会计期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移

也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### (2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

#### (3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### (4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

#### (5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的

有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### **6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金

融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### **6.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **6.4.4.11 基金的收益分配政策**

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### **6.4.4.12 分部报告**

无

#### **6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

#### 1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

#### 2. 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，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，分别按规定的比例缴纳。

### 3. 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。

### 4. 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
活期存款	1,490,084.57
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计：	1,490,084.57

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	10,326,909.71	10,394,282.11	67,372.40	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	104,032,403.78	103,591,342.00	-441,061.78
	银行间市场	49,931,830.71	49,959,850.00	28,019.29
	合计	153,964,234.49	153,551,192.00	-413,042.49
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	164,291,144.20	163,945,474.11	-345,670.09	

### 6.4.7.3 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。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

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。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	848.87
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	719.63
应收债券利息	2,491,253.96
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	11.90
合计	2,492,834.36

**6.4.7.6 其他资产**

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	37,255.40
银行间市场应付交易费用	3,441.45
合计	40,696.85

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付银行汇划手续费	60.00
预提费用	108,639.85

合计	108,699.85
----	------------

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	150,011,600.00	150,011,600.00
本期申购	1,455,849.89	1,455,849.89
本期赎回(以“-”号填列)	-45,002,300.00	-45,002,300.00
- 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	106,465,149.89	106,465,149.89

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	682,120.98	-4,958.83	677,162.15
本期利润	4,279,958.71	-340,711.26	3,939,247.45
本期基金份额交易产生的变动数	-1,423,479.62	420,613.91	-1,002,865.71
其中：基金申购款	46,116.18	-9,428.76	36,687.42
基金赎回款	-1,469,595.80	430,042.67	-1,039,553.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,538,600.07	74,943.82	3,613,543.89

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	18,227.35
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	26,113.84
其他	160.21

合计	44,501.40
----	-----------

### 6.4.7.12 股票投资收益

#### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	20,275,258.63
减：卖出股票成本总额	20,341,093.61
买卖股票差价收入	-65,834.98

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019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	1,248,066.58
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	1,248,066.58

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	243,068,352.51
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	237,130,776.17
减：应收利息总额	4,689,509.76
买卖债券差价收入	1,248,066.58

#### 6.4.7.13.3 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。

**6.4.7.13.4 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。

**6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	8,080,433.97
减：卖出资产支持证券成本总额	8,000,000.00
减：应收利息总额	61,019.18
资产支持证券投资收益	19,414.79

**6.4.7.14 贵金属投资收益****6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.14.3 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投资收益。

**6.4.7.14.4 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投资收益。

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

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	82,618.18

基金投资产生的股利收益	-
合计	82,618.18

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	-340,711.26
——股票投资	67,372.40
——债券投资	-408,083.66
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-340,711.26

#### 6.4.7.18 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	63,458.86
银行间市场交易费用	3,500.75
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	66,959.61

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	61,844.66
上清所查询服务费	100.00
银行费用	3,202.37
中债债券账户维护费	6,000.00
上清所账户维护费	6,000.00
合计	101,942.22

**6.4.7.21 分部报告**

无

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的重大资产负债表日后事项。

**6.4.9 关联方关系****6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期未发生变化。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

关联方名称	与本基金的关系
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
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

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

注：1. 本基金本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

2. 本基金基金合同自 2018 年 11 月 2 日起生效，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

注：1. 本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

2. 本基金基金合同自 2018 年 11 月 2 日起生效，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：1. 本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

2. 本基金基金合同自 2018 年 11 月 2 日起生效，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：1. 本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

2. 本基金基金合同自 2018 年 11 月 2 日起生效，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期末无应支付关联方的佣金。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	347,366.44	-
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：1. 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。管理费计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

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。经基金管理人与基金托管人双方核对无

误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 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、公休假或不可抗力致使无法按时支付的，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。

3. 本基金基金合同自 2018 年 11 月 2 日起生效，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	69,473.31	-

注：1. 本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

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，由基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

3. 本基金基金合同自 2018 年 11 月 2 日起生效，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：无

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 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
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
基金合同生效日（2018年	10,000,600.00	-

11 月 2 日 ) 持有的基金份额		
期初持有的基金份额	10,000,600.00	-
期间申购/买入总份额	1,455,849.89	-
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	11,456,449.89	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	10.7608%	-

注: 本基金基金合同自 2018 年 11 月 2 日起生效, 无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.4.2 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

份额单位: 份

关联方名称	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总 份额的比 例	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总 份额的比 例
北 京 千 石 创 富 资 本 管 理 有 限 公 司	9,999,600.00	9.3924%	-	-

注: 本基金基金合同自 2018 年 11 月 2 日起生效, 无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.5 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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
兴业银行	1,490,084.57	18,227.35	-	-

注: 1. 本基金的银行存款由基金托管人兴业银行行保管, 按银行同业利率或约定的利率计息。

2. 本基金基金合同自 2018 年 11 月 2 日起生效, 无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注: 本基金于本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本期末未持有认购新发或增发证券。

##### 6.4.12.2 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。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末 2019 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 9,409,915.07 元，是以如下债券作为质押：

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
190205	19国开05	2019年7月5日	97.95	100,000	9,795,000.00
合计				100,000	9,795,000.00

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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。

#### **6.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，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。

##### **6.4.13.2.1 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 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	5,297,350.00	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	5,297,350.00	-

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短期信用评级。

#### 6.4.13.2.2 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短期信用评级的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.3 按短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短期信用评级的同业存单。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
AAA	12,461,794.00	8,383,440.00
AAA 以下	105,159,948.00	169,328,881.20
未评级	-	10,051,000.00
合计	117,621,742.00	187,763,321.20

注：表中所列示的债券投资为除短期融资券、超短期融资券及其他按短期信用评级的债券投资、国债、政策性金融债、央行票据以外的债券。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末未持有长期信用评级的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.6 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长期信用评级的同业存单。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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。

### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无

### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的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》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。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，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。

### 6.4.13.4 市场风险

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

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 年 6	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
-----------------	--------	-----------	----------	-------	-------	-----	----

月 30 日							
资产							
银行存款	1,490,084.57	-	-	-	-	-	1,490,084.57
结算备付金	1,596,788.09	-	-	-	-	-	1,596,788.09
存出保证金	26,394.24	-	-	-	-	-	26,394.24
交易性金融资产	2,940,900.00	-102,687,552.00	18,300,740.00	29,622,000.00	10,394,282.11		163,945,474.11
应收证券清算款	-	-	-	-	308,829.82		308,829.82
应收利息	-	-	-	-	2,492,834.36		2,492,834.36
资产总计	6,054,166.90	-102,687,552.00	18,300,740.00	29,622,000.00	13,195,946.29		169,860,405.19
负债							
卖出回购金融资产款	59,199,865.90	-	-	-	-	-	59,199,865.90
应付证券清算款	-	-	-	-	337,887.44		337,887.44
应付管理人报酬	-	-	-	-	45,014.53		45,014.53
应付托管费	-	-	-	-	9,002.89		9,002.89
应付交易费用	-	-	-	-	40,696.85		40,696.85
应交税费	-	-	-	-	15,761.42		15,761.42
应付利息	-	-	-	-	24,782.53		24,782.53
其他负债	-	-	-	-	108,699.85		108,699.85
负债总计	59,199,865.90	-	-	-	581,845.51		59,781,711.41
利率敏感度缺口	-53,145,699.00	-102,687,552.00	18,300,740.00	29,622,000.00	12,614,100.78		110,078,693.78
上年度末 2018 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	6,523.81	-	-	-	-	-	6,523.81
结算备付金	3,885,865.57	-	-	-	-	-	3,885,865.57
存出保证金	7,326.37	-	-	-	-	-	7,326.37
交易性金融资产	6,993,750.00	-78,516,750.80	7,891,200.00	-	-	99,906,720.40	193,308,421.20

应收证券清算款						54,204.59	54,204.59
应收利息						3,844,483.61	3,844,483.61
资产总计	10,893,465.75		78,516,750.80	7,891,200.00		-103,805,408.60	201,106,825.15
负债							
卖出回购金融资产款	50,300,000.00						50,300,000.00
应付管理人报酬						63,902.68	63,902.68
应付托管费						12,780.53	12,780.53
应交税费						17,153.88	17,153.88
应付利息						-9,159.09	-9,159.09
其他负债						33,385.00	33,385.00
负债总计	50,300,000.00					118,063.00	50,418,063.00
利率敏感度缺口	-39,406,534.25		78,516,750.80	7,891,200.00		-103,687,345.60	150,688,762.15

#### 6.4.13.4.1.2 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减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影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019 年 6 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	+25 个基点	-1,161,587.53	-1,015,982.55
	-25 个基点	1,181,723.16	1,025,607.79

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于交易所上市或银行间同业市场交易

的股票和债券等，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金的风险及潜在价格风险进行度量和测试，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	10,394,282.11	9.44	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	153,551,192.00	139.49	193,308,421.20	128.28
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	163,945,474.11	148.93	193,308,421.20	128.28

注：无

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定中证 500 指数 (000905.SH) 变化 5%，其他变量不变； Beta 系数是根据组合报告期内所有交易日的净值数据和中证 500 指数数据回归得出，反映了基金和中证 500 指数的相关性。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 (2019年6月30日)	上年度末 (2018年12月31日)
分析	+5%	164,449.46	6,639.08
	-5%	-164,449.46	-6,639.08

#### 6.4.13.4.4 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 (单位: 人民币元)	本期末 (2019 年 6 月 30 日)	上年度末 (2018 年 12 月 31 日)
	合计	-	-

#### 6.4.14 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	权益投资	10,394,282.11	6.12
	其中：股票	10,394,282.11	6.12
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	153,551,192.00	90.40
	其中：债券	153,551,192.00	90.40
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,086,872.66	1.82
8	其他各项资产	2,828,058.42	1.66
9	合计	169,860,405.19	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	202,636.00	0.18
B	采矿业	340,482.00	0.31
C	制造业	6,689,604.06	6.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	460,203.00	0.42
E	建筑业	251,369.05	0.23
F	批发和零售业	583,425.00	0.53
G	交通运输、仓储和邮政业	277,107.00	0.25
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	356,326.00	0.32
J	金融业	104,313.00	0.09
K	房地产业	367,237.00	0.33
L	租赁和商务服务业	216,326.00	0.20
M	科学研究和技术服务业	110,396.00	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	58,562.00	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	183,525.00	0.17
S	综合	192,771.00	0.18
	合计	10,394,282.11	9.44

注：以上行业分类以 2019 年 6 月 30 日的证监会行业分类标准为依据。

### 7.2.2 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。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	603385	惠达卫浴	14,500	131,225.00	0.12
2	300729	乐歌股份	5,700	131,043.00	0.12
3	600173	卧龙地产	30,500	130,540.00	0.12
4	002528	英飞拓	31,700	129,653.00	0.12
5	300150	世纪瑞尔	28,400	129,504.00	0.12
6	002853	皮阿诺	6,900	128,478.00	0.12
7	300546	雄帝科技	5,100	128,469.00	0.12
8	603661	恒林股份	3,900	128,193.00	0.12
9	600873	梅花生物	26,600	127,414.00	0.12
10	002577	雷柏科技	11,800	126,850.00	0.12
11	002267	陕天然气	15,400	126,126.00	0.11
12	300621	维业股份	12,450	125,496.00	0.11
13	300609	汇纳科技	3,500	122,710.00	0.11
14	002817	黄山胶囊	5,800	120,872.00	0.11
15	600665	天地源	30,700	120,651.00	0.11
16	002724	海洋王	20,400	119,136.00	0.11
17	300652	雷迪克	5,400	118,854.00	0.11
18	000517	荣安地产	37,800	116,046.00	0.11
19	002351	漫步者	20,200	115,746.00	0.11
20	002861	瀛通通讯	5,400	114,426.00	0.10
21	603861	白云电器	11,400	114,000.00	0.10
22	603277	银都股份	11,700	113,490.00	0.10
23	002728	特一药业	6,800	113,152.00	0.10
24	300219	鸿利智汇	15,300	112,914.00	0.10
25	603037	凯众股份	5,900	112,277.00	0.10

26	603926	铁流股份	9,070	112,014.50	0.10
27	002620	瑞和股份	17,900	111,875.00	0.10
28	600310	桂东电力	22,000	111,540.00	0.10
29	603023	威帝股份	24,400	111,020.00	0.10
30	600681	百川能源	14,900	110,856.00	0.10
31	600629	华建集团	11,440	110,396.00	0.10
32	603685	晨丰科技	9,000	110,340.00	0.10
33	603380	易德龙	7,100	110,050.00	0.10
34	603015	弘讯科技	15,500	109,585.00	0.10
35	002458	益生股份	5,600	109,256.00	0.10
36	300434	金石东方	12,500	109,250.00	0.10
37	002452	长高集团	26,600	108,528.00	0.10
38	603829	洛凯股份	9,900	108,405.00	0.10
39	002608	江苏国信	12,700	108,331.00	0.10
40	603507	振江股份	5,100	108,018.00	0.10
41	601168	西部矿业	16,800	107,184.00	0.10
42	000530	大冷股份	24,500	106,330.00	0.10
43	600293	三峡新材	25,700	105,884.00	0.10
44	603298	杭叉集团	8,300	105,078.00	0.10
45	603331	百达精工	6,300	104,517.00	0.09
46	002884	凌霄泵业	7,000	102,760.00	0.09
47	000821	京山轻机	12,600	102,186.00	0.09
48	600497	驰宏锌锗	20,100	102,108.00	0.09
49	603855	华荣股份	11,600	101,848.00	0.09
50	300146	汤臣倍健	5,200	100,880.00	0.09
51	002272	川润股份	18,300	100,650.00	0.09
52	603667	五洲新春	12,000	100,200.00	0.09
53	600673	东阳光	12,700	99,695.00	0.09
54	300620	光库科技	2,700	99,117.00	0.09
55	603976	正川股份	6,200	98,890.00	0.09
56	300583	赛托生物	3,000	98,850.00	0.09
57	000869	张裕A	3,066	98,479.92	0.09
58	002873	新天药业	6,312	97,646.64	0.09
59	603757	大元泵业	6,700	97,485.00	0.09
60	600350	山东高速	20,300	97,440.00	0.09
61	603156	养元饮品	2,600	96,408.00	0.09
62	000411	英特集团	7,400	96,126.00	0.09
63	300571	平治信息	2,300	95,565.00	0.09
64	300519	新光药业	6,800	95,540.00	0.09

65	600269	赣粤高速	21,300	94,572.00	0.09
66	300511	雪榕生物	11,600	93,380.00	0.08
67	600551	时代出版	10,000	90,700.00	0.08
68	002878	元隆雅图	3,200	88,704.00	0.08
69	300610	晨化股份	7,100	88,679.00	0.08
70	300061	康旗股份	12,900	88,623.00	0.08
71	600229	城市传媒	11,800	88,618.00	0.08
72	002053	云南能投	11,200	88,480.00	0.08
73	601500	通用股份	12,500	88,375.00	0.08
74	002187	广百股份	10,600	88,298.00	0.08
75	600319	亚星化学	17,800	88,110.00	0.08
76	603033	三维股份	5,100	88,077.00	0.08
77	002802	洪汇新材	4,200	87,864.00	0.08
78	600865	百大集团	14,300	87,230.00	0.08
79	300522	世名科技	5,200	86,112.00	0.08
80	600828	茂业商业	17,100	85,842.00	0.08
81	600611	大众交通	18,300	85,095.00	0.08
82	000985	大庆华科	5,900	85,078.00	0.08
83	600785	新华百货	5,100	84,762.00	0.08
84	002753	永东股份	9,800	84,672.00	0.08
85	002763	汇洁股份	9,400	80,088.00	0.07
86	603958	哈森股份	9,800	77,714.00	0.07
87	002543	万和电气	5,600	75,152.00	0.07
88	000921	海信家电	6,000	74,880.00	0.07
89	000782	美达股份	15,600	68,796.00	0.06
90	603238	诺邦股份	3,700	64,010.00	0.06
91	000415	渤海租赁	16,200	63,504.00	0.06
92	002392	北京利尔	17,900	62,650.00	0.06
93	002403	爱仕达	7,300	62,342.00	0.06
94	600390	五矿资本	6,600	62,238.00	0.06
95	603300	华铁科技	7,600	60,648.00	0.06
96	002225	濮耐股份	12,200	55,998.00	0.05
97	002346	柘中股份	4,300	55,814.00	0.05
98	600862	中航高科	5,300	47,647.00	0.04
99	300600	瑞特股份	2,400	46,728.00	0.04
100	002829	星网宇达	2,200	45,650.00	0.04
101	600508	上海能源	4,600	44,574.00	0.04
102	002128	露天煤业	5,100	44,115.00	0.04
103	601001	大同煤业	9,300	42,501.00	0.04

104	600051	宁波联合	5,700	35,283.00	0.03
105	600070	浙江富润	4,300	34,916.00	0.03
106	600603	广汇物流	7,400	33,448.00	0.03
107	600784	鲁银投资	5,900	30,444.00	0.03
108	002059	云南旅游	4,700	30,268.00	0.03
109	600082	海泰发展	6,400	29,184.00	0.03
110	603136	天目湖	1,400	28,294.00	0.03
111	002756	永兴特钢	1,800	26,280.00	0.02
112	002478	常宝股份	3,900	23,595.00	0.02
113	600016	民生银行	3,500	22,225.00	0.02
114	600126	杭钢股份	4,600	20,976.00	0.02
115	600000	浦发银行	1,500	17,520.00	0.02
116	603887	城地股份	821	13,998.05	0.01
117	002316	亚联发展	1,100	8,547.00	0.01
118	603488	展鹏科技	800	6,688.00	0.01
119	601801	皖新传媒	700	4,207.00	0.00
120	002712	思美传媒	500	3,470.00	0.00
121	000600	建投能源	500	3,350.00	0.00
122	600053	九鼎投资	100	2,330.00	0.00
123	603633	徕木股份	200	2,314.00	0.00
124	603116	红蜻蜓	300	2,286.00	0.00
125	603608	天创时尚	100	742.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002577	雷柏科技	281,834.00	0.19
2	603385	惠达卫浴	279,011.00	0.19
3	002853	皮阿诺	254,068.00	0.17
4	300571	平治信息	251,972.00	0.17
5	002861	瀛通通讯	233,561.00	0.15
6	603507	振江股份	227,566.00	0.15
7	600629	华建集团	220,841.00	0.15
8	002608	江苏国信	213,948.00	0.14
9	603380	易德龙	212,916.00	0.14

10	300150	世纪瑞尔	205,910.00	0.14
11	603156	养元饮品	200,631.00	0.13
12	600673	东阳光	199,734.00	0.13
13	603661	恒林股份	198,766.00	0.13
14	000869	张裕 A	197,891.00	0.13
15	300511	雪榕生物	195,834.00	0.13
16	603855	华荣股份	192,384.00	0.13
17	002062	宏润建设	189,713.00	0.13
18	002878	元隆雅图	187,676.00	0.12
19	002753	永东股份	187,558.00	0.12
20	002053	云南能投	186,590.00	0.12

注：上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002062	宏润建设	191,958.55	0.13
2	603198	迎驾贡酒	191,397.50	0.13
3	000906	浙商中拓	177,328.00	0.12
4	002746	仙坛股份	168,293.80	0.11
5	002462	嘉事堂	164,634.40	0.11
6	603669	灵康药业	157,131.40	0.10
7	002577	雷柏科技	156,009.97	0.10
8	300571	平治信息	154,142.23	0.10
9	002771	真视通	149,045.41	0.10
10	600976	健民集团	144,480.44	0.10
11	603385	惠达卫浴	143,375.00	0.10
12	603165	荣晟环保	143,358.43	0.10
13	603589	口子窖	140,970.91	0.09
14	603059	倍加洁	134,254.81	0.09
15	300270	中威电子	133,722.54	0.09
16	300550	和仁科技	131,980.49	0.09
17	000046	泛海控股	130,454.24	0.09
18	300155	安居宝	129,090.61	0.09
19	002799	环球印务	128,862.57	0.09
20	600327	大东方	125,150.53	0.08

注：上述卖出金额为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	30,668,003.32
卖出股票收入（成交）总额	20,275,258.63

注：上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

### 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	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,632,100.00	27.83
	其中：政策性金融债	30,632,100.00	27.83
4	企业债券	97,250,358.00	88.35
5	企业短期融资券	5,297,350.00	4.81
6	中期票据	15,040,500.00	13.66
7	可转债（可交换债）	5,330,884.00	4.84
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	153,551,192.00	139.49

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	190205	19 国开 05	200,000	19,590,000.00	17.80
2	143553	18 市政 02	100,000	10,637,000.00	9.66
3	190210	19 国开 10	100,000	10,032,000.00	9.11
4	101900134	19 首钢 MTN001	100,000	10,028,000.00	9.11
5	152065	18 湘高速	100,000	9,966,000.00	9.05

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.10.1 本期国债期货投资政策**

报告期内本基金未进行国债期货投资。

**7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

注：本基金本报告期末投资国债期货。

**7.10.3 本期国债期货投资评价**

本基金报告期内未参与国债期货投资。

**7.11 投资组合报告附注****7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明**

本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本期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。

**7.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明**

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

**7.11.3 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	26,394.24
2	应收证券清算款	308,829.82
3	应收股利	-
4	应收利息	2,492,834.36
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,828,058.42

**7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113009	广汽转债	2,256,744.00	2.05
2	113008	电气转债	497,728.00	0.45
3	128020	水晶转债	198,420.00	0.18
4	127004	模塑转债	110,328.00	0.10
5	113521	科森转债	100,900.00	0.09
6	123017	寒锐转债	100,322.00	0.09

### 7.11.5 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。

### 7.11.6 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
4	26,616,287.47	106,465,149.89	100.00%	-	-

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占 基金总份额 比例（%）	发起份额总数	发起份额占 基金总份额 比例（%）	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有 资金	11,456,449.89	10.76	10,000,600.00	9.39	3年
基金管理人高级 管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	11,456,449.89	10.76	10,000,600.00	9.39	3年

注：本基金成立后有 10,000,600.00 份额为发起份额，发起份额承诺的持有期限为 3 年，自 2018 年 11 月 2 日起至 2021 年 11 月 1 日止。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年11月2日）基金份额总额	150,011,600.00
本报告期期初基金份额总额	150,011,600.00
本报告期期间基金总申购份额	1,455,849.89
减：本报告期期间基金总赎回份额	45,002,300.00
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	106,465,149.89

注：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。

## § 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

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

本报告期本基金投资策略未发生改变。

### 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例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券	1	25,780,443.63	50.61%	18,853.39	50.61%	-
华创证券	1	25,162,818.32	49.39%	18,402.01	49.39%	-
银河证券	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，向多家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
东方证券	45,572,941.82	20.14%	401,800,000.00	10.66%	-	-
华创证券	180,695,138.91	79.86%	3,368,000,000.00	89.34%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《关于增加大连网金基金销售有限公司为国金基金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	2019年1月4日
2	《关于增加阳光人寿保险股份有限公司为国金基金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	2019年1月10日
3	《关于国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理变更的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019年2月12日
4	《关于暂停大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019年2月23日
5	《关于北京懒猫金融服务有限公司终止代理销售国金基金管理有限公司旗下基金的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019年4月18日
6	《国金量化添利定期开放债券型	指定披露媒体和本	2019年4月22日

	发起式证券投资基金 2019 年第 1 季度报告》	基金基金管理人网站	
7	《国金基金管理有限公司关于增加泰信财富、奕丰金融为国金基金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	2019 年 4 月 25 日
8	《关于国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019 年 4 月 29 日
9	《关于国金基金管理有限公司开通旗下部分基金转换业务的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019 年 5 月 22 日
10	《关于增加通华财富（上海）基金销售有限公司为旗下部分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	2019 年 5 月 28 日
11	《关于增加国都证券、平安证券为国金基金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	2019 年 6 月 11 日
12	《国金基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019 年 6 月 21 日

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份额净值，在封闭期内至少每周公告 1 次基金的资产净值和份额净值。

## § 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	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	45,005,300.00	-	-	45,005,300.00	42.27%
	2	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	40,003,800.00	-	-	40,003,800.00	37.57%
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：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无
---

## § 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、国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同；
- 3、国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议；
- 4、国金量化添利定期开放债券型发起式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

2019 年 8 月 27 日