

国金民丰回报 6 个月定期开放混合型证券
投资基金
2021 年第 2 季度报告

2021 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

报告送出日期：2021 年 7 月 20 日

§ 1 重要提示

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

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2021 年 7 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 4 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国金民丰回报
场内简称	-
交易代码	005018
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2017 年 11 月 24 日
报告期末基金份额总额	20,075,319.89 份
投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金资产配置策略主要是以市场波动率分析为基础，兼顾经济结构调整过程中相关政策与法规的变化、证券市场环境、金融市场利率变化、经济运行周期、投资者情绪以及证券市场不同类别资产的风险/收益状况等，动态调整资产配置比例。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>固定收益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>

本基金可投资于中小企业私募债。由于中小企业私募债券整体流动性相对较差，且整体信用风险相对较高。中小企业私募债券的这两个特点要求在具体的投资过程中，应采取更为谨慎的投资策略。本基金投资该类债券的核心要点是分析和跟踪发债主体的信用基本面，并综合考虑信用基本面、债券收益率和流动性等要素，确定最终的投资决策。

3、可转换债券投资策略

本基金根据对可转换债券的发行条款和对应基础证券的估值与价格变化的研究，采用买入低转换溢价率的债券并持有的投资策略，密切关注可转换债券市场与股票市场之间的互动关系，选择恰当的时机进行套利，获得超额收益。

4、资产支持证券投资策略

资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析，本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

5、量化选股模型

本基金主要采用以阿尔法为主的多策略量化投资模型。

(1) 多因子选股策略

本基金股票部分的构建主要采用 Alpha 多因子选股模型。根据对中国证券市场运行特征的长期研究，利用长期积累并最新扩展的大量因子信息，引入先进的因子筛选技术，动态捕捉市场热点，快速适应新的市场环境，对全市场股票进行筛选，增大组合的超市场收益。本基金在股票投资过程中，强调投资纪律，降低随意性投资带来的风险，力争实现基金资产长期稳定增值。

(2) 统计套利策略

本基金通过对股票大量数据的回溯研究，用量化统计分析工具找出市场内部个股之间的稳定性关系，将套利建立在对历史数据进行统计分析的基础之上，估计相关变量的概率分布，尝试以较高的成功概率进行套利。

(3) 事件驱动套利策略

本基金通过挖掘和深入分析可能造成股价异常波动的时间以及对过往事件的数据检测，获取时间影响所带来的超额投资回报。

(4) 投资组合优化

本基金根据量化风险模型对投资组合进行优化，调整个股权重，在控制风险的前提下追求收益最大化。

	<p>6、股指期货投资策略</p> <p>本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择的投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。通过对证券市场和期货市场进行量化研究，结合股指期货定价模型寻求其合理的估值水平，在法律法规允许的范围内进行相应投资操作。</p> <p>7、国债期货投资策略</p> <p>国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将以套期保值为目的，按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。</p> <p>8、权证投资策略</p> <p>本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型寻求其合理估值水平，并充分考虑权证资产的收益性、流动性、风险性特征，主要考虑运用的策略主要包括：价值挖掘策略、获利保护策略、杠杆策略、双向权证策略、价差策略、买入保护性的认沽权证策略、卖空保护性的认购权证策略等。</p> <p>9、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。</p>
业绩比较基准	80%×中证全债指数收益率+15%×沪深 300 指数收益率+5%×同期银行活期存款利率（税后）。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021年4月1日—2021年6月30日）
1. 本期已实现收益	51,313.98
2. 本期利润	171,236.50
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0085
4. 期末基金资产净值	23,080,381.06
5. 期末基金份额净值	1.1497

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（不含公允价值变动损益）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损益。

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

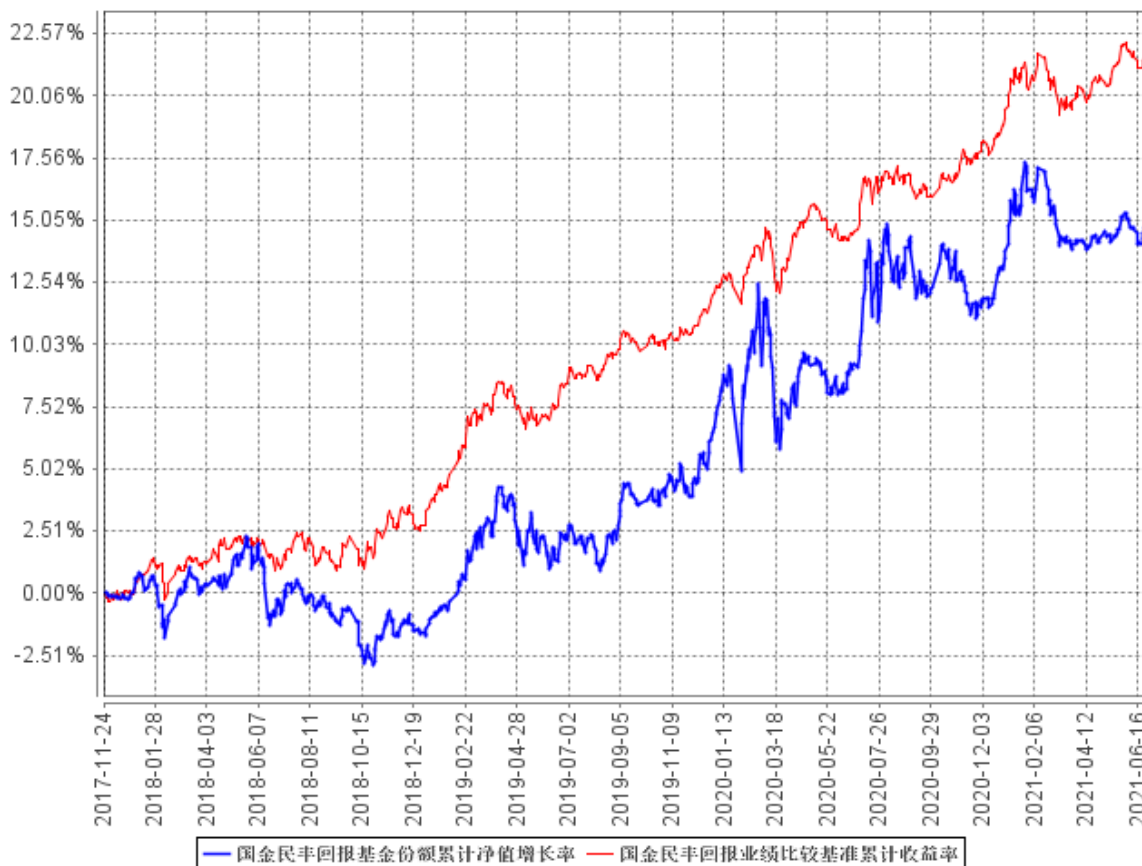
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	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
过去三个月	0.74%	0.13%	1.61%	0.15%	-0.87%	-0.02%
过去六个月	1.05%	0.25%	2.02%	0.20%	-0.97%	0.05%
过去一年	4.88%	0.38%	6.12%	0.20%	-1.24%	0.18%
过去三年	15.29%	0.39%	20.18%	0.20%	-4.89%	0.19%
自基金合同 生效起至今	14.97%	0.37%	21.93%	0.19%	-6.96%	0.18%

注：本基金的业绩比较基准为：中证全债指数收益率×80%+沪深300指数收益率×15%+同期银行活期存款利率（税后）×5%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

国金民丰回报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：本基金基金合同生效日为 2017 年 11 月 24 日，图示日期为 2017 年 11 月 24 日至 2021 年 6 月 30 日。

3.3 其他指标

无

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张航	本基金基金经理，	2019 年 9 月 16 日	-	14	张航先生，中央财经大学博士。2006 年 6

	国金国鑫发起、国金鑫意医药消费、国金鑫悦经济新动能、国金自主创新、国金惠诚基金经理，主动权益投资部总经理兼主动权益投资总监				月至 2011 年 4 月在长盛基金管理有限公司任研究部研究员，2011 年 4 月至 2016 年 4 月先后历任新华资产管理有限公司首席策略研究员、消费行业研究组组长、股票投资经理，2016 年 4 月至 2016 年 8 月在北京汇垠天然投资基金管理有限公司投资部任常务副总裁，2016 年 9 月至 2019 年 1 月任北京忠诚志业资本管理有限公司研究部研究总监、副总经理。2019 年 2 月加入国金基金管理有限公司，历任主动权益投资副总监；现任主动权益投资部总经理兼主动权益投资总监。
徐艳芳	本基金基金经理，国金众赢货币、国金及第中短债、国金惠宁中短期利率债、国金惠鑫短债基金经理，固定收益投资部总经理	2017 年 11 月 24 日	-	12	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；现任固定收益投资部总经理兼基金经理。
刘佳蕾	本基金基金经理，研究部固收研究副总监	2021 年 5 月 27 日	-	4	刘佳蕾女士，美国明尼苏达大学双城分校硕士。2011 年 8 月至 2016 年 4 月任泰康资产管理有限责任公司产品研发中心高级产品经理，2016 年 12 月加入国金基金管理有

					限公司，历任产品中心副总经理，现任研究部固收研究副总监。
--	--	--	--	--	------------------------------

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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

截至本报告期末，不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》《国金民丰回报 6 个月定期开放混合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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，国内经济基本面仍处于新冠疫情后的修复通道中，景气指数的表现也处于扩张区间，但是经济修复动能逐步弱化。随着全球产业链的修复以及外围流动性的逐步退潮，出口的增速放缓；消费恢复仍然较慢，消费能力和意愿受疫情影响，预防性储蓄上升；房地产调控、地方债务管控趋严，紧信用对经济的抑制作用显现。上半年财政政策发力较慢，也给下半年留出较大空间。在资金面上，央行货币政策以稳为主，实施倾向直达货币政策工具，运用多种手段支持小微企业，引导银行扩大信用贷款等支持实体经济。银行间资金总体宽松，机构跨季顺利。在社融和信贷方面，监管政策在超预期收紧，各地严查经营贷和消费贷进入房市，在 1、2 月份的贷款超预期放量后，在全年总量已定的情况下，后续的贷款额度空间有限，二季度社融和信贷增速整体仍呈下行态势。从债市表现来看，尽管市场有对税期、利率供给增加、通胀上行等因素的担心，但经济修复边际转弱、信用收缩、机构欠配等因素主导了债市收益变化的方向。3 月中旬以来资金利率逐渐回落，债市呈现震荡修复状态；6 月以来，流动性边际趋紧，资金利率中枢有所上行，债市的乐观预期又有所修正。组合在二季度的震荡行情下整体维持谨慎，以票息策略为主，适度参与利率品的波段操作。由于权益市场的震荡风险在二季度依然存在，组合在大类资产配置策略上维持权益类资产的偏低仓位，同时精选个券和标的，择机参与一级和二级可转债的投资，在绝对收益目标基础上增厚组合收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值 1.1497 元，累计单位净值 1.1497 元。本报告期内，本基金份额净值增长率为 0.74%，同期业绩比较基准收益率为 1.61%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期，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的情况。截至本报告期末，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。本基金管理人已经按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》向中国证监会报告并提出解决方案。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,108,696.00	9.10
	其中：股票	2,108,696.00	9.10
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,595,003.60	45.74
	其中：债券	10,595,003.60	45.74
	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	4,000,000.00	17.27
	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	5,908,628.06	25.51
8	其他资产	552,778.24	2.39
9	合计	23,165,105.90	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,644,885.00	7.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	270,950.00	1.17
K	房地产业	192,861.00	0.84
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,108,696.00	9.14

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金报告期末未持有港股通股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002311	海大集团	8,900	726,240.00	3.15
2	600036	招商银行	5,000	270,950.00	1.17
3	603501	韦尔股份	800	257,600.00	1.12
4	600660	福耀玻璃	4,500	251,325.00	1.09
5	002304	洋河股份	1,100	227,920.00	0.99
6	000002	万科 A	8,100	192,861.00	0.84
7	603195	公牛集团	900	181,800.00	0.79

5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	2,792,350.00	12.10
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,119,607.00	17.85
	其中：政策性金融债	4,119,607.00	17.85
4	企业债券	1,000,000.00	4.33
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-

7	可转债（可交换债）	2,683,046.60	11.62
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,595,003.60	45.90

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	018006	国开 1702	20,400	2,064,072.00	8.94
2	108604	国开 1805	20,500	2,055,535.00	8.91
3	010303	03 国债(3)	15,000	1,520,250.00	6.59
4	010107	21 国债(7)	10,500	1,052,100.00	4.56
5	136825	16 滇路 03	10,000	1,000,000.00	4.33

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在报告期内未进行股指期货投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

报告期内本基金组合适度参与国债期货套期保值策略，选择流动性好、交易活跃的国债期货

合约，对冲利率上行风险。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险指标说明
-	-	-	-	-	报告期内，本基金投资国债期货是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的，总体风险可控且符合既定的投资政策和投资目标。
公允价值变动总额合计（元）					-
国债期货投资本期收益（元）					-4,200.00
国债期货投资本期公允价值变动（元）					-

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金国债期货操作整体谨慎，通过严控持仓规模和持仓期限，有效控制风险。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行于 2020 年 12 月 25 日被中国银行保险监督管理委员会行政处罚，罚款合计 4880 万元。主要违法违规事实：（一）为违规的政府购买服务项目提供融资；（二）项目资本金管理不到位，棚改贷款项目存在资本金违规抽回情况；（三）违规变相发放土地储备贷款；（四）设置不合理存款考核要求，以贷转存，虚增存款；

（五）贷款风险分类不准确；（六）向资产管理公司以外的主体批量转让不良信贷资产；（七）违规进行信贷资产拆分转让，隐匿信贷资产质量；（八）向棚改业务代理结算行强制搭售低收益理财产品；（九）扶贫贷款存贷挂钩；（十）易地扶贫搬迁贷款“三查”不尽职，部分贷款资金未真正用于扶贫搬迁；（十一）未落实同业业务交易对手名单制监管要求；（十二）以贷款方式向金融租赁公司提供同业融资，未纳入同业借款业务管理；（十三）以协定存款方式吸收同业存款，未纳入同业存款业务管理；（十四）风险隔离不到位，违规开展资金池理财业务；（十五）未按规定向投资者充分披露理财产品投资非标准化债权资产情况；（十六）逾期未整改，屡查屡犯，违规新增业务；（十七）利用集团内部交易进行子公司间不良资产非洁净出表；（十八）违规收取小微企业贷款承诺费；（十九）收取财务顾问费质价不符；（二十）利用银团贷款承诺费浮利分费；（二十一）

向检查组提供虚假整改证明材料；（二十二）未如实提供信贷资产转让台账；（二十三）案件信息迟报、瞒报；（二十四）对以往监管检查中发现的国别风险管理问题整改不到位。

云南省交通投资建设集团有限公司于 2021 年 4 月 24 日被大理市税务局行政处罚，处罚内容如下：（1）停止违法行为；（2）限期采取补救措施（六十日内补办取水许可的有关手续；逾期不补办或者补办未被批准的，限十日内拆除取水设施，封填取水工程）；（3）处贰万元罚款。

招商银行股份有限公司于 2021 年 5 月 21 日被中国银保监会行政处罚，罚款合计 7170 万元。主要违法违规事实：一、为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产；二、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品；三、理财产品之间风险隔离不到位；四、理财资金投资非标准化债权资产认定不准确，实际余额超监管标准；五、同业投资接受第三方金融机构信用担保；六、理财资金池化运作；七、利用理财产品准备金调节收益；八、高净值客户认定不审慎；九、并表管理不到位，通过关联非银机构的内部交易，违规变相降低理财产品销售门槛；十、投资集合资金信托计划的理财产品未执行合格投资者标准；十一、投资集合资金信托计划人数超限；十二、面向不合格个人投资者销售投资高风险资产或权益性资产的理财产品；十三、信贷资产非真实转让；十四、全权委托业务不规范；十五、未按要求向监管机构报告理财投资合作机构，被监管否决后仍未及时停办业务；十六、通过关联机构引入非合格投资者，受让以本行信用卡债权设立的信托次级受益权；十七、“智能投资受托计划业务”通过其他方式规避整改，扩大业务规模，且业务数据和材料缺失；十八、票据转贴现假卖断屡查屡犯；十九、贷款、理财或同业投资资金违规投向土地储备项目；二十、理财资金违规提供棚改项目资本金融资，向地方政府提供融资并要求地方政府提供担保；二十一、同业投资、理财资金等违规投向地价款或四证不全的房地产项目；二十二、理财资金认购商业银行增发的股票；二十三、违规为企业发行短期融资券提供搭桥融资，并用理财产品投资本行主承债券以承接表内类信贷资产；二十四、为定制公募基金提供投资顾问；二十五、为本行承销债券兑付提供资金支持；二十六、协助发行人以非市场化的价格发行债券；二十七、瞒报案件信息。

上述证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。除上述情况外，本基金投资的其他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。

5.11.2 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

本期基金投资组合前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	6,869.87
2	应收证券清算款	408,602.57
3	应收股利	-
4	应收利息	137,305.80
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	552,778.24

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	123078	飞凯转债	244,220.00	1.06
2	110068	龙净转债	201,280.00	0.87
3	113611	福 20 转债	172,090.00	0.75
4	113037	紫银转债	154,755.00	0.67
5	127005	长证转债	117,140.00	0.51
6	110047	山鹰转债	116,670.00	0.51
7	113044	大秦转债	115,259.20	0.50
8	128081	海亮转债	113,710.00	0.49
9	128130	景兴转债	113,090.00	0.49
10	123086	海兰转债	110,800.00	0.48
11	128141	旺能转债	110,040.00	0.48
12	110073	国投转债	107,710.00	0.47
13	110067	华安转债	107,420.00	0.47
14	123044	红相转债	104,670.00	0.45
15	128142	新乳转债	81,536.00	0.35
16	110070	凌钢转债	69,402.00	0.30
17	128048	张行转债	54,800.00	0.24

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	20,075,319.89
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	20,075,319.89

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。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况**

本报告期，基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息**8.1 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	2021 年 4 月 1 日 -2021 年 6 月 30	6,166,714.35	-	-	6,166,714.35	30.72%

		日					
	2	2021 年 4 月 1 日 -2021 年 6 月 30 日	9,240,827.23	-	-	9,240,827.23	46.03%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
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。							

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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，基金管理人根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定，在《证券时报》、规定互联网网站及基金管理人网站进行了如下信息披露：

- 1、2021 年 4 月 2 日《国金基金管理有限公司关于公司直销系统维护的公告》
- 2、2021 年 4 月 20 日《国金基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金增加侧袋机制并相应修改法律文件的公告》
- 3、2021 年 4 月 20 日《国金民丰回报 6 个月定期开放混合型证券投资基金基金合同》
- 4、2021 年 4 月 20 日《国金民丰回报 6 个月定期开放混合型证券投资基金托管协议》
- 5、2021 年 4 月 20 日《国金民丰回报 6 个月定期开放混合型证券投资基金招募说明书(更新)》
- 6、2021 年 4 月 20 日《国金民丰回报 6 个月定期开放混合型证券投资基金产品资料概要(更新)》
- 7、2021 年 4 月 21 日《国金民丰回报 6 个月定期开放混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告》
- 8、2021 年 5 月 12 日《国金基金管理有限公司关于公司直销系统升级的公告》
- 9、2021 年 5 月 19 日《国金基金管理有限公司关于公司直销系统升级的公告》
- 10、2021 年 5 月 29 日《关于国金民丰回报 6 个月定期开放混合型证券投资基金基金经理变更的公告》
- 11、2021 年 5 月 31 日《国金民丰回报 6 个月定期开放混合型证券投资基金招募说明书(更新)》
- 12、2021 年 5 月 31 日《国金民丰回报 6 个月定期开放混合型证券投资基金产品资料概要(更新)》

新)》

本报告期内,基金管理人在基金封闭期内至少每周公告 1 次基金的份额净值和份额累计净值。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件;
- 2、国金民丰回报 6 个月定期开放混合型证券投资基金基金合同;
- 3、国金民丰回报 6 个月定期开放混合型证券投资基金托管协议;
- 4、国金民丰回报 6 个月定期开放混合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。

9.2 存放地点

北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 层。

9.3 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

2021 年 7 月 20 日