

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

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

### 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。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	国金量化添利
基金主代码	006189
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

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	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

### 2.4 信息披露方式

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

### § 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

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。

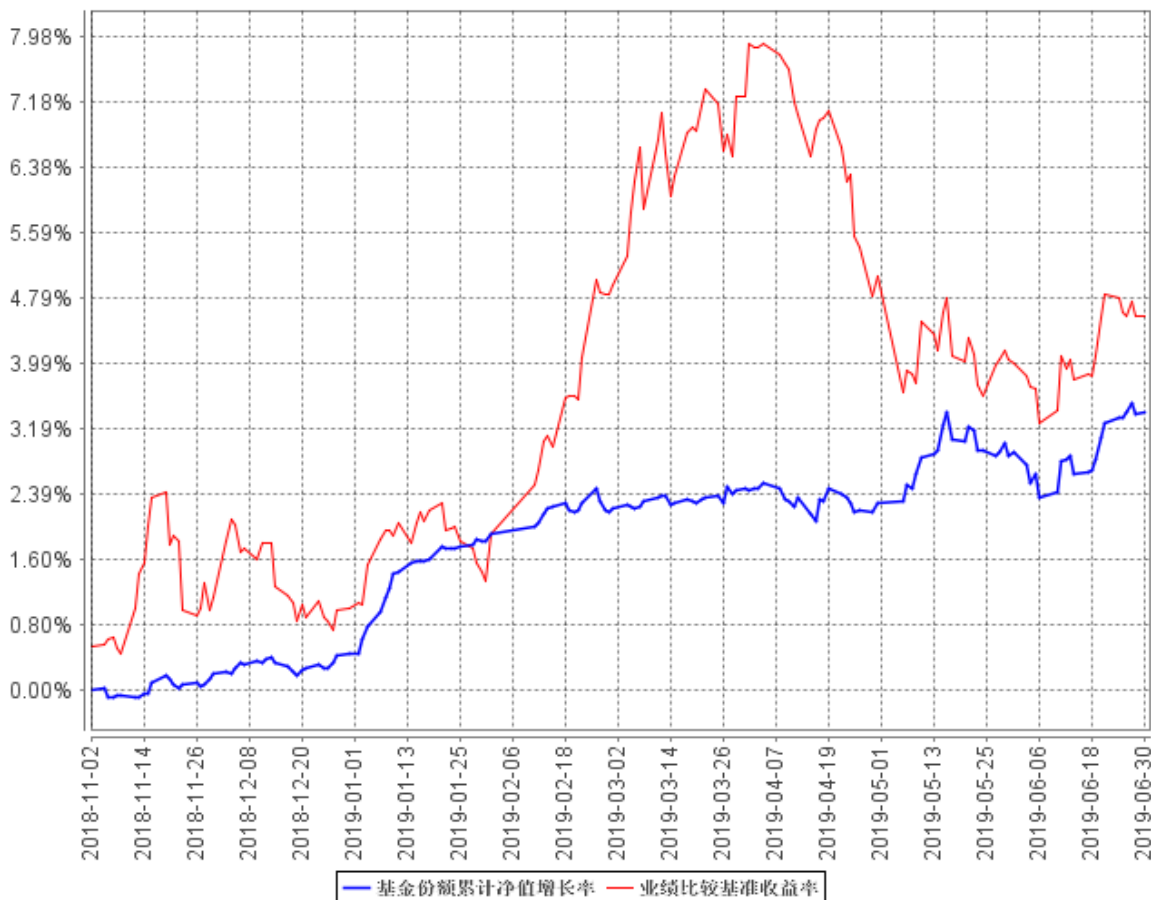
#### 3.2 基金净值表现

##### 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。

## § 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估部担任信用评估研究总监、信用评估研究高级经理。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	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,939,247.45	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		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
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		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

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。

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：

<u>尹庆军</u>	<u>聂武鹏</u>	<u>于晓莲</u>
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

国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金，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[2018]1033 号文的核准，由国金基金管理有限公司于 2018 年 10 月 15 日至 2018 年 10 月 26 日向社会公开募集，基金合同于 2018 年 11 月 2 日生效。首次募集规模为 150,011,600.00 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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、债券（国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、中小企业私募债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券）、资产支持证券、同业存单、银行存款（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 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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.4.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的会计差错更正。

### 6.4.5 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。

### 6.4.6 关联方关系

#### 6.4.6.1 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。

#### 6.4.6.2 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

### 6.4.7 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。

#### 6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.7.1.1 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。

### 6.4.7.1.2 债券交易

- 注：1. 本基金本报告期未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。

### 6.4.7.1.3 债券回购交易

- 注：1. 本基金本报告期未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。

### 6.4.7.1.4 权证交易

- 注：1. 本基金本报告期未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。

### 6.4.7.1.5 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。

## 6.4.7.2 关联方报酬

### 6.4.7.2.1 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	-

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。

**6.4.7.2.2 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。

**6.4.7.2.3 销售服务费**

注：无

**6.4.7.3 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。

**6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.7.4.1 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11月2日）持有的基金份额	10,000,600.00	-
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。

**6.4.7.4.2 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。

**6.4.7.5 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。

**6.4.7.6 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。

**6.4.7.7 其他关联交易事项的说明**

无

**6.4.8 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.8.1 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。

**6.4.8.2 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。

**6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.8.3.1 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

**6.4.8.3.2 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。

**6.4.9 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
3	固定收益投资	153,551,192.00	90.40
	其中：债券	153,551,192.00	90.40
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
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
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前十名股票投资明细

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

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的半年度报告正文。

### 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（%）
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
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的前十名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
4	应收利息	2,492,834.36
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
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	-	-	-	-	-	-



## § 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
---

国金基金管理有限公司

2019 年 8 月 27 日