

国金量化添利定期开放债券型发起式证券  
投资基金  
2020 年中期报告

2020 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：2020 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。本中期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 2020 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 2020 年 1 月 1 日起至 2020 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.....	12
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.....	13
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 托管人对本中期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>44</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	44
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.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
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.....	51
7.7 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.....	51
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.....	51
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.....	51
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
7.11 投资组合报告附注.....	51
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>53</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
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.....	53
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	53
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>54</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>55</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	55
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.....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
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.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8 其他重大事件.....	56
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>58</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 .....	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	58
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>59</b>
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	59

## § 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
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	378,815,608.06 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
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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.gfund.com
基金中期报告备置地点	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(2020年1月1日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	6,812,351.17
本期利润	-925,397.51
加权平均基金份额本期利润	-0.0055
本期加权平均净值利润率	-0.52%
本期基金份额净值增长率	1.73%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	16,844,228.97
期末可供分配基金份额利润	0.0445
期末基金资产净值	395,659,837.03
期末基金份额净值	1.0445
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	8.75%

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

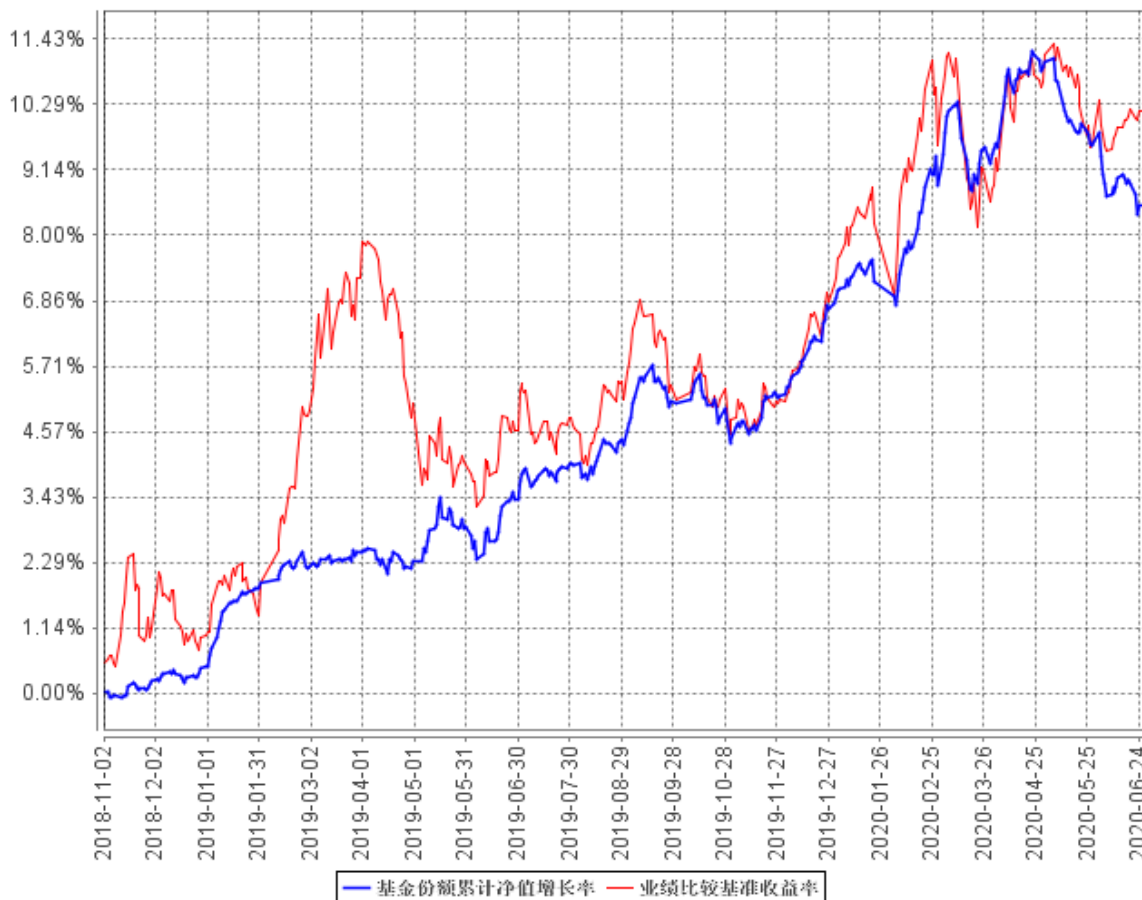
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.82%	0.17%	0.82%	0.21%	-1.64%	-0.04%
过去三个月	-0.61%	0.19%	1.73%	0.28%	-2.34%	-0.09%
过去六个月	1.73%	0.19%	3.19%	0.34%	-1.46%	-0.15%
过去一年	5.19%	0.16%	5.84%	0.28%	-0.65%	-0.12%
自基金合同生效起至今	8.75%	0.14%	10.68%	0.30%	-1.93%	-0.16%

注：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%。



### 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



本基金基金合同生效日为 2018 年 11 月 2 日，图示日期为 2018 年 11 月 2 日至 2020 年 6 月 30 日。

### 3.3 其他指标

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2020年6月30日，国金基金管理有限公司共管理19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）、国金惠远纯债债券型证券投资基金、国金惠安利率债债券型证券投资基金、国金鑫意医药消费混合型发起式证券投资基金。

#### 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		
宫雪	本基金基金经理，国金鑫新灵活配置（LOF）、国金300指数增强、国金上证50指数增强（LOF）、国金鑫瑞灵活、国金红利增	2020年6月29日	-	12	宫雪女士，中国科学院博士。2008年7月至2011年12月在博时基金管理有限公司股票投资部，任产业分析师；2012年2月至今在国金基金管理有限公司，历任产品经理、行业分析师、产品与金融工程部副总经理、指数投资部副总经理、指数投资事业部总经理、量化投资事业部三部总经理兼产品中心代总经理；现任创新投资部总经理。

	强、国金量化多因子、国金量化多策略基金经理，创新投资部总经理				
尹海峰	本基金基金经理，研究部总经理	2019年2月12日	-	9	尹海峰先生，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，国金及第中短债、国金民丰回报、国金众赢货币、国金惠鑫短债基金经理，固定收益投资部总经理	2018年11月2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。
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	2018年11月2日	2020年6月19日	11	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

	投资事业二部总经理				至 2017 年 6 月在摩根士丹利华鑫基金管理有限公司任数量化投资部副总监、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。

#### 4.1.3 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

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

固收方面，2020 年上半年债市陆续经历了疫情冲击、外资流入、央行货币政策放松推动的债市行情和央行边际收紧引发的市场调整。其中市场调整分两个阶段，第一阶段调整自 4 月 30 日至 5 月 19 日，由经济预期趋于好转、两会可能出经济强刺激政策的担心导致。第二阶段调整自 5 月 25 日到 6 月底，原因是央行货币政策边际收紧引发资金利率、债市利率重定价，导致债券利率上行更加迅猛。针对债市波动，固收组合积极通过杠杆和久期操作，适度升降久期来博取波段收益和控制收益回撤。自 5 月底开放期结束后，始终保持较慢的建仓节奏和较低的杠杆水平，通过增加期限匹配的债券品种提升静态收益率，尽可能控制固收组合对产品净值波动的影响。

股票方面，2020 年上半年市场风格主线是大盘蓝筹股弱于中小盘成长股，市场波动方面第二季度弱于第一季度。组合在分散投资、量化精选的基础上，运用基于 A 股自身特点开发的量化多因子选股模型进行选股投资，着重量化的方法精选高成长性的公司。

### 4.4.2 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为 1.0445 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.73%，业绩比较基准收益率为 3.19%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前大多数债券品种已经接近或者超过春节后第一个交易日的估值水平，而疫情发生以来，央行 OMO 利率、MLF 利率陆续下调，显示当前债市收益率可能存在超调的可能。当前疫情明显加大了中国政府保就业、稳经济和保民生的压力。此外考虑海外疫情未见拐点以及中美经贸摩擦不断升级，国内经济基本面短期较难恢复到疫情之前。从政策面看，6 月 17 日国常会李克强总理指出“进一步通过引导贷款利率和债券利率下行，同时要求综合运用降准、再贷款等工具，保持市场流动性合理充裕”，国常会上首提引导债券利率下行，释放出较为明确的积极信号。综上，我们认为随着债券市场恐慌情绪的逐步缓解，债券配置价值已经显现。疫情还在全球扩散，其对经济、社会造成的影响还在持续。尽管国内复工复产积极推进，但在全球经济陷入衰退已成定局下，经济修复仍然受制于疫情，外贸、消费持续承压。美国等主要经济体长期保持低利率，在应对外部压力增大的情况下中国央行仍存在释放货币政策空间的可能，利率中枢下行仍有空间。

## 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

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 托管人对本中期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中期报告中的财务指标、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：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	5,633,091.88	543,060.28
结算备付金		2,707,979.52	966,174.71
存出保证金		29,838.87	17,986.39
交易性金融资产	6.4.7.2	536,435,424.43	135,191,860.61
其中：股票投资		36,022,867.43	10,533,087.71
基金投资		-	-
债券投资		500,412,557.00	124,658,772.90
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	7,106,789.13	2,767,698.11
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		551,913,123.83	139,486,780.10
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2019 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		153,949,633.27	27,600,000.00
应付证券清算款		1,818,674.86	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		162,331.53	47,627.53
应付托管费		32,466.28	9,525.52
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	149,974.18	76,341.42
应交税费		26,206.23	18,499.75



应付利息		20,465.09	2,340.33
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	93,535.36	192,138.23
负债合计		156,253,286.80	27,946,472.78
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	378,815,608.06	108,641,890.03
未分配利润	6.4.7.10	16,844,228.97	2,898,417.29
所有者权益合计		395,659,837.03	111,540,307.32
负债和所有者权益总计		551,913,123.83	139,486,780.10

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值为人民币 1.0445 元，基金份额总额 378,815,608.06 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		722,613.48	5,287,919.03
1.利息收入		3,974,371.15	4,344,365.72
其中：存款利息收入	6.4.7.11	33,448.09	44,501.40
债券利息收入		3,939,142.27	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		1,780.79	50.41
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,483,862.58	1,284,264.57
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,247,412.13	-65,834.98
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	3,074,007.40	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	162,443.05	82,618.18
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-7,737,748.68	-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	2,128.43	-
<b>减：二、费用</b>		1,648,010.99	1,348,671.58

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	437,093.19	347,366.44
2. 托管费	6.4.10.2.2	87,418.64	69,473.31
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	291,295.89	66,959.61
5. 利息支出		714,833.92	750,958.64
其中：卖出回购金融资产支出		714,833.92	750,958.64
6. 税金及附加		8,933.84	11,971.36
7. 其他费用	6.4.7.20	108,435.51	101,942.22
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-925,397.51	3,939,247.45
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-925,397.51	3,939,247.45

### 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	108,641,890.03	2,898,417.29	111,540,307.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-925,397.51	-925,397.51
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）	270,173,718.03	14,871,209.19	285,044,927.22
其中：1.基金申购款	281,764,709.21	15,502,358.06	297,267,067.27
2.基金赎回款	-11,590,991.18	-631,148.87	-12,222,140.05
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）	378,815,608.06	16,844,228.97	395,659,837.03

项目	上年度可比期间 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

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：

_____ 尹庆军	_____ 聂武鹏	_____ 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》、《公开募集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〈年度报告和中期报告〉》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及参考意见。

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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

## 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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	5,633,091.88
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：	5,633,091.88

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	35,870,144.14	36,022,867.43	152,723.29	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	75,064,648.11	74,092,057.00	-972,591.11
	银行间市场	432,090,212.78	426,320,500.00	-5,769,712.78
	合计	507,154,860.89	500,412,557.00	-6,742,303.89
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	543,025,005.03	536,435,424.43	-6,589,580.60	

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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

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

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 2020年6月30日
应收活期存款利息	503.73
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	1,215.31
应收债券利息	7,105,056.59
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	-
应收出借证券利息	-
其他	13.50
合计	7,106,789.13

#### 6.4.7.6 其他资产

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 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	136,085.99
银行间市场应付交易费用	13,888.19
合计	149,974.18

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元



项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	93,535.36
合计	93,535.36

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	108,641,890.03	108,641,890.03
本期申购	281,764,709.21	281,764,709.21
本期赎回(以“-”号填列)	-11,590,991.18	-11,590,991.18
- 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	378,815,608.06	378,815,608.06

#### 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	1,305,234.29	1,593,183.00	2,898,417.29
本期利润	6,812,351.17	-7,737,748.68	-925,397.51
本期基金份额交易产生的变动数	14,823,352.83	47,856.36	14,871,209.19
其中：基金申购款	15,461,494.33	40,863.73	15,502,358.06
基金赎回款	-638,141.50	6,992.63	-631,148.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	22,940,938.29	-6,096,709.32	16,844,228.97

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	19,514.69
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	13,748.90
其他	184.50
合计	33,448.09

#### 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	98,886,863.54
减：卖出股票成本总额	97,639,451.41
买卖股票差价收入	1,247,412.13

#### 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 2020年1月1日至2020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	3,074,007.40
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	3,074,007.40

##### 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 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交	183,389,291.43

总额	
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	176,587,559.96
减：应收利息总额	3,727,724.07
买卖债券差价收入	3,074,007.40

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

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

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

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 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

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

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

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

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

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	162,443.05
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	162,443.05

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-7,737,748.68
——股票投资	28,478.69
——债券投资	-7,766,227.37
——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	-7,737,748.68

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	2,128.43
合计	2,128.43

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购费补差和赎回费两部分构成，其中不低于赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

交易所市场交易费用	281,333.39
银行间市场交易费用	9,962.50
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	291,295.89

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
上清所查询服务费	600.00
中债债券账户维护费	9,000.00
上清所账户维护费	9,000.00
银行费用	5,300.15
合计	108,435.51

#### 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
兴业银行股份有限公司	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**

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。

**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

**6.4.10.1.2 债券交易**

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

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。

**6.4.10.1.4 权证交易**

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

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 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	437,093.19	347,366.44
其中：支付销售机构的客户维护费	77,667.51	-

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。

#### 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
	2020年1月1日至2020年6月30日	2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	87,418.64	69,473.31

注：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。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

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

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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出

借业务。

#### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 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
	2020年1月1日至2020年6月30日	2019年1月1日至2019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	10,000,600.00
报告期初持有的基金份额	11,852,028.34	10,000,600.00
报告期间申购/买入总份额	-	1,455,849.89
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	1,455,849.89	-
报告期末持有的基金份额	10,396,178.45	11,456,449.89
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.7444%	10.7608%

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。

##### 6.4.10.5.2 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		上年度末	
	2020年6月30日		2019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
北京千石创富资产管理	-	-	9,999,600.00	9.2042%



有 限 公 司				
---------	--	--	--	--

注：除基金管理人之外的其他关联方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。

#### 6.4.10.6 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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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-活期存款	5,633,091.88	19,514.69	1,490,084.57	18,227.35

注：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。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2020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

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

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2020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111,149,633.27元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
-----	------	-------	--------	-------	--------

码					
190215	19 国开 15	2020 年 7 月 1 日	101.38	500,000	50,690,000.00
200203	20 国开 03	2020 年 7 月 1 日	101.41	600,000	60,846,000.00
190310	19 进出 10	2020 年 7 月 1 日	103.47	70,000	7,242,900.00
合计				1,170,000	118,778,900.00

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 42,800,000.00 元，于 2020 年 7 月 7 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

#### 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 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
A-1	10,060,000.00	5,333,390.00
A-1 以下	-	-
未评级	39,972,000.00	-
合计	50,032,000.00	5,333,390.00

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**

本基金本报告期末及上年度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**

本基金本报告期末及上年度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 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	264,243,863.90	70,246,096.90
AAA 以下	47,769,193.10	28,977,286.00
未评级	-	-
合计	312,013,057.00	99,223,382.90

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**

本基金本报告期末及上年度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**

本基金本报告期末及上年度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**

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、调整久期、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于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 202 0 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	5,633,091.88	-	-	-	-	-	5,633,091.88
结 算	2,707,979.52	-	-	-	-	-	2,707,979.52

备付金							
交易性金融资产	-	-	119,441,057.00	304,450,500.00	76,521,000.00	36,022,867.43	536,435,424.43
应收利息	-	-	-	-	-	7,106,789.13	7,106,789.13
存出保证金	29,838.87	-	-	-	-	-	29,838.87
资产总计	8,370,910.27	-	119,441,057.00	304,450,500.00	76,521,000.00	43,129,656.56	551,913,123.83
负债							
卖出回购金融资产款	153,949,633.27	-	-	-	-	-	153,949,633.27
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,818,674.86	1,818,674.86
应付管	-	-	-	-	-	162,331.53	162,331.53

理人报酬							
应付托管费						32,466.28	32,466.28
应付交易费用						149,974.18	149,974.18
应付利息						20,465.09	20,465.09
应交税费						26,206.23	26,206.23
其他负债						93,535.36	93,535.36
负债总计	153,949,633.27					2,303,653.53	156,253,286.80
利率敏感度缺口	-145,578,723.00		-119,441,057.00	304,450,500.00	76,521,000.00	40,826,003.03	395,659,837.03
上年度末 2019 年	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

12月31日							
资产							
银行存款	543,060.28	-	-	-	-	-	543,060.28
结算备付金	966,174.71	-	-	-	-	-	966,174.71
交易性金融资产	8,199,000.00	5,333,390.00	34,309,382.90	66,775,000.00	10,042,000.00	10,533,087.71	135,191,860.61
应收利息	-	-	-	-	-	2,767,698.11	2,767,698.11
存出保证金	17,986.39	-	-	-	-	-	17,986.39
资产总计	9,726,221.38	5,333,390.00	34,309,382.90	66,775,000.00	10,042,000.00	13,300,785.82	139,486,780.10
负债							
卖出回购金融资	27,600,000.00	-	-	-	-	-	27,600,000.00



产款							
应付管理人报酬		-	-	-	-	47,627.53	47,627.53
应付托管费		-	-	-	-	9,525.52	9,525.52
应付交易费用		-	-	-	-	76,341.42	76,341.42
应付利息		-	-	-	-	2,340.33	2,340.33
应交税费		-	-	-	-	18,499.75	18,499.75
其他负债		-	-	-	-	192,138.23	192,138.23
负债总计	27,600,000.00	-	-	-	-	346,472.78	27,946,472.78
利率敏感度缺口	-17,873,778.62	5,333,390.00	34,309,382.90	66,775,000.00	10,042,000.00	12,954,313.04	111,540,307.32

#### 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（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	+25 个基点	-4,467,066.98	-1,030,774.85
	-25 个基点	4,545,023.46	1,045,178.05

#### 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 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 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	36,022,867.43	9.10	10,533,087.71	9.44
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	500,412,557.00	126.48	124,658,772.90	111.76
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	536,435,424.43	135.58	135,191,860.61	121.20

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。		
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（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	+5.00%	1,197,454.11	269,438.11
	-5.00%	-1,197,454.11	-269,438.11

#### 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（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 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	36,022,867.43	6.53
	其中：股票	36,022,867.43	6.53
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	500,412,557.00	90.67
	其中：债券	500,412,557.00	90.67
	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	8,341,071.40	1.51
8	其他各项资产	7,136,628.00	1.29
9	合计	551,913,123.83	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	-	-
B	采矿业	89,883.00	0.02
C	制造业	18,259,195.11	4.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	54,696.00	0.01
E	建筑业	1,240,903.00	0.31
F	批发和零售业	3,115,811.66	0.79
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	4,576,432.32	1.16
J	金融业	35,480.00	0.01
K	房地产业	2,479,021.80	0.63
L	租赁和商务服务业	699,112.00	0.18
M	科学研究和技术服务业	1,834,568.50	0.46
N	水利、环境和公共设施管理业	50,052.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	2,289,328.04	0.58
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	139,636.00	0.04
S	综合	1,158,748.00	0.29
	合计	36,022,867.43	9.10

注：以上行业分类以 2020 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	300338	开元股份	163,400	1,197,722.00	0.30
2	600455	博通股份	50,800	1,158,748.00	0.29
3	300282	三盛教育	199,154	1,119,245.48	0.28
4	002621	美吉姆	177,786	1,091,606.04	0.28
5	601515	东风股份	154,580	944,483.80	0.24
6	300500	启迪设计	65,000	892,450.00	0.23
7	600939	重庆建工	246,400	884,576.00	0.22
8	601226	华电重工	237,750	882,052.50	0.22
9	300464	星徽精密	66,900	881,073.00	0.22
10	600076	康欣新材	268,200	863,604.00	0.22
11	603165	荣晟环保	73,100	836,995.00	0.21
12	600716	凤凰股份	215,600	834,372.00	0.21
13	600052	浙江广厦	242,700	822,753.00	0.21
14	000502	绿景控股	120,870	802,576.80	0.20
15	300780	德恩精工	44,800	784,448.00	0.20
16	002483	润邦股份	175,800	782,310.00	0.20
17	002730	电光科技	107,000	769,330.00	0.19
18	300430	诚益通	102,000	741,540.00	0.19
19	300419	浩丰科技	123,000	738,000.00	0.19
20	300195	长荣股份	127,200	736,488.00	0.19
21	600579	克劳斯	141,000	736,020.00	0.19
22	000906	浙商中拓	126,800	730,368.00	0.18
23	603901	永创智能	99,300	707,016.00	0.18
24	002578	闽发铝业	198,600	693,114.00	0.18
25	300062	中能电气	131,600	690,900.00	0.17

26	300407	凯发电气	87,400	686,964.00	0.17
27	300605	恒锋信息	52,000	682,240.00	0.17
28	600710	苏美达	155,000	672,700.00	0.17
29	002231	奥维通信	98,800	667,888.00	0.17
30	300105	龙源技术	167,400	664,578.00	0.17
31	002316	亚联发展	111,500	653,390.00	0.17
32	000633	合金投资	185,000	653,050.00	0.17
33	300344	太空智造	161,400	647,214.00	0.16
34	002380	科远智慧	46,200	646,800.00	0.16
35	300711	广哈通信	53,143	635,058.85	0.16
36	300150	世纪瑞尔	144,837	631,489.32	0.16
37	300670	大烨智能	102,500	626,275.00	0.16
38	603421	鼎信通讯	39,800	596,204.00	0.15
39	000626	远大控股	97,774	595,443.66	0.15
40	002379	宏创控股	203,084	532,080.08	0.13
41	002664	长鹰信质	35,100	464,022.00	0.12
42	300424	航新科技	29,600	396,048.00	0.10
43	300159	新研股份	98,600	385,526.00	0.10
44	002082	万邦德	33,400	334,000.00	0.08
45	300117	嘉寓股份	115,700	320,489.00	0.08
46	300508	维宏股份	6,700	160,331.00	0.04
47	002185	华天科技	7,600	102,828.00	0.03
48	002131	利欧股份	26,400	101,904.00	0.03
49	600438	通威股份	5,800	100,804.00	0.03
50	002481	双塔食品	5,400	93,528.00	0.02
51	300581	晨曦航空	6,200	90,024.00	0.02
52	002806	华锋股份	7,300	83,877.00	0.02
53	600511	国药股份	1,800	73,206.00	0.02
54	600386	北巴传媒	19,400	66,930.00	0.02
55	300615	欣天科技	4,200	64,554.00	0.02
56	300129	泰胜风能	15,800	57,986.00	0.01
57	603533	掌阅科技	1,500	57,195.00	0.01
58	600735	新华锦	10,200	56,814.00	0.01
59	300063	天龙集团	7,700	51,898.00	0.01
60	300001	特锐德	2,400	50,256.00	0.01
61	000619	海螺型材	10,288	49,382.40	0.01
62	300709	精研科技	500	48,075.00	0.01
63	000681	视觉中国	2,500	46,550.00	0.01
64	002063	远光软件	3,500	44,205.00	0.01

65	300457	赢合科技	1,300	41,444.00	0.01
66	300263	隆华科技	5,100	40,647.00	0.01
67	300328	宜安科技	3,200	38,304.00	0.01
68	300783	三只松鼠	500	37,990.00	0.01
69	002709	天赐材料	1,100	37,169.00	0.01
70	002025	航天电器	1,000	36,580.00	0.01
71	000603	盛达资源	3,100	36,425.00	0.01
72	002125	湘潭电化	4,000	36,320.00	0.01
73	002647	仁东控股	1,000	35,480.00	0.01
74	300203	聚光科技	2,100	35,133.00	0.01
75	002623	亚玛顿	800	35,048.00	0.01
76	300792	壹网壹创	200	34,832.00	0.01
77	603983	丸美股份	400	34,412.00	0.01
78	300448	浩云科技	3,500	33,425.00	0.01
79	300735	光弘科技	1,800	33,210.00	0.01
80	002734	利民股份	2,200	32,934.00	0.01
81	300579	数字认证	800	32,584.00	0.01
82	300018	中元股份	5,600	32,424.00	0.01
83	002343	慈文传媒	3,300	28,644.00	0.01
84	002973	侨银环保	1,200	28,128.00	0.01
85	000921	海信家电	2,300	27,968.00	0.01
86	300138	晨光生物	2,300	27,922.00	0.01
87	000655	金岭矿业	4,900	27,538.00	0.01
88	603466	风语筑	1,400	27,258.00	0.01
89	600452	涪陵电力	1,800	25,974.00	0.01
90	603505	金石资源	1,200	25,920.00	0.01
91	300682	朗新科技	1,500	25,530.00	0.01
92	300762	上海瀚讯	800	25,520.00	0.01
93	600602	云赛智联	3,500	25,410.00	0.01
94	603256	宏和科技	2,200	25,168.00	0.01
95	002417	深南股份	3,800	25,042.00	0.01
96	000925	众合科技	3,400	24,786.00	0.01
97	300516	久之洋	800	24,464.00	0.01
98	603096	新经典	400	23,612.00	0.01
99	603897	长城科技	1,200	23,376.00	0.01
100	300731	科创新源	700	23,100.00	0.01
101	002952	亚世光电	1,300	22,958.00	0.01
102	300771	智莱科技	600	22,680.00	0.01
103	300389	艾比森	2,300	22,678.00	0.01

104	002892	科力尔	1,000	22,530.00	0.01
105	002848	高斯贝尔	1,900	22,325.00	0.01
106	300597	吉大通信	2,000	22,300.00	0.01
107	002469	三维工程	5,000	22,000.00	0.01
108	002887	绿茵生态	1,800	21,924.00	0.01
109	002749	国光股份	1,700	21,590.00	0.01
110	603828	柯利达	4,600	21,390.00	0.01
111	600278	东方创业	2,300	21,321.00	0.01
112	002738	中矿资源	1,400	20,986.00	0.01
113	300542	新晨科技	1,900	20,900.00	0.01
114	300596	利安隆	600	20,898.00	0.01
115	600098	广州发展	3,800	20,862.00	0.01
116	300350	华鹏飞	5,600	20,552.00	0.01
117	600058	五矿发展	3,400	20,536.00	0.01
118	300385	雪浪环境	3,200	20,384.00	0.01
119	603339	四方科技	1,500	20,145.00	0.01
120	000812	陕西金叶	7,000	19,880.00	0.01
121	300610	晨化股份	1,600	19,680.00	0.00
122	600791	京能置业	5,600	19,320.00	0.00
123	300588	熙菱信息	2,000	18,980.00	0.00
124	002890	弘宇股份	500	18,815.00	0.00
125	603578	三星新材	900	18,711.00	0.00
126	300246	宝莱特	500	17,540.00	0.00
127	603859	能科股份	500	17,080.00	0.00
128	002745	木林森	1,100	16,951.00	0.00
129	603233	大参林	200	16,244.00	0.00
130	603098	森特股份	1,600	14,448.00	0.00
131	601595	上海电影	900	13,572.00	0.00
132	600562	国睿科技	900	13,338.00	0.00
133	603978	深圳新星	600	12,348.00	0.00
134	002162	悦心健康	3,650	10,913.50	0.00
135	300769	德方纳米	100	9,738.00	0.00
136	601778	晶科科技	1,000	7,860.00	0.00
137	300695	兆丰股份	100	7,645.00	0.00
138	300811	铂科新材	100	7,000.00	0.00
139	603990	麦迪科技	100	5,119.00	0.00
140	300657	弘信电子	200	4,014.00	0.00
141	300371	汇中股份	100	1,392.00	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	300338	开元股份	1,638,156.00	1.47
2	300282	三盛教育	1,444,657.00	1.30
3	002621	美吉姆	1,335,124.48	1.20
4	002730	电光科技	1,320,359.20	1.18
5	600576	祥源文化	1,216,974.98	1.09
6	600455	博通股份	1,170,324.00	1.05
7	300269	联建光电	1,073,490.00	0.96
8	601515	东风股份	1,052,136.80	0.94
9	600076	康欣新材	1,036,432.00	0.93
10	300105	龙源技术	990,009.00	0.89
11	000633	合金投资	977,530.00	0.88
12	000502	绿景控股	917,406.00	0.82
13	600939	重庆建工	906,232.00	0.81
14	601226	华电重工	900,184.50	0.81
15	300500	启迪设计	897,796.00	0.80
16	300654	世纪天鸿	866,054.50	0.78
17	603165	荣晟环保	858,370.20	0.77
18	002116	中国海诚	854,816.57	0.77
19	600302	标准股份	822,333.00	0.74
20	600716	凤凰股份	807,288.00	0.72

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	600576	祥源文化	1,278,675.70	1.15
2	300269	联建光电	1,129,641.32	1.01
3	300654	世纪天鸿	920,835.43	0.83
4	002116	中国海诚	876,987.78	0.79
5	603637	镇海股份	876,798.70	0.79

6	002591	恒大高新	871,119.33	0.78
7	603628	清源股份	853,396.87	0.77
8	300553	集智股份	850,502.47	0.76
9	600302	标准股份	838,766.04	0.75
10	000715	中兴商业	803,992.38	0.72
11	002540	亚太科技	757,821.04	0.68
12	000863	三湘印象	715,020.15	0.64
13	603838	四通股份	709,299.57	0.64
14	300306	远方信息	652,401.21	0.58
15	002686	亿利达	650,571.84	0.58
16	600551	时代出版	648,476.72	0.58
17	300488	恒锋工具	625,265.32	0.56
18	002599	盛通股份	623,815.20	0.56
19	002836	新宏泽	619,724.61	0.56
20	600202	哈空调	616,887.47	0.55

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	123,100,752.44
卖出股票收入（成交）总额	98,886,863.54

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	6,224,500.00	1.57
2	央行票据	-	-
3	金融债券	132,143,000.00	33.40
	其中：政策性金融债	132,143,000.00	33.40
4	企业债券	78,024,093.30	19.72
5	企业短期融资券	50,032,000.00	12.65
6	中期票据	233,749,500.00	59.08
7	可转债（可交换债）	239,463.70	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	500,412,557.00	126.48

**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	200203	20 国开 03	600,000	60,846,000.00	15.38
2	190215	19 国开 15	500,000	50,690,000.00	12.81
3	101800944	18 鲁能源 MTN001	100,000	10,782,000.00	2.73
4	190310	19 进出 10	100,000	10,347,000.00	2.62
5	190406	19 农发 06	100,000	10,260,000.00	2.59

**7.7 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**

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**

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**

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**

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	29,838.87
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,106,789.13
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,136,628.00

**7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

**7.11.5 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。

**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
1,338	283,120.78	106,670,401.80	28.16%	272,145,206.26	71.84%

### 8.2 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	1,040.10	0.0003%

### 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	10,396,178.45	2.74	10,396,178.45	2.74	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	10,396,178.45	2.74	10,396,178.45	2.74	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	108,641,890.03
本报告期基金总申购份额	281,764,709.21
减：本报告期基金总赎回份额	11,590,991.18
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	378,815,608.06

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，本基金管理人发生重大人事变动。根据国金基金管理有限公司第三届董事会审议通过，索峰先生自 2020 年 2 月 28 日起不再担任公司副总经理。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

本报告期内，本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	139,762,660.93	62.96%	102,209.58	62.96%	-
华创证券	1	82,220,585.05	37.04%	60,127.05	37.04%	-
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	6,697,146.28	4.31%	5,880,000.00	0.26%	-	-
华创证券	148,663,053.44	95.69%	2,216,600,000.00	99.74%	-	-
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	《国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金 2019 年第 4 季度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 1 月 17 日
2	《国金基金管理有限公司高级管理人员变更公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 2 月 29 日
3	《国金基金管理有限公司关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 3 月 26 日
4	《国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金 2019 年年度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 4 月 17 日
5	《国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金 2020 年第 1 季度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 4 月 22 日



6	《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	2020 年 5 月 12 日
7	《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	2020 年 6 月 20 日
8	《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（更新）》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 6 月 20 日
9	《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	2020 年 6 月 30 日
10	《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（更新）》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 6 月 30 日

注：本报告期内，基金管理人按照《公开募集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及基金份额累计净值，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。

## § 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	2020 年 1 月 1 日-2020 年 5 月 18 日	46,785,505.88	-	-	46,785,505.88	12.35%
	2	2020 年 1 月 1 日-2020 年 5 月 18 日	40,003,800.00	-	-	40,003,800.00	10.56%
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

2020 年 8 月 27 日