

国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金  
(LOF)  
2017 年年度报告

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：国金基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 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已经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 12 月 31 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>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9 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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>19</b>
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
7.4 报表附注.....	22
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>50</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	50
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	50
8.3 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.....	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	54
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	61
8.6 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.....	62

8.7 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 .....	62
8.8 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 .....	62
8.9 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 .....	62
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	62
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	63
8.12 投资组合报告附注 .....	63
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>65</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	65
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	65
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	65
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	65
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>67</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>68</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	68
11.2 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 .....	68
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	68
11.4 基金投资策略的改变 .....	68
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	68
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	68
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	68
11.8 其他重大事件 .....	69
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>72</b>
12.1 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 .....	72
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	72
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>73</b>
13.1 备查文件目录 .....	73
13.2 存放地点 .....	73
13.3 查阅方式 .....	73

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	国金鑫新灵活配置（LOF）
场内简称	国金鑫新
基金主代码	501000
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 7 月 3 日
基金管理人	国金基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	178,514,439.11 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2015 年 7 月 14 日

注：无。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过合理的资产配置和积极的证券选择，追求在严格控制风险的前提下实现资本的长期稳健回报。
投资策略	本基金将根据对宏观经济周期和市场运行阶段的判断来确定投资组合中各大类资产的权重。在权益类资产投资方面，本基金将综合运用定量分析和定性分析手段，精选出具有内在价值和成长潜力的股票来构建股票投资组合。在固定收益类资产投资方面，本基金将深入研究分析宏观经济和利率趋势，选择流动性好，到期收益率与信用质量相对较高的债券品种进行投资。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：一年期银行定期存款利率（税后）+3%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

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	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨海燕	方琦
	联系电话	010-88005970	0755-22160168

	电子邮箱	yanghaiyan@gfund.com	FANGQI275@pingan.com.cn
客户服务电话		4000-2000-18	95511-3
传真		010-88005666	0755-82080387
注册地址		北京市怀柔区府前街三号楼 3-6	深圳市罗湖区深南东路 5047 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	深圳市罗湖区深南东路 5047 号
邮政编码		100089	518001
法定代表人		尹庆军	谢永林

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.gfund.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2017 年	2016 年	2015 年 7 月 3 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	11,260,750.05	365,032.62	217,781.97
本期利润	38,876,569.09	365,032.62	217,781.97
加权平均基金份额本期利润	0.2489	0.0126	0.0044
本期加权平均净值利润率	22.26%	1.25%	0.44%
本期基金份额净值增长率	21.46%	1.40%	0.20%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	13,729,404.73	74,466.20	40,333.82
期末可供分配基金份额利润	0.0769	0.0161	0.0016
期末基金资产净值	220,345,997.91	4,705,449.63	25,360,160.01
期末基金份额净值	1.234	1.016	1.002
3.1.3 累计期末指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	23.40%	1.60%	0.20%

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

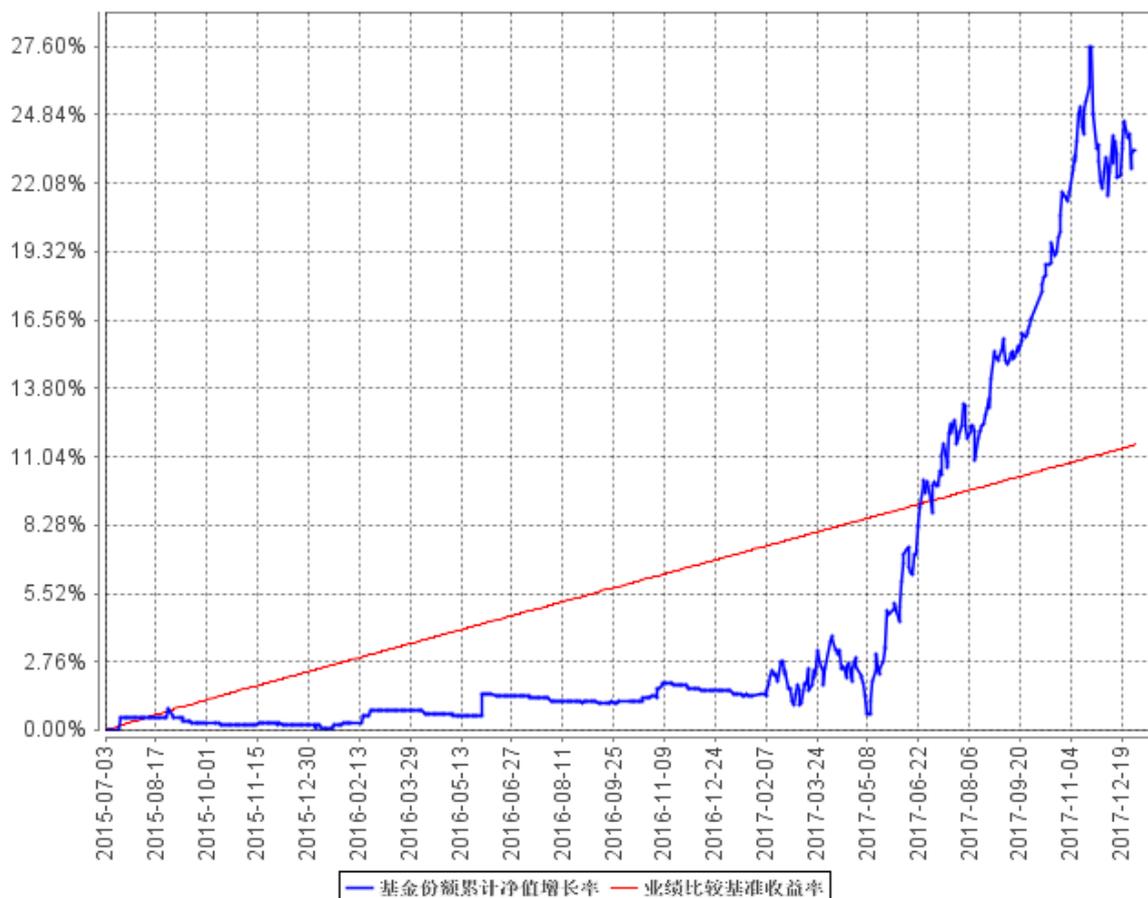
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	5.83%	0.61%	1.04%	0.01%	4.79%	0.60%
过去六个月	12.18%	0.53%	2.11%	0.01%	10.07%	0.52%
过去一年	21.46%	0.47%	4.27%	0.01%	17.19%	0.46%

自基金合同生效起至今	23.40%	0.31%	11.53%	0.01%	11.87%	0.30%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

注：本基金的业绩比较基准为：一年期银行定期存款利率(税后)+3%

### 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

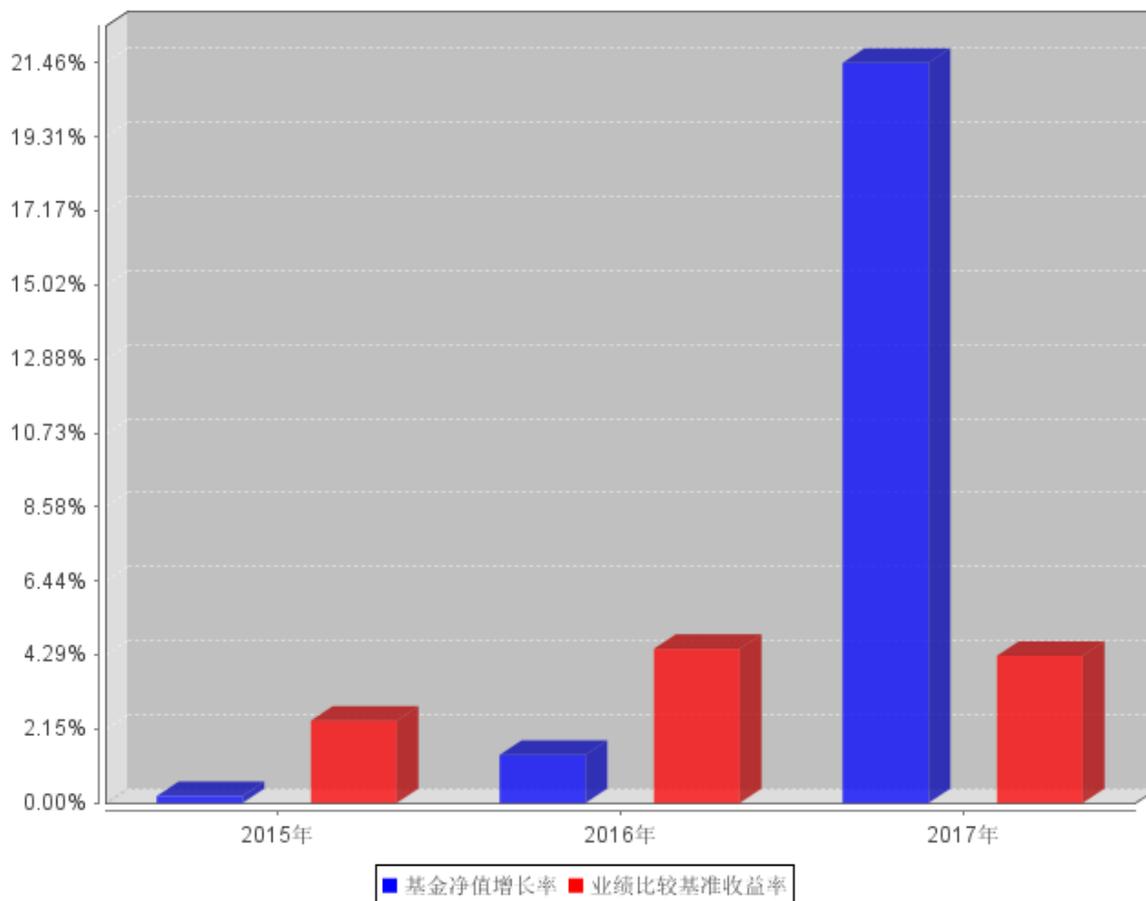
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为 2015 年 7 月 3 日至 2017 年 12 月 31 日。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同生效日为 2015 年 7 月 3 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 3.3 其他指标

注：无

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金于本报告期及上年度可比期间未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国金基金管理有限公司（原名称为“国金通用基金管理有限公司”）经中国证券监督管理委员会（证监许可[2011]1661号）批准，于2011年11月2日成立，总部设在北京。2012年9月，公司的注册资本由1.6亿元人民币增加至2.8亿元人民币。2015年7月，公司名称由“国金通用基金管理有限公司”变更为“国金基金管理有限公司”。公司股东为国金证券股份有限公司、苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司、广东宝丽华新能源股份有限公司、涌金投资控股有限公司，股权比例分别为49%、19.5%、19.5%和12%。截至2017年12月31日，国金基金管理有限公司共管理11只开放式基金——国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金、国金沪深300指数分级证券投资基金、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、国金鑫安保本混合型证券投资基金、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。

#### 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300指数增强、国金鑫安保本、国金上证50、国金鑫瑞灵活基金经理，量化投资事业部三部总经理	2015年7月3日	-	9	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，自2016年4月起任量化投资事业部三部总经理。

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》、《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及其他相关法律法规，制定了《国金基金管理有限公司公平交易管理办法》，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。该公平交易管理方法规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行（集中竞价及非集中竞价交易）、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

第一，明确公平交易的原则：（1）信息获取公平原则，不同投资组合经理可公平获得研究成果；（2）交易机会公平原则，不同投资组合经理可获得公平交易执行的机会。

第二，对开放式基金和特定客户资产管理计划等不同类型业务，公司分别设立独立的投资部门；研究团队对所有的投资业务同时提供研究支持；设立独立的基金交易部，实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；设立独立的合规风控部，对研究、投资、交易业务的公平交易进行监控、分析、预警、报告等。

第三，通过岗位设置、制度约束、流程规范、技术手段相结合的方式，实现公平交易的控制，具体如下：（1）总经理、督察长、风险控制委员会负责指导建立公平交易制度，并对公平交易的执行情况进行审核。（2）产品开发：风险分析师根据相关法律法规、公司规章制度以及产品合同的风险控制指标，在投资交易系统中完成风控参数设置，确保做好公平交易的事前控制。（3）研究与投资：投资人员负责在各自的职责及权限范围内从事相应的投资决策行为，其中，投资组合经理需对有可能涉及非公平交易的行为作出合理解释。研究人员负责以客观的研究方法开展研究工作，并根据研究结果建立及维护全公司适用的投资对象备选库和交易对手备选库。研究结果通

过策略会、行业及个股报告会、投研平台、邮件系统等共享机制统一开放给所有的投资组合经理，以确保各投资组合享有公平的信息获取机会。（4）交易执行：交易人员负责建立并执行公平的集中交易制度和交易分配制度，合规风控部利用投资交易系统对交易执行进行实时监控，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（5）事后分析：合规风控部利用公平交易系统对不同投资组合之间的同向、反向交易及交易时机和价差进行事后分析。（6）报告备案：合规风控部根据实时监控及事后分析的结果撰写定期报告，并由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。（7）信息披露环节：信息披露部门在各投资组合的定期报告中，至少披露公司整体公平交易制度执行情况、公平交易执行情况及异常交易行为专项说明等事项。（8）反馈完善：根据事后分析报告及信息披露结果，公平交易各相关部门对相关环节予以不断完善，以确保公平交易的执行日臻完善。（9）监督检查：合规风控部监察稽核人员根据法规规定及公司公平交易制度规定，监督、检查、评价公司公平交易制度执行情况，并提出改进建议。会计师事务所在公司年度内部控制评价报告中对公司公平交易制度的执行情况做出专项评价。

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 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

报告期内，本基金严格遵守基金合同，在权益类资产投资方面，本基金综合运用定量分析和定性分析手段，精选出具有内在价值和成长潜力的股票来构建股票投资组合。在固定收益类资产

投资方面，本基金主要通过回购投资进行现金管理。

权益资产配置方面，本基金严格根据基金合同的约定，主要投资于估值合理、具有长期增值潜力的行业及上市公司。重点以上证 50 和深证 100 的成分股为主。同时，本基金可参与新股申购（含网上和网下），努力为本基金增厚收益。为控制波动，除新股申购获配外，拟投资的权益类资产市值原则上不超过参与新股网下申购的股份市值要求，若因市场环境发生变化等因素，管理人从维护投资者利益的角度，进行调整。

固定收益投资方面，2018 年央行将继续实行稳健中性的货币政策，宏观经济有较强的韧性，但也要看到美联储持续加息对人民币贬值带来压力，资本外流压力再现，通货膨胀水平稳中有升，央行货币政策边际上很难宽松，因此本基金将结合国内外宏观经济、市场运行情况、市场资金面情况及市场供求、债市收益率水平、期限利差及信用利差等各方面的分析，合理安排基金组合中债券投资组合的久期及期限结构，结合内部研究和信用评级积极优选个券进行投资。为防范信用风险，拟主要投资于利率债和主体评级为 AA+及以上中高评级信用债券，且不参与两高一剩行业债券，同时拟将组合久期控制在 2 年以内，并抓住资金成本的抬升进行现金管理。

#### 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 21.46%，同期业绩比较基准收益率为 4.27%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年希望在于转型和创新，中国经济正站在新周期的起点上，世界经济正在复苏，供给侧改革正在积极推进，消费升级、先进制造、环保、对外开放、新兴产业等领域为投资者带来了大量的投资机会，同时金融监管加强、货币政策回归中性也要求投资者更加规范稳健。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人从合法、合规、保障基金持有人利益出发，由督察长领导独立于各业务部门的合规风控部对基金投资运作、公司经营管理及员工行为的合法、合规性等进行了监察稽核，通过实时监控、定期检查、专项稽核、日常不定期抽查等方式，及时发现情况、提出整改意见、督促有关业务部门整改并跟踪改进落实情况，并按照相关要求定期制作监察稽核报告报公司管理层、董事会以及监管部门。

本报告期内本基金管理人内部监察稽核的重点包括：

（1）进一步完善制度建设。本基金管理人根据公司实际业务情况不断细化制度流程，及时拟定了相关管理制度，并对原有制度体系进行了持续的更新和完善，截至报告出具日，本基金管理人共制订规章制度 152 项，涵盖公司主要业务范围。

（2）强化合规教育和培训。本基金管理人及时传达与基金相关的法律法规，将相关规定不断贯彻到相关制度及具体执行过程中，同时以组织公司内部培训、聘请外部律师提供法律专业培训等多种形式，提高全体员工的合规守法意识。

（3）有计划地开展监察稽核工作。本报告期内，本基金管理人根据年度监察稽核工作计划、通过日常监察与专项稽核相结合的方式，开展各项监察稽核工作，包括对基金销售、宣传材料、合同、反洗钱工作、基金投资运作、交易（包括公平交易）等方面进行稽核，对于稽核中发现的问题会通过监察稽核报告的形式，及时将潜在风险通报部门负责人、督察长及公司总经理，督促改进并跟踪改进效果。通过日常监察与专项稽核的方式，保证了内部监察稽核的全面性、实时性，强化内部控制流程，提高了业务部门及人员的风险意识水平，从而较好地预防风险。

#### 4.7 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。

#### **4.8 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，不存在应分配而未分配的情况。

#### **4.9 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，本基金不存在连续二十个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。本报告期内，本基金出现基金份额持有人数量连续二十个工作日不满二百人的情形，出现前述情形的时间范围为 2017 年 4 月 26 日至 2017 年 7 月 10 日。经过基金管理人积极地持续营销，截至 2017 年 7 月 11 日，本基金份额持有人数量已超过二百人。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，平安银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《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，对本基金的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

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

本报告期内，由国金基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2018）审字第 61004823_A06 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF），并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）管理层（以下简称“管理层”）对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在</p>

	<p>由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的财务报告过程。</p> <p>错报。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）</p>
<p>注册会计师的姓名</p>	<p>徐艳   贺耀</p>
<p>会计师事务所的地址</p>	<p>北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室</p>
<p>审计报告日期</p>	<p>2018年3月26日</p>

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	4,014,272.45	222,511.12
结算备付金		1,405,546.39	409,090.91
存出保证金		10,365.78	5,667.06
交易性金融资产	7.4.7.2	200,697,258.42	-
其中：股票投资		141,806,031.92	-
基金投资		-	-
债券投资		58,891,226.50	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	15,000,000.00	-
应收证券清算款		261,997.78	4,502,568.75
应收利息	7.4.7.5	544,453.18	305.35
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		221,933,894.00	5,140,143.19
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2016 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		975,440.55	-
应付赎回款		-	207,358.81
应付管理人报酬		223,804.52	5,110.72
应付托管费		18,650.37	425.92
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	115,000.65	12,298.11
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	255,000.00	209,500.00
负债合计		1,587,896.09	434,693.56
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	178,514,439.11	4,630,317.83
未分配利润	7.4.7.10	41,831,558.80	75,131.80
所有者权益合计		220,345,997.91	4,705,449.63
负债和所有者权益总计		221,933,894.00	5,140,143.19

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.234 元，基金份额总额 178,514,439.11 份。

## 7.2 利润表

会计主体：国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		41,575,912.98	982,763.28
1. 利息收入		2,031,200.74	704,896.09
其中：存款利息收入	7.4.7.11	134,591.87	151,172.82
债券利息收入		1,333,792.42	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		562,816.45	533,723.27
其他利息收入		-	20,000.00
2. 投资收益（损失以“-”填列）		11,917,195.41	-89,787.44
其中：股票投资收益	7.4.7.12	8,963,989.41	-89,787.44
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	12,713.12	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	2,940,492.88	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	27,615,819.04	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	11,697.79	367,654.63
<b>减：二、费用</b>		2,699,343.89	617,730.66
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,074,732.19	378,553.86
2. 托管费	7.4.10.2.2	172,894.34	31,546.26

3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	258,517.36	14,330.54
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	193,200.00	193,300.00
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>		38,876,569.09	365,032.62
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>		38,876,569.09	365,032.62

### 7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)

本报告期: 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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)	4,630,317.83	75,131.80	4,705,449.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	38,876,569.09	38,876,569.09
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)	173,884,121.28	2,879,857.91	176,763,979.19
其中: 1. 基金申购款	177,888,941.82	3,130,652.12	181,019,593.94
2. 基金赎回款	-4,004,820.54	-250,794.21	-4,255,614.75
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)	178,514,439.11	41,831,558.80	220,345,997.91
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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）	25,319,826.19	40,333.82	25,360,160.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	365,032.62	365,032.62
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）	-20,689,508.36	-330,234.64	-21,019,743.00
其中：1. 基金申购款	177,654,276.88	1,529,223.98	179,183,500.86
2. 基金赎回款	-198,343,785.24	-1,859,458.62	-200,203,243.86
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）	4,630,317.83	75,131.80	4,705,449.63

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（原名称为“国金通用鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）【2015】928 号文《关于核准国金通用鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）募集的批复》的核准，由国金基金管理有限公司于 2015 年 6 月 8 日至 2015 年 6 月 25 日向社会公开募集。基金合同于 2015 年 7 月 3 日生效。2015 年 9 月 23 日，本基金名称由“国金通用鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”变更为“国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”。本基金为上市契约型开放式，存续期限不定。首次募集规模为 204,137,143.70 份基金份额，其中场外募集份额为 46,061,573.70 份，场内募集份额为 158,075,802.86 份。

本基金的投资范围为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、股指期货等权益类金融工具、债券等固定收益类金融工具（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等）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的相关规定）。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 0%-95%；投资于债券、债券回购、货币市场工具、银行存款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不低于基金资产的 5%；中小企业私募债占基金资产净值的比例不高于 20%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后，本基金保留的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%。本基金的业绩比较基准为：一年期银行定期存款利率（税后）+3%。

#### 7.4.2 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（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《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 2 号《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。

#### 7.4.3 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 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则及应用指南、《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。

##### 7.4.4.1 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。

#### 7.4.4.2 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。

#### 7.4.4.3 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；

本基金目前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和债券投资等；

##### (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。

#### 7.4.4.4 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，或该金融资产已转移，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，即从本基金账户和资产负债表内予以转销；

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。

### 7.4.4.5 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方法进行估值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。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 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。

#### 7.4.4.8 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）”。

#### 7.4.4.9 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）系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、

交易性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。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.20% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率逐日计提；

(3) 卖出回购证券支出，按卖出回购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；

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第三位的，则采用待摊或预提的方法。

#### **7.4.4.11 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，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。登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，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。登记在基金份额持有人上海证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

(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。

#### **7.4.4.12 分部报告**

无

#### **7.4.4.13 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。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 7.4.6 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；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

### 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，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

### 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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题

的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	4,014,272.45	222,511.12
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	4,014,272.45	222,511.12

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	113,943,440.47	141,806,031.92	27,862,591.45

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	29,382,518.91	29,153,226.50	-229,292.41
	银行间市场	29,755,480.00	29,738,000.00	-17,480.00
	合计	59,137,998.91	58,891,226.50	-246,772.41
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		173,081,439.38	200,697,258.42	27,615,819.04
项目	上年度末 2016年12月31日			
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		-	-	-

注：本基金上年度末未持有交易性金融资产。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_交易所	15,000,000.00	-
合计	15,000,000.00	-
项目	上年度末 2016年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
合计	-	-

注：本基金上年度末未持有买入返售金融资产。

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

注：本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

**7.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
应收活期存款利息	887.20	99.98
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	695.20	202.51
应收债券利息	549,005.48	-
应收买入返售证券利息	-6,139.87	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	5.17	2.86
合计	544,453.18	305.35

**7.4.7.6 其他资产**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

**7.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	114,566.25	11,284.11
银行间市场应付交易费用	434.40	1,014.00
合计	115,000.65	12,298.11

**7.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提审计费	40,000.00	40,000.00
预提信息披露费	206,000.00	156,000.00
预提账户维护费	9,000.00	13,500.00
上清所查询服务费	-	-

合计	255,000.00	209,500.00
----	------------	------------

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,630,317.83	4,630,317.83
本期申购	177,888,941.82	177,888,941.82
本期赎回（以“-”号填列）	-4,004,820.54	-4,004,820.54
- 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	178,514,439.11	178,514,439.11

注：申购含转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

#### 7.4.7.10 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	74,466.20	665.60	75,131.80
本期利润	11,260,750.05	27,615,819.04	38,876,569.09
本期基金份额交易产生的变动数	2,394,188.48	485,669.43	2,879,857.91
其中：基金申购款	2,488,453.34	642,198.78	3,130,652.12
基金赎回款	-94,264.86	-156,529.35	-250,794.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,729,404.73	28,102,154.07	41,831,558.80

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
活期存款利息收入	49,977.54	44,723.97
定期存款利息收入	61,666.67	85,769.45
其他存款利息收入	-	-

结算备付金利息收入	18,270.06	19,769.22
其他	4,677.60	910.18
合计	134,591.87	151,172.82

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017 年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016 年12月31日
卖出股票成交总额	66,646,766.87	5,400,306.06
减：卖出股票成本总额	57,682,777.46	5,490,093.50
买卖股票差价收入	8,963,989.41	-89,787.44

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017 年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年 12月31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	12,713.12	-
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	12,713.12	-

注：本基金上年度可比期间无债券投资收益。

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017 年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	40,786,143.90	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	40,009,560.00	-
减：应收利息总额	763,870.78	-
买卖债券差价收入	12,713.12	-

注：本基金上年度可比期间无买卖债券差价收入。

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均无债券赎回差价收入。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均无债券申购差价收入。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金于本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均无买卖贵金属差价收入。

##### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均无贵金属赎回差价收入。

##### 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均无贵金属申购差价收入。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均无买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均无衍生工具投资收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月 31日
股票投资产生的股利收益	2,940,492.88	-

基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,940,492.88	-

注：本基金上年度可比期间无股利收益。

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017 年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年 12月31日
1. 交易性金融资产	27,615,819.04	-
——股票投资	27,862,591.45	-
——债券投资	-246,772.41	-
——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	-	-
合计	27,615,819.04	-

注：本基金上年度可比期间无公允价值变动损益。

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31 日
基金赎回费收入	11,697.79	367,654.63
合计	11,697.79	367,654.63

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月 31日
交易所市场交易费用	258,167.36	14,330.54
银行间市场交易费用	350.00	-
合计	258,517.36	14,330.54

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
审计费用	40,000.00	40,000.00
信息披露费	116,000.00	116,000.00
账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	-	400.00
上清所查询服务费	1,200.00	900.00
合计	193,200.00	193,300.00

#### 7.4.7.21 分部报告

无

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，除 7.4.6.2 增值税中披露的事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

注：本基金于本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金于本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金于本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金于本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,074,732.19	378,553.86
其中：支付销售机构的客户维护费	8,286.94	70,573.31

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.20%年费率计提。管理费计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

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

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	172,894.34	31,546.26

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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

**7.4.10.2.3 销售服务费**

注：无

**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

注：本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

**7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：本基金的管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

**7.4.10.4.2 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**

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

**7.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行	4,014,272.45	49,977.54	222,511.12	44,723.97

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，按银行同业利率计息。

**7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：本基金于本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

**7.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

无

**7.4.11 利润分配情况**

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

**7.4.12 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券****7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300664	鹏鹞环保	2017年12月28日	2018年1月5日	新股流通受限	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
002923	润都股份	2017年12月28日	2018年1月5日	新股流通受限	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-
300713	英可瑞	2017年10月23日	2018年11月1日	非公开发行流通受限	40.29	74.87	7,008	282,352.32	524,688.96	-

**7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300104	乐视网	2017年4月17日	临时停牌	15.33	-	-	31,200	550,405.00	478,296.00	-

300730	科创 信息	2017 年 12 月 25 日	临时 停牌	41.55	-	-	821	6,863.56	34,112.55	-
--------	----------	------------------------	----------	-------	---	---	-----	----------	-----------	---

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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。

#### 7.4.12.3.2 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。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

-

#### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 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。

##### 7.4.13.2.1 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 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	19,745,000.00	-
合计	19,745,000.00	-

注：表中所列示的债券投资为短期融资券、超短期融资券、同业存单及其他按短期信用评级的债券投资，其中超短期融资券和同业存单无信用评级。

##### 7.4.13.2.2 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 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
AAA	9,625,000.00	-
AAA 以下	237,226.50	-

未评级	-	-
合计	9,862,226.50	-

注：表中所列示的债券投资为除短期融资券、超短期融资券、同业存单、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。

### 7.4.13.3 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。

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无

#### 7.4.13.3.2 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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，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基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及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 7.4.12 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 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

### 7.4.13.4 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。

### 7.4.13.4.1 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。

本报告期内，本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年 12月31 日	1个月以内	1-3个月	3个月 -1 年	1-5年	5年 以上	不计息	合计
资产							
银行存款	4,014,272.45	-	-	-	-	-	4,014,272.45
结算备付金	1,405,546.39	-	-	-	-	-	1,405,546.39
存出保证金	10,365.78	-	-	-	-	-	10,365.78
交易性金融资产	9,993,000.00	19,745,000.00	-	29,153,226.50	-	141,806,031.92	200,697,258.42
买入返售金融资产	15,000,000.00	-	-	-	-	-	15,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	261,997.78	261,997.78
应收利息	-	-	-	-	-	544,453.18	544,453.18
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	30,423,184.62	19,745,000.00	-	29,153,226.50	-	142,612,482.88	221,933,894.00
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	975,440.55	975,440.55
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	223,804.52	223,804.52
应付托管费	-	-	-	-	-	18,650.37	18,650.37
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	115,000.65	115,000.65
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付税费	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	255,000.00	255,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	1,587,896.09	1,587,896.09
利率敏感度缺口	30,423,184.62	19,745,000.00	-29,153,226.50	-	-	141,024,586.79	220,345,997.91
上年度末 2016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	222,511.12	-	-	-	-	-	222,511.12
结算备付金	409,090.91	-	-	-	-	-	409,090.91
存出保证金	5,667.06	-	-	-	-	-	5,667.06
应收证券清算款	-	-	-	-	-	4,502,568.75	4,502,568.75
应收利息	-	-	-	-	-	305.35	305.35
资产总计	637,269.09	-	-	-	-	4,502,874.10	5,140,143.19
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	207,358.81	207,358.81
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	5,110.72	5,110.72
应付托管费	-	-	-	-	-	425.92	425.92
应付交易费用	-	-	-	-	-	12,298.11	12,298.11
其他负债	-	-	-	-	-	209,500.00	209,500.00
负债总计	-	-	-	-	-	434,693.56	434,693.56
利率敏感度缺口	637,269.09	-	-	-	-	4,068,180.54	4,705,449.63

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

### 7.4.13.4.1.2 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（2017年12月31日）	上年度末（2016年12月31日）
	利率+25个基点	-175,818.47	-
	利率-25个基点	177,324.29	-

### 7.4.13.4.2 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。

### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日		上年度末 2016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	141,806,031.92	64.36	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—债券投资	58,891,226.50	26.73	-	-
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	200,697,258.42	91.08	-	-

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定沪深 300 指数（000300.SH）变化 5%，其他变量不变；		
	Beta 系数是根据组合在过去一年所有交易日的净值数据和沪深 300 指数数据回归得出，反映了基金和沪深 300 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（2017 年 12 月 31 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	+5%	7,677,419.68	-
	-5%	-7,677,419.68	-

#### 7.4.13.4.4 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（2017 年 12 月 31 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

本基金非以公允价值计量的金融工具，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### (1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 141,482,299.13 元，属于第二层次的余额为人民币 59,214,959.29 元，无属于第三层次的余额（2016 年度：无）。

##### (2) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将

相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动（上年度：无）。

#### 7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

#### 7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

#### 7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2018 年 3 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	141,806,031.92	63.90
	其中：股票	141,806,031.92	63.90
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	58,891,226.50	26.54
	其中：债券	58,891,226.50	26.54
	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	15,000,000.00	6.76
	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	5,419,818.84	2.44
8	其他各项资产	816,816.74	0.37
9	合计	221,933,894.00	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,626,053.52	1.19
C	制造业	60,993,694.29	27.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	521,850.00	0.24
E	建筑业	5,240,661.00	2.38
F	批发和零售业	594,836.00	0.27
G	交通运输、仓储和邮政业	3,467,230.08	1.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,724,600.55	1.69
J	金融业	59,599,219.28	27.05
K	房地产业	1,708,790.00	0.78

L	租赁和商务服务业	125,490.00	0.06
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,621,598.20	1.19
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	406,320.00	0.18
S	综合	175,689.00	0.08
	合计	141,806,031.92	64.36

注：以上行业分类以 2017 年 12 月 31 日的中国证监会行业分类标准为依据。

### 8.2.2 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。

### 8.3 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	601318	中国平安	164,800	11,532,704.00	5.23
2	000063	中兴通讯	205,100	7,457,436.00	3.38
3	600519	贵州茅台	7,600	5,300,924.00	2.41
4	000858	五粮液	59,800	4,776,824.00	2.17
5	600036	招商银行	156,900	4,553,238.00	2.07
6	601166	兴业银行	202,800	3,445,572.00	1.56
7	601288	农业银行	883,200	3,382,656.00	1.54
8	600000	浦发银行	260,810	3,283,597.90	1.49
9	000568	泸州老窖	47,400	3,128,400.00	1.42
10	600016	民生银行	359,600	3,017,044.00	1.37
11	600887	伊利股份	92,200	2,967,918.00	1.35
12	000333	美的集团	51,700	2,865,731.00	1.30
13	002304	洋河股份	24,100	2,771,500.00	1.26
14	000651	格力电器	62,700	2,739,990.00	1.24
15	000338	潍柴动力	323,200	2,695,488.00	1.22
16	601328	交通银行	417,900	2,595,159.00	1.18
17	002415	海康威视	64,600	2,519,400.00	1.14
18	000876	新希望	330,900	2,465,205.00	1.12
19	002142	宁波银行	134,290	2,391,704.90	1.09
20	600030	中信证券	119,700	2,166,570.00	0.98

21	000776	广发证券	123,700	2,063,316.00	0.94
22	601668	中国建筑	228,200	2,058,364.00	0.93
23	601398	工商银行	328,000	2,033,600.00	0.92
24	000100	TCL 集	518,500	2,022,150.00	0.92
25	002352	顺丰控股	39,928	2,010,774.08	0.91
26	000423	东阿阿胶	33,000	1,988,910.00	0.90
27	000725	京东方 A	342,200	1,981,338.00	0.90
28	601601	中国太保	47,800	1,979,876.00	0.90
29	601766	中国中车	148,000	1,792,280.00	0.81
30	600104	上汽集团	53,300	1,707,732.00	0.78
31	000166	申万宏源	317,000	1,702,290.00	0.77
32	002310	东方园林	83,500	1,684,195.00	0.76
33	601169	北京银行	222,120	1,588,158.00	0.72
34	600837	海通证券	123,100	1,584,297.00	0.72
35	600048	保利地产	108,200	1,531,030.00	0.69
36	000625	长安汽车	119,700	1,508,220.00	0.68
37	000783	长江证券	190,200	1,496,874.00	0.68
38	000728	国元证券	133,950	1,473,450.00	0.67
39	300070	碧水源	79,300	1,377,441.00	0.63
40	002500	山西证券	147,300	1,358,106.00	0.62
41	601211	国泰君安	69,600	1,288,992.00	0.58
42	601988	中国银行	320,500	1,272,385.00	0.58
43	000826	启迪桑德	36,700	1,211,834.00	0.55
44	600518	康美药业	45,100	1,008,436.00	0.46
45	601818	光大银行	242,200	980,910.00	0.45
46	600028	中国石化	159,800	979,574.00	0.44
47	601390	中国中铁	113,400	951,426.00	0.43
48	601336	新华保险	12,700	891,540.00	0.40
49	000895	双汇发展	32,900	871,850.00	0.40
50	601688	华泰证券	49,700	857,822.00	0.39
51	601006	大秦铁路	90,400	819,928.00	0.37
52	600050	中国联通	129,000	816,570.00	0.37
53	601628	中国人寿	25,300	770,385.00	0.35
54	601088	中国神华	30,100	697,417.00	0.32
55	002466	天齐锂业	12,420	660,868.20	0.30
56	002230	科大讯飞	10,800	638,712.00	0.29
57	600029	南方航空	53,400	636,528.00	0.29
58	601857	中国石油	73,900	597,851.00	0.27
59	600999	招商证券	34,800	597,168.00	0.27

60	002024	苏宁云商	48,400	594,836.00	0.27
61	000538	云南白药	5,600	570,024.00	0.26
62	300713	英可瑞	7,008	524,688.96	0.24
63	601985	中国核电	71,000	521,850.00	0.24
64	002202	金风科技	27,560	519,506.00	0.24
65	601377	兴业证券	71,300	519,064.00	0.24
66	002008	大族激光	10,400	513,760.00	0.23
67	002456	欧菲科技	24,250	499,307.50	0.23
68	300104	乐视网	31,200	478,296.00	0.22
69	002594	比亚迪	6,900	448,845.00	0.20
70	601901	方正证券	63,200	435,448.00	0.20
71	002460	赣锋锂业	6,000	430,500.00	0.20
72	000503	海虹控股	9,800	422,968.00	0.19
73	300059	东方财富	32,280	418,026.00	0.19
74	002236	大华股份	17,100	394,839.00	0.18
75	002475	立讯精密	16,200	379,728.00	0.17
76	300124	汇川技术	12,800	371,456.00	0.17
77	002241	歌尔股份	21,000	364,350.00	0.17
78	600547	山东黄金	11,264	351,211.52	0.16
79	601800	中国交建	23,200	296,960.00	0.13
80	300024	机器人	15,700	295,474.00	0.13
81	000768	中航飞机	17,400	293,886.00	0.13
82	002673	西部证券	23,814	293,388.48	0.13
83	002405	四维图新	10,800	285,012.00	0.13
84	600100	同方股份	27,100	265,580.00	0.12
85	000839	中信国安	27,000	258,930.00	0.12
86	000157	中联重科	57,800	258,366.00	0.12
87	000623	吉林敖东	11,310	254,475.00	0.12
88	002081	金螳螂	16,300	249,716.00	0.11
89	002252	上海莱士	12,300	244,155.00	0.11
90	000793	华闻传媒	22,800	228,228.00	0.10
91	000709	河钢股份	56,200	219,180.00	0.10
92	002065	东华软件	24,200	198,440.00	0.09
93	000559	万向钱潮	18,840	191,226.00	0.09
94	002007	华兰生物	6,700	180,096.00	0.08
95	300027	华谊兄弟	20,400	178,092.00	0.08
96	000402	金融街	16,000	177,760.00	0.08
97	000009	中国宝安	24,300	175,689.00	0.08
98	000938	紫光股份	1,900	136,857.00	0.06

99	000917	电广传媒	13,900	125,934.00	0.06
100	002183	怡亚通	17,800	125,490.00	0.06
101	000738	航发控制	6,100	93,269.00	0.04
102	002292	奥飞娱乐	6,500	92,885.00	0.04
103	002610	爱康科技	23,000	54,510.00	0.02
104	300735	N 光弘	3,764	54,163.96	0.02
105	300085	银之杰	3,500	47,600.00	0.02
106	002797	第一创业	4,480	43,904.00	0.02
107	002915	中欣氟材	1,085	38,181.15	0.02
108	300730	科创信息	821	34,112.55	0.02
109	603856	东宏股份	1,619	33,302.83	0.02
110	300664	鹏鹞环保	3,640	32,323.20	0.01
111	002922	N伊戈尔	1,245	22,248.15	0.01
112	002923	润都股份	954	16,227.54	0.01
113	601727	上海电气	300	2,007.00	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	601318	中国平安	9,158,866.00	194.64
2	601166	兴业银行	5,188,997.00	110.28
3	600016	民生银行	5,020,779.00	106.70
4	600036	招商银行	4,544,250.35	96.57
5	600519	贵州茅台	4,105,330.97	87.25
6	601328	交通银行	3,893,190.00	82.74
7	000063	中兴通讯	3,479,783.00	73.95
8	600000	浦发银行	3,364,316.00	71.50
9	000333	美的集团	3,226,492.00	68.57
10	000651	格力电器	3,097,035.25	65.82
11	601668	中国建筑	3,092,077.00	65.71
12	600030	中信证券	3,019,849.00	64.18
13	600837	海通证券	3,007,456.00	63.91
14	300498	温氏股份	2,901,019.72	61.65

15	601288	农业银行	2,851,455.00	60.60
16	601169	北京银行	2,846,382.00	60.49
17	002415	海康威视	2,717,105.00	57.74
18	000876	新希望	2,705,602.00	57.50
19	600887	伊利股份	2,566,047.00	54.53
20	000858	五粮液	2,394,646.46	50.89
21	601398	工商银行	2,304,425.00	48.97
22	601766	中国中车	2,284,320.00	48.55
23	000776	广发证券	2,191,872.00	46.58
24	600104	上汽集团	2,082,298.00	44.25
25	601601	中国太保	2,059,792.00	43.77
26	002352	顺丰控股	2,051,536.00	43.60
27	000166	申万宏源	2,025,290.00	43.04
28	601211	国泰君安	2,019,415.00	42.92
29	002304	洋河股份	2,017,325.00	42.87
30	000783	长江证券	1,960,189.56	41.66
31	000625	长安汽车	1,940,723.00	41.24
32	002142	宁波银行	1,909,094.60	40.57
33	000423	东阿阿胶	1,871,284.00	39.77
34	000100	TCL 集	1,869,548.00	39.73
35	000338	潍柴动力	1,848,685.00	39.29
36	000568	泸州老窖	1,817,606.00	38.63
37	000728	国元证券	1,799,251.00	38.24
38	002500	山西证券	1,792,778.00	38.10
39	000895	双汇发展	1,771,309.55	37.64
40	601988	中国银行	1,754,373.00	37.28
41	601989	中国重工	1,620,771.00	34.44
42	601390	中国中铁	1,553,277.00	33.01
43	600048	保利地产	1,542,381.00	32.78
44	601818	光大银行	1,517,235.00	32.24
45	300070	碧水源	1,509,459.00	32.08
46	600028	中国石化	1,436,067.00	30.52
47	601688	华泰证券	1,391,048.00	29.56
48	002310	东方园林	1,360,806.63	28.92
49	601186	中国铁建	1,336,794.00	28.41
50	000826	启迪桑德	1,288,506.00	27.38

51	600050	中国联通	1,279,914.00	27.20
52	600518	康美药业	1,219,835.00	25.92
53	600958	东方证券	1,128,996.00	23.99
54	000725	京东方A	1,115,572.00	23.71
55	000002	万科A	1,097,180.64	23.32
56	601628	中国人寿	1,015,377.00	21.58
57	002396	星网锐捷	976,247.00	20.75
58	601006	大秦铁路	968,741.00	20.59
59	601857	中国石油	953,847.00	20.27
60	601336	新华保险	905,001.00	19.23
61	600999	招商证券	888,896.00	18.89
62	601377	兴业证券	859,607.10	18.27
63	601985	中国核电	777,769.00	16.53
64	601088	中国神华	773,417.00	16.44
65	601788	光大证券	719,626.00	15.29
66	600637	东方明珠	718,738.00	15.27
67	600893	航发动力	703,149.00	14.94
68	600547	山东黄金	648,912.00	13.79
69	600111	北方稀土	636,215.00	13.52
70	002460	赣锋锂业	613,278.00	13.03
71	600029	南方航空	602,604.00	12.81
72	601800	中国交建	598,332.00	12.72
73	600100	同方股份	566,304.00	12.04
74	002450	康得新	566,100.00	12.03
75	002024	苏宁云商	550,792.00	11.71
76	300104	乐视网	550,405.00	11.70
77	601901	方正证券	495,190.00	10.52
78	601198	东兴证券	494,284.00	10.50
79	601998	中信银行	489,667.00	10.41
80	300059	东方财富	446,809.00	9.50
81	002466	天齐锂业	434,334.20	9.23
82	000538	云南白药	430,437.50	9.15
83	001979	招商蛇口	427,619.00	9.09
84	000768	中航飞机	418,470.00	8.89
85	000503	海虹控股	416,059.00	8.84
86	002673	西部证券	406,477.18	8.64

87	002739	万达电影	365,252.00	7.76
88	002202	金风科技	358,253.00	7.61
89	300072	三聚环保	355,583.00	7.56
90	002594	比亚迪	346,030.00	7.35
91	002027	分众传媒	333,528.00	7.09
92	002230	科大讯飞	330,877.00	7.03
93	300024	机器人	326,245.00	6.93
94	002456	欧菲科技	322,997.00	6.86
95	600406	国电南瑞	319,271.00	6.79
96	000839	中信国安	316,440.00	6.72
97	002241	歌尔股份	313,909.00	6.67
98	000630	铜陵有色	290,304.00	6.17
99	000069	华侨城 A	289,150.00	6.15
100	300713	英可瑞	282,352.32	6.00
101	000157	中联重科	281,486.00	5.98
102	300124	汇川技术	278,737.00	5.92
103	002236	大华股份	259,920.00	5.52
104	000623	吉林敖东	259,018.00	5.50
105	000750	国海证券	257,114.00	5.46
106	002252	上海莱士	256,451.00	5.45
107	002065	东华软件	254,992.00	5.42
108	002008	大族激光	250,120.00	5.32
109	000060	中金岭南	248,668.00	5.28
110	002007	华兰生物	244,818.00	5.20
111	000793	华闻传媒	242,136.00	5.15
112	000009	中国宝安	238,869.00	5.08
113	002475	立讯精密	237,226.50	5.04
114	000540	中天金融	229,250.00	4.87
115	300027	华谊兄弟	223,948.00	4.76
116	000709	河钢股份	220,304.00	4.68
117	000917	电广传媒	205,442.00	4.37
118	002405	四维图新	203,904.00	4.33
119	000792	盐湖股份	201,637.00	4.29
120	002183	怡亚通	200,716.00	4.27
121	000559	万向钱潮	198,919.00	4.23
122	002407	多氟多	190,531.00	4.05

123	000983	西山煤电	187,785.00	3.99
124	002385	大北农	181,936.00	3.87
125	002081	金螳螂	176,692.00	3.76
126	002340	格林美	176,638.00	3.75
127	000402	金融街	174,240.00	3.70
128	300168	万达信息	173,369.00	3.68
129	600340	华夏幸福	164,448.00	3.49
130	000977	浪潮信息	156,571.00	3.33
131	000738	航发控制	155,550.00	3.31
132	002176	江特电机	146,286.00	3.11
133	002292	奥飞娱乐	144,495.00	3.07
134	000046	泛海控股	140,156.00	2.98
135	002030	达安基因	138,668.00	2.95
136	300253	卫宁健康	138,415.00	2.94
137	300251	光线传媒	134,000.00	2.85
138	000988	华工科技	130,559.00	2.77
139	601108	财通证券	130,483.08	2.77
140	600703	三安光电	126,060.00	2.68
141	300418	昆仑万维	117,008.00	2.49
142	600741	华域汽车	113,526.00	2.41
143	300431	暴风集团	113,185.00	2.41
144	000938	紫光股份	107,014.00	2.27
145	601225	陕西煤业	103,827.00	2.21
146	601952	苏垦农发	97,161.00	2.06

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。

#### 8.4.2 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	601318	中国平安	3,156,393.00	67.08
2	300498	温氏股份	2,400,491.20	51.02
3	000333	美的集团	2,190,344.94	46.55
4	002415	海康威视	2,150,042.00	45.69
5	000651	格力电器	2,033,000.00	43.21
6	601166	兴业银行	1,790,685.00	38.06

7	600016	民生银行	1,706,100.00	36.26
8	600036	招商银行	1,611,520.00	34.25
9	600519	贵州茅台	1,474,639.00	31.34
10	601989	中国重工	1,409,711.00	29.96
11	601328	交通银行	1,389,210.00	29.52
12	601186	中国铁建	1,286,358.00	27.34
13	002396	星网锐捷	1,236,254.87	26.27
14	000895	双汇发展	1,083,785.00	23.03
15	601668	中国建筑	1,064,033.00	22.61
16	600030	中信证券	1,044,207.00	22.19
17	600958	东方证券	1,026,666.00	21.82
18	000002	万科A	1,019,175.00	21.66
19	600837	海通证券	1,014,068.00	21.55
20	601169	北京银行	975,394.00	20.73
21	600887	伊利股份	887,420.00	18.86
22	601398	工商银行	811,013.00	17.24
23	601766	中国中车	806,052.00	17.13
24	600104	上汽集团	727,292.00	15.46
25	601211	国泰君安	691,789.00	14.70
26	601601	中国太保	688,709.00	14.64
27	601788	光大证券	677,837.00	14.41
28	600111	北方稀土	663,286.00	14.10
29	600637	东方明珠	656,869.00	13.96
30	002450	康得新	614,326.00	13.06
31	601988	中国银行	614,016.00	13.05
32	600893	航发动力	591,219.00	12.56
33	600048	保利地产	540,765.00	11.49
34	601390	中国中铁	538,233.00	11.44
35	601818	光大银行	534,681.00	11.36
36	600028	中国石化	482,718.00	10.26
37	601688	华泰证券	480,826.00	10.22
38	600050	中国联通	479,004.00	10.18
39	001979	招商蛇口	456,860.00	9.71
40	601998	中信银行	453,097.00	9.63
41	601198	东兴证券	440,720.00	9.37
42	600518	康美药业	422,794.00	8.99
43	002460	赣锋锂业	404,000.00	8.59
44	300072	三聚环保	399,825.50	8.50

45	002027	分众传媒	352,532.00	7.49
46	601628	中国人寿	344,054.00	7.31
47	601006	大秦铁路	333,400.00	7.09
48	300699	光威复材	320,396.40	6.81
49	601857	中国石油	320,188.00	6.80
50	000069	华侨城A	318,836.00	6.78
51	601336	新华保险	316,293.00	6.72
52	002739	万达电影	315,980.00	6.72
53	600406	国电南瑞	312,480.00	6.64
54	600999	招商证券	310,094.00	6.59
55	601377	兴业证券	299,428.00	6.36
56	601985	中国核电	271,796.00	5.78
57	601088	中国神华	264,264.00	5.62
58	601108	财通证券	263,488.68	5.60
59	002916	深南电路	262,283.32	5.57
60	000630	铜陵有色	235,872.00	5.01
61	603260	合盛硅业	234,388.68	4.98
62	600029	南方航空	221,399.00	4.71
63	601800	中国交建	220,664.00	4.69
64	600547	山东黄金	219,615.00	4.67
65	000540	中天金融	219,204.00	4.66
66	000060	中金岭南	209,592.00	4.45
67	601952	苏垦农发	198,700.50	4.22
68	600100	同方股份	196,598.00	4.18
69	300676	华大基因	194,544.51	4.13
70	000750	国海证券	192,270.00	4.09
71	601326	秦港股份	181,693.21	3.86
72	601878	浙商证券	172,578.56	3.67
73	600340	华夏幸福	169,425.00	3.60
74	000792	盐湖股份	168,285.00	3.58
75	600025	华能水电	167,655.08	3.56
76	002385	大北农	159,742.00	3.39
77	601949	中国出版	158,483.30	3.37
78	002340	格林美	152,768.00	3.25
79	000983	西山煤电	148,618.00	3.16
80	002407	多氟多	144,247.00	3.07
81	300679	电连技术	137,978.40	2.93
82	002030	达安基因	134,891.00	2.87

83	300168	万达信息	134,596.00	2.86
84	600703	三安光电	131,040.00	2.78
85	000977	浪潮信息	129,336.00	2.75
86	000046	泛海控股	126,096.00	2.68
87	601366	利群股份	122,603.40	2.61
88	000988	华工科技	120,931.00	2.57
89	600741	华域汽车	120,711.00	2.57
90	002176	江特电机	117,777.00	2.50
91	300418	昆仑万维	116,396.00	2.47
92	603882	金城医学	114,636.87	2.44
93	300251	光线传媒	110,550.00	2.35
94	603113	金能科技	108,725.60	2.31
95	002500	山西证券	108,698.00	2.31
96	603980	吉华集团	108,643.50	2.31
97	300253	卫宁健康	108,215.20	2.30
98	603612	索通发展	107,643.00	2.29
99	601225	陕西煤业	105,576.00	2.24
100	603367	辰欣药业	105,184.95	2.24
101	603920	世运电路	101,340.00	2.15
102	603359	东珠景观	101,232.20	2.15
103	603533	掌阅科技	100,901.97	2.14
104	300660	江苏雷利	100,096.26	2.13
105	300708	聚灿光电	98,667.28	2.10
106	603776	永安行	97,231.20	2.07
107	002906	华阳集团	95,778.06	2.04
108	603385	惠达卫浴	94,380.00	2.01

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。

#### 8.4.3 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	171,626,217.93
卖出股票收入（成交）总额	66,646,766.87

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。

#### 8.5 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	9,993,000.00	4.54
	其中：政策性金融债	9,993,000.00	4.54
4	企业债券	28,916,000.00	13.12
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	237,226.50	0.11
8	同业存单	19,745,000.00	8.96
9	其他	-	-
10	合计	58,891,226.50	26.73

### 8.6 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	170203	17 国开 03	100,000	9,993,000.00	4.54
2	111721187	17 渤海银行 CD187	100,000	9,873,000.00	4.48
3	111709506	17 浦发银行 CD506	100,000	9,872,000.00	4.48
4	136830	16 中信 G1	100,000	9,646,000.00	4.38
5	136622	16 国君 G3	100,000	9,645,000.00	4.38

### 8.7 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 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。

### 8.9 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。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

报告期，本基金未投资股指期货。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

报告期，本基金未投资国债期货。

#### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未参与国债期货投资。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体，没有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。

#### 8.12.2

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。

#### 8.12.3 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	10,365.78
2	应收证券清算款	261,997.78
3	应收股利	-
4	应收利息	544,453.18
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	816,816.74

#### 8.12.4 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	127004	模塑转债	237,226.50	0.11

#### 8.12.5 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
210	850,068.76	176,973,127.49	99.14%	1,541,311.62	0.86%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份 额比例
1	建信贵宾 4 号资产管理计划	88,640,048.17	49.65%
2	建信贵宾 1 号资产管理计划	49,309,664.69	27.62%
3	万家基金万融一号资产管理计划	39,023,414.63	21.86%
4	穆怀发	197,754.00	0.11%
5	杨秀英	100,000.00	0.06%
6	施鸿	100,000.00	0.06%
7	董丽亚	98,814.23	0.06%
8	余淑英	64,853.00	0.04%
9	徐先	52,785.00	0.03%
10	陈刚	50,413.62	0.03%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	3,751.86	0.0021%

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0~10

本基金基金经理持有本开放式基金	0~10
-----------------	------

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年7月3日）基金份额总额	204,137,143.70
本报告期期初基金份额总额	4,630,317.83
本报告期基金总申购份额	177,888,941.82
减:本报告期基金总赎回份额	4,004,820.54
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	178,514,439.11

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。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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

本报告期内无基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 40,000 元人民币。截至本报告期末，该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

### 11.6 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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	
国信证券		1,138,110,751.47	59.14%	101,000.12	59.14%	-

方正证券	1	95,413,600.23	40.86%	69,775.81	40.86%	-
------	---	---------------	--------	-----------	--------	---

注：1. 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。

### 11.7.2 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
国信证券	29,480,662.81	100.00%	2,470,600,000.00	100.00%	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 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	《国金基金管理有限公司 2016 年 12 月 31 日旗下基金净值公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 1 月 3 日
2	《国金鑫新灵活配置混合型证券	指定披露媒体和本基金基	2017 年 1 月 21 日

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
	投资基金（LOF）2016 年第 4 季度报告》	金管理人网站	
3	《国金基金管理有限公司关于基金经理恢复履行职责的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 2 月 13 日
4	《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）招募说明书（更新）》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 2 月 17 日
5	《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）招募说明书（更新）摘要》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 2 月 17 日
6	《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）招募说明书（更新）更正公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 3 月 9 日
7	《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2016 年年度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 3 月 28 日
8	《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2016 年年度报告摘要》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 3 月 28 日
9	《国金基金管理有限公司关于服务器升级维护的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 4 月 13 日
10	《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2017 年第 1 季度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 4 月 22 日
11	《国金基金管理有限公司关于直销交易系统升级的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 6 月 24 日
12	《国金基金 2017 年 6 月 30 日旗下基金净值公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 7 月 1 日
13	《国金基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 7 月 18 日
14	《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2017 年第 2 季度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 7 月 19 日
15	《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）投资基金托管人关联方承销证券的关联交易公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 7 月 29 日
16	《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）投资基金托管人关联方承销证券的关联交易公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 8 月 16 日
17	《国金鑫新灵活配置混合型证券	指定披露媒体和本基金基	2017 年 8 月 16 日

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
	投资基金（LOF）招募说明书(更新)》	金管理人网站	
18	《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）招募说明书(更新)摘要》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 8 月 16 日
19	《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2017 年半年度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 8 月 25 日
20	《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2017 年半年度报告摘要》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 8 月 25 日
21	《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2017 年半年度报告及摘要更正公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 8 月 26 日
22	《关于调整国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）单笔申购最低金额的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 8 月 30 日
23	《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）投资基金托管人关联方承销证券的关联交易公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 9 月 2 日
24	《国金基金管理有限公司关于增加天津万家财富资产管理有限公司为旗下基金销售机构的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 10 月 16 日
25	《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2017 年第 3 季度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 10 月 27 日
26	《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）投资基金托管人关联方承销证券的关联交易公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 11 月 8 日
27	《关于国金基金管理有限公司旗下产品实施增值税政策的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2017 年 12 月 30 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和基金份额累计净值。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	2017年1月24日至2017年12月31日	0.00	49,309,664.69	0.00	49,309,664.69	27.62%
	2	2017年1月24日至2017年12月31日	0.00	88,640,048.17	0.00	88,640,048.17	49.65%
	3	2017年4月17日至2017年12月31日	0.00	39,023,414.63	0.00	39,023,414.63	21.86%
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>							

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同；
- 3、国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）托管协议；
- 4、国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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。

### 13.2 存放地点

本基金基金管理人的办公场所。

### 13.3 查阅方式

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

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：4000-2000-18

公司网址：www.gfund.com

国金基金管理有限公司

2018年3月27日