

# 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

2017 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：平安银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 25 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 24 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 2017 年 1 月 1 日起至 2017 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.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
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.....	13
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.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	52
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	52
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	52
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.....	52
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	53
7.12 投资组合报告附注.....	53
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>55</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	55
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	55
8.4 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.....	55
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>57</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>58</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	58
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.....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4 基金投资策略的改变.....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
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.....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
10.8 其他重大事件.....	59

<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>61</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 .....	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	61
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>62</b>
12.1 备查文件目录.....	62
12.2 存放地点.....	62
12.3 查阅方式.....	62

## § 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	178,828,232.50 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》。
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.gfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	3,602,523.62
本期利润	14,804,458.98
加权平均基金份额本期利润	0.1119
本期加权平均净值利润率	10.81%
本期基金份额净值增长率	8.27%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	6,086,668.23
期末可供分配基金份额利润	0.0340
期末基金资产净值	196,636,370.99
期末基金份额净值	1.100
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	10.00%

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	4.86%	0.48%	0.34%	0.01%	4.52%	0.47%
过去三个月	7.32%	0.47%	1.05%	0.01%	6.27%	0.46%
过去六个月	8.27%	0.41%	2.12%	0.01%	6.15%	0.40%

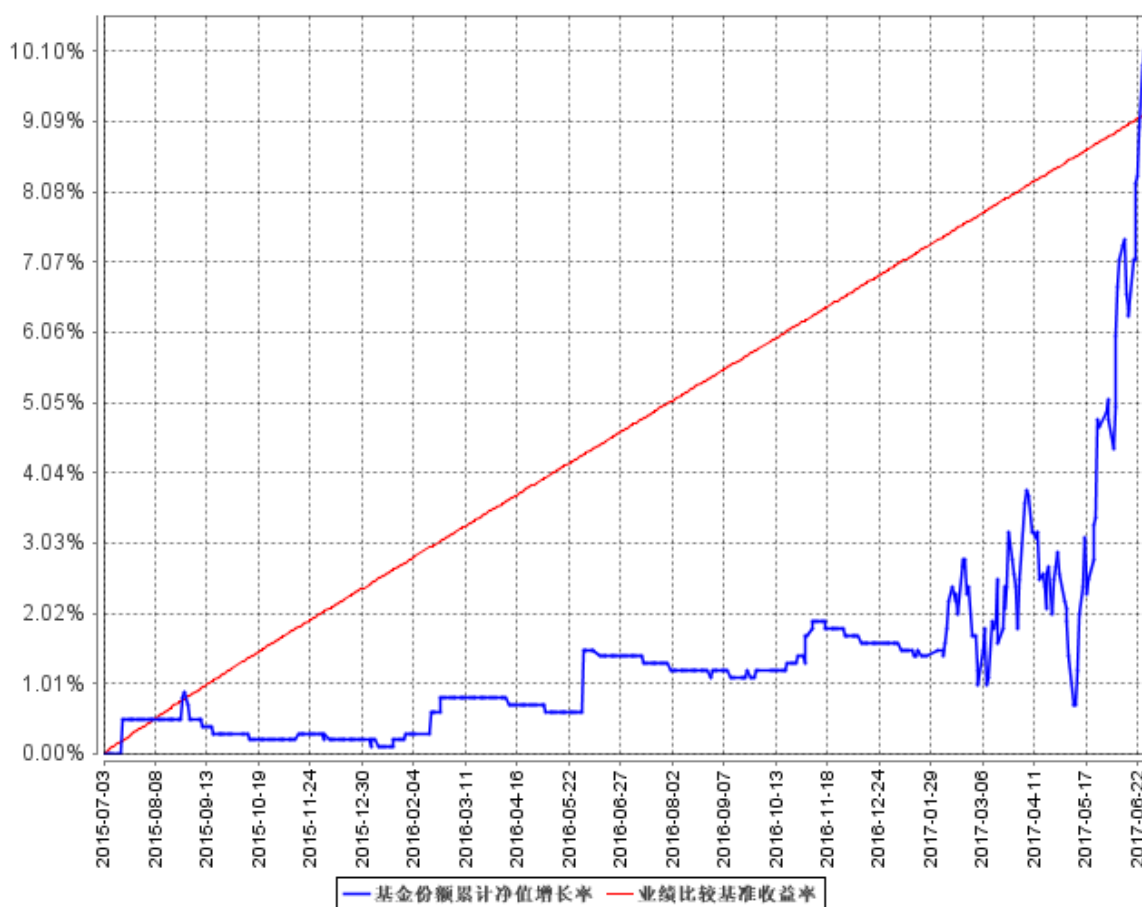


过去一年	8.48%	0.29%	4.36%	0.01%	4.12%	0.28%
自基金合同生效起至今	10.00%	0.21%	9.21%	0.01%	0.79%	0.20%

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 06 月 30 日。

### 3.3 其他指标

注：无

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国金基金管理有限公司（原名称为“国金通用基金管理有限公司”）经中国证券监督管理委员会（证监许可[2011]1661号）批准，于2011年11月2日成立，总部设在北京。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6月30日，国金基金管理有限公司共管理9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。

#### 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、国金鑫安保本、国金上证50基金经理，量化投资事业三部总经理	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

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，本基金主要进行回购投资进行现金管理。后期来看，我们认为虽然二季度经济增长表现出较强的韧性，短期来看三季度经济有望继续延续二季度的韧性，但四季度经济会集中面临下行压力，因此市场维持震荡格局的可能性高，本基金将通过合理的资产配置和积极的证券选择，在严格控制风险的前提下继续追求资本的稳健回报。

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，2017 年央行将实行稳健中性的货币政策，短期看三季度美联储加息概率较低，短期人民币贬值预期有所缓解，资本外流压力减轻，PPI 下行减缓并有企稳迹象，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 8.27%，同期业绩比较基准收益率为 2.12%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度经济超预期高增长显示出经济的韧性，黑色系的狂欢使得上游工业企业的盈利状况大幅好转，但需求不足，上游原材料价格上涨并未顺利传导至下游企业，这也为经济持续保持较高的韧性埋下了隐忧。展望三季度，随着 PPI 的企稳，CPI 稳中有升，在消费、基建投资稳定增长的情况下、外需改善的助力下三季度经济有望继续延续二季度的韧性。但步入四季度，经济会面临一定下行压力，其中有高基数的因素在，更为重要的是价格因素对实际经济增速的支撑将退去。对证券市场而言，美联储三季度加息概率较低，人民币贬值压力短期有所缓解，短期资本外流压力减轻，同时国内供给侧结构性改革，环保限产等方面的带动下，证券市场有望保持震荡上行，但目前市场仍旧是存量资金在博弈，缺乏新增资金入市，因而证券市场也难以有较明显的趋势性

行情。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，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，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、数量研究员、风险管理人员、监察稽核人员及基金清算人员组成。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。涉及模型定价的，由数量研究员或风险控制人员向运营支持部提供模型定价的结果，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，不存在应分配而未分配的情况。

#### 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 6 月 30 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，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

### 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方面进行了必要的监督，对本基金的基金资产净值计算、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的复核，未发现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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，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 半年度财务会计报告 (未经审计)

## 6.1 资产负债表

会计主体: 国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)

报告截止日: 2017 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
银行存款	6.4.7.1	2,620,466.20	222,511.12
结算备付金		760,471.30	409,090.91
存出保证金		128,119.97	5,667.06
交易性金融资产	6.4.7.2	175,735,741.08	-
其中: 股票投资		126,357,037.58	-
基金投资		-	-
债券投资		49,378,703.50	-
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	17,000,135.00	-
应收证券清算款		176,360.55	4,502,568.75
应收利息	6.4.7.5	932,229.44	305.35
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		197,353,523.54	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 6 月 30 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		176,283.35	207,358.81
应付管理人报酬		189,101.91	5,110.72
应付托管费		15,758.49	425.92
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	126,649.40	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	6.4.7.8	209,359.40	209,500.00
负债合计		717,152.55	434,693.56
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	178,828,232.50	4,630,317.83
未分配利润	6.4.7.10	17,808,138.49	75,131.80
所有者权益合计		196,636,370.99	4,705,449.63
负债和所有者权益总计		197,353,523.54	5,140,143.19

注：本报告截止日2017年6月30日，基金份额净值人民币1.100元，基金份额总额178,828,232.50份。

## 6.2 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6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017年1月1日至 2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年6月30日
<b>一、收入</b>		16,007,240.07	425,007.79
1.利息收入		568,200.57	191,890.50
其中：存款利息收入	6.4.7.11	112,777.58	102,636.55
债券利息收入		246,507.06	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		208,915.93	89,253.95
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,228,256.69	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,924,209.60	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	12,889.01	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
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	1,291,158.08	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	11,201,935.36	-
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	8,847.45	233,117.29



<b>减：二、费用</b>		1,202,781.09	230,662.24
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	805,676.52	124,421.72
2. 托管费	6.4.10.2.2	67,139.69	10,368.48
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	234,005.48	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	95,959.40	95,872.04
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		14,804,458.98	194,345.55
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		14,804,458.98	194,345.55

### 6.3 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6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017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）	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）	-	14,804,458.98	14,804,458.98
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）	174,197,914.67	2,928,547.71	177,126,462.38
其中：1.基金申购款	177,351,546.49	3,039,247.38	180,390,793.87
2.基金赎回款	-3,153,631.82	-110,699.67	-3,264,331.49
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	178,828,232.50	17,808,138.49	196,636,370.99

项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
	金净值)		
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)	-	194,345.55	194,345.55
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)	-17,052,728.22	-119,742.04	-17,172,470.26
其中：1.基金申购款	79,753,060.44	358,877.16	80,111,937.60
2.基金赎回款	-96,805,788.66	-478,619.20	-97,284,407.86
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)	8,267,097.97	114,937.33	8,382,035.30

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%。

#### 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《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《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。

#### 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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止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

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 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；

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. 营业税、增值税

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，继续免征营业税；

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。

### 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。

## 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 2017 年 6 月 30 日
活期存款	2,620,466.20
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	2,620,466.20

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	115,245,406.81	126,357,037.58	11,111,630.77
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	29,382,518.91	29,466,703.50	84,184.59
	银行间市场	19,905,880.00	19,912,000.00	6,120.00
	合计	49,288,398.91	49,378,703.50	90,304.59
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		164,533,805.72	175,735,741.08	11,201,935.36

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	7,000,000.00	-
买入返售证券_银行间	10,000,135.00	-
合计	17,000,135.00	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	625.02
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	341.80
应收债券利息	906,481.32
应收买入返售证券利息	24,723.60
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	57.70
合计	932,229.44

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	126,339.40
银行间市场应付交易费用	310.00
合计	126,649.40

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	209,359.40
合计	209,359.40

#### 6.4.7.9 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6月30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	177,351,546.49	177,351,546.49
本期赎回(以“-”号填列)	-3,153,631.82	-3,153,631.82
- 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	178,828,232.50	178,828,232.50

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。



**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	74,466.20	665.60	75,131.80
本期利润	3,602,523.62	11,201,935.36	14,804,458.98
本期基金份额交易产生的变动数	2,409,678.41	518,869.30	2,928,547.71
其中：基金申购款	2,458,518.71	580,728.67	3,039,247.38
基金赎回款	-48,840.30	-61,859.37	-110,699.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,086,668.23	11,721,470.26	17,808,138.49

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	37,151.87
定期存款利息收入	61,666.67
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	9,800.09
其他	4,158.95
合计	112,777.58

**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 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	54,199,191.01
减：卖出股票成本总额	51,274,981.41
买卖股票差价收入	2,924,209.60

**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
----	----

	2017年1月1日至2017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	12,889.01
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	12,889.01

#### 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 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	10,273,916.40
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	10,152,490.00
减：应收利息总额	108,537.39
买卖债券差价收入	12,889.01

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券赎回差价收入。

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券申购差价收入。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：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

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

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

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,291,158.08
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,291,158.08

**6.4.7.17 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6月30日
1. 交易性金融资产	11,201,935.36
——股票投资	11,111,630.77
——债券投资	90,304.59
——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	11,201,935.36

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日

基金赎回费收入	8,847.45
合计	8,847.45

注：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。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	233,830.48
银行间市场交易费用	175.00
合计	234,005.48

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	57,523.61
上清所帐户维护费	9,000.00
上清所查询服务费	600.00
中债债券账户维护费	9,000.00
合计	95,959.40

#### 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，本基金并无须作披露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
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
上海国金通用财富资产管理有限公司	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。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

注：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股票交易。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

注：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债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：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债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：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权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间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 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	805,676.52	124,421.72
其中：支付销售机构的客户维护费	5,516.77	21,408.87

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 2 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。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	67,139.69	10,368.48

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% / \text{当年天数}$$

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 2 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。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：无

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（回购）交易。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生管理人运用固有资金投资本基金的情况。

#### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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
平安银行股份有限公司	2,620,466.20	37,151.87	277,394.67	20,849.32

注：本基金的活期银行存款和部分定期银行存款由基金托管人平安银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无

### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本会计期间未进行利润分配。

### 6.4.12 期末（2017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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
002879	长缆科技	2017年6月5日	2017年7月7日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017年6月15日	2017年7月17日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017年6月28日	2017年7月6日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017年6月30日	2017年7月10日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017年6月26日	2017年7月3日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017年6月30日	2017年7月12日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
603617	君禾股份	2017年6月23日	2017年7月3日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

#### 6.4.12.2 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
000100	TCL集	2017年6月2日	临时停牌	3.43	-	-	518,500	1,869,548.00	1,778,455.00	-
600050	中国联通	2017年4月6日	临时停	7.47	-	-	129,000	842,822.39	963,630.00	-



		日	牌							
601088	中国神华	2017年6月5日	临时停牌	22.29	-	-	30,100	509,405.95	670,929.00	-
300104	乐视网	2017年4月17日	临时停牌	30.68	-	-	15,600	550,405.00	478,608.00	-
600100	同方股份	2017年4月21日	临时停牌	14.12	-	-	27,100	371,603.48	382,652.00	-
002252	上海莱士	2017年6月21日	临时停牌	20.24	-	-	12,300	256,451.00	248,952.00	-
000503	海虹控股	2017年5月11日	临时停牌	24.93	-	-	9,800	416,059.00	244,314.00	-
300085	银之杰	2017年6月30日	临时停牌	18.50	-	-	3,500	72,922.00	64,750.00	-
002610	爱康科技	2017年5月12日	临时停牌	2.44	-	-	23,000	73,370.00	56,120.00	-
601727	上海电气	2017年6月23日	临时停牌	7.57	-	-	300	2,163.00	2,271.00	-

### 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

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人的风险管理政策是通过事前充分到位的防范、事中实时有效的过程控制、事后完备可追踪的检查和反馈，将风险管理贯穿于投研运作的整个流程，从而使基金投资风险可测、可控、可承担，有效防范和化解投研业务的市场风险、信用风险、流动性风险及操作风险。

本基金管理人建立了董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险管理组织体系，合规风控部风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险控制委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

董事会负责公司整体风险的预防和控制，审核、监督公司风险控制制度的有效执行。董事会下设风险管理委员会，并制定《风险管理委员会议事规则》，规范其组成人员、职责、议事规则等事宜。

督察长负责公司及其投资组合运作的监察稽核工作，向董事会汇报。

总经理负责公司日常经营管理中的风险控制工作。总经理下设风险控制委员会，负责对公司经营及投资组合运作中的风险进行识别、评估和防控，负责对投资组合风险评估报告中提出的重大问题进行讨论和决定应对措施。公司制定《风险控制委员会议事规则》，规范其组成人员、职责、议事规则等事宜。

本基金管理人推行全员风险管理理念，公司各部门是风险管理的一线部门，公司各部门负责人是其部门风险管理的第一责任人，根据公司制度规定的各项作业流程和规范，加强对风险的控制。

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制，基金经理是本基金风险管理的第一责任人。

合规风控部监察稽核团队负责对风险控制制度的建立和落实情况进行监督，在职权范围内独立履行检查、评价、报告、建议职能；合规风控部风险管理团队独立于投资研究体系，负责落实具体的风险管理政策，对投资进行事前、事中及事后的风险管理。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、到期未能及时足额兑付本息，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 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	9,893,000.00	-
合计	9,893,000.00	-

注：表中所列示的债券投资为短期融资券、超短期融资券、同业存单及其他发行期限小于等于 1 年的信用债，其中超短期融资券和同业存单无信用评级。

#### 6.4.13.2.2 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6月30日	上年度末 2016年12月31日
AAA	29,172,000.00	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	29,172,000.00	-

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。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于开放日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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理团队设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，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。

于本报告期末，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

##### 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受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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产及债券投资等。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 2017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	2,620,466.20	-	-	-	-	-	2,620,466.20
结算备付金	760,471.30	-	-	-	-	-	760,471.30
存出保证金	128,119.97	-	-	-	-	-	128,119.97
交易性金融资产	9,893,000.00	9,697,000.00	10,313,703.50	19,475,000.00	-	-126,357,037.58	175,735,741.08
买入返售金融资产	17,000,135.00	-	-	-	-	-	17,000,135.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	176,360.55	176,360.55
应收利息	-	-	-	-	-	932,229.44	932,229.44
资产总计	30,402,192.47	9,697,000.00	10,313,703.50	19,475,000.00	-	-127,465,627.57	197,353,523.54
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	176,283.35	176,283.35
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	189,101.91	189,101.91
应付托管费	-	-	-	-	-	15,758.49	15,758.49
应付交易费用	-	-	-	-	-	126,649.40	126,649.40
其他负债	-	-	-	-	-	209,359.40	209,359.40
负债总计	-	-	-	-	-	717,152.55	717,152.55
利率敏感度缺口	30,402,192.47	9,697,000.00	10,313,703.50	19,475,000.00	-	-126,748,475.02	196,636,370.99
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	637,269.09	-	-	-	-	4,068,180.54	4,705,449.63

缺口							
----	--	--	--	--	--	--	--

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。

#### 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（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	+25 个基点	-282,882.19	-
	-25 个基点	286,334.13	-

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券等，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净	公允价值	占基金资产净值比

		值比例 (%)		例 (%)
交易性金融资产-股票投资	126,357,037.58	64.26	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	49,378,703.50	25.11	-	-
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	175,735,741.08	89.37	-	-

#### 6.4.13.4.3.2 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 6 月 30 日）			上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	+5%	6,316,340.57	-
	-5%	-6,316,340.57	-

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：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。

#### 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	126,357,037.58	64.03
	其中：股票	126,357,037.58	64.03
2	固定收益投资	49,378,703.50	25.02
	其中：债券	49,378,703.50	25.02
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	17,000,135.00	8.61
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	3,380,937.50	1.71
7	其他各项资产	1,236,709.96	0.63
8	合计	197,353,523.54	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	2,512,701.52	1.28
C	制造业	52,823,441.08	26.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	554,510.00	0.28
E	建筑业	5,135,896.00	2.61
F	批发和零售业	544,500.00	0.28
G	交通运输、仓储和邮政业	1,223,036.00	0.62
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,777,068.60	1.92
J	金融业	54,896,042.38	27.92
K	房地产业	1,266,274.00	0.64



L	租赁和商务服务业	153,614.00	0.08
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,767,849.00	1.41
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	505,518.00	0.26
S	综合	196,587.00	0.10
	合计	126,357,037.58	64.26

注：以上行业分类以 2017 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沪港通投资股票。

### 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	601318	中国平安	164,800	8,175,728.00	4.16
2	000063	中兴通讯	205,100	4,869,074.00	2.48
3	600036	招商银行	156,900	3,751,479.00	1.91
4	600519	贵州茅台	7,600	3,586,060.00	1.82
5	601166	兴业银行	202,800	3,419,208.00	1.74
6	000858	五粮液	59,800	3,328,468.00	1.69
7	600000	浦发银行	260,810	3,299,246.50	1.68
8	601288	农业银行	883,200	3,108,864.00	1.58
9	600016	民生银行	359,600	2,955,912.00	1.50
10	000876	新希望	330,900	2,719,998.00	1.38
11	000651	格力电器	62,700	2,581,359.00	1.31
12	601328	交通银行	417,900	2,574,264.00	1.31
13	000568	泸州老窖	47,400	2,397,492.00	1.22
14	000423	东阿阿胶	33,000	2,372,370.00	1.21
15	000333	美的集团	51,700	2,225,168.00	1.13
16	601668	中国建筑	228,200	2,208,976.00	1.12
17	000776	广发证券	123,700	2,133,825.00	1.09
18	000338	潍柴动力	161,600	2,133,120.00	1.08
19	002304	洋河股份	24,100	2,092,121.00	1.06

20	002415	海康威视	64,600	2,086,580.00	1.06
21	600030	中信证券	119,700	2,037,294.00	1.04
22	002142	宁波银行	103,300	1,993,690.00	1.01
23	600887	伊利股份	92,200	1,990,598.00	1.01
24	000895	双汇发展	82,900	1,968,875.00	1.00
25	600837	海通证券	123,100	1,828,035.00	0.93
26	000783	长江证券	190,200	1,801,194.00	0.92
27	000100	TCL 集	518,500	1,778,455.00	0.90
28	000166	申万宏源	317,000	1,775,200.00	0.90
29	000625	长安汽车	119,700	1,726,074.00	0.88
30	601398	工商银行	328,000	1,722,000.00	0.88
31	601169	北京银行	185,100	1,697,367.00	0.86
32	600104	上汽集团	53,300	1,654,965.00	0.84
33	000728	国元证券	133,950	1,636,869.00	0.83
34	601601	中国太保	47,800	1,618,986.00	0.82
35	601766	中国中车	148,000	1,497,760.00	0.76
36	300070	碧水源	79,300	1,478,945.00	0.75
37	601211	国泰君安	69,600	1,427,496.00	0.73
38	000725	京东方 A	342,200	1,423,552.00	0.72
39	002500	山西证券	147,300	1,411,134.00	0.72
40	002310	东方园林	83,500	1,396,120.00	0.71
41	000826	启迪桑德	36,700	1,288,904.00	0.66
42	601988	中国银行	320,500	1,185,850.00	0.60
43	600048	保利地产	108,200	1,078,754.00	0.55
44	601390	中国中铁	113,400	983,178.00	0.50
45	601818	光大银行	242,200	980,910.00	0.50
46	600518	康美药业	45,100	980,474.00	0.50
47	002396	星网锐捷	50,000	967,500.00	0.49
48	600050	中国联通	129,000	963,630.00	0.49
49	600028	中国石化	159,800	947,614.00	0.48
50	601688	华泰证券	49,700	889,630.00	0.45
51	601006	大秦铁路	90,400	758,456.00	0.39
52	601628	中国人寿	25,300	682,594.00	0.35
53	601088	中国神华	30,100	670,929.00	0.34
54	601336	新华保险	12,700	652,780.00	0.33
55	601901	方正证券	63,200	627,576.00	0.32
56	600999	招商证券	34,800	599,256.00	0.30
57	002466	天齐锂业	10,800	586,980.00	0.30
58	601857	中国石油	73,900	568,291.00	0.29

59	601985	中国核电	71,000	554,510.00	0.28
60	002024	苏宁云商	48,400	544,500.00	0.28
61	601377	兴业证券	71,300	529,759.00	0.27
62	000538	云南白药	5,600	525,560.00	0.27
63	300104	乐视网	15,600	478,608.00	0.24
64	600029	南方航空	53,400	464,580.00	0.24
65	002456	欧菲光	24,250	440,622.50	0.22
66	002230	科大讯飞	10,800	430,920.00	0.22
67	002241	歌尔股份	21,000	404,880.00	0.21
68	002236	大华股份	17,100	390,051.00	0.20
69	300059	东方财富	32,280	388,005.60	0.20
70	600100	同方股份	27,100	382,652.00	0.19
71	600111	北方稀土	33,200	376,156.00	0.19
72	601800	中国交建	23,200	368,648.00	0.19
73	002008	大族激光	10,400	360,256.00	0.18
74	002594	比亚迪	6,900	344,655.00	0.18
75	002673	西部证券	23,814	338,635.08	0.17
76	002202	金风科技	21,200	327,964.00	0.17
77	300124	汇川技术	12,800	326,912.00	0.17
78	600547	山东黄金	11,264	325,867.52	0.17
79	000768	中航飞机	17,400	320,856.00	0.16
80	002475	立讯精密	10,800	315,792.00	0.16
81	300024	机器人	15,700	306,150.00	0.16
82	002460	赣锋锂业	6,000	277,500.00	0.14
83	000839	中信国安	27,000	269,730.00	0.14
84	002065	东华软件	12,100	263,659.00	0.13
85	000157	中联重科	57,800	259,522.00	0.13
86	000623	吉林敖东	11,310	258,885.90	0.13
87	002252	上海莱士	12,300	248,952.00	0.13
88	002007	华兰生物	6,700	244,550.00	0.12
89	000503	海虹控股	9,800	244,314.00	0.12
90	000709	河钢股份	56,200	235,478.00	0.12
91	000793	华闻传媒	22,800	230,736.00	0.12
92	002405	四维图新	10,800	213,408.00	0.11
93	000559	万向钱潮	18,840	200,080.80	0.10
94	000009	中国宝安	24,300	196,587.00	0.10
95	000402	金融街	16,000	187,520.00	0.10
96	002081	金螳螂	16,300	178,974.00	0.09
97	300027	华谊兄弟	20,400	165,036.00	0.08

98	000917	电广传媒	13,900	157,070.00	0.08
99	002183	怡亚通	17,800	153,614.00	0.08
100	002030	达安基因	6,300	137,277.00	0.07
101	000977	浪潮信息	7,400	128,168.00	0.07
102	000988	华工科技	8,300	121,097.00	0.06
103	000738	航发控制	6,100	119,377.00	0.06
104	300418	昆仑万维	5,200	118,924.00	0.06
105	000938	紫光股份	1,900	116,128.00	0.06
106	002176	江特电机	12,900	112,488.00	0.06
107	002292	奥飞娱乐	6,500	109,850.00	0.06
108	300251	光线传媒	13,400	109,746.00	0.06
109	300253	卫宁健康	13,680	106,840.80	0.05
110	300431	暴风集团	3,240	77,209.20	0.04
111	300085	银之杰	3,500	64,750.00	0.03
112	002610	爱康科技	23,000	56,120.00	0.03
113	603801	N 志邦	1,406	47,522.80	0.02
114	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.02
115	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.02
116	002797	第一创业	4,480	41,260.80	0.02
117	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.02
118	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.01
119	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.01
120	002881	美格智能	989	22,608.54	0.01
121	603679	华体科技	809	21,438.50	0.01
122	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
123	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
124	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.01
125	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.01
126	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.01
127	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.01
128	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.01
129	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.01
130	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
131	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00
132	601727	上海电气	300	2,271.00	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	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	000166	申万宏源	2,025,290.00	43.04
27	601211	国泰君安	2,019,415.00	42.92
28	002304	洋河股份	2,017,325.00	42.87
29	000783	长江证券	1,960,189.56	41.66

30	000625	长安汽车	1,940,723.00	41.24
31	002142	宁波银行	1,909,094.60	40.57
32	000423	东阿阿胶	1,871,284.00	39.77
33	000100	TCL 集	1,869,548.00	39.73
34	000338	潍柴动力	1,848,685.00	39.29
35	000568	泸州老窖	1,817,606.00	38.63
36	000728	国元证券	1,799,251.00	38.24
37	002500	山西证券	1,792,778.00	38.10
38	000895	双汇发展	1,771,309.55	37.64
39	601988	中国银行	1,754,373.00	37.28
40	601989	中国重工	1,620,771.00	34.44
41	601390	中国中铁	1,553,277.00	33.01
42	600048	保利地产	1,542,381.00	32.78
43	601818	光大银行	1,517,235.00	32.24
44	300070	碧水源	1,509,459.00	32.08
45	600028	中国石化	1,436,067.00	30.52
46	601688	华泰证券	1,391,048.00	29.56
47	002310	东方园林	1,360,806.63	28.92
48	601186	中国铁建	1,336,794.00	28.41
49	000826	启迪桑德	1,288,506.00	27.38
50	600050	中国联通	1,279,914.00	27.20
51	600518	康美药业	1,219,835.00	25.92
52	600958	东方证券	1,128,996.00	23.99
53	000725	京东方 A	1,115,572.00	23.71
54	000002	万 科 A	1,097,180.64	23.32
55	601628	中国人寿	1,015,377.00	21.58
56	002396	星网锐捷	976,247.00	20.75
57	601006	大秦铁路	968,741.00	20.59
58	601857	中国石油	953,847.00	20.27
59	601336	新华保险	905,001.00	19.23
60	600999	招商证券	888,896.00	18.89
61	601377	兴业证券	859,607.10	18.27
62	601985	中国核电	777,769.00	16.53
63	601088	中国神华	773,417.00	16.44
64	601788	光大证券	719,626.00	15.29
65	600637	东方明珠	718,738.00	15.27

66	600893	航发动力	703,149.00	14.94
67	600547	山东黄金	648,912.00	13.79
68	600111	北方稀土	636,215.00	13.52
69	002460	赣锋锂业	613,278.00	13.03
70	600029	南方航空	602,604.00	12.81
71	601800	中国交建	598,332.00	12.72
72	600100	同方股份	566,304.00	12.04
73	002450	康得新	566,100.00	12.03
74	002024	苏宁云商	550,792.00	11.71
75	300104	乐视网	550,405.00	11.70
76	601901	方正证券	495,190.00	10.52
77	601198	东兴证券	494,284.00	10.50
78	601998	中信银行	489,667.00	10.41
79	300059	东方财富	446,809.00	9.50
80	000538	云南白药	430,437.50	9.15
81	001979	招商蛇口	427,619.00	9.09
82	000768	中航飞机	418,470.00	8.89
83	002466	天齐锂业	416,417.00	8.85
84	000503	海虹控股	416,059.00	8.84
85	002673	西部证券	406,477.18	8.64
86	002739	万达电影	365,252.00	7.76
87	002202	金风科技	358,253.00	7.61
88	300072	三聚环保	355,583.00	7.56
89	002594	比亚迪	346,030.00	7.35
90	002027	分众传媒	333,528.00	7.09
91	002230	科大讯飞	330,877.00	7.03
92	300024	机器人	326,245.00	6.93
93	002456	欧菲光	322,997.00	6.86
94	600406	国电南瑞	319,271.00	6.79
95	000839	中信国安	316,440.00	6.72
96	002241	歌尔股份	313,909.00	6.67
97	000630	铜陵有色	290,304.00	6.17
98	000069	华侨城A	289,150.00	6.15
99	000157	中联重科	281,486.00	5.98
100	300124	汇川技术	278,737.00	5.92
101	002236	大华股份	259,920.00	5.52

102	000623	吉林敖东	259,018.00	5.50
103	000750	国海证券	257,114.00	5.46
104	002252	上海莱士	256,451.00	5.45
105	002065	东华软件	254,992.00	5.42
106	002008	大族激光	250,120.00	5.32
107	000060	中金岭南	248,668.00	5.28
108	002007	华兰生物	244,818.00	5.20
109	000793	华闻传媒	242,136.00	5.15
110	000009	中国宝安	238,869.00	5.08
111	002475	立讯精密	237,226.50	5.04
112	000540	中天金融	229,250.00	4.87
113	300027	华谊兄弟	223,948.00	4.76
114	000709	河钢股份	220,304.00	4.68
115	000917	电广传媒	205,442.00	4.37
116	002405	四维图新	203,904.00	4.33
117	000792	盐湖股份	201,637.00	4.29
118	002183	怡亚通	200,716.00	4.27
119	000559	万向钱潮	198,919.00	4.23
120	002407	多氟多	190,531.00	4.05
121	000983	西山煤电	187,785.00	3.99
122	002385	大北农	181,936.00	3.87
123	002081	金螳螂	176,692.00	3.76
124	002340	格林美	176,638.00	3.75
125	000402	金融街	174,240.00	3.70
126	300168	万达信息	173,369.00	3.68
127	600340	华夏幸福	164,448.00	3.49
128	000977	浪潮信息	156,571.00	3.33
129	000738	航发控制	155,550.00	3.31
130	002176	江特电机	146,286.00	3.11
131	002292	奥飞娱乐	144,495.00	3.07
132	000046	泛海控股	140,156.00	2.98
133	002030	达安基因	138,668.00	2.95
134	300253	卫宁健康	138,415.00	2.94
135	300251	光线传媒	134,000.00	2.85
136	000988	华工科技	130,559.00	2.77
137	600703	三安光电	126,060.00	2.68



138	300418	昆仑万维	117,008.00	2.49
139	600741	华域汽车	113,526.00	2.41
140	300431	暴风集团	113,185.00	2.41
141	000938	紫光股份	107,014.00	2.27
142	601225	陕西煤业	103,827.00	2.21
143	601952	苏垦农发	97,161.00	2.06

#### 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	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	601668	中国建筑	1,064,033.00	22.61
14	600030	中信证券	1,044,207.00	22.19
15	600958	东方证券	1,026,666.00	21.82
16	000002	万科A	1,019,175.00	21.66
17	600837	海通证券	1,014,068.00	21.55
18	601169	北京银行	975,394.00	20.73
19	600887	伊利股份	887,420.00	18.86
20	601398	工商银行	811,013.00	17.24
21	601766	中国中车	806,052.00	17.13
22	600104	上汽集团	727,292.00	15.46
23	601211	国泰君安	691,789.00	14.70
24	601601	中国太保	688,709.00	14.64
25	601788	光大证券	677,837.00	14.41

26	600637	东方明珠	656,869.00	13.96
27	002450	康得新	614,326.00	13.06
28	601988	中国银行	614,016.00	13.05
29	600893	航发动力	591,219.00	12.56
30	600048	保利地产	540,765.00	11.49
31	601390	中国中铁	538,233.00	11.44
32	601818	光大银行	534,681.00	11.36
33	600028	中国石化	482,718.00	10.26
34	601688	华泰证券	480,826.00	10.22
35	600050	中国联通	479,004.00	10.18
36	001979	招商蛇口	456,860.00	9.71
37	601998	中信银行	453,097.00	9.63
38	601198	东兴证券	440,720.00	9.37
39	600518	康美药业	422,794.00	8.99
40	002460	赣锋锂业	404,000.00	8.59
41	300072	三聚环保	399,825.50	8.50
42	002027	分众传媒	352,532.00	7.49
43	601628	中国人寿	344,054.00	7.31
44	601006	大秦铁路	333,400.00	7.09
45	601857	中国石油	320,188.00	6.80
46	000069	华侨城 A	318,836.00	6.78
47	601336	新华保险	316,293.00	6.72
48	002739	万达电影	315,980.00	6.72
49	600406	国电南瑞	312,480.00	6.64
50	600999	招商证券	310,094.00	6.59
51	601377	兴业证券	299,428.00	6.36
52	601985	中国核电	271,796.00	5.78
53	601088	中国神华	264,264.00	5.62
54	000630	铜陵有色	235,872.00	5.01
55	600111	北方稀土	223,386.00	4.75
56	600029	南方航空	221,399.00	4.71
57	601800	中国交建	220,664.00	4.69
58	600547	山东黄金	219,615.00	4.67
59	000540	中天金融	219,204.00	4.66
60	000060	中金岭南	209,592.00	4.45
61	601952	苏垦农发	198,700.50	4.22
62	600100	同方股份	196,598.00	4.18
63	000750	国海证券	192,270.00	4.09

64	601878	浙商证券	172,578.56	3.67
65	600340	华夏幸福	169,425.00	3.60
66	000792	盐湖股份	168,285.00	3.58
67	002385	大北农	159,742.00	3.39
68	002340	格林美	152,768.00	3.25
69	000983	西山煤电	148,618.00	3.16
70	002407	多氟多	144,247.00	3.07
71	300168	万达信息	134,596.00	2.86
72	600703	三安光电	131,040.00	2.78
73	000046	泛海控股	126,096.00	2.68
74	601366	利群股份	122,603.40	2.61
75	600741	华域汽车	120,711.00	2.57
76	603113	金能科技	108,725.60	2.31
77	002500	山西证券	108,698.00	2.31
78	603980	吉华集团	108,643.50	2.31
79	601225	陕西煤业	105,576.00	2.24
80	603920	世运电路	101,340.00	2.15
81	300660	江苏雷利	100,096.26	2.13
82	603385	惠达卫浴	94,380.00	2.01

### 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	166,520,388.22
卖出股票收入（成交）总额	54,199,191.01

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,019,000.00	5.10
	其中：政策性金融债	10,019,000.00	5.10
4	企业债券	29,172,000.00	14.84
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-

7	可转债 (可交换债)	294,703.50	0.15
8	同业存单	9,893,000.00	5.03
9	其他	-	-
10	合计	49,378,703.50	25.11

## 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	140225	14 国开 25	100,000	10,019,000.00	5.10
2	111709159	17 浦发银行 CD159	100,000	9,893,000.00	5.03
3	136830	16 中信 G1	100,000	9,781,000.00	4.97
4	136622	16 国君 G3	100,000	9,697,000.00	4.93
5	136826	16 国网 01	100,000	9,694,000.00	4.93

## 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 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。

## 7.10.2 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。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

报告期，本基金未投资国债期货。

### 7.11.2 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持有国债期货。

### 7.11.3 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。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体，本期没有被监管部门立案调查，在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

### 7.12.2

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。

### 7.12.3 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	128,119.97
2	应收证券清算款	176,360.55
3	应收股利	-
4	应收利息	932,229.44
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,236,709.96

#### **7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

#### **7.12.5 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的股票。

#### **7.12.6 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
173	1,033,689.21	176,973,127.49	98.96%	1,855,105.01	1.04%

### 8.2 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	49.57%
2	建信贵宾 1 号资产管理计划	49,309,664.69	27.57%
3	万家基金万融一号资产管理 计划	39,023,414.63	21.82%
4	穆怀发	197,754.00	0.11%
5	杨秀英	181,558.00	0.10%
6	祝普铎	100,000.00	0.06%
7	李制	98,814.23	0.06%
8	董丽亚	98,814.23	0.06%
9	余淑英	88,996.00	0.05%
10	景凤英	80,000.00	0.04%

### 8.3 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	0.00	0.0000%

### 8.4 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

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



## § 9 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	177,351,546.49
减：本报告期基金总赎回份额	3,153,631.82
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	178,828,232.50

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
国信证券	1	132,588,147.50	60.54%	96,961.47	60.54%	-
方正证券	1	86,437,092.34	39.46%	63,211.30	39.46%	-

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。

2. 本基金本报告期 无交易单元变更。

### 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
国信证券	29,401,435.31	100.00%	1,010,600,000.00	100.00%	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

### 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	《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2016 年第 4 季	指定披露媒体和基金管理人网站	2017 年 1 月 21 日

	度报告》		
2	《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》	指定披露媒体和基金管理人网站	2017年2月13日
3	《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）》	指定披露媒体和基金管理人网站	2017年2月17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）摘要》	指定披露媒体和基金管理人网站	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）更正公告》	指定披露媒体和基金管理人网站	2017年3月9日
6	《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2016年年度报告》	指定披露媒体和基金管理人网站	2017年3月28日
7	《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2016年年度报告摘要》	指定披露媒体和基金管理人网站	2017年3月28日
8	《国金基金管理有限公司关于服务器升级维护的公告》	指定披露媒体和基金管理人网站	2017年4月13日
9	《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》	指定披露媒体和基金管理人网站	2017年4月22日
10	《国金基金管理有限公司关于直销交易系统升级的公告》	指定披露媒体和基金管理人网站	2017年6月24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。

## § 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	2017年1月24日至2017年6月30日	0.00	49,309,664.69	0.00	49,309,664.69	27.57%
	2	2017年1月24日至2017年6月30日	0.00	88,640,048.17	0.00	88,640,048.17	49.57%
	3	2017年4月17日至2017年6月30日	0.00	39,023,414.63	0.00	39,023,414.63	21.82%
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>							

### 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。

### 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](http://www.gfund.com)

国金基金管理有限公司

2017 年 8 月 25 日