国金鑫盈货币市场证券投资基金
2018 年半年度报告 摘要

2018 年 6 月 30 日

基金管理人：国金基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 24 日

§1 重要提示

1.1 重要提示

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 23 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 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 6 月 30 日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	国金鑫盈货币
场内简称	-
基金主代码	000439
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 12 月 16 日
基金管理人	国金基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	24,537,468.35 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

注：无

2.2 基金产品说明

投资目标	在综合考虑基金资产收益性、安全性和流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为投资者创造稳定的收益。
投资策略	本基金在分析各类资产的信用风险、流动性风险及其经风险调整后的收益率水平或盈利能力的基础上，通过比较或合理预期不同的各类资产的风险与收益率变化，确定并动态地调整优先配置的资产类别和配置比例。
业绩比较基准	人民币七天通知存款利率（税后）。
风险收益特征	本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种，其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。

注：无

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国金基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	彭文敏	曾麓燕
	联系电话	010-88005888	021-52629999-212040
	电子邮箱	pengwenmin@gfund.com	015292@cib.com.cn

客户服务电话	4000-2000-18	95561
传真	010-88005666	021-62535823

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	688,529.57
本期利润	688,529.57
本期净值收益率	1.2325%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-
期末基金资产净值	24,537,468.35
期末基金份额净值	1.0000

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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、本基金收益分配为按日结转份额。

3.2 基金净值表现

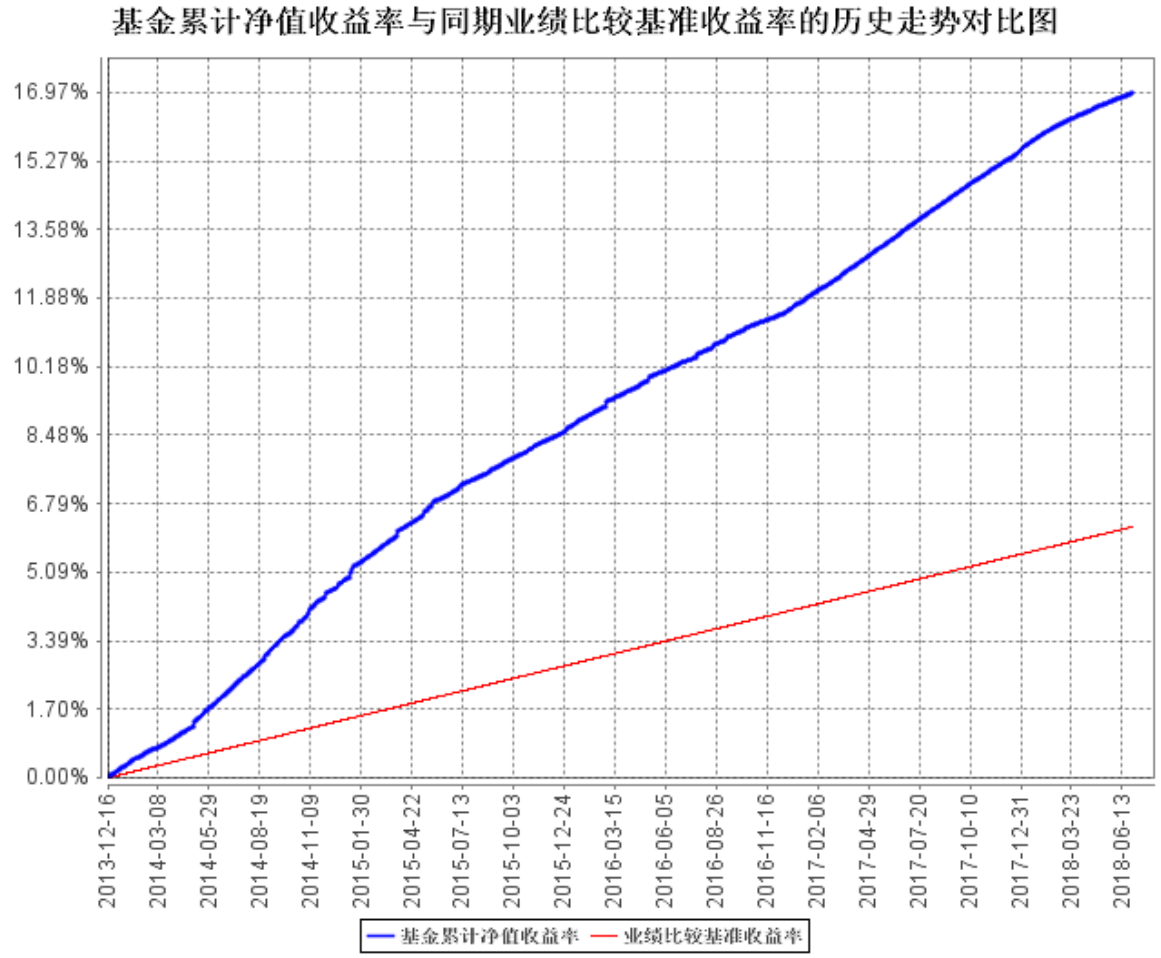
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	0.1628%	0.0014%	0.1125%	0.0000%	0.0503%	0.0014%
过去三个月	0.5115%	0.0012%	0.3413%	0.0000%	0.1702%	0.0012%
过去六个月	1.2325%	0.0020%	0.6788%	0.0000%	0.5537%	0.0020%
过去一年	2.9616%	0.0024%	1.3688%	0.0000%	1.5928%	0.0024%

过去三年	9.2129%	0.0060%	4.1100%	0.0000%	5.1029%	0.0060%
自基金合同生效起至今	16.9722%	0.0091%	6.2175%	0.0000%	10.7547%	0.0091%

注：本基金的业绩比较基准为：人民币七天通知存款利率(税后)

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：本基金基金合同生效日为 2013 年 12 月 16 日，图示日期为 2013 年 12 月 16 日至 2018 年 6 月 30 日。

§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 2018 年 6 月 30 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 指数增强证券投资基金、国金鑫盈货币市场证券投资基金、国金金腾通货币市场证券投资基金、国金上证 50 指数分级证券投资基金、国金众赢货币市场证券投资基金、国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国金及第七天理财债券型证券投资基金、国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金、国金民丰回报 6 个月定期开放混合型证券投资基金、国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金。

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		
刘辉	本基金基金经理，国金金腾通货币、国金众赢货币基金经理	2016 年 8 月 29 日	-	7	刘辉先生，对外经济贸易大学硕士。2011 年 8 月至 2013 年 8 月在中债资信评估有限责任公司任评级分析师。2013 年 8 月加入国金基金管理有限公司，历任投资研究部固定收益分析师、基金交易部债券交易员、上海资管事业部投资经理、上海资管事业部基金经理；自 2017 年 3 月起任投资管理部基金经理。

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遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《国金鑫盈货币市场证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金

无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《国金基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定，通过制度、流程和系统等方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下所有投资组合。在投资决策内部控制方面，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；在交易执行控制方面，通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；在行为监控和分析评估方面，通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控，确保做好公平交易的监控和分析。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年上半年，国内经济呈现走弱态势，地方政府融资监管加强导致基建投资增速大幅下滑，地产投资仍稳定，制造业投资仍处低位，固定资产投资整体增速下行，居民加杠杆购房致使消费乏力，5月社会消费品零售总额实际增速6.8%、创下2004年以来新低，中美贸易战对出口压力尚未显现，但进口回升，净出口对经济拉动减弱。通胀方面，5月猪肉继续下跌带动CPI同比仍维持在1.8%的低位，原油价格上涨带动PPI回升至4.1%，总体而言上半年通胀压力仍低。货币政策方面，国内经济下行压力显现以及中美贸易战开打，央行货币政策也有所放松，分别在4月和6月宣布实施定向降准，上半年资金面呈现逐步宽松态势。监管方面，上半年金融监管全面深入推进，“一委一行两会”新金融监管体系正式亮相，资管新规发布实施，影子银行逐步收缩、宏观杠杆率得到控制。受经济基本面走弱、中美贸易战开打、央行货币政策微调影响，2018年上半年债券市场收益率持续下行。

报告期内，本基金依旧保持稳健的操作风格，始终把流动性风险放在第一位，根据央行态度和资金面的变化，在资金紧张时点积极布局，灵活调整债券仓位和久期，在控制风险的同时，

为投资人提供了合理的回报。

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 1.2325%，同期业绩比较基准收益率为 0.6788%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018 年下半年，中央政治局会议对下半年政策基调有所调整，财政政策将积极发力，基建投资将有所反弹，但房地产调控未放松、房地产投资预计将下行，前期居民杠杆过快上升仍将抑制消费，中美贸易战对出口的影响将逐步显现，总体来看，下半年经济下行压力仍大。通胀方面，预计 PPI 环比上涨空间不大、同比增速仍将回落，猪肉等食品价格将有所回升、但 CPI 仍将保持温和，预计下半年通胀压力不大。政策方面，中央银行货币政策边际上有所放松，去杠杆节奏和力度将有所调整，资管新规相关配套细则也有所放松。综合而言，预计下半年债市仍将震荡走强，收益率仍将下行。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会相关规定及基金合同关于估值的约定，严格执行内部估值控制程序，对基金所持有的投资品种进行估值。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，估值委员会由公司督察长、投资总监、运营总监、清算业务负责人、研究部门负责人、风控业务负责人、合规业务负责人组成，可根据需要邀请产品托管行代表、公司独立董事、会计师事务所代表等外部人员参加。公司运营总监为公司基金估值委员会主席。运营支持部根据估值委员会的估值意见进行相关具体的估值调整或处理，并负责与托管行进行估值结果的核对，运营支持部业务人员复核后使用。基金经理作为估值委员会的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定，但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。本基金管理人参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

公司与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，并每日进行支付。

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基金份额持有人数量不满二百人的情形。本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于人民币 5,000 万元的情况，出现该情况的时间范围为 2018 年 3 月 26 日至 2018 年 6 月 30 日。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，基金管理人决定转换本基金的运作方式，由货币型基金转变为债券型基金。基金管理人于 2018 年 6 月 22 日上报了《关于国金鑫盈货币市场证券投资基金处置方案的报告》，该方案拟将本基金名称由“国金鑫盈货币市场证券投资基金”更名为“国金鑫盈短债债券型证券投资基金”，并根据短债型基金特点，变更本基金类型、投资目标、投资范围和比例、投资策略、赎回到账时间、基金费率结构、基金份额分类等方面的内容。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国金鑫盈货币市场证券投资基金
报告截止日： 2018年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资 产：			
银行存款		11,135,053.04	50,400,619.51
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产		4,999,262.65	9,972,114.49
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		4,999,262.65	9,972,114.49
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		8,455,252.68	38,712,498.07
应收证券清算款		-	-
应收利息		191,765.98	330,550.56
应收股利		-	-
应收申购款		100.00	27,302.00
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		24,781,434.35	99,443,084.63
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2018年6月30日**	**上年度末 2017年12月31日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		6,676.69	24,947.64
应付托管费		2,023.20	7,559.89
应付销售服务费		5,058.05	18,899.72
应付交易费用		2,346.54	5,194.77
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		3,922.08	50,198.19
递延所得税负债		-	-
其他负债		223,939.44	571,701.27
负债合计		243,966.00	678,501.48
所有者权益：			
实收基金		24,537,468.35	98,764,583.15
未分配利润		-	-
所有者权益合计		24,537,468.35	98,764,583.15
负债和所有者权益总计		24,781,434.35	99,443,084.63

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，国金鑫盈货币基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 24,537,468.35 份。

6.2 利润表

会计主体：国金鑫盈货币市场证券投资基金
本报告期： 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		1,002,014.22	5,867,130.34
1.利息收入		1,000,305.56	5,867,633.80
其中：存款利息收入		453,834.05	992,705.30
债券利息收入		252,792.83	3,206,954.77
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		293,678.68	1,667,973.73
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,708.66	-503.46
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		1,708.66	-503.46
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-

股利收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		-	-
减：二、费用		313,484.65	1,164,800.63
1．管理人报酬		83,213.33	454,122.40
2．托管费		25,216.17	137,612.82
3．销售服务费	6.4.8.2.3	63,040.39	344,032.02
4．交易费用		-	-
5．利息支出		1,422.82	13,062.13
其中：卖出回购金融资产支出		1,422.82	13,062.13
6．其他费用		140,591.94	215,971.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		688,529.57	4,702,329.71
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		688,529.57	4,702,329.71

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国金鑫盈货币市场证券投资基金
本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	98,764,583.15	-	98,764,583.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	688,529.57	688,529.57
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）	-74,227,114.80	-	-74,227,114.80
其中：1.基金申购款	46,380,537.03	-	46,380,537.03
2.基金赎回款	-120,607,651.83	-	-120,607,651.83

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）	-	-688,529.57	-688,529.57
五、期末所有者权益（基金净值）	24,537,468.35	-	24,537,468.35
项目	**上年度可比期间 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）	327,342,468.78	-	327,342,468.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	4,702,329.71	4,702,329.71
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）	-62,746,323.12	-	-62,746,323.12
其中：1.基金申购款	333,611,360.03	-	333,611,360.03
2.基金赎回款	-396,357,683.15	-	-396,357,683.15
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）	-	-4,702,329.71	-4,702,329.71
五、期末所有者权益（基金净值）	264,596,145.66	-	264,596,145.66

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

国金鑫盈货币市场证券投资基金（原名称为“国金通用鑫盈货币市场证券投资基金”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”）证监许可[2013]1442 号文的核准，由国金基金管理有限公司于 2013 年 11 月 28 日至 2013 年 12 月 11 日

向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具（2013）验字第 61004823_A26 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。2015 年 9 月 23 日，本基金名称由“国金通用鑫盈货币市场证券投资基金”变更为“国金鑫盈货币市场证券投资基金”。基金合同于 2013 年 12 月 16 日正式生效，本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金设立时，首次募集（不含认购费）的有效净认购金额为人民币 545,227,344.41 元，折合 545,227,344.41 份基金份额；有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币 20,693.49 元，折合 20,693.49 份基金份额；以上收到的实收基金共计人民币 545,248,037.90 元，折合 545,248,037.90 份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构均为国金基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金，通知存款，短期融资券，一年以内（含一年）的银行定期存款和大额存单，剩余期限（或回售期限）在 397 天以内（含 397 天）的债券、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的中期票据、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的资产支持证券，期限在一年以内（含一年）的债券回购，期限在一年以内（含一年）的中央银行票据，以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金的业绩比较基准为：人民币七天通知存款利率（税后）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制,同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.4.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.4.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.4.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的会计差错更正。

6.4.5 税项

1.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。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按5%，3%和2%的比例缴纳。

2.企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3.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。

6.4.6 关联方关系

6.4.6.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生变化。

6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国金基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
国金证券股份有限公司	基金管理人股东、基金代销机构
广东宝丽华新能源股份有限公司	基金管理人股东
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

涌金投资控股有限公司	基金管理人股东
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、基金代销机构
北京千石创富资本管理有限公司	基金管理人的子公司
兴业银行股份有限公司	基金托管人、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。

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.7.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.7.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.7.1.4 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例

注：本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	83,213.33	454,122.40
其中：支付销售机构的客户维护费	11,534.72	81,761.56

注：1.本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.33%年费率计提。管理费计算方法如下：

H=E×0.33%/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。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	25,216.17	137,612.82

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×0.10%/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。

6.4.7.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费 各关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
国金基金管理有限公司	39,352.14
兴业银行股份有限公司	5,927.94
国金证券	13.68
合计	45,293.76
获得销售服务费 各关联方名称	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
国金基金管理有限公司	227,398.89
兴业银行股份有限公司	10,123.15
国金证券	534.55
合计	238,056.59

注：本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

H＝E×0.25%÷当年天数

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计算，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销售服务费划款指令，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登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2018年1月1日至2018年6月30日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出

注：1.本基金本报告期未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（回购）交易。

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
基金合同生效日（2013年12月16日）持有的基金份额	0.00	0.00
期初持有的基金份额	15,266,182.05	65,996,309.66
期间申购/买入总份额	128,091.17	8,193,805.62
期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：期间赎回/卖出总份额	7,020,058.71	2,310.00
期末持有的基金份额	8,374,214.51	74,187,805.28
期末持有的基金份额占基金总份额比例	34.1283%	28.0381%

注：期间申购份额含红利再投份额。

6.4.7.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018年6月30日		上年度末 2017年12月31日	
	持有的	持有的基金份额	持有的	持有的基金份额

	基金份额	占基金总份额的比例	基金份额	占基金总份额的比例
北京千石创富资本管理有限公司	0.00	0.0000%	10,018,433.67	10.1438%

注：本基金本报告期未发生其他关联方投资本基金的情况。

6.4.7.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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

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兴业银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额
上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

无

6.4.8 期末（ 2018 年 6 月 30 日 ）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.10.1.1 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

6.4.10.1.2 受限证券类别：债券

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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注

6.4.10.1.3 受限证券类别：权证										
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：份	期末成本总额	期末估值总额	备注

注：本基金本期末未持有认购新发或增发证券。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

-

金额单位：人民币元

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

本基金本期末未持有银行间市场正回购抵押债券。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场正回购抵押债券。

6.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	4,999,262.65	20.17
	其中：债券	4,999,262.65	20.17
	资产支持证券	-	-

2	买入返售金融资产	8,455,252.68	34.12
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	11,135,053.04	44.93
4	其他各项资产	191,865.98	0.77
5	合计	24,781,434.35	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	0.10	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例（%）	原因	调整期

注：在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	19
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	36
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	8

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限（天数）	原因	调整期

注：本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净	各期限负债占基金资产净

		值的比例（%）	值的比例（%）
1	30 天以内	67.61	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	32.60	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天（含）	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		100.21	-

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

序号	发生日期	平均剩余存续期	原因	调整期

注：本报告期未发生投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

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	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,999,262.65	20.37
	其中：政策性金融债	4,999,262.65	20.37
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	4,999,262.65	20.37
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	170207	17 国开 07	50,000	4,999,262.65	20.37

7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.0808%
报告期内偏离度的最低值	-0.0115%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0235%

注：本基金本报告期内未发生偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

序号	发生日期	偏离度	原因	调整期

注：本报告期内无负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

序号	发生日期	偏离度	原因	调整期

注：本报告期内无正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例(%)

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1

本基金估值采用“摊余成本法”，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内平均摊销，每日计提损益。本基金不采用市场利率

和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。

为了避免采用“摊余成本法”计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用估值技术，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当“摊余成本法”计算的基金资产净值与“影子定价”确定的基金资产净值偏离达到或超过 0.25%时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，其中，对于偏离程度达到或超过 0.5%的情形，基金管理人应与基金托管人协商一致后，参考成交价、市场利率等信息对投资组合进行价值重估，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

7.9.2

本报告日前一年内，本基金投资前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查、公开谴责、处罚。

7.9.3 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	191,765.98
4	应收申购款	100.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	191,865.98

7.9.4 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	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
20,467	1,198.88	8,478,529.89	34.55%	16,058,938.46	65.45%

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	51,121.41	0.2083%

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	0~10
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（2013 年 12 月 16 日）基金份额总额	545,248,037.90
本报告期期初基金份额总额	98,764,583.15
本报告期基金总申购份额	46,380,537.03
减:本报告期基金总赎回份额	120,607,651.83
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	24,537,468.35

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，基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金在报告期内投资策略无重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务至今，本报告期内会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华创证券	1	-	-	-	-	-

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，向券商租用了基金专用交易席位。

（1） 基金专用交易席位的选择标准如下：

① 经营行为规范，在近一年内未出现重大违规行为；

② 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

③ 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易需要；

④ 具有较强的研究能力，能及时、全面地提供高质量的宏观、策略、行业、上市公司、证券市场研究、固定收益研究、数量研究等报告及信息资讯服务；

⑤交易佣金收取标准合理。

（2）基金专用交易席位的选择程序如下：

① 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；

② 本基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华创证券	-	-	-	-	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

项目	发生日期	偏离度	法定披露报刊	法定披露日期

注：本基金本报告期内不存在偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

§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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		超过20%的时间区间					
机构	1	2018年3月26日至2018年6月30日	15,266,182.05	128,091.17	7,020,058.71	8,374,214.51	34.13%
	2	2018年1月8日至2018年3月25日	0.00	40,229,221.23	40,229,221.23	0.00	0.00%
	3	2018年1月1日至2018年1月10日	50,051,248.46	76,234.93	50,127,483.39	0.00	0.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有份额占比达到或超过20%的情形，由此可能导致的特有风险包括：产品流动性风险、巨额赎回风险以及净值波动风险等。本基金管理人将持续加强投资者集中度管理，审慎确认大额申购与大额赎回，同时进一步完善流动性风险管控机制，加强对基金份额持有人利益的保护。							

11.2影响投资者决策的其他重要信息

无

国金基金管理有限公司

2018 年 8 月 24 日