国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金2019年半年度报告

2019-06-30

基金管理人：国金基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

报告送出日期：2019-08-27

目录全部展开 目录全部收拢

- 重要提示
- 基金简介
  - 基金基本情况
  - 基金产品说明
  - 基金管理人和基金托管人
  - 信息披露方式
  - 其他相关资料
- 主要财务指标和基金净值表现
  - 主要会计数据和财务指标
  - 基金净值表现
    - 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
    - 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
- 管理人报告
  - 基金管理人及基金经理情况
    - 基金管理人及其管理基金的经验
    - 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介
  - 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
  - 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明
    - 公平交易制度的执行情况
    - 异常交易行为的专项说明
  - 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩

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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年8月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至2019年6月30日止。

基金基本情况

项目	数值
基金名称	国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金
基金简称	国金国鑫发起
场内简称	
基金主代码	762001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012-08-28
基金管理人	国金基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	155,920,693.00
基金合同存续期	不定期

注：无。

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，本基金会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	金融机构人民币三年期定期存款基准利率（税后）。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

注：本基金为发起式基金。

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	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈广龙	石立平
	联系电话	010-88005888	010-63639180
	电子邮箱	chenguanglong@gfund.com	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		4000-2000-18	95595
传真		010-88005666	010-63639132
注册地址		北京市怀柔区府前街三号楼3-6	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
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	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码		100089	100033
法定代表人		尹庆军	李晓鹏

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》
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

其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国金基金管理有限公司	北京市海淀区西三环北路87号国际财经中心D座14层

主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

报告期	报告期(2019-01-01 至 2019-06-30)
本期已实现收益	15,781,070.34
本期利润	54,527,344.86
加权平均基金份额本期利润	0.3447
本期加权平均净值利润率	21.78 %
本期基金份额净值增长率	25.97 %
报告期末	**报告期末(2019-06-30)**
期末可供分配利润	94,971,543.01
期末可供分配基金份额利润	0.6091
期末基金资产净值	263,022,112.04
期末基金份额净值	1.6869
报告期末	**报告期末(2019-06-30)**
基金份额累计净值增长率	180.30 %

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。

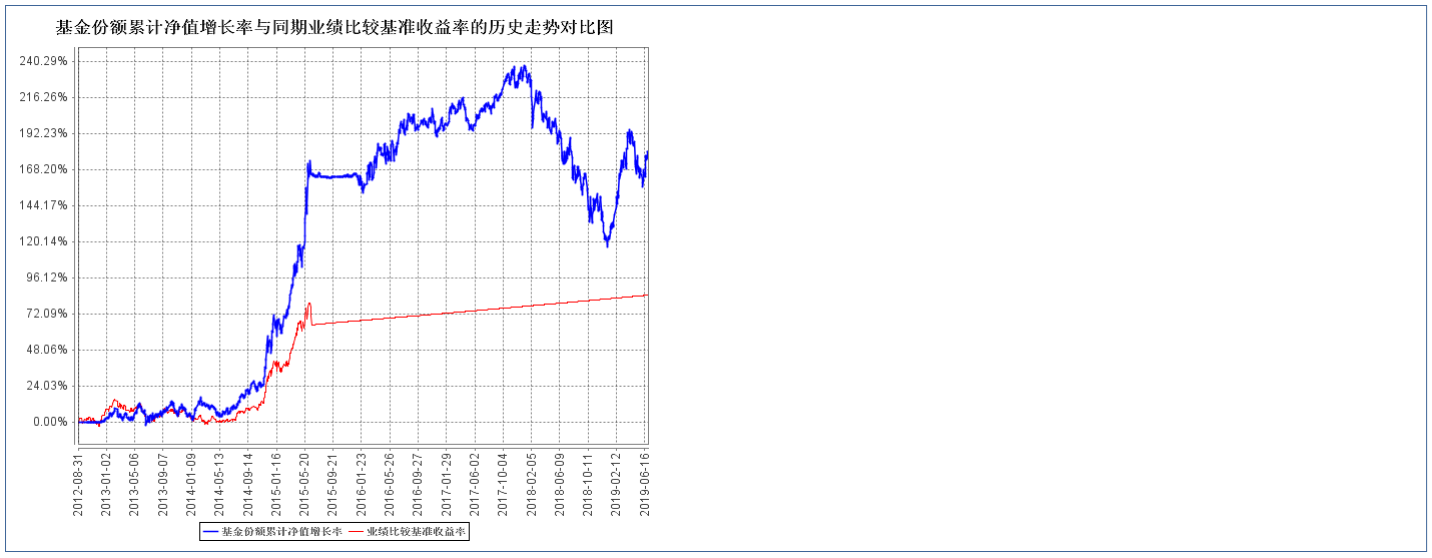
基金净值表现

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	净值增长率①	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	5.90 %	1.17 %	0.23 %	0.01 %	5.67 %	1.16 %
过去三个月	-0.65 %	1.48 %	0.70 %	0.01 %	-1.35 %	1.47 %
过去六个月	25.97 %	1.43 %	1.39 %	0.01 %	24.58 %	1.42 %
过去一年	0.15 %	1.43 %	2.83 %	0.01 %	-2.68 %	1.42 %
过去三年	-1.87 %	1.06 %	8.72 %	0.01 %	-10.59 %	1.05 %
自基金合同生效起至今	180.30 %	1.12 %	84.54 %	0.57 %	95.76 %	0.55 %

注：注：本基金的业绩比较基准为：金融机构人民币三年期定期存款基准利率(税后)。

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



注：注：本基金的基金合同生效日为2012年8月28日，2012年8月28日至2015年6月21日，本基金的业绩比较基准为：60%×沪深 300 指数收益率+40%×上证国债指数收益率；2015年6月22日至今，本基金的业绩比较基准为：金融机构人民币三年期定期存款基准利率(税后)。

基金管理人及基金经理情况

基金管理人及其管理基金的经验

国金基金管理有限公司（原名称为“国金通用基金管理有限公司”）经中国证券监督管理委员会（证监许可[2011]1661号）批准，于2011年11月2日成立，总部设在北京。公司注册资本为3.6亿元人民币，股东为国金证券股份有限公司、苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司、广东宝丽华新能源股份有限公司、涌金投资控股有限公司，股权比例分别为49%、19.5%、19.5%和12%。截至2019年6月30日，国金基金管理有限公司共管理16只公募基金，具体包括国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金、国金沪深300指数增强证券投资基金、国金鑫盈货币市场证券投资基金、国金金腾通货币市场证券投资基金、国金上证50指数分级证券投资基金、国金众赢货币市场证券投资基金、国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国金及第七天理财债券型证券投资基金、国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金、国金民丰回报6个月定期开放混合型证券投资基金、国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、国金量化多因子股票型证券投资基金、国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金、国金惠盈纯债债券型证券投资基金、国金惠鑫短债债券型证券投资基金、国金标普中国A股低波红利指数增强证券投资基金（LOF）。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐艳芳	本基金基金经理，国金众赢货币、国金及第七天理财、国金民丰回报、国金量化添利、国金惠鑫短债基金经理，固定收益投资部总经理	2013-02-25	-	11	徐艳芳女士，清华大学硕士。2005年10月至2012年6月历任皓天财经公关公司财经咨询师、英大泰和财产保险股份有限公司投资经理。2012年6月加入国金基金管理有限公司，历任投资研究部基金经理；现任固定收益投资部总经理兼基金经理。
滕祖光	本基金基金经理，国金惠盈纯债基金经理	2014-04-11	-	14	滕祖光先生，中央财经大学硕士。2003年至2009年先后历任中国工商银行深圳分行国际业务员、中大期货经纪有限公司期货交易员、和讯信息科技有限公司高级编辑、国投信托有限公司证券交易员。2009年11月加入国金基金管理有限公司，历任基金交易部高级交易员、投资研究部基金经理、投资管理部基金经理；现任主动权益投资部基金经理。
张航	本基金基金经理，主动权益投资副总监	2019-04-16	-	13	中央财经大学博士。2006年7月至2011年4月在长盛基金管理有限公司任研究部研究员，2011年4月至2016年4月先后历任新华资产管理有限公司首席策略研究员、消费行业研究组组长、股票投资经理，2016年8月至2018年2月任北京忠诚志业资本管理有限公司研究部研究总监、副总经理。2019年2月加入国金基金管理有限公司，任主动权益投资副总监。

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。

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》、《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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。

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。

管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

报告期内基金投资策略和运作分析

2019年上半年，中国经济出现见底企稳的迹象。尤其是在一季度，这个迹象尤为明显。然而，进入二季度，由于中美贸易问题的反复，以及经济数据的进一步走弱，投资者对未来又进入一个迷茫期，风险偏好开始急剧下降，市场出现了在3000点附近震荡的走势。
首先，我们对于中国经济的前景不悲观。在一季度，大家对经济数据一片欢欣鼓舞之时，我们关注到李总理在博鳌论坛已经精准了描述当时经济的走势并对未来做了判断。这里摘录部分如下：
“今年不稳定不确定因素明显增多，外部输入性风险上升，经济增速在月度或季度间不排除会出现一定幅度波动，我们留有充足的备用工具，不会实施大水漫灌式强刺激政策，不会走铺摊子、粗放增长的老路，不会采取为维持短期增长而损害长期发展的做法，而是将坚持改革开放，激发市场主体活力，增加内生动力，顶住下行压力，保持中国经济长期向好。观察中国经济、判断宏观政策取向，要把时间轴拉长了看，重在看全年、看整体、看趋势“。
我们非常认同总理对经济走势判断，也非常认同政府对经济所采取的政策方向。本轮中国经济正处于小复苏后的调整期。供给侧改革后，很多产业现在已经处于有效供给和需求平衡的局面。2019年，由于老百姓对地产的需求开始逐渐冷静，家电、汽车消费都出现回落的局面。这些需求增速的回落，使经济数据有些回落。进入2019年二季度，这些数据的回落加剧了投资者对未来的担心。但我们认为，大家不必过于担心经济回落的风险，要看到供给侧改革后有效供给的比例逐步提升，要看到新的改革方向和新的需求萌芽！正如总理所说，要看全年、整体和趋势。
对于贸易战，还是如之前我们分析，这是大国谈判的长期问题，我们不期待短期解决，但也不认为会恶化为剧烈冲突。在我们实际投资调研中，我们看到了很多出口的企业正在和国外企业积极磋商，寻求新的合作方式，来适应新的环境。我们相信国际经济学中的比较优势理论，国际合作分工依然是全球化的必然趋势。
基于以上判断，我们的投资依然集中于各个产业中的领袖企业。消费、医药、科技依然是我们重点看好的行业。在这些行业里，我们选择有创新力、有谈判力、有创造现金流能力的企业作为重点持仓。有创新力，代表了企业未来才有竞争力，无论贸易战还是经济转型，创新都是绕不开的话题。2019年下半年，我们迎来了科创板，创新在未来战略地位之重不言而喻。实际上，主板上市的公司里已经有很多优秀的公司已经在不断创新以适应未来需求，他们就是我们投资的重点标的；有谈判力，代表公司产业地位，也代表了其历史成绩的优秀，市场份额指标最能说明这一点，这也是我们选择重点投资标的的核心要素；创造现金流的能力，这个指标是从2018年开始，就是我们一直重视的指标。因为在经济回落情况下，现金流的创造力是一个公司生存发展的重中之重。巴菲特说“潮水退去的时候，才知道谁在裸泳”。2018开始到2019年中，各种暴雷事件不绝于耳，其实就是经济大环境回落期下，有些只看资产价格，不看现金流的投资基本都出现了风险。2019年下半年，我们认为保持对风险的警惕依然是重点工作，所以投资标的创造现金流能力也是我们重点研究分析的指标。这些行业和选股指标，依然也是我们下半年配置股票的重点行业和指标。

报告期内基金的业绩表现

截至2019年6月30日，本基金份额净值1.6869元，累计单位净值2.3799元。本报告期份额净值增长率为25.97%。

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对下半年经济和投资环境的判断，我们认为大致可参照2013-2014年的周期，即经济在震荡中筑底。但也不能简单的“刻舟求剑”，动态看，现在的经济结构及周边环境还是要远好于2013-2014年的。2019年下半年经济企稳是2018年底时候很多人做的预判，现在时间已经接近。我们通过库存周期模型预判，3季度末到四季度初期，我们应该能看到经济出现小复苏的迹象。在经济弱势筑底阶段，政策还是至关重要的。目前政策面依然坚持预调和微调为主，做到了没有“大水漫溢”。这种政策组合，对于中国经济的长期发展转型无疑是一剂良药。
经济弱势，货币宽松；无风险利率处于历史低位；估值保持于底部20%的分位。这种情形下，核心应该关注的就是增长的预期。我们认为3季度后库存周期的见底应该大概率会出现，这将会逐步增加投资者对股票的信心。基于此，我们对股票投资依然保持谨慎乐观，保持一定仓位，集中于优势行业中的优势企业。

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。

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。

管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金无连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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，中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

托管人对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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金2019年半年度报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、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。

资产负债表

会计主体：国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金
报告截止日：2019-06-30

单位：人民币元

资产	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
资产：		
银行存款	31,119,128.69	21,829,680.04
结算备付金	686,940.36	1,464,080.51
存出保证金	163,899.03	222,416.98
交易性金融资产	233,432,874.71	192,587,576.84
其中：股票投资	219,794,793.91	181,905,782.84
基金投资	-	-
债券投资	13,638,080.80	10,681,794.00
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	-	11,200,000.00
应收证券清算款	-	-
应收利息	148,994.82	302,779.48
应收股利	-	-
应收申购款	43,280.89	82,752.74
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	265,595,118.50	227,689,286.59
负债和所有者权益	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
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	-	11,041,132.40
应付赎回款	951,240.41	224,935.41
应付管理人报酬	311,819.53	293,199.23
应付托管费	51,969.93	48,866.51
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,053,089.57	1,437,613.46
应交税费	15.00	17.71
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	204,872.02	379,208.71
负债合计	2,573,006.46	13,424,973.43
所有者权益：	-	-
实收基金	155,920,693.00	160,010,051.98
未分配利润	107,101,419.04	54,254,261.18
所有者权益合计	263,022,112.04	214,264,313.16
负债和所有者权益总计	265,595,118.50	227,689,286.59

注：报告截止日2019年6月30日，基金份额净值1.6869元，基金份额总额155,920,693.00份。

利润表

会计主体：国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金
本报告期：2019-01-01至2019-06-30

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
一、收入	57,399,682.92	-42,160,911.42
1.利息收入	299,820.75	820,463.41
其中：存款利息收入	118,211.01	141,608.78
债券利息收入	172,305.44	243,742.00
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	9,304.30	435,112.63
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	18,318,929.76	-265,149.59
其中：股票投资收益	15,868,166.35	-1,977,307.62
基金投资收益	-	-
债券投资收益	26,868.34	107,938.44
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	2,423,895.07	1,604,219.59
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	38,746,274.52	-42,899,712.47
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	34,657.89	183,487.23
减：二、费用	2,872,338.06	4,101,860.18
1．管理人报酬	1,860,203.91	2,156,145.92
2．托管费	310,033.96	359,357.68
3．销售服务费	-	-
4．交易费用	588,564.77	1,383,787.14
5．利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6．税金及附加	0.46	11.55
7．其他费用	113,534.96	202,557.89
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	54,527,344.86	-46,262,771.60
减：所得税费用	-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）	54,527,344.86	-46,262,771.60

所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金
本报告期：2019-01-01至2019-06-30

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30		
	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）	160,010,051.98	54,254,261.18	214,264,313.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	54,527,344.86	54,527,344.86
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）	-4,089,358.98	-1,680,187.00	-5,769,545.98
其中：1.基金申购款	19,142,314.11	13,088,795.85	32,231,109.96
2.基金赎回款	-23,231,673.09	-14,768,982.85	-38,000,655.94
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）	155,920,693.00	107,101,419.04	263,022,112.04

项目	上年度可比期间 -至-		
	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）	181,828,315.93	196,526,086.50	378,354,402.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-46,262,771.60	-46,262,771.60
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）	-59,376,120.12	-56,803,678.12	-116,179,798.24
其中：1.基金申购款	16,164,336.83	15,315,654.22	31,479,991.05
2.基金赎回款	-75,540,456.95	-72,119,332.34	-147,659,789.29
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）	122,452,195.81	93,459,636.78	215,911,832.59

本报告第6.1页至第6.4页财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：尹庆军　　主管会计工作负责人：聂武鹏　　会计机构负责人：于晓莲

注：此处为PDF文件中的章节数或者页数。

报表附注

基金基本情况

国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金（原名称为“国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金”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[2012]953号文的核准，由国金基金管理有限公司于2012年8月13日至2012年8月24日向社会公开募集，基金合同于2012年8月28日生效。2015年9月23日，本基金名称由“国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金”变更为“国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金”。首次募集规模为178,532,819.63份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为国金基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。
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（含中小板股票、创业板股票，以及其它经中国证监会核准上市的股票）、权证、股指期货、债券（含中小企业私募债、中期票据）、可转换债券（含分离交易可转债、可交换债券）、资产支持证券、银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金股票投资占基金资产的比例为0%－95%，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后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：金融机构人民币三年期定期存款基准利率（税后）。

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。

遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2019年6月30日的财务状况以及2019年1月1日至2019年6月30日止会计期间的经营成果和净值变动情况。

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。

会计年度

-

记账本位币

-

金融资产和金融负债的分类

-

金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

-

金融资产和金融负债的估值原则

-

金融资产和金融负债的抵销

-

实收基金

-

损益平准金

-

收入/(损失)的确认和计量

-

费用的确认和计量

-

基金的收益分配政策

-

其他重要的会计政策和会计估计

-

会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

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。

会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

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。

税项

1.印花税
经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；
经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；
2.增值税
根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；
根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；
根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；
根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；
根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；
根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让2017年12月31日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价（2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。
增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。
3.企业所得税
根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；
根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。
4.个人所得税
根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；
根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；
根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

重要财务报表项目的说明

银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
活期存款	31,119,128.69	-
定期存款	-	-
其中：存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	-	-
存款期限3个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	31,119,128.69	21,829,680.04

交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2019-06-30		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		204,273,805.69	219,794,793.91	15,520,988.22
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	13,615,242.40	13,638,080.80	22,838.40
	银行间市场	-	-	-
	合计	13,615,242.40	13,638,080.80	22,838.40
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		217,889,048.09	233,432,874.71	15,543,826.62
项目		上年度末 2018-12-31		
		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		-	-	-

衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019-06-30			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-
项目	上年度末 2018-12-31			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

买入返售金融资产

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 2019-06-30	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
项目	上年度末 2018-12-31	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

期末买断式逆回购交易中取得的债券

单位：人民币元

项目	本期末 2019-06-30						
	债券代码	债券名称	约定返售日	估值单价	数量（张）	估值总额	其中：已出售或再质押总额
项目	上年度末 2018-12-31						
	债券代码	债券名称	约定返售日	估值单价	数量（张）	估值总额	其中：已出售或再质押总额

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。

应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
应收活期存款利息	6,307.80	-
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	84.10	-
应收债券利息	142,529.22	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	73.70	-
合计	148,994.82	302,779.48

其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	-

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
交易所市场应付交易费用	1,052,963.58	-
银行间市场应付交易费用	125.99	-
合计	1,053,089.57	1,437,613.46

其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1,352.06	-
预提费用	203,519.96	-
合计	204,872.02	379,208.71

实收基金

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	160,010,051.98	160,010,051.98
本期申购	19,142,314.11	19,142,314.11
本期赎回（以“-”号填列）	-23,231,673.09	-23,231,673.09
本期末	155,920,693.00	155,920,693.00

注：申购含红利再投、转换入份额及金额；赎回含转换出份额及金额。

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	81,553,061.97	-27,298,800.79	54,254,261.18
本期利润	15,781,070.34	38,746,274.52	54,527,344.86
本期基金份额交易产生的变动数	-2,362,589.30	682,402.30	-1,680,187.00
其中：基金申购款	10,282,950.60	2,805,845.25	13,088,795.85
基金赎回款	-12,645,539.90	-2,123,442.95	-14,768,982.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	94,971,543.01	12,129,876.03	107,101,419.04

存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
活期存款利息收入	112,314.40	-
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	4,441.45	-
其他	1,455.16	-
合计	118,211.01	141,608.78

股票投资收益

股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
卖出股票成交总额	224,613,398.25	-
减：卖出股票成本总额	208,745,231.90	-
买卖股票差价收入	15,868,166.35	-

债券投资收益

债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	26,868.34	-
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	26,868.34	107,938.44

债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	14,318,226.01	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	13,796,377.88	-
减：应收利息总额	494,979.79	-
买卖债券差价收入	26,868.34	-

债券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
赎回基金份额对价总额	-	-
减：现金支付赎回款总额	-	-
减：赎回债券成本总额	-	-
减：赎回债券应收利息总额	-	-
赎回差价收入	-	-

注：本基金本报告期无债券赎回差价收入。

债券投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
申购基金份额对价总额	-	-
减：现金支付申购款总额	-	-
减：申购债券成本总额	-	-
减：申购债券应收利息总额	-	-
申购差价收入	-	-

注：本基金本报告期无债券申购差价收入。

资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
卖出资产支持证券成交总额	-	-
减：卖出资产支持证券成本总额	-	-
减：应收利息总额	-	-
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。

贵金属投资收益

贵金属投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入	-	-
贵金属投资收益——赎回差价收入	-	-
贵金属投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-	-

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
卖出贵金属成交总额	-	-
减：卖出贵金属成本总额	-	-
减：买卖贵金属差价收入应缴纳增值税额	-	-
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。

贵金属投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
赎回贵金属份额对价总额	-	-
减：现金支付赎回款总额	-	-
减：赎回贵金属成本总额	-	-
赎回差价收入	-	-

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

贵金属投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
申购贵金属份额总额	-	-
减：现金支付申购款总额	-	-
减：申购贵金属成本总额	-	-
申购差价收入	-	-

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

衍生工具收益

衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
卖出权证成交总额	-	-
减：卖出权证成本总额	-	-
减：买卖权证差价收入应缴纳增值税额	-	-
买卖权证差价收入	-	-

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间收益金额 -至-
国债期货投资收益	-	-
股指期货-投资收益	-	-

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
股票投资产生的股利收益	2,423,895.07	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,423,895.07	1,604,219.59

公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
1.交易性金融资产	38,746,274.52	-
——股票投资	38,734,409.24	-
——债券投资	11,865.28	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	38,746,274.52	-42,899,712.47

其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
基金赎回费收入	34,593.78	-
转出费收入	64.11	-
合计	34,657.89	183,487.23

注：1.本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。
2.本基金的转换费由申购费补差和赎回费两部分构成，其中不低于赎回费部分的25%归入转出基金的基金资产。

交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
交易所市场交易费用	588,564.77	-
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	588,564.77	1,383,787.14

其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
审计费用	29,752.78	-
信息披露费	64,767.18	-
上清所查询服务费	600.00	-
上清所账户维护费	9,000.00	-
中债债券账户维护费	9,000.00	-
银行费用	415.00	-
合计	113,534.96	202,557.89

分部报告

无

或有事项、资产负债表日后事项的说明

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。

资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的重大资产负债表日后事项。

关联方关系

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。

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、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

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。

通过关联方交易单元进行的交易

股票交易

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019-01-01至2019-06-30		上年度可比期间 -至-	
	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
国金证券	155,493,444.62	36.10 %	252,809,815.94	25.62 %

债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019-01-01至2019-06-30		上年度可比期间 -至-	
	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
国金证券	15,763,836.40	92.86 %	4,883,156.40	11.38 %

债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019-01-01至2019-06-30		上年度可比期间 -至-	
	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
国金证券	56,000,000.00	81.16 %	380,000,000.00	18.49 %

权证交易

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019-01-01至2019-06-30		上年度可比期间 -至-	
	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：本基金于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权证交易。

应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019-01-01至2019-06-30			
	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
国金证券	113,712.17	34.91 %	318,442.94	30.24 %
关联方名称	上年度可比期间 -至-			
	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
国金证券	184,878.94	24.52 %	204,730.77	10.28 %

注：1.上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。
2.该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

关联方报酬

基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
当期发生的基金应支付的管理费	1,860,203.91	2,156,145.92
其中：支付销售机构的客户维护费	590,103.86	881,072.60

注：1.本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费计算方法如下：
H=E×1.50%/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。

基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
当期发生的基金应支付的托管费	310,033.96	359,357.68

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.25%/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。

销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019-01-01至2019-06-30 当期发生的基金应支付的销售服务费
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 -至- 当期应支付的销售服务费

注：无

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

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2019-01-01至2019-06-30					
	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 -至-					
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：本基金本报告期未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

各关联方投资本基金的情况

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 2019-01-01至2019-06-30	上年度可比期间 -至-
基金合同生效日（2012-08-28）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-%	-%

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。

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

项目	本期末 2019-06-30		上年度末 2018-12-31	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例

注：除基金管理人之外的其他关联方于本报告期及上年度可比期间均未投资本基金。

由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019-01-01至2019-06-30		上年度可比期间 -至-	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
光大银行	31,119,128.69	112,314.40	18,641,890.63	115,363.75

注：本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行保管，按银行同业利率计息。

本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2019-01-01至2019-06-30				
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：股/张） 总金额
上年度可比期间 -至-				
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：股/张） 总金额

注：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。

其他关联交易事项的说明

无

利润分配情况

利润分配情况——非货币市场基金

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注

注：本基金本报告期未进行利润分配。

期末（2019-06-30）本基金持有的流通受限证券

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

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
601236	红塔证券	2019-06-26	2019-07-05	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-
300788	中信出版	2019-06-27	2019-07-05	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-
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：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注

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因暂时停牌而流通受限的股票。

期末债券正回购交易中作为抵押的债券

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

注：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。

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。

金融工具风险及管理

-

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。

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；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。

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 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注： 注：本基金本报告期末及上年度末未持有短期信用评级的债券。

按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注： 本基金本报告期末及上年度末未持有短期信用评级的资产支持证券。

按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注： 注：本基金本报告期末及上年度末未持有短期信用评级的同业存单。

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 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
AAA	-	-
AAA以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本基金本报告期末及上年度末未持有长期信用评级的债券。

按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
AAA	-	-
AAA以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本基金本报告期末及上年度末未持有长期信用评级的资产支持证券。

按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
AAA	-	-
AAA以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本基金本报告期末及上年度末未持有长期信用评级的同业存单。

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。

金融资产和金融负债的到期期限分析

单位：人民币元

本期末 2019-06-30	合计
资产	
资产总计	-
负债	
负债总计	-
流动性净额	-
上年度末 2018-12-31	**合计**
资产	
资产总计	-
负债	
负债总计	-
流动性净额	-

注：注：无

报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例、份额持有人集中度、调整平均剩余期限和平均剩余存续期、压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人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，除在附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。除附注中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在1个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约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。

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。

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。

利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019-06-30	1个月以内	3个月-1年	不计息	合计
资产				
银行存款	31,119,128.69	-	-	31,119,128.69
结算备付金	686,940.36	-	-	686,940.36
存出保证金	163,899.03	-	-	163,899.03
交易性金融资产	-	13,638,080.80	219,794,793.91	233,432,874.71
应收利息	-	-	148,994.82	148,994.82
应收申购款	-	-	43,280.89	43,280.89
资产总计	31,969,968.08	13,638,080.80	219,987,069.62	265,595,118.50
负债				
应付赎回款	-	-	951,240.41	951,240.41
应付管理人报酬	-	-	311,819.53	311,819.53
应付托管费	-	-	51,969.93	51,969.93
应付交易费用	-	-	1,053,089.57	1,053,089.57
应交税费	-	-	15.00	15.00
其他负债	-	-	204,872.02	204,872.02
负债总计	-	-	2,573,006.46	2,573,006.46
利率敏感度缺口	31,969,968.08	13,638,080.80	217,414,063.16	263,022,112.04
上年度末 2018-12-31	1个月以内	3个月-1年	不计息	合计
资产				
银行存款	21,829,680.04	-	-	21,829,680.04
结算备付金	1,464,080.51	-	-	1,464,080.51
存出保证金	222,416.98	-	-	222,416.98
交易性金融资产	-	10,681,794.00	181,905,782.84	192,587,576.84
买入返售金融资产	11,200,000.00	-	-	11,200,000.00
应收利息	-	-	302,779.48	302,779.48
应收申购款	-	-	82,752.74	82,752.74
资产总计	34,716,177.53	10,681,794.00	182,291,315.06	227,689,286.59
负债				
应付证券清算款	-	-	11,041,132.40	11,041,132.40
应付赎回款	-	-	224,935.41	224,935.41
应付管理人报酬	-	-	293,199.23	293,199.23
应付托管费	-	-	48,866.51	48,866.51
应付交易费用	-	-	1,437,613.46	1,437,613.46
应交税费	-	-	17.71	17.71
其他负债	-	-	379,208.71	379,208.71
负债总计	-	-	13,424,973.43	13,424,973.43
利率敏感度缺口	34,716,177.53	10,681,794.00	168,866,341.63	214,264,313.16

注：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。

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 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
	+25个基准点	-18,877.62	-7,283.60
	-25个基准点	18,929.49	7,306.32

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。

外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2019-06-30			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	-	-	-
项目	上期末 2018-06-30			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	-	-	-

外汇风险的敏感性分析

假设	-		
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 2019-06-30	上年度末 2018-12-31

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。

其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019-06-30		上年度末 2018-12-31	
	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	219,794,793.91	83.57	181,905,782.84	84.90
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	13,638,080.80	5.19	10,681,794.00	4.99
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	233,432,874.71	88.75	192,587,576.84	89.88

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系数是根据组合报告期内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		对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
	相关风险变量的变动	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31
	+5%	11,290,784.74	9,553,636.03
	-5%	-11,290,784.74	-9,553,636.03

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	-		
	-		
分析	风险价值（金额单位：人民币元）	本期末 2019-06-30	上年度末 2018-12-31

有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无

期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	219,794,793.91	82.76
	其中：股票	219,794,793.91	82.76
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	13,638,080.80	5.13
	其中：债券	13,638,080.80	5.13
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	31,806,069.05	11.98
8	其他各项资产	356,174.74	0.13
9	合计	265,595,118.50	100.00

报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末按行业分类的股票投资组合

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	167,737.50	0.06
C	制造业	131,914,956.18	50.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	12,435,861.68	4.73
G	交通运输、仓储和邮政业	10,481,537.00	3.99
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,452,255.46	8.54
J	金融业	35,366,977.10	13.45
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	6,952,362.39	2.64
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.01
S	综合	-	-
	合计	219,794,793.91	83.57

注：以上行业分类以2019年6月30日的证监会行业分类标准为依据。

报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	-	-
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-
G 工业	-	-
H 信息技术	-	-
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	231,592	20,521,367.12	7.80
2	300003	乐普医疗	811,656	18,684,321.12	7.10
3	002050	三花智控	1,716,003	18,103,831.65	6.88
4	600887	伊利股份	541,077	18,077,382.57	6.87
5	002007	华兰生物	512,550	15,627,649.50	5.94
6	002415	海康威视	460,079	12,688,978.82	4.82
7	601933	永辉超市	1,218,008	12,435,861.68	4.73
8	002422	科伦药业	401,200	11,927,676.00	4.53
9	601336	新华保险	185,600	10,213,568.00	3.88
10	000063	中兴通讯	246,200	8,008,886.00	3.04
11	002236	大华股份	519,000	7,535,880.00	2.87
12	300015	爱尔眼科	224,487	6,952,362.39	2.64
13	002368	太极股份	200,200	6,066,060.00	2.31
14	300188	美亚柏科	319,680	5,699,894.40	2.17
15	600276	恒瑞医药	85,823	5,664,318.00	2.15
16	300383	光环新网	326,490	5,475,237.30	2.08
17	002821	凯莱英	55,200	5,414,016.00	2.06
18	601111	中国国航	551,300	5,275,941.00	2.01
19	600029	南方航空	674,300	5,205,596.00	1.98
20	300212	易华录	211,080	5,171,460.00	1.97
21	600036	招商银行	127,798	4,598,172.04	1.75
22	600519	贵州茅台	3,852	3,790,368.00	1.44
23	002463	沪电股份	243,400	3,315,108.00	1.26
24	300750	宁德时代	28,050	1,932,084.00	0.73
25	603019	中科曙光	29,240	1,026,324.00	0.39
26	600968	海油发展	47,250	167,737.50	0.06
27	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.03

28	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.02
29	603863	松炀资源	1,612	37,204.96	0.01
30	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.01
31	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.01

报告期内股票投资组合的重大变动

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	002050	三花智控	27,590,507.50	12.88
2	600066	宇通客车	14,493,380.00	6.76
3	600406	国电南瑞	11,695,532.97	5.46
4	002422	科伦药业	11,138,983.00	5.20
5	600276	恒瑞医药	10,043,615.04	4.69
6	300003	乐普医疗	9,966,395.00	4.65
7	601336	新华保险	9,889,879.00	4.62
8	002236	大华股份	8,894,983.00	4.15
9	300015	爱尔眼科	8,845,437.17	4.13
10	000063	中兴通讯	7,680,952.00	3.58
11	002415	海康威视	6,682,725.96	3.12
12	300212	易 华 录	6,013,404.00	2.81
13	600887	伊利股份	5,841,080.00	2.73
14	002007	华兰生物	5,826,193.00	2.72
15	002368	太极股份	5,689,329.00	2.66
16	300188	美亚柏科	5,656,533.00	2.64
17	300383	光环新网	5,380,019.56	2.51
18	002821	凯 莱 英	5,175,518.00	2.42
19	601111	中国国航	5,091,155.00	2.38
20	603866	桃李面包	5,055,872.00	2.36
21	600029	南方航空	5,013,328.00	2.34
22	000977	浪潮信息	4,977,329.21	2.32

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。

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	002384	东山精密	13,261,773.51	6.19
2	600066	宇通客车	12,950,280.20	6.04
3	600048	保利地产	12,942,381.00	6.04
4	002050	三花智控	12,359,872.12	5.77
5	300383	光环新网	11,873,581.19	5.54
6	600519	贵州茅台	11,764,912.20	5.49
7	600406	国电南瑞	11,515,985.04	5.37
8	002594	比 亚 迪	11,315,197.17	5.28
9	300003	乐普医疗	10,826,722.92	5.05
10	600276	恒瑞医药	10,403,713.82	4.86
11	601288	农业银行	10,039,515.08	4.69
12	000977	浪潮信息	5,977,735.10	2.79
13	000001	平安银行	5,932,586.59	2.77
14	600585	海螺水泥	5,894,322.31	2.75
15	601318	中国平安	5,811,088.31	2.71
16	600887	伊利股份	5,618,972.65	2.62
17	603866	桃李面包	5,245,971.29	2.45
18	300015	爱尔眼科	5,093,073.06	2.38
19	600521	华海药业	4,782,708.98	2.23
20	603019	中科曙光	4,539,436.00	2.12

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。

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	207,899,833.73
卖出股票收入（成交）总额	224,613,398.25

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。

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	13,638,080.80	5.19
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	13,638,080.80	5.19

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019611	19国债01	136,490	13,638,080.80	5.19

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。

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

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注： 本基金本报告期末未持有权证。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动	风险说明
公允价值变动总额合计				-	
股指期货投资本期收益				-	
股指期货投资本期公允价值变动				-	

注：本基金本报告期末投资股指期货。

本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本期国债期货投资政策

本基金本报告期未投资国债期货。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明
公允价值变动总额合计(元)				-	
国债期货投资本期收益（元）				-	
国债期货投资本期公允价值变动(元)				-	

注：本基金本报告期未投资国债期货。

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。

投资组合报告附注

本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本期基金投资组合前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	163,899.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	148,994.82
5	应收申购款	43,280.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	356,174.74

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换债券。

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。

投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

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
10,291	15,151.17	50,579,287.96	32.44 %	105,341,405.04	67.56 %

期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占上市总份额比例

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	151,906.06	0.0974 %

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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	-

发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-%	-	-%	-
基金管理人高级管理人员	94,231.50	0.06 %	-	-%	-
基金经理等人员	-	-%	-	-%	-
基金管理人股东	-	-%	-	-%	-
其他	-	-%	-	-%	-
合计	94,231.50	0.06 %	-	-%	-

注：本基金成立后有11,001,640.59份额为发起份额，发起份额承诺的持有期限为3年，自2012年8月28日起至2015年8月27日止。自2015年8月28日起发起份额承诺持有期限届满，发起份额可以自由申购赎回退出。

开放式基金份额变动

单位：份

项目	数值
基金合同生效日（2012-08-28）的基金份额总额	178,532,819.63
本报告期期初基金份额总额	160,010,051.98
本报告期期间基金总申购份额	19,142,314.11
减：本报告期期间基金总赎回份额	23,231,673.09
本报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	155,920,693.00

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。

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。

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。

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。

基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

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。

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，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

基金租用证券公司交易单元的有关情况

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		基金交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		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	成交金额	占当期基金成交总额的比例	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	佣金	占当期佣金总量的比例	
国金证券	2	155,493,444.62	36.10 %	-	-%	15,763,836.40	92.86 %	56,000,000.00	81.16 %	-	-%	113,712.17	34.91 %	-
东方证券	1	129,884,906.92	30.16 %	-	-%	197,825.46	1.17 %	-	-%	-	-%	94,984.86	29.16 %	-
华金证券	1	59,406,703.34	13.79 %	-	-%	211,977.85	1.25 %	-	-%	-	-%	43,444.11	13.34 %	-
中信证券	1	53,644,679.57	12.45 %	-	-%	802,448.48	4.73 %	13,000,000.00	18.84 %	-	-%	49,958.89	15.34 %	-
平安证券	1	22,076,179.42	5.13 %	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	16,143.99	4.96 %	-
东兴证券	1	10,209,527.79	2.37 %	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	7,466.31	2.29 %	-
国元证券	1	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-
西藏东方财富证券	2	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-
方正证券	1	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-
光大证券	2	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-
中信建投	1	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-
天风证券	1	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-
华创证券	1	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-
国信证券	1	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-
招商证券	2	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-
国盛证券	1	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-
国融证券	1	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-
申万宏源	1	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-	-%	-
银河证券	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.本报告期新增平安证券、东兴证券、国元证券各一个交易单元。 -

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	《关于增加大连网金基金销售有限公司为国金基金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	2019-01-04
2	《关于增加阳光人寿保险股份有限公司为国金基金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	2019-01-10
3	《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金2018年第4季度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019-01-19
4	《关于暂停大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019-02-23
5	《关于增加民商基金销售(上海)有限公司为国金基金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	2019-03-07
6	《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金2018年年度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019-03-30
7	《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金2018年年度报告摘要》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019-03-30
8	《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019-04-13
9	《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）摘要》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019-04-13
10	《关于国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理变更的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019-04-16
11	《关于北京懒猫金融信息服务有限公司终止代理销售国金基金管理有限公司旗下基金的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019-04-18
12	《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金2019年第1季度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019-04-22
13	《国金基金管理有限公司关于增加泰信财富、奕丰金融为国金基金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	2019-04-25
14	《国金基金关于国金国鑫发起、国金上证50参加中国民生银行直销银行申购及定期定额投资费率优惠活动的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019-05-14
15	《关于国金基金管理有限公司开通旗下部分基金转换业务的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019-05-22
16	《关于增加国都证券、平安证券为国金基金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	2019-06-11
17	《关于增加洪泰财富（青岛）基金销售有限责任公司为国金基金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	2019-06-20
18	《国金基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019-06-21
19	《国金基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的中科曙光估值方法调整的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2019-06-26

注：注：本报告期内，公司按照《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。

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	-	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险								
-								

注：本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

影响投资者决策的其他重要信息

无

备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件；
2、国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同；
3、国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议；
4、国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书；
5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
7、报告期内披露的各项公告。

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。

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