

国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资 基金 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：中国光大银行股份有限公司

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。

基金托管人中国光大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

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
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
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
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
§4 管理人报告	10
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.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	41
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	41
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.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
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.....	46
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.....	47
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.....	47
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.....	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.12 投资组合报告附注.....	47
§8 基金份额持有人信息.....	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	49
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	49
§9 开放式基金份额变动.....	51
§10 重大事件揭示.....	52
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
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.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
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.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	54

§11 影响投资者决策的其他重要信息	57
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	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	57
§12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录.....	58
12.2 存放地点.....	58
12.3 查阅方式.....	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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
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	2012 年 8 月 28 日
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	283,332,204.58 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

注：无。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金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	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，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。

注：本基金为发起式基金。

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	中国光大银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	杨海燕	张建春
	联系电话	010-88005970	010-63639180
	电子邮箱	yanghaiyan@gfund.com	zhangjianchun@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	唐双宁

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	国金基金管理有限公司	北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	4,836,510.26
本期利润	17,845,875.52
加权平均基金份额本期利润	0.0685
本期加权平均净值利润率	3.58%
本期基金份额净值增长率	4.36%
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	221,766,876.70
期末可供分配基金份额利润	0.7827
期末基金资产净值	550,436,621.91
期末基金份额净值	1.9427
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	208.38%

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

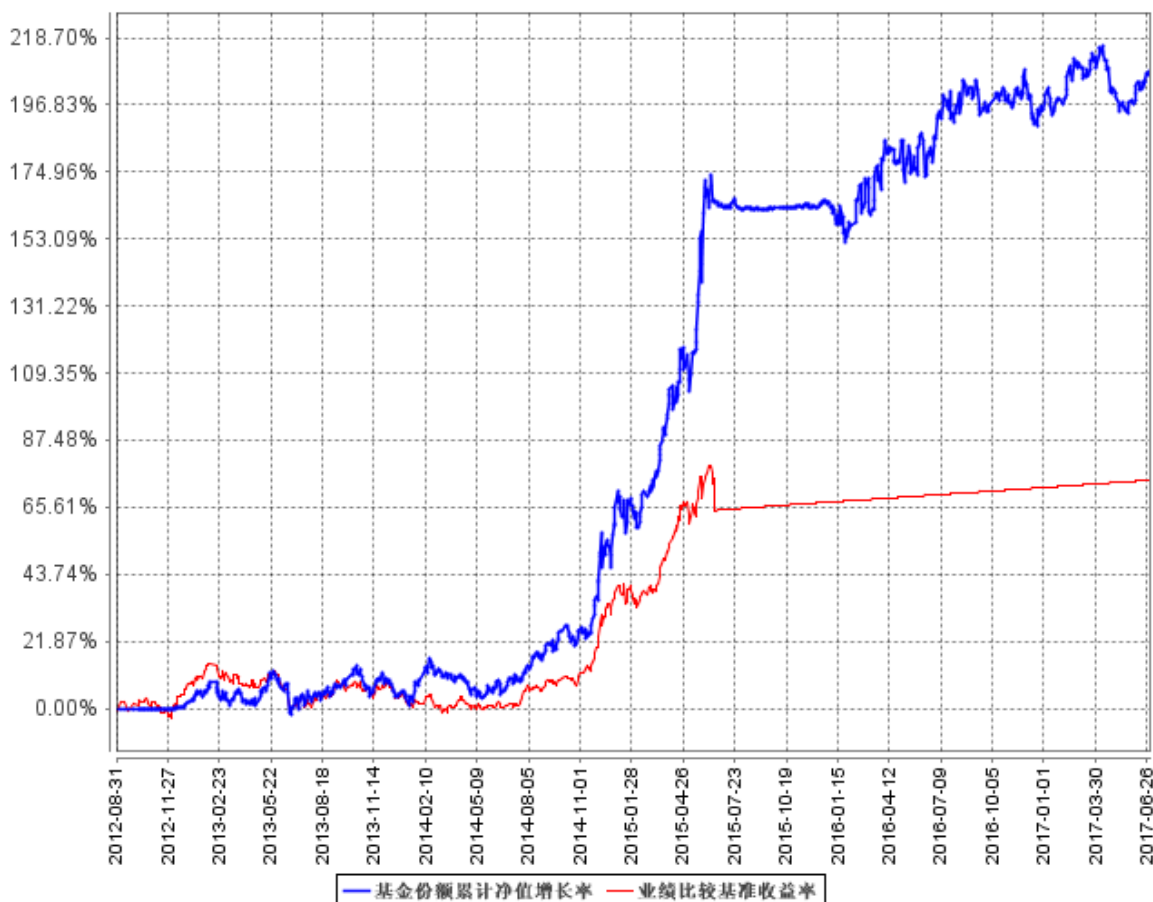
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.47%	0.42%	0.23%	0.01%	3.24%	0.41%
过去三个月	-0.20%	0.52%	0.70%	0.01%	-0.90%	0.51%
过去六个月	4.36%	0.54%	1.39%	0.01%	2.97%	0.53%

过去一年	7.96%	0.67%	2.83%	0.01%	5.13%	0.66%
过去三年	186.98%	1.16%	72.17%	0.59%	114.81%	0.57%
自基金合同生效起至今	208.38%	1.07%	74.53%	0.66%	133.85%	0.41%

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）。

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：1、图示日期为 2012 年 8 月 31 日至 2017 年 6 月 30 日。

2、本基金基金合同生效日为 2012 年 8 月 28 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		
徐艳芳	本基金基金经理，国金金腾货币、国金众赢货币、国金及第七天理财基金经理，投资管理部总经理	2013年2月25日	-	9	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、固定收益投资部总经理兼基金经理；自2017年3月起任投资管理部总经理兼基金经理。
李安心	本基金基金经	2016年8月29日	-	13	李安心先生，复旦大学硕士。2004年1月至2005

	理, 国金鑫安保本基金经理				年 5 月在金元证券有限责任公司任研究员; 2005 年 6 月至 2012 年 8 月在中邮创业基金管理有限公司任研究员、基金经理; 2012 年 9 月至 2013 年 1 月在国金基金管理有公司任特定资产管理部副总经理; 2013 年 1 月至 2016 年 8 月在北京千石创富资本管理有限公司历任特定资产管理部投资副总监、乾石投资工作室投资副总监、证券投资部投资副总监。2016 年 8 月再次加入国金基金管理有限公司, 历任权益投资事业部基金经理; 自 2017 年 3 月起任投资管理部基金经理。
滕祖光	本基金经理, 国金鑫安保本基金经理	2014 年 4 月 11 日	-	12	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、固定收益投资部基金经理; 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。

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

2017 年上半年 A 股市场一波三折，年初短暂下跌后市场缓慢上涨，4 月份金融整顿以及 PPI 见顶，市场快速下跌，随后政策加强协调，经济表现稳定，市场逐步企稳回升，但高估值的创业板持续走弱。

本基金在报告期延续稳健的投资风格，持续保持中性偏低的股票配置比例，优选低估值、业绩确定性强的优质绩优公司，一季度重点配置建筑、消费，二季度重点配置金融、消费、航空等行业，规避了成长股的下跌风险，保持业绩稳定，取得较好投资效果。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.9427 元，本报告期份额净值增长率为 4.36%，同期业绩比较基准增长率为 1.39%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年经济面临小周期见顶风险。货币供应增速自 2016 年以来持续下行，房地产销售增速自 2016 年 4 月份持续下行，对经济的压力将逐步显现。但经过供给侧改革之后，工业体系供需结构改善，经济大幅下行的风险较小。

流动性趋于稳定。利率与通胀之差处于历史高位，企业债务融资规模急剧缩小，利率上行的空间有限。同时，强化监管协调有利于减少利率波动。但需要警惕全球利率超预期上行的风险。美联储已经加息两次，缩减资产负债表纳入日程，欧洲及英国央行表露缩表意图。

流动性企稳有利于风险偏好的提升，结构性机会将增加。改革持续推进，国企改革、军民融合等领域不断取得进展。新能源汽车风潮渐起，国内销售持续改善，特斯拉成功推出 MODEL3，但需要关注供应链短期产能过剩的风险。

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

本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

报告期内，本基金无利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2017 年上半年度，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的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《公开募集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、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定，依法安全托管了基金的全部资产，对国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资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。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。

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

2017 年上半年度，中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《公开募集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、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人国金基金管理有限公司的投资运作、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《证券投资基金法》等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。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人国金基金管理有限公司编制的《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金 2017 年半年度报告》进行了复核，报告中相关财务指标、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是真实、准确和完整的。

§ 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：国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金

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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	20,736,278.22	28,500,514.79
结算备付金		9,954,849.43	3,721,292.77
存出保证金		404,889.87	289,670.16
交易性金融资产	6.4.7.2	380,591,052.70	290,742,009.22
其中：股票投资		352,610,252.70	267,933,769.22
基金投资		-	-
债券投资		27,980,800.00	22,808,240.00
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	130,000,000.00	70,000,195.00
应收证券清算款		20,088,993.21	14,889,122.48
应收利息	6.4.7.5	943,073.90	577,988.45
应收股利		-	-
应收申购款		1,219,206.95	1,248,134.33
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	13,635.05	-
资产总计		563,951,979.33	409,968,927.20
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负债：			
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		6,399,019.34	1,847,544.35
应付赎回款		3,627,416.77	1,392,737.90
应付管理人报酬		676,846.10	505,976.40
应付托管费		112,807.65	84,329.40
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,150,127.54	1,859,309.29

应交税费		15.00	15.00
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	549,125.02	553,204.94
负债合计		13,515,357.42	6,243,117.28
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	283,332,204.58	216,877,927.60
未分配利润	6.4.7.10	267,104,417.33	186,847,882.32
所有者权益合计		550,436,621.91	403,725,809.92
负债和所有者权益总计		563,951,979.33	409,968,927.20

注：本报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.9427 元，基金份额总额 283,332,204.58 份。

6.2 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：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
一、收入		23,887,889.80	17,978,459.48
1.利息收入		2,475,753.72	628,643.30
其中：存款利息收入	6.4.7.11	383,235.13	271,053.06
债券利息收入		510,961.85	204,336.96
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,581,556.74	153,253.28
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		7,675,908.15	9,602,687.16
其中：股票投资收益	6.4.7.12	6,038,130.53	6,733,285.09
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-242,677.09	-236,585.25
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	1,880,454.71	3,105,987.32
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	13,009,365.26	5,545,610.51
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	726,862.67	2,201,518.51

减：二、费用		6,042,014.28	4,208,720.30
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,694,710.35	2,007,213.88
2. 托管费	6.4.10.2.2	615,785.01	334,535.62
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,521,524.14	1,653,768.74
5. 利息支出		-	970.14
其中：卖出回购金融资产支出		-	970.14
6. 其他费用	6.4.7.20	209,994.78	212,231.92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		17,845,875.52	13,769,739.18
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		17,845,875.52	13,769,739.18

6.3 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：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）	216,877,927.60	186,847,882.32	403,725,809.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	17,845,875.52	17,845,875.52
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）	66,454,276.98	62,410,659.49	128,864,936.47
其中：1.基金申购款	182,687,375.43	169,016,766.43	351,704,141.86
2.基金赎回款	-116,233,098.45	-106,606,106.94	-222,839,205.39
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	283,332,204.58	267,104,417.33	550,436,621.91

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%。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）

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 日止会计期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

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、地方政府债券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	20,736,278.22
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	20,736,278.22

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	329,560,129.63	352,610,252.70	23,050,123.07
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	7,968,800.00	-31,385.00
	银行间市场	20,012,000.00	-142,360.00
	合计	27,980,800.00	-173,745.00
资产支持证券	-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	357,714,674.63	380,591,052.70	22,876,378.07

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	130,000,000.00	-
合计	130,000,000.00	-

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	6,237.69
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	4,254.60
应收债券利息	991,728.22
应收买入返售证券利息	-59,328.81
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	182.20
合计	943,073.90

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
其他应收款	-
待摊费用	13,635.05
合计	13,635.05

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	2,149,957.54
银行间市场应付交易费用	170.00
合计	2,150,127.54

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	6,647.13
账户维护费	9,000.00
信息披露费	498,765.71
审计费	34,712.18
合计	549,125.02

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	216,877,927.60	216,877,927.60
本期申购	182,687,375.43	182,687,375.43
本期赎回(以“-”号填列)	-116,233,098.45	-116,233,098.45
- 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	283,332,204.58	283,332,204.58
-----	----------------	----------------

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	164,087,368.52	22,760,513.80	186,847,882.32
本期利润	4,836,510.26	13,009,365.26	17,845,875.52
本期基金份额交易产生的变动数	52,842,997.92	9,567,661.57	62,410,659.49
其中：基金申购款	143,868,529.71	25,148,236.72	169,016,766.43
基金赎回款	-91,025,531.79	-15,580,575.15	-106,606,106.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	221,766,876.70	45,337,540.63	267,104,417.33

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	328,700.02
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	51,649.49
其他	2,885.62
合计	383,235.13

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	546,768,564.81
减：卖出股票成本总额	540,730,434.28
买卖股票差价收入	6,038,130.53

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	-242,677.09
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	-242,677.09

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	23,578,261.50
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	23,323,689.82
减：应收利息总额	497,248.77
买卖债券差价收入	-242,677.09

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	1,880,454.71
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,880,454.71

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	13,009,365.26
——股票投资	13,001,660.44
——债券投资	7,704.82
——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	13,009,365.26

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	725,412.47
转出费收入	1,450.20
合计	726,862.67

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

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

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	1,521,324.14
银行间市场交易费用	200.00
合计	1,521,524.14

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	34,712.18
信息披露费	148,765.71
其他	10.00
上清所查询服务费	600.00
中债债券账户维护费	9,000.00
上清所账户维护费	9,000.00
银行费用	7,906.89
合计	209,994.78

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
中国光大银行股份有限公司	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

金额单位：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	
	成交金额	占当期股票	成交金额	占当期股票

		成交总额的比例		成交总额的比例
国金证券	324,749,813.73	28.12%	-	-

注：本基金于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

金额单位：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	
	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
国金证券	948,824.76	8.53%	-	-

注：本基金于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债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日			
	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	237,488.20	27.23%	333,309.95	15.50%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016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
国金证券	-	-	-	-

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。

3. 本基金于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	3,694,710.35	2,007,213.88
其中：支付销售机构的客户维护费	1,473,511.38	820,181.05

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：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，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。

6.4.10.2.2 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	615,785.01	334,535.62

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：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

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
光大银行	20,736,278.22	328,700.02	11,931,561.18	257,046.14

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。

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：本基金于本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

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：本基金本报告期未进行利润分配。

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

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。

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、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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末未持有短期信用评级的债券。

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	-	-
AAA 以下	-	2,808,240.00
未评级	-	-
合计	-	2,808,240.00

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所持金融工具变现的难易程度。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，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部门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。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。

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 6.4.12 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，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均

为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）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。

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	20,736,278.22	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	20,736,278.22
结算备付金	9,954,849.43	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	9,954,849.43
存出保证金	404,889.87	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	404,889.87
交易性金融资产	20,012,000.00	0.00	7,968,800.00	0.00	0.00	352,610,252.70	380,591,052.70
买入返售金融资产	130,000,000.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	130,000,000.00
应收证券清算款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	20,088,993.21	20,088,993.21
应收利息	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	943,073.90	943,073.90
应收申购款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	1,219,206.95	1,219,206.95
其他资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	13,635.05	13,635.05
资产总计	181,108,017.52	0.00	7,968,800.00	0.00	0.00	374,875,161.81	563,951,979.33
负债							
应付证券清算款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	6,399,019.34	6,399,019.34
应付赎回款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	3,627,416.77	3,627,416.77

应付管理人报酬	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	676,846.10	676,846.10
应付托管费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	112,807.65	112,807.65
应付交易费用	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	2,150,127.54	2,150,127.54
应付税费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	15.00	15.00
其他负债	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	549,125.02	549,125.02
负债总计	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	13,515,357.42	13,515,357.42
利率敏感度缺口	181,108,017.52	0.00	7,968,800.00	0.00	0.00	361,359,804.39	550,436,621.91
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	28,500,514.79	-	-	-	-	-	28,500,514.79
结算备付金	3,721,292.77	-	-	-	-	-	3,721,292.77
存出保证金	289,670.16	-	-	-	-	-	289,670.16
交易性金融资产	21,792,500.00	-	1,015,740.00	-	-	267,933,769.22	290,742,009.22
买入返售金融资产	70,000,195.00	-	-	-	-	-	70,000,195.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	14,889,122.48	14,889,122.48
应收利息	-	-	-	-	-	577,988.45	577,988.45
应收申购款	-	-	-	-	-	1,248,134.33	1,248,134.33
资产总计	124,304,172.72	-	1,015,740.00	-	-	284,649,014.48	409,968,927.20
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,847,544.35	1,847,544.35
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,392,737.90	1,392,737.90
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	505,976.40	505,976.40
应付托管费	-	-	-	-	-	84,329.40	84,329.40
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,859,309.29	1,859,309.29
应付税费	-	-	-	-	-	15.00	15.00
其他负债	-	-	-	-	-	553,204.94	553,204.94
负债总计	-	-	-	-	-	6,243,117.28	6,243,117.28
利率敏感度缺口	124,304,172.72	-	1,015,740.00	-	-	-278,405,897.20	403,725,809.92

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）

	利率+25 个基点	-14, 219. 19	-37, 164. 85
	利率-25 个基点	14, 272. 00	37, 737. 82

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 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	352, 610, 252. 70	64. 06	267, 933, 769. 22	66. 37
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	27, 980, 800. 00	5. 08	22, 808, 240. 00	5. 65
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	380, 591, 052. 70	69. 14	290, 742, 009. 22	72. 01

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%	22,235,483.96	11,269,546.28
	-5%	-22,235,483.96	-11,269,546.28

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

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	352,610,252.70	62.52
	其中：股票	352,610,252.70	62.52
2	固定收益投资	27,980,800.00	4.96
	其中：债券	27,980,800.00	4.96
	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	130,000,000.00	23.05
	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	30,691,127.65	5.44
7	其他各项资产	22,669,798.98	4.02
8	合计	563,951,979.33	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	3,107,363.73	0.56
B	采矿业	20,162,000.00	3.66
C	制造业	108,845,271.10	19.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	38,218,778.24	6.94
F	批发和零售业	25,010,962.94	4.54
G	交通运输、仓储和邮政业	40,590,000.00	7.37
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	61,985,415.69	11.26
K	房地产业	2,951,231.00	0.54

L	租赁和商务服务业	18,084,000.00	3.29
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	19,470,950.00	3.54
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	14,184,280.00	2.58
S	综合	-	-
	合计	352,610,252.70	64.06

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港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600887	伊利股份	1,200,000	25,908,000.00	4.71
2	601668	中国建筑	2,500,000	24,200,000.00	4.40
3	601111	中国国航	2,200,000	21,450,000.00	3.90
4	601336	新华保险	399,998	20,559,897.20	3.74
5	600028	中国石化	3,400,000	20,162,000.00	3.66
6	000963	华东医药	399,960	19,878,012.00	3.61
7	600029	南方航空	2,200,000	19,140,000.00	3.48
8	000001	平安银行	2,000,000	18,780,000.00	3.41
9	601169	北京银行	2,000,000	18,340,000.00	3.33
10	601888	中国国旅	600,000	18,084,000.00	3.29
11	002185	华天科技	1,999,890	14,479,203.60	2.63
12	000826	启迪桑德	400,000	14,048,000.00	2.55
13	601117	中国化学	2,000,000	13,980,000.00	2.54
14	603898	好莱客	395,900	13,836,705.00	2.51
15	600373	中文传媒	500,000	11,755,000.00	2.14
16	600073	上海梅林	1,000,000	9,550,000.00	1.73
17	300444	双杰电气	300,000	6,438,000.00	1.17
18	601398	工商银行	784,300	4,117,575.00	0.75
19	603588	高能环境	230,000	3,588,000.00	0.65

20	600201	生物股份	90,000	3,201,300.00	0.58
21	600585	海螺水泥	138,300	3,143,559.00	0.57
22	000651	格力电器	76,300	3,141,271.00	0.57
23	000501	鄂武商 A	168,639	3,113,075.94	0.57
24	603228	景旺电子	63,900	3,083,175.00	0.56
25	600522	中天科技	254,600	3,067,930.00	0.56
26	002242	九阳股份	154,700	3,042,949.00	0.55
27	000998	隆平高科	134,549	2,962,768.98	0.54
28	600383	金地集团	257,300	2,951,231.00	0.54
29	600089	特变电工	285,342	2,947,582.86	0.54
30	002273	水晶光电	137,000	2,826,310.00	0.51
31	600528	中铁工业	188,700	2,696,523.00	0.49
32	601633	长城汽车	190,400	2,530,416.00	0.46
33	300133	华策影视	216,900	2,429,280.00	0.44
34	000786	北新建材	150,000	2,376,000.00	0.43
35	600309	万华化学	80,000	2,291,200.00	0.42
36	300116	坚瑞沃能	192,300	2,067,225.00	0.38
37	600827	百联股份	124,300	2,019,875.00	0.37
38	002573	清新环境	97,500	1,834,950.00	0.33
39	002001	新和成	80,000	1,552,800.00	0.28
40	601878	浙商证券	11,049	187,943.49	0.03
41	300616	尚品宅配	1,301	176,363.56	0.03
42	601952	苏垦农发	10,425	144,594.75	0.03
43	603345	安井食品	3,227	82,611.20	0.02
44	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.01
45	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.01
46	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.01
47	603316	诚邦股份	1,824	38,778.24	0.01
48	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.01
49	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
50	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
51	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
52	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
53	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
54	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
55	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
56	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
57	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
58	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00

59	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
60	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
61	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
62	603617	君禾股份	832	7,429.76	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	000528	柳 工	32,401,137.04	8.03
2	600887	伊利股份	27,453,545.00	6.80
3	000001	平安银行	26,608,857.00	6.59
4	601668	中国建筑	24,541,057.02	6.08
5	601111	中国国航	22,590,204.41	5.60
6	600597	光明乳业	21,149,056.35	5.24
7	601336	新华保险	20,574,161.64	5.10
8	601808	中海油服	20,015,702.67	4.96
9	600029	南方航空	18,977,078.83	4.70
10	601169	北京银行	17,888,775.00	4.43
11	002353	杰瑞股份	17,086,557.78	4.23
12	600208	新湖中宝	16,714,897.98	4.14
13	601888	中国国旅	16,027,853.00	3.97
14	601800	中国交建	14,808,931.04	3.67
15	300228	富瑞特装	14,523,703.63	3.60
16	000709	河钢股份	14,207,457.00	3.52
17	603898	好 莱 客	13,346,131.83	3.31
18	002185	华天科技	13,279,028.65	3.29
19	600373	中文传媒	12,773,742.33	3.16
20	600000	浦发银行	12,467,265.40	3.09
21	600054	黄山旅游	11,139,831.52	2.76
22	600073	上海梅林	10,847,941.00	2.69
23	601117	中国化学	10,588,877.56	2.62

24	000683	远兴能源	10,020,000.00	2.48
25	300408	三环集团	9,727,855.08	2.41
26	601390	中国中铁	8,941,340.00	2.21
27	000538	云南白药	8,899,970.45	2.20

注：“买入金额”为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000528	柳 工	33,111,246.11	8.20
2	601800	中国交建	22,023,388.44	5.46
3	601186	中国铁建	21,427,614.00	5.31
4	600597	光明乳业	19,599,431.64	4.85
5	600428	中远海特	17,861,782.00	4.42
6	600820	隧道股份	17,475,934.00	4.33
7	600208	新湖中宝	16,600,278.43	4.11
8	601808	中海油服	16,379,212.82	4.06
9	000709	河钢股份	15,577,200.00	3.86
10	300070	碧 水 源	15,140,349.72	3.75
11	002450	康 得 新	14,448,035.73	3.58
12	600039	四川路桥	14,445,369.37	3.58
13	002294	信 立 泰	14,413,404.46	3.57
14	002353	杰瑞股份	14,143,781.15	3.50
15	000157	中联重科	13,698,877.48	3.39
16	600000	浦发银行	12,602,866.13	3.12
17	600141	兴发集团	12,484,016.00	3.09
18	600885	宏发股份	12,226,482.00	3.03
19	601965	中国汽研	11,688,833.10	2.90
20	000059	华锦股份	11,628,799.32	2.88
21	300228	富瑞特装	11,358,710.30	2.81
22	002008	大族激光	11,013,115.84	2.73
23	601117	中国化学	10,954,689.72	2.71
24	600054	黄山旅游	10,546,301.11	2.61
25	300408	三环集团	10,029,832.00	2.48
26	000683	远兴能源	9,380,000.00	2.32
27	000001	平安银行	9,055,000.00	2.24

28	601390	中国中铁	8,952,950.00	2.22
29	000538	云南白药	8,700,887.16	2.16

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	612,405,257.32
卖出股票收入（成交）总额	546,768,564.81

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	7,968,800.00	1.45
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,012,000.00	3.64
	其中：政策性金融债	20,012,000.00	3.64
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	27,980,800.00	5.08

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	140438	14 农发 38	200,000	20,012,000.00	3.64
2	019557	17 国债 03	80,000	7,968,800.00	1.45

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：本基金本报告期末投资股指期货。

7.10.2 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。

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

本基金本报告期末投资国债期货。

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：本基金本报告期末投资国债期货。

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

本期基金投资组合前十名证券的发行主体中，平安银行（000001.SZ）在报告编制日前一年内受到中国银监会行政处罚。根据中国银监会于 2017 年 4 月 10 日发布的行政处罚信息，中国银监会作出银监罚决字[2017]14 号行政处罚决定书：对平安银行罚款共计 1670 万元。由于平安银行（000001.SZ）所涉及到的违规问题对公司的主要经营业务影响较小，对公司投资价值影响不明显，本基金维持对该股票的持有。基金管理人对该股票的投资决策程序符合法律法规及公司制度的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

除上述情况外，本基金投资的其他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。

7.12.2

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。

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	404,889.87
2	应收证券清算款	20,088,993.21
3	应收股利	-
4	应收利息	943,073.90
5	应收申购款	1,219,206.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	13,635.05
8	其他	-
9	合计	22,669,798.98

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情况。

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
19,293	14,685.75	41,516,120.81	14.65%	241,816,083.77	85.35%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	501,566.54	0.1770%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	403,364.58	0.14	1,400,342.78	0.49	3年
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	98,201.96	0.03	600,084.67	0.21	3年
合计	501,566.54	0.18	2,000,427.45	0.71	3年

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。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012年8月28日）基金份额总额	178,532,819.63
本报告期期初基金份额总额	216,877,927.60
本报告期基金总申购份额	182,687,375.43
减：本报告期基金总赎回份额	116,233,098.45
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	283,332,204.58

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

本报告期内，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			
方正证券	1	501,273,707.17	43.40%	366,577.46	42.04%	-
国金证券	2	324,749,813.73	28.12%	237,488.20	27.23%	-
国融证券	1	190,438,034.02	16.49%	139,268.03	15.97%	-
中信证券	1	137,419,348.80	11.90%	127,978.21	14.68%	-
财达证券	1	1,002,822.00	0.09%	733.41	0.08%	-
中信证券山东	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定要求，本基金管理人在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

(1) 基金专用交易席位的选择标准如下：

- ① 经营行为规范，在近一年内未出现重大违规行为；
- ② 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- ③ 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易需要；
- ④ 具有较强的研究能力，能及时、全面地提供高质量的宏观、策略、行业、上市公司、证券市场研究、固定收益研究、数量研究等报告及信息资讯服务；
- ⑤ 交易佣金收取标准合理。

(2) 基金专用交易席位的选择程序如下：

- ① 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；
- ② 本基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易
------	------	--------	------

	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权 证 成交总额 的比例
方正证券	9,801,955.95	88.11%	8,290,000,000.00	94.20%	-	-
国金证券	948,824.76	8.53%	-	-	-	-
国融证券	286,780.24	2.58%	-	-	-	-
中信证券	87,176.50	0.78%	480,000,000.00	5.45%	-	-
财达证券	-	-	30,000,000.00	0.34%	-	-
中信证券山东	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《国金基金管理有限公司 2016 年 12 月 31 日旗下基金净值公告》	指定披露媒体和基金管理人网站	2017 年 1 月 3 日
2	《国金基金管理有限公司关于增加北京蛋卷基金销售有限公司为国金基金旗下基金销售机构的公告》	指定披露媒体和基金管理人网站	2017 年 1 月 4 日
3	《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金投资托管人关联方承销证券的关联交易公告》	指定披露媒体和基金管理人网站	2017 年 1 月 4 日
4	《国金基金管理有限公司关于增加上海华信证券有限责任公司和贵州华阳众惠基金销售有限公司为国金基金旗下基金销售机构的公告》	指定披露媒体和基金管理人网站	2017 年 1 月 10 日
5	《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金投资托管人关联方承销证券的关联交易公告》	指定披露媒体和基金管理人网站	2017 年 1 月 12 日
6	《国金国鑫灵活配置混合型发起	指定披露媒体和基	2017 年 1 月 14 日

	式证券投资基金投资托管人关联方承销证券的关联交易公告》	金管理人网站	
7	《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金参加招商证券股份有限公司基金申购费率优惠的公告》	指定披露媒体和基金管理人网站	2017年1月19日
8	《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金投资托管人关联方承销证券的关联交易公告》	指定披露媒体和基金管理人网站	2017年1月20日
9	《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金2016年第4季度报告》	指定披露媒体和基金管理人网站	2017年1月21日
10	《国金基金管理有限公司关于增加北京肯特瑞财富投资管理有限公司为旗下基金销售机构的公告》	指定披露媒体和基金管理人网站	2017年1月25日
11	《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金投资托管人关联方承销证券的关联交易公告》	指定披露媒体和基金管理人网站	2017年1月25日
12	《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金投资托管人关联方承销证券的关联交易公告》	指定披露媒体和基金管理人网站	2017年2月9日
13	《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金投资托管人关联方承销证券的关联交易公告》	指定披露媒体和基金管理人网站	2017年2月10日
14	《国金基金管理有限公司参加北京钱景财富投资管理有限公司基金申购费率优惠的公告》	指定披露媒体和基金管理人网站	2017年2月16日
15	《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金投资托管人关联方承销证券的关联交易公告》	指定披露媒体和基金管理人网站	2017年3月3日
16	《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金投资托管人关联方承销证券的关联交易公告》	指定披露媒体和基金管理人网站	2017年3月4日
17	《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金投资托管人关联方承销证券的关联交易公告》	指定披露媒体和基金管理人网站	2017年3月11日
18	《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金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
19	《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金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
20	《国金国鑫灵活配置混合型发起	指定披露媒体和基	2017年3月30日

	式证券投资基金参加中国工商银行股份有限公司个人电子银行申购费率优惠活动的公告》	金管理人网站	
21	《国金基金管理有限公司关于深圳前海微众银行股份有限公司开通本公司旗下基金定期定额投资业务的公告》	指定披露媒体和基金管理人网站	2017年3月30日
22	《国金基金管理有限公司关于增加南京苏宁基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告》	指定披露媒体和基金管理人网站	2017年4月13日
23	《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
24	《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）》	指定披露媒体和基金管理人网站	2017年4月13日
25	《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》	指定披露媒体和基金管理人网站	2017年4月13日
26	《国金基金管理有限公司关于增加北京植信基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告》	指定披露媒体和基金管理人网站	2017年4月19日
27	《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金 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
28	《国金基金管理有限公司关于增加中天证券股份有限公司为旗下基金销售机构的公告》	指定披露媒体和基金管理人网站	2017年5月12日
29	《国金基金管理有限公司关于旗下基金参加中泰证券股份有限公司基金申购费率优惠的公告》	指定披露媒体和基金管理人网站	2017年5月18日
30	《国金基金管理有限公司关于在深圳前海凯恩斯基金销售有限公司开通基金转换业务的公告》	指定披露媒体和基金管理人网站	2017年5月27日
31	《国金基金管理有限公司关于增加国融证券股份有限公司为旗下基金销售机构的公告》	指定披露媒体和基金管理人网站	2017年5月27日
32	《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金投资托管人关联方承销证券的关联交易公告》	指定披露媒体和基金管理人网站	2017年6月1日
33	《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，公司按照《证券投资基金信息披露管理办法》的规定，在打开申购、赎回后，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

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。

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。

12.2 存放地点

本基金基金管理人的办公场所：北京海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 87 号 D 座 14 层。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：4000-2000-18

公司网址：www.gfund.com

国金基金管理有限公司

2017 年 8 月 25 日