

国开泰富开航灵活配置混合型发起式证券 投资基金 2019 年半年度报告摘要

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：国开泰富基金管理有限责任公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 28 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 22 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	国开开航混合
基金主代码	004649
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 7 月 13 日
基金管理人	国开泰富基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	22,749,162.10 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析，灵活配置权益类资产和固定收益类资产，并在严格控制下行风险的基础上，力争实现基金资产较高的长期稳健回报。
投资策略	本基金主要通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析，在评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率的基础上，动态优化调整权益类、固定收益类大类资产的配置。在严格控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的绝对回报。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*50%+中债财富（总值）指数收益率*50%
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，其风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金，属于承担较高风险、预期收益较高的证券投资基金品种。

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		国开泰富基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	岳斌	贺倩
	联系电话	010-59363088	010-66060069
	电子邮箱	yuebin@cdbsfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		010-59363299	95599
传真		010-59363220	010-68121816

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.cdbsfund.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(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,866,598.22
本期利润	2,214,776.44
加权平均基金份额本期利润	0.0986
本期基金份额净值增长率	11.74%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0767
期末基金资产净值	21,004,934.69
期末基金份额净值	0.9233

注：1. 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；

2. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动损益）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

3.2 基金净值表现

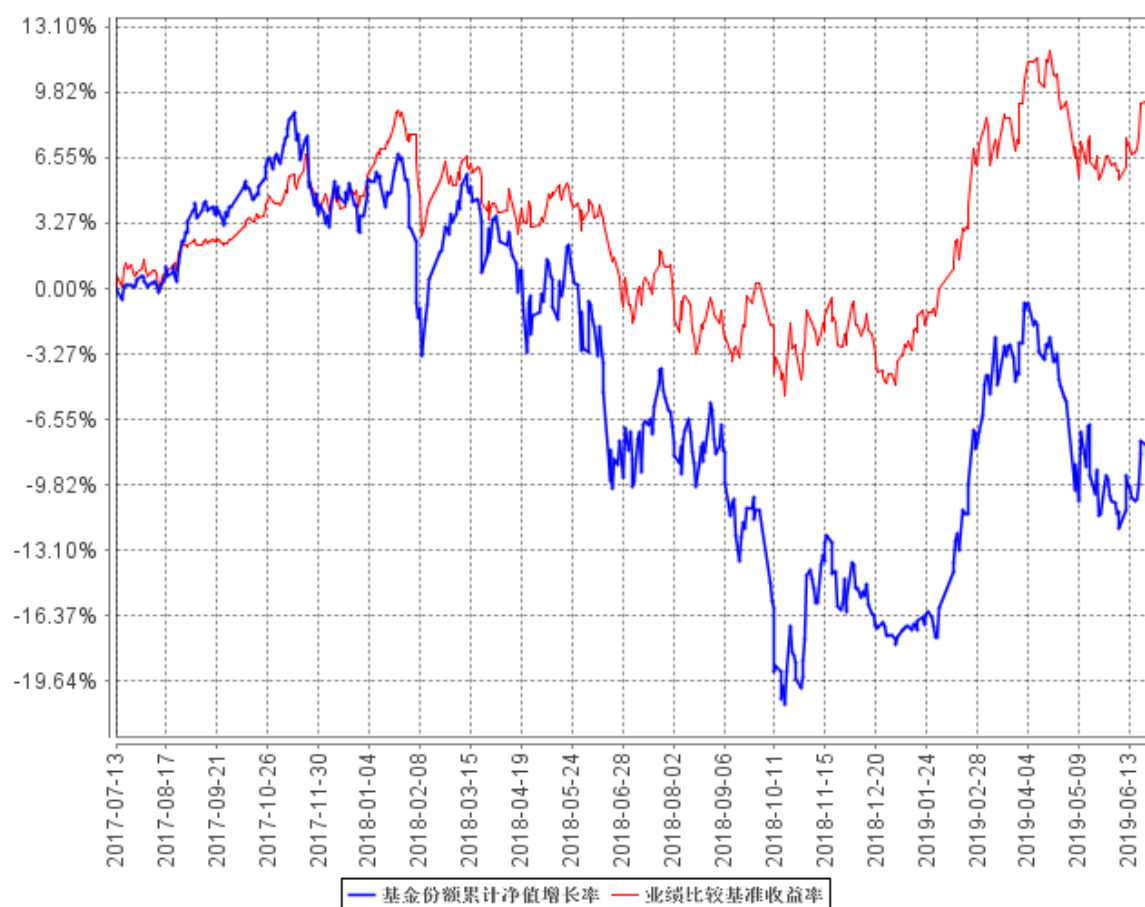
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.29%	0.81%	3.02%	0.56%	0.27%	0.25%
过去三个月	-5.09%	1.25%	-0.23%	0.74%	-4.86%	0.51%
过去六个月	11.74%	1.10%	14.00%	0.76%	-2.26%	0.34%
过去一年	-0.74%	1.16%	8.29%	0.75%	-9.03%	0.41%
自基金合同生效起至今	-7.67%	1.04%	8.60%	0.63%	-16.27%	0.41%

注：本基金业绩比较基准为中债财富(总值)*50%+沪深 300 指数收益率*50%

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、本基金业绩比较基准为中债财富(总值)*50%+沪深 300 指数收益率*50%；

2、本报告期内，基金的投资组合比例已符合基金合同投资限制的有关约定。

§ 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

国开泰富基金管理有限责任公司于 2013 年 6 月 28 日正式获得中国证券监督管理委员会批准成立，公司注册地位于北京市，注册资本为人民币叁亿陆仟万元整，其中国开证券股份有限公司出资比例为 66.7%，国泰证券投资信托股份有限公司出资比例为 33.3%。公司经营范围包括：基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

截至 2019 年 6 月 30 日，公司旗下管理 4 只开放式基金，分别是：国开泰富货币市场证券投资基金、国开泰富开泰灵活配置混合型证券投资基金、国开泰富开航灵活配置混合型发起式证券投资基金、国开泰富睿富债券型证券投资基金。同时，公司还管理多个特定客户资产管理计划。

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		
何玄文	权益投资总监，本基金基金经理	2018 年 8 月 29 日	-	12 年	何玄文先生，权益投资总监，硕士。现任国开泰富开泰灵活配置混合型证券投资基金及国开泰富开航灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。曾任职于中信证券股份有限公司、北京乐正资本管理有限公司等公司，先后担任研究员、研究主管、投资经理、权益投资主管、量化投资总监等职务，拥有丰富的权益研究及投资经验。
方龙	本基金基金经理	2019 年 4 月 4 日	-	6 年	方龙先生，权益投资部基金经理。中国社会科学院研究生院经济学博士，现任国开泰富睿富债券型证券投资基金、国开泰富开航灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理，曾任职于中国社会科学院金融研究所担任助理研究员，银河期货有限责任公司担任高级研究员，

					方正证券股份有限公司担任高级经理、量化交易员，九州证券股份有限公司担任量化投资经理。
高耀华	本基金基金经理	2019 年 4 月 8 日	-	7 年	高耀华先生，权益投资部基金经理。现为国开泰富开航灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理，曾先后任职于德勤管理咨询公司担任咨询顾问，国信证券股份有限公司经济研究所担任计算机行业研究负责人，中信证券股份有限公司资产管理部从事 TMT 行业股票研究，北京财猫时代网络股份有限公司担任总经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

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，公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，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；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。本报告期，未出现清算不到位的情况，且本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

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

权益市场方面，2019 年 1 季度 A 股市场二次探底之后强势反弹，上证指数上涨 23.93%，沪深

300 上涨 28.62%，中小板指上涨 35.66%，创业板指上涨 35.43%。结构上，各类行业整体上行，成长及消费类行业涨幅普遍居前，周期类行业涨幅相对滞后。一季度行情主要围绕三大主线展开：5G 应用进程的不断推进使得产业链相关上市公司备受资金青睐，5G、边缘计算、高清视频等概念轮番上涨；受益于金融制度改革，金融科技指数连续大涨，并诞生多只翻倍牛股；另外，科创板的不断推进也带动相关行业及个股大涨。整个季度来看，计算机、农林牧渔、食品饮料等行业表现居前，涨幅均在 40%以上；建筑装饰、公用事业、银行等行业表现落后，但涨幅也均在 15%以上。二季度 A 股市场冲高回落，上证指数下跌 3.62%，沪深 300 下跌 1.21%，中小板指下跌 10.99%，创业板指下跌 10.75%。结构上，在经济下行压力和中美贸易摩擦升级等因素的影响下，市场风险偏好降低，消费类白马、大金融板块显示出较好的避险功能和抗跌性，尤其是白酒板块，成为资金抱团取暖的对象，在市场整体下行背景下逆势迭创新高。同时，受贸易协商进展影响，科技类成长股及周期股中相关板块均有阶段性表现，如华为主题以及稀土永磁等。此外，金价在美联储降息预期升温的刺激下不断上行，黄金股也有相应表现。整个季度来看，食品饮料、家用电器、银行等行业表现居前，是二季度为数不多逆势上涨的板块；钢铁、轻工制造、传媒等行业表现落后，跌幅均在 10%以上。

本基金偏股灵活配置型基金，根据大类资产配置模型在宏观经济周期的不同阶段灵活配置权益仓位，以期实现控制最大回撤的基础上实现较好的绝对回报。根据我们的大类资产配置模型，认为 2019 年二季度仍处于衰退后期，权益资产保持中性仓位。具体操作上，本基金股票仓位维持在 60%左右的中性仓位，结构上继续按照基于主动量化的指数增强策略进行操作；展望下半年，宏观经济周期有望从衰退后期进入到复苏期和扩张期，我们将择机增加权益仓位，并继续按照指数增强策略进行操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.9233 元；本报告期基金份额净值增长率为 11.74%，业绩比较基准收益率为 14.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

股票市场方面，全球货币政策宽松预期增强，从美联储公布的 6 月份议息会议声明来看，通胀预期下行，经济增速预期下行，利率预期出现下行。就国内来看，上半年货币政策总体偏宽松，利率维持在低位，目前经济下行压力仍在，下半年货币政策有望继续保持宽松以助力实体经济修复。估值方面，A 股总体估值仍处中低位水平且估值结构相对合理，参考当前 A 股的 ROE 水平，估值仍有提升的空间。尽管如此，市场对中美贸易摩擦升级以及经济下行的担忧仍会对估值修复形成阻力。中美双方摩擦的不断升级，边界不断突破，对包括中国在内的全球经济、产业链等的

影响存在巨大的不确定性。国内需求能否在下半年真正企稳也有待观察，未来的市场的空间取决于业绩预期的变化，如果业绩端迟迟难有改善预期，行情可能仍将陷入盘整甚至有所下行。以上不确定性使得下半年板块和个股选择难度加大。在全球货币宽松预期增强及中美贸易摩擦背景下，黄金有望迎来阶段性上涨机会。科技成长兼顾经济托底与经济转型双重目标，政策主线清晰且确定，科创板的开市也有望带来长线积极的变化。可关注 5G、国产芯片、云计算等领域。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1 参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

4.6.1.1 职责分工

参与估值小组成员为 6 人，分别是公司基金运营部负责人、基金运营部估值会计、投资部负责人、研究部负责人、风险管理部负责人、监察稽核部（法律合规部）负责人，组长由基金运营部负责人担任。

各部门负责人也可推荐代表各部门参与估值小组的成员，如需更换，由相应部门负责人提出。小组成员需经公司分管基金运营部的经理层成员批准同意。

4.6.1.2 专业胜任能力及相关工作经历

小组由具有多年从事估值运作、证券行业研究、风险管理及熟悉业内法律法规的专家型人员组成。

4.6.2 基金经理参与或决定估值的程度

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

4.6.3 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.6.4 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

尚无已签约的任何定价服务。本基金所采用的估值流程及估值结果均已经过会计师事务所鉴证，并经托管银行复核确认。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

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

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—国开泰富基金管理有限责任公司 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，国开泰富基金管理有限责任公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；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

本托管人认为，国开泰富基金管理有限责任公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金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、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 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：国开泰富开航灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	5,573,413.04	7,659,732.66
结算备付金	121,390.33	175,506.39
存出保证金	29,627.79	34,183.65
交易性金融资产	13,441,602.40	3,135,652.00
其中：股票投资	12,215,357.20	3,135,652.00
基金投资	-	-
债券投资	1,226,245.20	-
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	-	6,000,000.00
应收证券清算款	2,027,399.19	2,039,290.29
应收利息	28,784.96	7,502.78
应收股利	-	-
应收申购款	-	9.99
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	21,222,217.71	19,051,877.76
负债和所有者权益	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 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	2,761.98	8,231.45
应付管理人报酬	25,093.53	24,020.80
应付托管费	4,182.26	4,003.44
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	123,092.83	155,978.21
应交税费	-	-

应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	62,152.42	149,015.41
负债合计	217,283.02	341,249.31
所有者权益：		
实收基金	22,749,162.10	22,643,417.87
未分配利润	-1,744,227.41	-3,932,789.42
所有者权益合计	21,004,934.69	18,710,628.45
负债和所有者权益总计	21,222,217.71	19,051,877.76

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9233 元，基金份额总额 21,004,934.69 份。

6.2 利润表

会计主体：国开泰富开航灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入	2,674,017.43	-2,704,652.97
1.利息收入	43,933.88	102,764.02
其中：存款利息收入	31,612.54	25,173.11
债券利息收入	4,639.63	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	7,681.71	77,590.91
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	2,279,469.42	-856,478.87
其中：股票投资收益	2,164,717.30	-1,010,562.42
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
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	114,752.12	154,083.55
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	348,178.22	-1,989,545.86
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	2,435.91	38,607.74
减：二、费用	459,240.99	478,898.89
1. 管理人报酬	151,703.95	231,991.19
2. 托管费	25,283.96	38,665.23
3. 销售服务费	-	-

4. 交易费用	207,922.69	95,586.09
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	-	-
7. 其他费用	74,330.39	112,656.38
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	2,214,776.44	-3,183,551.86
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	2,214,776.44	-3,183,551.86

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国开泰富开航灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	22,643,417.87	-3,932,789.42	18,710,628.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,214,776.44	2,214,776.44
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）	105,744.23	-26,214.43	79,529.80
其中：1.基金申购款	1,602,931.62	-128,409.34	1,474,522.28
2.基金赎回款	-1,497,187.39	102,194.91	-1,394,992.48
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）	22,749,162.10	-1,744,227.41	21,004,934.69
项目	上年度可比期间 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）	32,677,128.33	1,183,556.23	33,860,684.56

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,183,551.86	-3,183,551.86
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）	-2,596,997.69	-98,110.59	-2,695,108.28
其中：1.基金申购款	7,240,860.22	217,684.47	7,458,544.69
2.基金赎回款	-9,837,857.91	-315,795.06	-10,153,652.97
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）	30,080,130.64	-2,098,106.22	27,982,024.42

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：

<u>杨波</u>	<u>朱瑜</u>	<u>姚劼</u>
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

国开泰富开航灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2017]570 号《关于准予国开泰富开航灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由国开泰富基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国开泰富开航灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 79,460,984.36 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第 607 号予以验证。经向中国证监会备案，《国开泰富开航灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2017 年 7 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 79,479,595.52 份基金份额，其中认购资金利息折合 18,611.16 份基金份额。本基金的基金管理人为国开泰富基金管理有限责任公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“农业银行”)。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10,000,600.00 基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国开泰富开航灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，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、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(含国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券及其他中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、货币市场工具、权证、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货等金融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)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的 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,基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率 X 50% + 中债财富(总值)指数收益率 X 50%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国开泰富开航灵活配置混合型发起式证券投资基金 基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间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 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 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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的说明

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。

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

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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》、财税[2015]101号《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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。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。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，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。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、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。

(2) 对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，股票的股息、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) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%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。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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

本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 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
国开泰富基金管理有限责任公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
国开证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
国泰证券投资信托股份有限公司	基金管理人的股东

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

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交易。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	151,703.95	231,991.19
其中：支付销售机构的客户维护费	28,022.14	63,734.88

注：支付基金管理人 国开泰富基金管理有限责任公司 的管理人报酬按前一日基金资产净值

1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	25,283.96	38,665.23

注：支付基金托管人 农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间均无销售服务费。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
基金合同生效日（2017年7月13日）持有的基金份额	10,000,600.00	10,000,600.00
期初持有的基金份额	10,000,600.00	10,000,600.00
期间申购/买入总份额	—	—
期间因拆分变动份额	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—
期末持有的基金份额	10,000,600.00	10,000,600.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	43.9600%	33.2500%

注：基金管理人于 2017 年 6 月 30 日，运用固有资金通过直销机构认购本基金 10,000,000.00 元，其中认购费用为 1,000.00 元，折合本基金份额为 9,999,000.00 份，募集期利息结转份额 1,600.00 份，共计 10,000,600.00 份。以上基金管理人运用的固有资金作为本基金的发起资金，自本基金基金合同生效之日起，所认购的基金份额持有期限不少于三年。

6.4.8.4.2 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

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的情况。

6.4.8.5 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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
中国农业银行股份有限公司	5,573,413.04	30,057.75	1,924,905.62	21,085.16

注：本基金的银行存款由基金托管人农业银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期末未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作其他关联交易事项的说明。

6.4.9 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 12,215,357.20 元，属于第二层次的余额为 1,226,245.20 元，无属于第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第一层次的余额为 3,135,652.00 元，无属于第二层次或第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	12,215,357.20	57.56
	其中：股票	12,215,357.20	57.56
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	1,226,245.20	5.78
	其中：债券	1,226,245.20	5.78
	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	5,694,803.37	26.83
8	其他各项资产	2,085,811.94	9.83
9	合计	21,222,217.71	100.00

注：由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	6,303,969.00	30.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	118,200.00	0.56
F	批发和零售业	599,622.20	2.85
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务	2,009,250.00	9.57

	业		
J	金融业	2,352,781.00	11.20
K	房地产业	735,235.00	3.50
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	96,300.00	0.46
S	综合	-	-
	合计	12,215,357.20	58.15

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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前十名权益投资明细

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	600030	中信证券	19,400	461,914.00	2.20
2	600048	保利地产	34,300	437,668.00	2.08
3	000001	平安银行	29,200	402,376.00	1.92
4	600887	伊利股份	12,000	400,920.00	1.91
5	000338	潍柴动力	32,500	399,425.00	1.90
6	601933	永辉超市	39,100	399,211.00	1.90
7	601318	中国平安	4,500	398,745.00	1.90
8	600519	贵州茅台	400	393,600.00	1.87
9	600036	招商银行	10,900	392,182.00	1.87
10	300170	汉得信息	24,200	328,878.00	1.57

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的半年度报告正文。

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	300059	东方财富	1,357,652.00	7.26
2	600519	贵州茅台	1,194,177.00	6.38

3	002008	大族激光	1,144,675.00	6.12
4	601933	永辉超市	1,089,176.00	5.82
5	002230	科大讯飞	1,022,151.00	5.46
6	000063	中兴通讯	1,011,335.00	5.41
7	002371	七星电子	1,005,161.00	5.37
8	002624	完美世界	977,378.00	5.22
9	300136	信维通信	930,289.00	4.97
10	000977	浪潮信息	906,042.00	4.84
11	002262	恩华药业	891,344.00	4.76
12	300033	同花顺	888,782.00	4.75
13	300408	三环集团	880,053.00	4.70
14	002405	四维图新	867,831.00	4.64
15	600588	用友网络	867,451.00	4.64
16	601318	中国平安	855,402.00	4.57
17	300014	亿纬锂能	838,187.95	4.48
18	601012	隆基股份	833,230.00	4.45
19	002410	广联达	819,336.00	4.38
20	000858	五 粮 液	814,284.00	4.35
21	300017	网宿科技	775,517.00	4.14
22	000651	格力电器	774,112.00	4.14
23	002916	深南电路	772,949.39	4.13
24	002460	赣锋锂业	744,012.00	3.98
25	300699	光威复材	726,607.00	3.88
26	603816	顾家家居	721,984.80	3.86
27	002572	索菲亚	719,660.00	3.85
28	603517	绝味食品	700,639.00	3.74
29	002223	鱼跃医疗	695,970.00	3.72
30	600372	中航电子	694,126.00	3.71
31	300170	汉得信息	687,695.00	3.68
32	000338	潍柴动力	673,705.00	3.60
33	600887	伊利股份	671,631.00	3.59
34	000001	平安银行	665,214.00	3.56
35	300271	华宇软件	661,174.00	3.53
36	601336	新华保险	651,779.00	3.48
37	002253	川大智胜	651,326.00	3.48
38	002466	天齐锂业	639,607.00	3.42

39	002384	东山精密	622,230.00	3.33
40	600048	保利地产	617,201.00	3.30
41	603605	珀莱雅	615,440.00	3.29
42	600036	招商银行	615,224.87	3.29
43	603986	兆易创新	609,850.00	3.26
44	600893	航发动力	591,201.00	3.16
45	601633	长城汽车	568,479.00	3.04
46	603899	晨光文具	564,678.00	3.02
47	603160	汇顶科技	558,214.00	2.98
48	002236	大华股份	550,788.00	2.94
49	603019	中科曙光	544,254.00	2.91
50	002508	老板电器	537,494.00	2.87
51	300383	光环新网	531,784.00	2.84
52	002439	启明星辰	526,808.00	2.82
53	600031	三一重工	511,466.00	2.73
54	300037	新宙邦	508,926.00	2.72
55	300630	普利制药	508,097.00	2.72
56	000513	丽珠集团	507,728.00	2.71
57	603799	华友钴业	502,756.00	2.69
58	002475	立讯精密	500,710.00	2.68
59	000596	古井贡酒	497,021.00	2.66
60	000002	万科A	495,053.00	2.65
61	600600	青岛啤酒	484,317.00	2.59
62	600030	中信证券	481,357.00	2.57
63	603833	欧派家居	480,861.00	2.57
64	002281	光迅科技	477,171.00	2.55
65	300310	宜通世纪	476,042.00	2.54
66	601398	工商银行	471,135.00	2.52
67	600315	上海家化	471,006.00	2.52
68	002123	梦网荣信	470,042.00	2.51
69	300188	美亚柏科	464,457.00	2.48
70	300616	尚品宅配	463,207.00	2.48
71	603486	科沃斯	462,878.00	2.47
72	600438	通威股份	462,431.00	2.47
73	600298	安琪酵母	458,071.00	2.45
74	600690	海尔智家	450,427.00	2.41

75	600570	恒生电子	445,751.00	2.38
76	000661	长春高新	438,131.00	2.34
77	000963	华东医药	437,737.00	2.34
78	000568	泸州老窖	437,423.00	2.34
79	000538	云南白药	426,253.00	2.28
80	300571	平治信息	422,879.00	2.26
81	300251	光线传媒	422,811.00	2.26
82	002714	牧原股份	419,947.00	2.24
83	600884	杉杉股份	415,219.00	2.22
84	300613	富瀚微	413,311.00	2.21
85	300142	沃森生物	408,185.00	2.18
86	002465	海格通信	403,781.00	2.16
87	603939	益丰药房	402,325.00	2.15
88	002049	紫光国芯	400,510.00	2.14
89	300168	万达信息	386,298.00	2.06
90	300628	亿联网络	378,881.00	2.02
91	600196	复星医药	377,964.00	2.02

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	300059	东方财富	1,310,045.00	7.00
2	000063	中兴通讯	1,108,991.00	5.93
3	002262	恩华药业	1,074,622.00	5.74
4	002371	七星电子	1,061,071.00	5.67
5	601012	隆基股份	967,460.00	5.17
6	300033	同花顺	950,904.00	5.08
7	000977	浪潮信息	942,795.00	5.04
8	000858	五粮液	913,518.00	4.88
9	002008	大族激光	868,795.00	4.64
10	300014	亿纬锂能	853,134.00	4.56
11	600519	贵州茅台	840,343.48	4.49
12	002410	广联达	817,478.00	4.37
13	300136	信维通信	803,798.00	4.30
14	002624	完美世界	799,109.00	4.27
15	300271	华宇软件	780,135.00	4.17

16	002230	科大讯飞	779,674.00	4.17
17	002916	深南电路	759,001.80	4.06
18	000651	格力电器	748,554.00	4.00
19	300699	光威复材	728,774.00	3.89
20	601933	永辉超市	714,030.00	3.82
21	002384	东山精密	708,983.00	3.79
22	002405	四维图新	706,431.00	3.78
23	300408	三环集团	686,347.00	3.67
24	600588	用友网络	658,919.20	3.52
25	002572	索菲亚	656,766.00	3.51
26	002253	川大智胜	653,966.00	3.50
27	002466	天齐锂业	650,365.00	3.48
28	603160	汇顶科技	649,688.58	3.47
29	002714	牧原股份	647,956.00	3.46
30	603986	兆易创新	643,776.00	3.44
31	002460	赣锋锂业	643,136.00	3.44
32	603833	欧派家居	628,893.00	3.36
33	603019	中科曙光	623,752.40	3.33
34	002223	鱼跃医疗	616,839.00	3.30
35	300017	网宿科技	616,739.00	3.30
36	300188	美亚柏科	610,091.00	3.26
37	601336	新华保险	607,562.00	3.25
38	603486	科沃斯	592,869.00	3.17
39	600893	航发动力	588,191.00	3.14
40	603517	绝味食品	578,890.20	3.09
41	300142	沃森生物	578,089.00	3.09
42	300310	宜通世纪	578,077.00	3.09
43	603899	晨光文具	569,561.00	3.04
44	300170	汉得信息	566,996.00	3.03
45	603605	珀莱雅	566,247.00	3.03
46	300383	光环新网	566,152.00	3.03
47	300571	平治信息	561,681.00	3.00
48	002465	海格通信	551,939.00	2.95
49	002439	启明星辰	547,293.00	2.93
50	600438	通威股份	541,394.00	2.89
51	000661	长春高新	537,317.00	2.87
52	603816	顾家家居	529,575.00	2.83
53	300676	华大基因	527,623.00	2.82

54	600600	青岛啤酒	515,790.00	2.76
55	300628	亿联网络	510,924.80	2.73
56	000596	古井贡酒	508,894.00	2.72
57	002281	光迅科技	508,613.00	2.72
58	600372	中航电子	499,212.00	2.67
59	000513	丽珠集团	496,056.00	2.65
60	002236	大华股份	490,888.00	2.62
61	002475	立讯精密	484,418.00	2.59
62	300037	新宙邦	480,045.00	2.57
63	601318	中国平安	471,383.00	2.52
64	603799	华友钴业	471,375.60	2.52
65	300168	万达信息	457,417.48	2.44
66	603659	璞泰来	446,688.00	2.39
67	002271	东方雨虹	445,813.00	2.38
68	300616	尚品宅配	444,722.00	2.38
69	002049	紫光国芯	430,358.00	2.30
70	000538	云南白药	428,459.00	2.29
71	600884	杉杉股份	427,735.00	2.29
72	300251	光线传媒	426,573.00	2.28
73	000725	京东方 A	425,423.00	2.27
74	603939	益丰药房	423,198.00	2.26
75	300012	华测检测	404,596.00	2.16
76	603259	药明康德	395,939.00	2.12
77	300613	富瀚微	395,504.00	2.11
78	002027	分众传媒	388,242.00	2.07
79	300474	景嘉微	379,147.00	2.03
80	002375	亚厦股份	378,490.00	2.02
81	002841	视源股份	377,806.00	2.02
82	601633	长城汽车	377,488.00	2.02

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	78,167,742.01
卖出股票收入（成交）总额	71,601,200.13

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	1,226,245.20	5.84

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	1,226,245.20	5.84

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	019544	16 国债 16	12,260	1,226,245.20	5.84

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

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

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

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

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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。

7.12.2 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

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	29,627.79
2	应收证券清算款	2,027,399.19
3	应收股利	-
4	应收利息	28,784.96
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,085,811.94

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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
162	140,426.93	10,000,600.00	43.96%	12,748,562.10	56.04%

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	883,445.53	3.8834%

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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

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	发起份额总数	发起份额占 基金总份额	发起份额承 诺持有期限
----	--------	----------------	--------	----------------	----------------

		比例 (%)		比例 (%)	
基金管理人固有资金	10,000,600.00	43.96	10,000,600.00	43.96	3 年
基金管理人高级管理人员	—	—	—	—	—
基金经理等人员	—	—	—	—	—
基金管理人股东	—	—	—	—	—
其他	—	—	—	—	—
合计	10,000,600.00	43.96	10,000,600.00	43.96	—

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017 年 7 月 13 日）基金份额总额	79,479,595.52
本报告期期初基金份额总额	22,643,417.87
本报告期间基金总申购份额	1,602,931.62
减：本报告期间基金总赎回份额	1,497,187.39
本报告期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—
本报告期期末基金份额总额	22,749,162.10

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

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，国开泰富基金管理有限责任公司无重大人事变动。
2019 年 1 月，中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。
2019 年 4 月，中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

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

本报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

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

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员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	
宏源证券	2	76,926,608.34	51.36%	55,773.29	45.31%	—
海通证券	2	72,842,333.80	48.64%	67,319.54	54.69%	—
信达证券	2	—	—	—	—	—
安信证券	2	—	—	—	—	—
国开证券	2	—	—	—	—	—

注：1. 券商的选择标准和程序

(1) 选择标准：注重投资研究服务质量

a) 券商财务状况良好、经营行为规范、最近一年内无重大违规行为。

b) 券商具有较强的综合研究能力：能及时、全面、定期提供高质量的关于宏观、行业、资本市场、个股分析的报告及其他丰富全面的信息咨询服务；有很强的分析能力，提供专门研究报告；具有开发量化投资组合模型的能力以及其他综合服务能力。

c) 券商能够提供最佳交易执行和优惠合理的佣金率。

(2) 选择程序

a) 确定券商范围：券商的选择由公司分管投资的经理层人员及投资部、专户投资部、交易部、研究部、监察稽核部负责人组成的办公会议集体讨论拟合作券商名单。

b) 初始评分确定合作名单：由研究部、投资部、专户投资部、交易部对拟合作券商进行评分，根据评分结果确定合作券商，报公司总经理办公会审批。

c) 交易量分配：投资部、研究部、专户投资部、交易部根据券商提供的研究报告质量和综合研究服务的情况，于每季前三个工作日分别对券商进行评分。交易部将评分结果进行汇总，形成最终评分结果，作为当季分配交易量的依据。公司严禁将席位开设与券商的基金销售挂钩，严禁以任何形式向券商承诺基金在席位上的交易量。

d) 日常监控：公司监察稽核部、交易部、风险管理部、基金运营部、研究部等相关部门均可从各自业务角度对合作券商进行监控，当合作券商发生可能导致基金持有人利益受损的事件时，各

部门均可提请暂停与该券商经纪业务的合作，经公司监察稽核部、交易部、风险管理部、基金运营部、研究部会商后执行。

2. 券商的评估，保留和更换程序

(1) 席位的租用期限暂定为一年，合同到期 15 天内，投资研究部门将根据各券商研究在服务期间的综合证券服务质量等情况，进行评估。

(2) 投资部、研究部、专户投资部、交易部根据证券公司提供的研究报告质量和综合研究服务的情况，于每季前三个工作日分别对证券公司进行评分。交易部将投资部、研究部、专户投资部、交易部对证券公司的评分结果进行汇总，形成最终评分结果，作为当季分配交易量的依据。交易部于每季初根据最新评分结果，与累计席位交易量进行比较，拟定席位使用调整计划，填写《券商交易席位分配表》。经公司领导审批后执行。

(3) 若券商提供的综合证券服务不符合要求，按照委托协议规定，提前中止租用其交易席位。

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
宏源证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	1,249,461.39	100.00%	6,000,000.00	100.00%	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国开证券	-	-	-	-	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190101-20190630	10,000,600.00	-	-	10,000,600.00	43.96%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

本基金为混合基金，风险等级为中高级，单一投资者持有的份额比例过于集中达到或超过 20%，存在潜在流动性风险和集中赎回风险。但公司对该基金拥有完全自主投资决策权，报告期间严格按照法规和基金合同规定合规运作，严控流动性风险，单一投资者赎回本基金不会给本基金带来显著的流动性风险。因基金单位净值最末位小数致四舍五入的原因，单一投资者赎回本基金可能给存续投资者带来一定程度的净值损失。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

国开泰富基金管理有限责任公司及子公司北京国开泰富资产管理有限公司办公地址于 2019 年 1 月 7 日由北京市东城区朝阳门北大街 7 号五矿广场 C 座 10 层，搬迁至北京市西城区西直门南小街国英园 9 号楼。

国开泰富基金管理有限责任公司

2019 年 8 月 28 日