

# 国开泰富睿富债券型证券投资基金 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：浙商银行股份有限公司

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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 08 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	国开睿富债券
基金主代码	005298
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 12 月 19 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	浙商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	96,955,789.03 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在适度承担风险并保持资产流动性的基础上，通过配置债券等金融工具，追求基金资产的长期稳定增值，通过适量投资股票力争获取增强型回报。
投资策略	本基金将在资产配置策略的基础上，通过债券投资策略构筑债券组合的平稳收益，通过积极的股票投资策略追求基金资产的增强型回报。本基金将研究与跟踪中国宏观经济运行状况和资本市场变动特征，依据定量分析和定性分析相结合的方法，考虑经济环境、政策取向、类别资产收益风险预期等因素，采取“自上而下”的方法将基金资产在债券与股票等资产类别之间进行动态资产配置。本基金将在稳健的资产配置策略基础上，根据股票一级市场和二级市场的运行状况和收益预期，在严格控制风险的基础上，积极并适时适度的参与权益类资产配置，把握市场时机力争为基金资产获取增强型回报。

业绩比较基准	中债综合财富指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金与股票型基金，属于中低风险、中低预期收益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责任公司	浙商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	岳斌
	联系电话	010-59363088
	电子邮箱	yuebin@cdbsfund.com
客户服务电话	010-59363299	95527
传真	010-59363220	0571-88268688

### 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	2,132,379.64
本期利润	2,122,074.54
加权平均基金份额本期利润	0.0145
本期基金份额净值增长率	1.47%
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	0.0149
期末基金资产净值	98,486,726.88
期末基金份额净值	1.0158

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. 本基金基金合同生效日为 2018 年 12 月 19 日。

### 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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

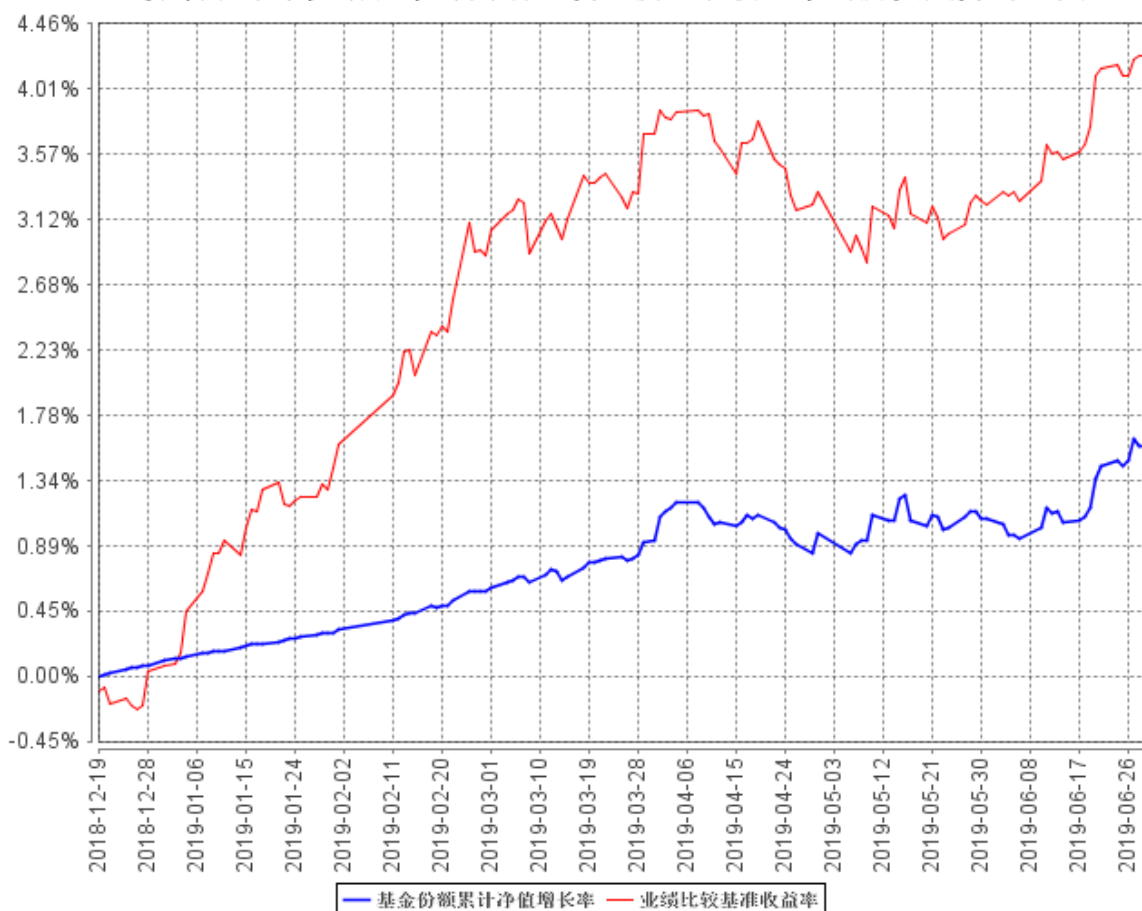
过去一个月	0.49%	0.07%	1.02%	0.11%	-0.53%	-0.04%
过去三个月	0.64%	0.07%	0.53%	0.14%	0.11%	-0.07%
过去六个月	1.47%	0.05%	4.24%	0.14%	-2.77%	-0.09%
自基金合同生效起至今	1.58%	0.05%	4.32%	0.14%	-2.74%	-0.09%

注：1、本基金基金合同于 2018 年 12 月 19 日生效；

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。

### 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综合财富指数收益率\*90%+沪深 300 指数收益率\*10%；

2、本基金基金合同于 2018 年 12 月 19 日生效；

3、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		
王婷婷	本基金基金经理	2018 年 12 月 19 日	-	8 年	王婷婷女士，固定收益投资部基金经理，中央财经大学法律硕士。现任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及国开泰富睿富债券型证券投资基金基金经理。曾任益民基金管理有限公司益民货币市场基金、益民多利债券混合型证券投资基金基金经理；持有国家法律职业资格、银行间市场本币交易员资格、证券从业资格和会计从业资格。
方龙	本基金基金经理	2019 年 4 月 10 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。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，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

2019 年 1 季度，宏观经济仍处于下行趋势中，经济数据受春节假期因素影响，在前三个月基本处于数据空窗期，从已公布数据来看，工业产出、消费、固定资产投资均呈现下行趋势，但 2 月份 PMI 重回荣枯线以上；物价方面，一季度 CPI、PPI 仍呈下行趋势，但受猪周期以及非洲猪瘟因素影响，市场对未来通胀上行有所预期；金融数据方面，2 月份公布 1 月社融数据、贷款数据大幅回升，2 月份数据受春节放假影响，再次回调。央行货币政策方面，宽货币逐步向宽信用传导，一月份，央行公布扩大普惠金融定向降准优惠政策覆盖面，引导金融机构更好地满足小微企业要求，同时，降准 1%，释放资金约 1.5 万亿，一季度资金面较为宽松，隔夜利率最低下至 2% 以下，跨春节以及跨一季度末均未见资金价格大幅飙升。2 季度，宏观经济开局平稳，4 月公布 1 季度 GDP 同比增速 6.4%，金融数据方面，受地方政府债提前放量发行以及银行传统信贷投放节奏影响，4 月公布社融、贷款均大幅超出市场预期，M2 同比增长 8.6% 创 13 个月以来新高，但 5、6 月份数据再度转头向下，4 月工业增加值同比增长 5.4%，较上月下降 3.1 个百分点，固定资产投资以及消费均不及预期，仅房地产数据一枝独秀。货币政策方面，2019 年以来资金利率整体中枢下移，波动增强，在今年 5 月份，再度对中小银行实行优惠存款准备金率，于 5 月、6 月和 7 月实施，6 月初受包商银行信用事件影响，资金市场信用分层，央行加大资金投放。

债券市场方面，1 季度，债券收益率曲线长短端走势分化，短端曲线受资金面影响走势较为平稳，长端收益率曲线逐步由债牛转为震荡向上。1 月份，上旬央行宣布降准 1%，释放资金约 1.5

万亿，同时经济下行趋势确立，债券市场情绪较好，十年期金融债下行至本轮债券牛市最低点，但随后地方政府债提前发行以及宽信用政策不断出台引发债市回调；2 月份，金融数据大幅超预期，市场对宽信用相关政策积极效果逐步确认，宏观经济方面，2 月财新 PMI49.9，创三个月新高，较 1 月大幅回升 1.6 个百分点，伴随地方政府专项债发行提前启动，以及货币政策滴水灌溉，制造业在基建的带动下出现修复，经济下滑压力得到缓和，同时，股市情绪得到修复，市场风险偏好提高，债券市场情绪转为悲观；3 月份，传统季末并未现资金紧张趋势，资金面异常宽松，跨月资金供给充足，月末海外市场利好债券市场，美国十年期国债下行至 2.35%，但股市反弹强劲，上证 A 股突破 3200 点，债券市场情绪悲观，长久期利率债收益率上行接近 20bp；4 月公布金融数据大幅超预期，同时叠加猪周期以及非洲猪瘟因素影响，市场对未来通胀上行有所预期，债市牛市由去年快牛进入震荡走势，10 年期国债收益率曲线由本轮牛市最低点 3.07% 回调至 3.43%；随着 2 季度数据陆续公布，宏观经济再度走弱，工业增加值、固定资产投资均呈回落趋势，6 月包商银行信用事件一度引起市场恐慌，伴随着央行巨量资金投放，债券市场重拾信心，收益率震荡下行，但现券走势较为纠结，一方面担忧逆周期调节政策持续加码，另外对中美贸易战以及央行后续公开市场操作仍有所顾忌。

本基金本着债券为主、权益增强的稳健策略，因债券市场风险加大，主要采取短久期票息策略，避免了债券市场下跌引起的净值的回撤，同时，根据该基金已积累的安全垫收益，小仓位加转债适当增强收益。

#### 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 1.0158 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.47%，业绩比较基准收益率为 4.24%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019 年下半年，货币政策方面，伴随着美联储降息以及全球降息周期的开启，下半年央行仍将实行稳健的货币政策，坚持稳中求进总基调，大概率仍维持流动性充裕，同时稳健推进利率两轨并一轨，完善利率市场化形成和传导，但资金市场受包商事件影响引起的利率分化，将得到修复，但利差较大的情况短期内仍将持续。

宏观经济方面，中美贸易战反复以及地产调控政策加码，预计下半年宏观经济仍将小幅下行，通胀方面，年初对通胀的担忧主要由于猪肉价格、水果价格大涨引起，但需求总体走弱使得通胀不会成为系统性风险；财政政策方面，在外部冲击下，预计将会进一步加大逆周期调节力度，地方专项债、政策性银行债、特别国债等工具均有向上扩充空间。

债券市场方面，在资金面宽松充裕的带动下，短端利率目前已接近历史低位，预计下半年短

端资金利率进一步下行空间不大，长端利率债方面，三季度，经济下行压力仍大，同时叠加中美贸易战，收益率有望突破 2016 年前期低点。债券配置方面，我们倾向于适当拉长债券久期，同时以高等级信用债配置为主。

#### 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遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对国开泰富睿富债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。



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

本报告期内，国开泰富睿富债券型证券投资基金的管理人-国开泰富基金管理有限责任公司在国开泰富睿富债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，国开泰富睿富债券型证券投资基金未进行利润分配。

## 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对国开泰富基金管理有限责任公司编制和披露的国开泰富睿富债券型证券投资基金 2019 年半年度报告中财务指标、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进行了复核，以上内容真实、准确和完整。

# § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：国开泰富睿富债券型证券投资基金

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
<b>资产：</b>		
银行存款	2,067,303.56	211,556,489.32
结算备付金	112,347.42	-
存出保证金	21,161.27	-
交易性金融资产	94,550,546.06	-
其中：股票投资	3,124,620.80	-
基金投资	-	-
债券投资	91,425,925.26	-
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	10,000,135.00	-
应收证券清算款	4,974,751.42	-
应收利息	1,515,360.41	240,614.06
应收股利	-	-
应收申购款	-	999.20
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	113,241,605.14	211,798,102.58
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>

	2019 年 6 月 30 日	2018 年 12 月 31 日
<b>负 债:</b>		
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	13,999,876.50	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	599,158.01	998.01
应付管理人报酬	33,702.62	27,835.73
应付托管费	8,425.66	6,958.95
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	24,160.26	-
应交税费	6,305.68	-
应付利息	1,849.53	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	81,400.00	-
负债合计	14,754,878.26	35,792.69
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	96,955,789.03	211,531,508.55
未分配利润	1,530,937.85	230,801.34
所有者权益合计	98,486,726.88	211,762,309.89
负债和所有者权益总计	113,241,605.14	211,798,102.58

注：1. 报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0158 元，基金份额总额 96,955,789.03 份。

2. 本基金基金合同生效日为 2018 年 12 月 19 日。

## 6.2 利润表

会计主体：国开泰富睿富债券型证券投资基金

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
<b>一、收入</b>	2,651,876.16
1.利息收入	2,352,105.87
其中：存款利息收入	1,095,489.24
债券利息收入	762,729.64
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	493,886.99
其他利息收入	-

2.投资收益（损失以“-”填列）	293,667.80
其中：股票投资收益	-376,830.83
基金投资收益	-
债券投资收益	648,364.71
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	22,133.92
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-10,305.10
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	16,407.59
<b>减：二、费用</b>	529,801.62
1. 管理人报酬	293,639.66
2. 托管费	73,409.89
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	36,088.76
5. 利息支出	43,269.37
其中：卖出回购金融资产支出	43,269.37
6. 税金及附加	1,993.94
7. 其他费用	81,400.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	2,122,074.54
减：所得税费用	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	2,122,074.54

注：本基金基金合同生效日为 2018 年 12 月 19 日。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国开泰富睿富债券型证券投资基金

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）	211,531,508.55	230,801.34	211,762,309.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,122,074.54	2,122,074.54
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-114,575,719.52	-821,938.03	-115,397,657.55

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	180,910.80	966.46	181,877.26
2.基金赎回款	-114,756,630.32	-822,904.49	-115,579,534.81
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)	96,955,789.03	1,530,937.85	98,486,726.88

注：本基金基金合同生效日为 2018 年 12 月 19 日。

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：

_____ 杨波 _____	_____ 朱瑜 _____	_____ 姚劼 _____
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

国开泰富睿富债券型证券投资基金(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]1277号《关于准予国开泰富睿富债券型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《国开泰富睿富债券型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 211,556,360.00 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(2018)第 0773 号予以验证。经向中国证监会备案,《国开泰富睿富债券型证券投资基金基金合同》于 2018 年 12 月 19 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 211,577,023.41 份基金份额,其中认购资金利息折合 20,663.41 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,基金托管人为浙商银行股份有限公司(以下简称“浙商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国开泰富睿富债券型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企业债券、公司债券、可转换债券(含可分离债券)、金融债、央行票据、国债、资产支持证券、短期融资券和债券回购,国内依法发行上市的股票(含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)和权证,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：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 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中债综合财富指数收益率 X 90% + 沪深 300 指数收益率 X 10%。

#### 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》、《国开泰富睿富债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、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 年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则及应用指南、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场, 采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时, 优先使用可观察输入值, 只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下, 才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件, 应对估值进行调整并确定公允价值。

#### **6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的; 且 2) 交易双方准备按净额结算时, 金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### **6.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **6.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时, 申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时, 申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列, 并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### **6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益; 于处置时, 其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益, 其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算, 实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；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；每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

（2）对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监



会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### **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 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 2019 年 6 月 30 日	
	活期存款	2,067,303.56
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:	2,067,303.56	

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,156,524.96	3,124,620.80	-31,904.16

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	25,172,839.28	25,115,525.26
	银行间市场	66,231,486.92	66,310,400.00
	合计	91,404,326.20	91,425,925.26
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	94,560,851.16	94,550,546.06	-10,305.10

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/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 2019年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	10,000,135.00	-
合计	10,000,135.00	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易，也无在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 2019年6月30日
应收活期存款利息	938.12
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	50.60
应收债券利息	1,500,842.97
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	13,519.22
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	9.50
合计	1,515,360.41

注：“其他”为应收结算保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	16,379.32
银行间市场应付交易费用	7,780.94
合计	24,160.26

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	81,400.00
合计	81,400.00

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	211,531,508.55	211,531,508.55
本期申购	180,910.80	180,910.80
本期赎回(以“-”号填列)	-114,756,630.32	-114,756,630.32
- 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	96,955,789.03	96,955,789.03

注：本期申购含红利再投、转换入份额；本期赎回含转换出份额。

#### 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	230,801.34	-	230,801.34
本期利润	2,132,379.64	-10,305.10	2,122,074.54
本期基金份额交易产生的变动数	-915,448.64	93,510.61	-821,938.03
其中：基金申购款	1,113.09	-146.63	966.46
基金赎回款	-916,561.73	93,657.24	-822,904.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,447,732.34	83,205.51	1,530,937.85

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	42,084.22
定期存款利息收入	1,038,819.47
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	14,513.83
其他	71.72
合计	1,095,489.24

注：“其他”为结算保证金利息收入。

#### 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 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	12,743,191.69
减：卖出股票成本总额	13,120,022.52
买卖股票差价收入	-376,830.83

#### 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 2019年1月1日至2019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	648,364.71
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	648,364.71

### 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 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	130,482,796.04
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	128,095,128.81
减：应收利息总额	1,739,302.52
买卖债券差价收入	648,364.71

### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

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

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

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

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

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 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	22,133.92
基金投资产生的股利收益	-
合计	22,133.92

### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	-10,305.10
——股票投资	-31,904.16

——债券投资	21,599.06
——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	-10,305.10

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	16,407.59
合计	16,407.59

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	33,173.76
银行间市场交易费用	2,915.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	36,088.76

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	32,728.42
信息披露费	39,671.58
银行间帐户维护费	9,000.00
合计	81,400.00

#### 6.4.7.21 分部报告

无。

## 6.4.8 关联方关系

### 6.4.8.1 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。

### 6.4.8.2 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
浙商银行股份有限公司	基金托管人
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
北京国开泰富资产管理有限公司	基金管理人的子公司

## 6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行交易。

### 6.4.9.2 关联方报酬

#### 6.4.9.2.1 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
当期发生的基金应支付的管理费	293,639.66
其中：支付销售机构的客户维护费	46,067.15

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 0.40% 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 X 0.40% / 当年天数。

#### 6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	73,409.89

注：支付基金托管人浙商银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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 0.10% / 当年天数。



### 6.4.9.2.3 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。

### 6.4.9.3 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。

### 6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用自有资金投资本基金。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018年12月31日	
	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
北京国开泰富资产管理有限公司	4,999,100.00	51.5610%	-	-

#### 6.4.9.5 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	
	期末余额	当期利息收入
浙商银行股份有限公司	2,067,303.56	42,084.22

#### 6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.9.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须作其他关联交易事项的说明。

### 6.4.10 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.10.1 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。

#### 6.4.10.2 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。

### 6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末 2019 年 06 月 30 日止, 本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 6,999,876.50, 是以如下债券作为抵押:

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
011900778	19 鲁钢铁 SCP004	2019 年 7 月 1 日	100.19	70,000	7,013,300.00
合计				70,000	7,013,300.00

#### 6.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末, 本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 7,000,000.00 元, 于 2019 年 07 月 01 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券, 按证券交易所规定的比例折算为标准券后, 不低于债券回购交易的余额。

### 6.4.11 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 06 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 7,926,769.70 元, 属于第二层次的余额为 86,623,776.36 元, 无属于第三层次的余额。

###### (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 06 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。

(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	3,124,620.80	2.76
	其中：股票	3,124,620.80	2.76
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	91,425,925.26	80.74
	其中：债券	91,425,925.26	80.74
	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	10,000,135.00	8.83
	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	2,179,650.98	1.92
8	其他各项资产	6,511,273.10	5.75
9	合计	113,241,605.14	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	2,168,571.80	2.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	20,620.00	0.02
F	批发和零售业	38,940.00	0.04
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业	176,100.00	0.18
J	金融业	480,719.00	0.49
K	房地产业	239,670.00	0.24
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,124,620.80	3.17

### 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	601233	桐昆股份	23,980	371,929.80	0.38
2	002783	凯龙股份	26,175	335,040.00	0.34
3	300568	星源材质	9,000	207,450.00	0.21
4	601677	明泰铝业	20,000	206,200.00	0.21
5	000001	平安银行	14,600	201,188.00	0.20
6	000002	万科A	7,200	200,232.00	0.20
7	600271	航天信息	5,000	115,250.00	0.12
8	002142	宁波银行	3,300	79,992.00	0.08
9	000338	潍柴动力	6,500	79,885.00	0.08
10	002230	科大讯飞	2,400	79,776.00	0.08

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	601727	上海电气	2,121,757.41	1.00
2	600728	佳都科技	1,147,514.02	0.54
3	002142	宁波银行	742,806.28	0.35
4	002783	凯龙股份	728,497.50	0.34
5	601677	明泰铝业	720,500.00	0.34
6	000002	万科A	551,618.00	0.26
7	000001	平安银行	530,319.00	0.25
8	002224	三力士	489,717.80	0.23
9	300059	东方财富	405,787.00	0.19
10	601233	桐昆股份	371,929.80	0.18
11	603588	高能环境	351,648.68	0.17
12	000338	潍柴动力	306,850.00	0.14
13	300498	温氏股份	260,306.00	0.12
14	300388	国祯环保	256,975.47	0.12
15	000063	中兴通讯	254,011.00	0.12
16	603313	梦百合	251,886.24	0.12
17	002230	科大讯飞	250,951.00	0.12
18	000333	美的集团	221,065.00	0.10
19	300568	星源材质	213,721.00	0.10
20	600170	上海建工	205,140.00	0.10

### 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	601727	上海电气	2,086,233.65	0.99
2	600728	佳都科技	1,139,607.32	0.54
3	002142	宁波银行	666,270.58	0.31
4	601677	明泰铝业	521,900.00	0.25
5	002224	三力士	497,546.70	0.23
6	300059	东方财富	383,177.00	0.18
7	000002	万科A	355,574.00	0.17
8	002783	凯龙股份	346,810.00	0.16

9	603588	高能环境	338,029.65	0.16
10	000001	平安银行	301,802.00	0.14
11	603313	梦百合	250,304.04	0.12
12	300498	温氏股份	245,270.00	0.12
13	300388	国祯环保	240,272.99	0.11
14	000063	中兴通讯	233,018.00	0.11
15	000338	潍柴动力	220,963.00	0.10
16	000333	美的集团	216,871.00	0.10
17	600170	上海建工	195,000.00	0.09
18	002230	科大讯飞	164,553.00	0.08
19	601128	常熟银行	146,160.57	0.07
20	002340	格林美	136,453.00	0.06

### 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	16,276,547.48
卖出股票收入（成交）总额	12,743,191.69

### 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	3,996,800.00	4.06
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,004,000.00	4.07
	其中：政策性金融债	4,004,000.00	4.07
4	企业债券	8,777,126.36	8.91
5	企业短期融资券	59,269,100.00	60.18
6	中期票据	7,041,300.00	7.15
7	可转债（可交换债）	8,337,598.90	8.47
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	91,425,925.26	92.83

### 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	011802138	18 国网租赁 SCP002	100,000	10,057,000.00	10.21
2	011801989	18 北电 SCP002	70,000	7,060,200.00	7.17
3	011801995	18 华菱钢铁 SCP005	70,000	7,047,600.00	7.16
4	101900461	19 圆通蛟龙 MTN001	70,000	7,041,300.00	7.15
5	011802059	18 杭金投 SCP011	70,000	7,039,200.00	7.15

**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国债期货交易情况说明**

本基金本报告期末未进行国债期货投资。

**7.11 投资组合报告附注****7.11.1 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、出发的情形。

**7.11.2 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**

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

**7.11.3 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	21,161.27
2	应收证券清算款	4,974,751.42
3	应收股利	-
4	应收利息	1,515,360.41
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,511,273.10

**7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	132013	17 宝武 EB	1,499,100.00	1.52
2	132015	18 中油 EB	978,900.00	0.99
3	132011	17 浙报 EB	944,000.00	0.96
4	113013	国君转债	396,340.00	0.40
5	127005	长证转债	347,940.00	0.35

6	123009	星源转债	305,610.00	0.31
7	128043	东音转债	279,800.00	0.28
8	113011	光大转债	271,000.00	0.28
9	123016	洲明转债	252,273.00	0.26
10	110046	圆通转债	231,460.00	0.24
11	127008	特发转债	223,600.00	0.23
12	110033	国贸转债	167,175.00	0.17
13	110049	海尔转债	120,320.00	0.12
14	132005	15 国资 EB	113,450.00	0.12
15	113008	电气转债	113,120.00	0.11
16	123017	寒锐转债	97,400.00	0.10
17	128028	赣锋转债	96,460.00	0.10
18	128046	利尔转债	77,352.80	0.08

### 7.11.5 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未存在流通受限的股票。

## § 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
614	157,908.45	55,001,900.00	56.73%	41,953,889.03	43.27%

### 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	141,798.60	0.1463%

### 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	-

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年12月19日）基金份额总额	211,577,023.41
本报告期期初基金份额总额	211,531,508.55



本报告期间基金总申购份额	180,910.80
减:本报告期间基金总赎回份额	114,756,630.32
本报告期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
本报告期末基金份额总额	96,955,789.03

注: 1. 报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额;

2. 报告期期间基金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。

本报告期内, 基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及管理人、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

本基金本报告期末改聘会计师事务所。

### 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	
海通证券	2	22,397,410.69	100.00%	16,379.32	100.00%	-

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

海通证券	168,988,279.27	100.00%	2,079,100,000.00	100.00%	-	-
------	----------------	---------	------------------	---------	---	---

## § 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	20190116-20190630	40,003,000.00	-	-	40,003,000.00	41.26%
个人	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

本基金为债券型基金，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