国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)招募说明书 便新)摘要

本基金募集申请已于2015年5月19日获中国证监会证监许可 [2015]928号文准予募集注册。本基金的基金合同于2015年7月3日生

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明 书经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其 对本基金的投资价值、市场前景和收益作出实质性判断或保证,也不表

7) 不多基立的交页所值、17-20前京林中区面下面头质住开的风味证,也不会明投资于本基金没有风险。 本基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理

本基金管理人亦培依照恪尽职守,诚实信用,強慎動蚬的原则管理 和运用基金财产,但不保证投资本基金一定盈利,也不保证是低收益。当 投资者赎回时,所得或会高于或低于投资者先前所支付的金额。 本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生 波动,投资者在投资本基金前,应全面了解本基金的产品特性,充分考虑 自身的风险承受能力,理性判断市场,并承担基金投资中出现的各类风 日3117人成本文化之,在上下前17%,并已经基础及下一次出一条从 胶、包括:因蜂体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成 成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于基金投资者连续 大量赎回基金产生的流动性风险,上市交易风险,基金管理人在基金管

理实施过程中产生的基金管理风险等等。 本基金为混合型基金,其预期风险、预期收益高于货币市场基金和

债券型基金、低于股票型基金。 本基金可投资中小企业私募债,中小企业私募债由于发行人自身特点,存在一定的违约风险。同时单只债券发行规模较小,且只能通过两大

思,行任。是的证金9%减少。问的"单关"的分及自然快级分,且尽能通过两个交易所特定果直进行转让交易,存在流动性风险。 基金的过往业绩并不预示其未来表现,基金管理人屋程投资者基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人屋程投资者基金投资的"买者自负"原则,在作出投资决策后,基金运营状况与基金净值 变化引致的投资风险,由投资者自行承担。基金管理人所管理的其他基 (1) 13(1) 1 息披露文件,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用 基金财产,不保证投资本基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的最

....。 本招墓说明书所载内容截止日为2018年7月3日,有关财务数据和

第一部分基金管理人

基金管理人概况

一、基本目生人概况 名称:国金基金管理有限公司 住所:北京市怀柔区府前街三号楼3-6 成立日期:2011年11月2日

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 法定代表人:尹庆军

联系电话:010-88005888 注册资本:2.8亿元人民币

区水品付: 国金基金管理有限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、四家企业共同出资2.8亿元人民币,出资比例分别为

49%、19.5%、19.5%和12%。 (二)主要人员情况 、董事会成员

纪路先生,董事长,硕士EMBA。历任博时基金管理有限公司研究 员、金信证券有限责任公司投资研究中心总经理、国金证券股份有限公司研究所总经理。现任国金证券股份有限公司研究所总经理。现任国金证券股份有限公司副总经理,国金基金管理有限公司董事长,国金财务(香港)有限公司董事,国金财务(香港)有 限公司董事,国金证券上海投资咨询分公司总经理,上海国金理益财富

報公司董事,認证仍不信贷及目的分公司总定证,上海高亚生证为 基金销售有限公司执行董事。 金鵬先生,董事,研究生学历。历任涌金期货经纪有限公司总经理助 理、上海涌金理财顺可有限公司副总经理,河北财金投资有限公司总经 理,涌金实业(集团)有限公司副总裁,国金证券有限责任公司风险控制 中心总经理,国金证券股份有限公司董事副总经理、监事、监事会主席, 国金期货有限责任公司董事长。现任国金证券股份有限公司董事、总经 理,国金创新投资有限公司董事长,国金期货有限责任公司董事,国金基

金管理有限公司董事,国金证券(香港)有限公司董事。 许强先生,董事,硕士。历任苏州商品交易所交易部、交割部、信息部 总经理,中国华通物产集团经易期货经纪有限公司副总裁,苏州工业园 区国有资产经营公司投资银行部总经理,苏州工业园区地产经营管理公 司投资部总经理。现任苏州工业园区资产管理有限公司董事长、国金基 金管理有限公司董事。

並自理有限公司重事。 宁远喜桂生,董事,硕士。历任三九集团工程有限公司办公室主任, 深圳伯龙建筑工程有限公司总经理助理,广东宝丽华集团有限公司广告 部经理,广东宝丽华实业股份有限公司董事会秘书。现任广东宝丽华新 即至生, 水玉郎中关业成份有限公司重争去极力。观江, 水玉郎中树 能源股份有限公司董事长, 广东宝游资产管理有限公司执行董事、宝弥 融资租赁有限公司执行董事, 广东信用宝征信管理有限公司执行董事, 梅州客商银行股份有限公司董事长, 百合佳缘网络集团股份有限公司副 董事长, 国金基金管理有限公司董事, 深圳微金所金融信息服务有限公 司董事, 宝合金服投资管理股份有限公司董事。

(李) 孟日亚版(艾及) 日本成(万有成立) 高季。 赵煜先生, 董事, 学士。历任北京台都汽车安全设备有限公司销售经 北京顶峰贸易公司销售经理, 上海浦东中软科技发展有限公司副总 理,北京顶峰贸易公司销售经理,上海浦东中软科技发展有限公司副总 经理。现任涌金实业(集团)有限公司董事长助理,国金基金管理有限公

尹庆军先生,董事,硕士。历任中央编译局世界所助理研究员、办公厅科研外事秘书,中央编译出版社出版部主任,博时基金管理有限公司人力资源部总经理、董事会秘书、监事,国金基金管理有限公司(筹)拟任督繁长、国金基金管理有限公司督察长。现任国金基金管理有限公司 江自舜怀、国並雖並自是特別於中国宗怀。 处江国立雄亚自是中国公司董事、总是鬼、北京千石创富资本管理有限公司董事长。 张克东先生,独立董事学士,注册会计师。历任煤炭工业部技术发 展司、煤炭科学研究总院科员、主任科员,中国国际经济咨询公司、中信 会计师事务所咨询员、项目经理、中信会计师事务所副主任,中天信会计

师事务所副主任。现任信永中和会计师事务所副总经理、合伙人,国金基 金管理有限公司独立董事。 鲍卉芳女士,独立董事,硕士。历任湖北省郧阳地区法律顾问处律

师,最高人民检察院法纪厅书记员,北京市中银律师事务所律师,北京市 博宇律师事务所律师,北京市大成律师事务所律师,北京市同维律师事 斤律师。现任北京市康达律师事务所合伙人、律师,国金基金管理有限 张勇先生,硕士,高级经济师。历任中国建设银行北京分行二处副处

长,中国建设银行北京信托公司总经理,中国信达资产管理股份有限公司托管清算部总经理,中国金谷国际信托有限责任公司董事长。现任国金基金管理有限公司独立董事。

刘洼先生,监事会主席,硕士。历任南方报业传媒集团资深记者,广 が代元主、血事水主流、吸上。 がに開力が設定は来源は成本に有い 东宝丽华新能源股份有限公司董事会秘书、董事。 现任广东宝丽华新能 源股份有限公司副董事长、总经理兼董事会秘书,国金基金管理有限公 司监事会主席、股东代表监事。

可面等宏王府,版家代表面等。 张宝全先生,监事,硕士,会计师。历任哈尔滨翔鸿电子有限公司成 本会计,哈尔滨八达科技有限公司主办会计,国巨电子(中国)有限公司 内审专员,苏州工业园区财政局项目签全管理外周协长。现任苏州工业 园区兆润投资控股集团有限公司总裁助理,国金基金管理有限公司股东

聂武鹏先生,职工代表监事,硕士。历任天虹商场股份有限公司培训 专员、TCL 集团股份有限公司招聘及培训经理、深圳迅雷网络技术有限 公司高级招聘经理、国金基金管理有限公司(筹)综合管理部总经理助 公司高級拍判空准、国家建筑管理有限公司(寿)综合管理部总经理则理兼人力资本经理、国家建筑管理有限公司总管监监兼运营支持部总经理。现任国金基金管理有限公司总经理助理、运营总监兼运营支持部总经理,取工代表选事,北京千石创营资本管理有限公司。即至安土、职工代表选审,破土、历任北大方公司监事会主席。 划容女士、职工代表监事、破土、历任北大方正物产集团农产品部朋货研究员兼总办会助理,国金基金管理有限公司(筹)风险管理部风险

风听光识来忘办宝别建,国运基金草里有限公司(寿)从险官理部从险分析师兼董事会秘书。 分析师、国金基金管理有限公司风险管理部风险分析师兼董事会秘书。 合规风控部总经理助理。现任国金基金管理有限公司合规风控部剧总经 理、职工代表监事,北京千石创富资本管理有限公司股东代表监事。 3、总经理及其他高级管理人员

3、尼於理及其他局級管理人员 经路先生、董事长、硕士医MBA。简历请见上文。 尹庆军先生,总经理,硕士。简历请见上文。 班丽女士,督察长,硕士,通过国家司法考试,国际注册内部审计师。 历任科学出版社法律事务部内部法律顾问,国金基金管理有限公司 (筹)监察稽核部法律顾问,国金基金管理有限公司监察稽核部法律顾 同,监察稽核部副总经理兼法律顾问,监察稽核部总经理。现任国金基金 管理有限公司整察核 索峰先生,副总经理,学十,历任重庆润庆期货服务有限公司业务部

緊峰穴生,創心经理,字士。仍吐趣庆润庆明页服务有限公司业务部 副总经理, 遺庆星河朝接经纪公司业务都投资顺向,上海申银万国证券 投资咨询人员, 君安证券有限责任公司重庆民生路营业部交易部经理, 中国银河证券有限责任公司重庆民族路营业部、重庆管理部研发部经 理,银河基金管理有限公司基金经理 固定收益部总监、总会理助理,国 金基金管理有限公司总经理助理、固定收益投资总监兼上海资管事业部 (四)基金经理

宫雪女士,博士。历任博时基金管理有限公司产业分析师,国金基金 自己是一点的工。仍正的印象率自定有成立的。近7的797,周亚泰亚 管理有限公司产品经理,行业分析师、产品与金融工程部总经理,指数投资部副总经理、指数投资事业部总经理。现任国金基金管理有限公司量 化投资事业三部总经理,截至本招募说明书更新公布之日,宫雪女士兼 任国金沪深300指数增强证券投资基金、国金上证50指数分级证券投资 基金、国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金的基金经理的基金经理。

投资决策委员会成员包括公司总经理尹庆军先生,副总经理兼固定 收益投资总监索峰先生,基金交易部总经理詹毛毛先生,量化投资总监 林健武先生,量化投资事业二部总经理杨雨龙先生,量化投资事业二部 总经理兼基金经理官事女士,投资管理部总经理兼基金经理徐苒芳女 士,基金经理滕祖光先生,基金经理李安心先生,研究部总经理尹海峰先

- (六)上述人员之间均不存在近亲属关系。
- (六)上还人风之间均不好住紅水腐大水。 三、基金管理人的职责 (一)依法募集资金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构 代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜。
- (三)对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账,进行证券投
- (四)按照基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份
- (四月)以而安全。日中日5月27年 1875年 1875年
- (六)编制季度、半年度和年度基金报告。 (七)计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回价格
- 、)严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定,履行信息披
- (十一)以基金管理人名义,代表本基金份额持有人利益行使诉讼 权利或者实施其他法律行为
-)中国证监会规定的其他职责 四、基金管理人承诺
- (一)基金管理人基格 (一)基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》的行 为,并承诺建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反《中华人民 共和国证券法》行为的发生。 (二)基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为,并承诺建立健
- 全内部风险控制制度,采取有效措施,防止压体。 全内部风险控制制度,采取有效措施,防止下列行为的发生: 1、将其固有财产或者他人财产混同于基金资产从事证券投资。 2、不公平地对待其管理的不同基金资产。
- 3. 条 用证 5 。 4. 将基金财产用于抵押、担保、资金拆借或者贷款。 5. 从事承担无限责任的投资。 6. 利用基金财产或职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取
- 、向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失。

- 、泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、
- 暗示他人从事相关的交易活动。 10.玩忽职守,不按照规定履行职责。
- 10、从选级时,不该积极足履门取员。 11、法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。 (三)基金管理人承诺不从事证券法规规定禁止从事的其他行为。 (四)基金管理人承诺加强人员管理,强化职业操守,督促和约束员 工遵守国家有关法律、法规、规章及行业规范,诚实信用、勤勉尽责,不从

- 2、违反基金合同或托管协议。
- 3. 故意锁弄基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益。 4. 在包括向中国证监会报送的资料中进行虚假信息披露。 5. 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管。
- 6、玩忽职守、滥用职权,不按照规定履行职责。 洲震在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公
- 开的基金投资内容、基金投资计划等信息,或利用该信息从事或者明示、暗示他从从事相关的交易活动。 8、除按基金管理人制度进行基金运作投资外,直接或间接进行其他
- 9、协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交
- 10、违反证券交易场所业务规则,利用对敲、对倒、倒仓等手段操纵
- 价格, 扰乱市场秩序。
 11、贬损同行,以提高自己。
 12、在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分。
 13、以不正当手段谋求业务发展。
 14、有悖社会公德, 损害证券投资基金人员形象。
 15、其他法律, 行政法规禁止的行为。
 五、基金经理承诺
 (一) 依照有关法律, 法规, 规章和基金合同的规定, 本着勤勉谨慎
- 的原则为基金份额持有人谋取最大利益。 (二)不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者牟取利益。 (三)不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密,尚
- 法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息,或利用该信息从事或者
- 明示、暗示他人从事相关的交易活动。 (四)不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。 六、基金管理人的内部控制制度
-)内部控制的原则 、全面性原则:内部控制必须覆盖公司的所有部门和岗位,渗透各
- 1、全面性原则:內部控制必须覆盖公司的所有部「和岗位、渗透各项业务过程和业务环节。 2、独立性原则:设立独立的合规风控部,合规风控部保持高度的独立性和权威性,负责对公司各部门风险控制工作进行稽核和检查。 3、相互制约原则:各部门在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制,建立不同岗位之间的制衡体系。 4、定性和定量相结合原则:建立完备的风险管理指标体系,使风险管理具客观性和操作性。 (一)内部控制的依据系结构
- 二) 内部控制的体系结构 公司的内部控制体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构,由最高管理层对内部控制体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构,由最高管理层对内部控制负最终责任,各个业务部门负责本部门的风险评估和监控,合规风控部负责监察公司的风险管理措施的执行。具体而
- 、董事会:负责制定公司的内部控制政策,对内部控制负完全的和
- 2、督察长:独立行使督察权利;直接对董事会负责;及时向董事会及 /或董事会下设的相关专门委员会提交有关公司规范运作和风险控制方
- 、投资决策委员会:负责指导基金财产的运作、制定本基金的资产

3.投资供取卖贝云: 以页扫于基本则厂目为户口则是不完整的日本。 配置方案和基本的投资策略。 4.风险控制委员会: 负责对基金投资运作的风险进行测量和监控。 5.合规风控部: 负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监 察, 并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助, 使公司在一种风 险管理和控制的环境中实现业务目标; 同时负责对投资事前及事中的风 险监控,具体落实针对投研运作的相关法律法规、公司制度及日常的投 研风控决策设置相应的投研风控措施,并对各投资组合风险进行分析

对发现的异常及时向相关部门反馈,以作为调整投资决策的依据。 6、业务部门: 风险管理是每一个业务部门最首要的责任。部门负责 人对本部门的风险负全部责任,负责履行公司的风险管理程序,负责本 部门的风险管理系统的开发、执行和维护,用于识别、监控和降低风险。

、建立、健全内控体系,完善内控制度:建立、健全了内控结构,高管 人员关于内控有明确的分工,确保各项业务活动有恰当的组织和授权 确保监察稽核工作是独立的,并得到高管人员的支持,同时置备操作手

册,并定期更新。 2、建立相互分离、相互制衡的内控机制:建立、健全了各项制度 到基金经理分开,投资决策分开,基金交易集中,形成不同部门、不同岗位之间的制衡机制,从制度上减少和防范风险。 unjmpjegのlimj, が,mpje、上extシがipj7i2JANEC。 、建立、健全岗位责任制:建立、健全了岗位责任制,使每个员工都 自己的任务、职责,并及时将各自工作领域中的风险隐患上报,以防

4.建立风险分类。识别、评估、报告、提示程序:分别建立了公司营运 风险和投资风险控制委员会。使用适合的程序,确认和评估与公司运作和投资有关的风险。公司建立了自下而上的风险报告程序,对风险隐患进行层层汇报,使各个层次的人员及时掌握风险状况,从而以最快速度

5、建立内部监控系统;建立了有效的内部监控系统,如电脑预警系统,投资监控系统,能对可能出现的各种风险进行全面和实时的监控。6、使用数量化的风险管理手段;采取数量化、技术化的风险控制手

段,建立数量化的风险管理模型,用以提示指数趋势、行业及个股的风 以便公司及时采取有效的措施,对风险进行分散、控制和规避,尽可 7、提供足够的培训:制定了完整的培训计划,为所有员工提供足够

- 第二部分基金托管人
- 、基金托管人情况 、基本情况
- 1、基本间况 名称:平安银行股份有限公司 住所:广东省深圳市罗湖区深南东路5047号
- 办公地址:广东省深圳市罗湖区深南东路5047号 法定代表人:谢永林 成立日期:1987年12月22日
- 组织形式:股份有限公司 注册资本:17,170,411,366元 存续期间:持续经营
- 基金托管资格批文及文号:中国证监会证监许可[2008]1037 号 联系人:高希泉

吸索公司 (1907年) 联系电话:(0755) 2219 7701 1.平安银行基本情况 平安银行股份有限公司是一家总部设在深圳的全国性股份制商业 组行(深圳证券交易所管称,亚安组行)证券代码000001) 甘前身具深 银行、保外加近牙之物所间标: 平安银行, 近芳八岛000001)。 共則身是除 划发展银行股份有限公司, 于2012年6月吸收合并原平安银行并于同年 7月更名为平安银行。中国平安保险(集团)股份有限公司及其子公司合 计持有平安银行58%的股份, 为平安银行的控股股东。截至2017年末, 在

职员工32502人,通过全国70家分行、1079家营业机构为客户提供多种

2017年,平安银行收入、利润、规模保持稳健发展。实现营业收入 1057.86亿元 (还原营改增前的营业收入同比增幅1.67%) 净利润 231.89亿元(同比增长261%)、资产总额32,484.74亿元(较上年末增长9.99%)、吸收存款余额20,004.20亿元(较上年末增长4.09%)、发放贷款和建款总额(含贴取 17,042.30亿元(较上年末增临1.64%)。 平安银行总行设资产托管事业部、下设市场拓展处、创新发展处、估

信核管外 资全清管外 抑划发展外 [[[系统支持外 督察合规外 其全服 务中心8个处室,目前部门人员为60人。

陈正涛,男,中共党员,经济学硕士、高级经济师、高级理财规划师。 国际注册私人银行家,具备《中国证券业执业证书》。长期从事商业银行 36水上加州人民门家、吴宙、广岛北方北京北市门。大学从李尚亚银门工作,具有水外币资金清算。银行经营管理及基金托管业务的经营管理 经验。1985年7月至1993年2月在武汉金融高等专科学校任教;1993年3 月至1993年7月在招商银行武汉分行任客户经理;1993年8月至1999年2 日在招行武汉分行武昌支行任计划信贷部经理 行长助理:1999年3 7日 - 2000年1月在招行武汉分行青山支行任行长助理;2000年2月至 2001年7月在招行武汉分行公司银行部任副总经理;2001年8月至2003 年2月在招行武汉分行解放公园支行任行长;2003年3月至2005年4月在 年2月在招行武汉分行解放公园支行任行长;2003年3月至2005年4月在 招行武汉分行机构业务部任总经理;2006年5月至2007年6月在招行武 汉分行桥口支行任行长;2007年7月至2008年1月在招行武汉分行同业 银行部任总经理;自2008年2月加盟平安银行先后任公司业务部总经理 助理,产品及交易银行部刷总经理,一直负责公司银行产品开发与管理, 全面掌握银行产品包括托管业务产品的运作,营销和管理,尤其是对商 业银行有关的各项监管政策比较熟悉。2011年12月任平安银行资产托 管部副总签理,2013年6月起任平安银行资产托管事业部副总裁(主持 工作);2015年3月5日起任平安银行资产托管事业部总裁。 3、基金托管业务经营情况

2008年8月15日获得中国证监会、银监会核准开办证券投资基金托

2008年8月19日3万日7日 1878年 1878年 2008年8月19日3万日 1878年 1879年 上盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金、新华活期添利货币产 上盛但自显然的低量低百量及起风证分较及基金。剩中的网络外贝印印 场证券投资基金。民生加银优选股票型证券投资基金。新华增盈回报债 券型证券投资基金。鹏华安盈宝货币市场基金、平安大华新鑫先锋混合 型证券投资基金、新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金、中 海进市及及基础、州土力成少几条中岛门间。国际日本电力及及基础、下海进取收益灵活配置混合型证券投资基金、东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金、国立部投资基金、国由廉新灵活配置混合型证券投资基金、(LOF),嘉合磐石混合型证券投资基金、(LOF),嘉合磐石混合型证券投资基金、(LOF),嘉合磐石混合型证券投资基金、(LOF),嘉合磐石混合型证券投资基金、(LOF),第合整石混合型证券投资基金、(LOF),第合整合混合型证券投资基金、(LOF),第一次提供证据 大现金通货币市场基金、平安大华鼎信定期开放债券型证券投资基金 不完立。但以下"海墨蓝",十文(千市旧户20),加度沙兰亚河及沙兰亚河及金蓝、平安大华崩泰灵活配置混合型证券投资基金。南方荣欢定期开放混合型 发起式证券投资基金。长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金。中海合嘉增强收益债券型证券投资基金。南方颐元债券型发起式证券投资基金。斯华 配置保日至证予及以基金、前升 所力的力切分量交流 远近 予及 贝基亚、前升 战惠灵活配置混合型证券投资基金、产部升制 不能 电影中发 定期开放灵活配置混合型证券投资基金、西部利得天添利货币市场基金、鹏华弘腾灵活配置混合型证券投资基金、博时安祺一年定期开放债券型证券投资基金、安信活 期宝货币市场基金、广发鑫源灵活配置混合型证券投资基金、平安大华 惠享纯债债券型证券投资基金、广发安悦回报灵活配置混合型证券投资 基金、平安大华惠融纯债债券型证券投资基金、广发产港赛新起点股票 型证券投资基金、平安大华惠金定期开放债券型证券投资基金、平安大 华量化成长多策略灵活配置混合型证券投资基金、博时丰达纯债6个月定期开放债券型发起式证券投资基金、英大睿襄灵活配置混合型证券投资基金、西部利得新动力灵活配置混合型证券投资基金、不见安盈灵活配置混合型证券投资基金、平安大华惠利纯债债券型证券投资基金、

发鑫盛18个月定期开放混合型证券投资基金、长盛盛丰灵活配置混合型证券投资基金、鹏华丰盈债券型证券投资基金、平安大华惠隆纯债债券型证券投资基金、平安大华惠隆纯债债券型证券投资基金、平安大华鑫利定期开

至此方次及等述、"子文人干生业合家贝川州州海监、十文人干量州之州 放灵活配置混合型证券投资基金、国联安奢智定期开放混合型证券投资 基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、广发汇平一年定期 开放债券型证券投资基金、华安新安平灵活配置混合型证券投资基金、

平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金、前海开源聚财宝

货币市场基金、招商招弘纯债债券型证券投资基金、招商稳阳定期开放

於而這時百至地分投及基金、於歐洲一級市的上記的至地分投及基金 。前海开源沙港深隆鑫灵活配置混合型证券投资基金、安安大华惠益 纯债债券型证券投资基金、金鹰添荣纯债债券型证券投资基金、西部利 得汇享债券型证券投资基金、鹏华丰玉债券型证券投资基金、华安睿安 定期开放混合型证券投资基金、西部利得久安回报灵活配置混合型证券 投资基金、广发汇安18个月定期开放债券型证券投资基金、上投票根学 岁金定期开放债券型证券投资基金、平安大华转型创新灵活配置混合型 证券投资基金、南方和元债券型证券投资基金、中金丰沃灵活配置混合 型证券投资基金、兴银消费新趋势灵活配置混合型证券投资基金、南方高元债券型发起式证券投资基金、易方达瑞智灵活配置混合型证券投资基金、南方高元债券型发起式证券投资基金、易方达瑞智灵活配置混合型证券投资 基金、中金丰颐灵活配置混合型证券投资基金、中金丰鸿灵活配置混合 型证券投资基金、平安大华惠泽和债债券型证券投资基金、南方智造未来股票型证券投资基金、万家安弘纯债一年定期开放债券型证券投资基金、平安大华量化先锋混合型发起式证券投资基金、平安大华沪深300 指数量化增强证券投资基金、平安大华合正定期开放纯债债券型发起式 捐效量化·自强证分权贝基金、十安人宁日正是别开放电员回分呈及起工证券投资基金、嘉合筹通债券型证券投资基金、生用产期开放债券型发起式证券投资基金、国泰安惠收益定期开放债券型证券投资 基金、博时富安纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、富荣福 審述、IPPI自安全UNOTIA與打形以的分望及是孔址分投页基並、晶本相處表所能置混合型证券投资基金、富荣福福混合型证券投资基金、前每 开源丰鑫灵活配置混合型证券投资基金、平安大华中证500交易型开放 式指数证券投资基金(ETF),汇添富鑫成定期开放债券型发起式证券 投资基金、平安大华合韵定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、 方达恒安定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券汇享定期开放 债券型发起式证券投资基金、平安大华MSCI中国A股低波动交易型开 放式指数证券投资基金(ETF)、平安大华合悦定期开放债券型发起式

、基金托管人的内部风险控制制度说明 1、内部控制目标

(ハロルアに明日46) 作为基金托管人,平安银行股份有限公司严格遵守国家有关托管业 务的法律法规,行业监管要求,自觉形成守法经营,规范运作的经营理念 和经营风格;确保基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完 8 及时 保护其余份额持有人的合法权益,确保内部控制和风险管理体 有效性;防范和化解经营风险,确保业务的安全、稳健运行,促进经

2、内部控制组织结构

资产托管事业部具备系统、完善的制度控制体系、建立了管理制度。 双广九号事业即录音系统、元曾印刷及控制体系、建立了旨是的是、控制制度、岗位职责、业务操作流程。可以保证托管业务务的规范操作和顺利进行;取得基金从业资格的人员符合监管要求;业务管理严格实行复 核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存 使用 账户资料严格保管 制约机制严格有效, 业务操作区专门设置

从、这种,我们从村村村标告,那多处时间,甘有数,业分末户尽引入起, 封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密; 业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整,独立。 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序 衣照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定,监督所托管基金

的投资运作。利用行业普遍使用的 "资产托管业务系统——监控子系 印以风语[Fe-7] 中州丁亚昌则是中间,贞广古自业学系统。 血注于系统",严格按照现行法律法规以及基金合同规定,对基金管理人运作基金的投资比例,投资范围、投资组合等情况进行监督,并定期编写基金投资运作监督报告,报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基 >洁管和核質服务环节中.对基金管理人发送的投资指令、基金管理人 的提取与开支情况进行检查监督。 2、监督流程

(1)每工作日按时通过监控子系统,对各基金投资运作比例控制指 (1)每上下日球的迴应血红了赤坑,对台港亚球页层下已的红帕纳 标进行例行监控,发现投资比例超标等异常情况,向基金管理人发出书 面通知,与基金管理人进行情况核实,督促其纠正,并及时报告中国证监

(2)收到基金管理人的投资指令后,对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。 (3)根据基金投资运作监督情况,定期编写基金投资运作监督报

告,对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价,报送中国证监会。 (4)通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易,电话或书面要

求管理人进行解释或举证,并及时报告中国证监会。 第三部分相关服务机构 一、基金份额销售机构 一)场外销售机构

1、直销机构 (1)国金基金管理有限公司直销中心

注册地址:北京市怀柔区府前街三号楼3-6

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

联系电话:010-88005812

客服信箱:service@gfund.com 客服电话:4000–2000–18 传真:010–88005816 网站:http://www.gfund.com (2)国金基金管理有限公司网上直销系统

交易系统网址:https://trade.gfund.com 目前支持的网上直销支付渠道:建行卡、工行卡、天天盈、通联支付。

客户服务电话:4000-2000-18 客户服务信箱:service@gfund.com (3)国金基金移动客户端 移动客户端(APP)名称:及第理财 目前支持的移动客户端支付渠道:通联支付

客户服务电话:4000-2000-18 客户服务信箱:service@gfund.com

注册地址:四川省成都市东城根上街95号 办公地址:四川省成都市东城根上街95号 联系人:刘婧漪、贾鹏

电话:028-86690057、028-86690058 传真号码:028-86690126 客服电话:95310 网址:www.gjzq.com.cn (2) 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司 注册地址:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室

办公地址:上海市杨浦区秦皇岛路32号东码头园区C栋 法定代表人:汪静波 客服电话:400-821-5399

図世・www.noah_fund.com (3) 北京恒天明泽基金销售有限公司 注册地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室

办公地址:北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层 法定代表人:梁越 电话:010-56810792

客服申话:4007-868-868-5 网址:www.chtfund.com (4) 北京唐鼎耀华投资咨询有限公司

注册地址:北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室 办公地址:北京朝阳区亮马桥路40号二十

客服电话:400-819-9868 网址: www.tdyhfund.com/ (5) 上海基煜基金销售有限公司

注册地址: 上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室 (上海泰和经济发展区)

法定代表人:王翔 联系人: 俞申莉 电话:021-65370077 客服电话:021-65370077

図世:www.jivufund.com.cn

(6) 北京晟视天下投资管理有限公司 注册地址:北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室 邮政编码:101404

法定代表人: 蔣煜 电话:010-58170820

客服电話: 400-818-8866 网址: www.shengshiview.com (7) 凤凰金信(银川)基金销售有限公司

法定代表人:程刚

联系人,张旭 电话:010-58160168 传真:010-58160173 客服电话:400-810-5919

(二)场内销售机构 本基金的场内销售机构为上海证券交易所内具有基金销售业务

注册地址, 宁夏同族自治区银川市全区区阅海湾中央商各区万寿路

2、基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机 构销售本基金,并及时公告。

二、登记机构 名称:中国证券登记结算有限责任公司 住所:北京西城区太平桥大街17号 办公地址:北京西城区太平桥大街17号

申话:(010)59378835 传真:(010)59378839 联系人:朱立元

法定代表人:周明

. 出具法律意见书的律师事务所

名称:上海通力律师事务所 注册地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼 负责人: 俞卫锋 电话:021-31358666 传真:021-31358600

经办律师:黎明、陆奇 联系人: 陆奇 四、审计基金财产的会计师事务所 名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)

注册地址:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层 __ 办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层

法定代表人:毛鞍宁 经办注册会计师:徐艳、贺耀 联系电话:010-58152145 传真:010-85188298 第四部分基金的名称 本基金名称:国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金(LOF)。

第五部分基金的类型 本基金类型:混合型证券投资基金 第六部分基金的投资目标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

第七部分基金的投资方向

行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、股指期货等权益类金融工具、债券等固定收益类金融工具 (包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募 债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期副 游,资产支持证券,债券回购,银行存款等)及法律法规或中国证监会 许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本 基金的投资组合比例为:

華並的政员组日に別分: 股票资产占基金资产的0%-95%;投资于债券、债券回购、货币市场 工具、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工 具不低于基金资产的5%;中小企业私募债占基金资产净值的比例不高 于20%;每个交易日日终在扣除股捐期货合约需缴纳的交易保证金以 后,本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产

水基金在建立相关业务流程和风险控制制度 经托管人同意并履行 在基础已建立而产业步加强力加强和ANA型型加州政策,至15日入间总力级门适当程序而可参与融资融券业务,参与融资融券业务需符合《基金参与融资融券及转融通证券出借业务指引》及其它相关法律法规规定。

在不违反法律法规目对投资者人利益无实质性影响、不改变本基金 的风险收益特征、投资目标、投资策略的前提下;在管理人具备相应条件且与托管人协商一致后,本基金可投资沪港通机制下允许投资的香港取 合交易所上市的股票,上述事项无需召开基金份额持有人大会,但需履 行相应程序 并遵守相关规定

行相应程序,并遵守相大规定。 如法律法规或监管机构在基金合同生效以后允许基金投资其他品 种或变更投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以相应调整 本基金的投资范围、投资比例规定 第八部分基金的投资策略

本基金的大类资产配置策略,主要是根据对宏观经济周期和市场运 行阶段的综合研判结果予以决策,通过对比大类资产的相对价值,流动性及市场情绪等指标来判断经济周期所处阶段以及未来发展趋势,动态 配置股票、债券、现金之间的比例。

在对宏观经济环境有初步判断的基础上,综合考虑整体资产组合的风险,收益、流动性及各类资产相关性等因素,应用量化工具对上述资产配置比例进行优化,在规避风险的前提下,为本基金的资产配置提供支 一、股票投资策略

合的投资策略,主要投资于估值合理、具有长期增值潜力的行业及上市

本基金运用行业基本面、市场估值等指标,选择在不同经济周期的 段中具有较高成长性和景气优势的行业,并选择其中估值合理的行业进

对行业配置权重的确定或调整从以下几个方面考虑

1、行业基本面比较。行业比较包括两个层面行业生命周期和行业 景气。行业生命周期由行业自身发展规律决定,主要受产业链、行业竞争 结构等因素的影响;行业景气受宏观经济环境影响而表现不同,主要分 析指标包括收入、利润、价格、产量、产能利用率、销量及增速等。 2、行业市场估值比较。估值体现市场预期,行业间估值排序、行业自 身估值水平都影响行业在市场中的表现。因此,运用行业估值模型分析 行业投资机会是行之有效的手段,具体指标包括行业间估值比较、行业

估值水平、行业的盈利调整等。 3、在上述初步筛选的基础上,结合产业政策,从全球产业格局变迁、 国内经济增长驱动等角度,寻求符合国际经济发展趋势和国内经济结构 等型主题。估值合理的优势行业。 (二)个股投资策略 本基金将采用定量分析和定性分析相结合的方法来建立股票库。首 先,运用流动性、盈利能力、估值水平等指标对所有投资范围内的股票进 行定量筛选、构建股票备选库、其次,在此基础上通过对上市公司基本面 进行深入的研究和定性分析,进一步发掘符合本基金投资理念、且估值 合理的优质个股构建股票风格库。

大定量师远 本基金管理人将通过以下两步对上市公司股票进行筛选,建立本基 金的股票备选库。 1)在投资范围内的股票中.剔除ST、*ST及公司认为的其他高风

险品种股票。 (2)在上一步的基础上,重点考察盈利能力、估值等指标,并根据这 些指标综合排序、筛选、形成股票备选库。 盈利能力指标:盈利能力是指企业获取利润的能力,利润是经营者 经营业绩和管理效能的集中体现。企业的盈利能力指标是本基金管理人

(ROE)、总资产根酬率(ROA)、主营业务收入同比增长率、主营业务利润同比增长率等指标作为衡量标准。 估值指标:企业的估值水平在一定程度上反应了其未来成长性以及 回面資物:正建的回面水平在一个在接上及企,具本来放大区等及 当前投资的安全性。估值合理将是本基金选股的一个重要条件。本基金 采用市盈率(P/E)、市净率(P/B)、市盈率相对盈利增长比例(PEG) 等估值指标,并参考国际估值分析方法、结合国内市场特征对入选的上

市公司股票进行综合评估人选,选取估值合理的个股。

2、定性分析 从以下几个方面对股票备选库中的股票进行定性分析:

在投资运作过程中重点关注的因素。本基金洗取净资产收益率

行业发展前景及地位;公司所在行业发展趋势良好,具有良好的行业成长性;公司在行业中处于领先地位,或者在生产、技术、市场等一个或多个方面具有行业内领先地位,并在短时间内难以被行业内的其他竞 争对手超越,在未来的发展中,其在行业或者细分行业中的地位预期会 有较大的上升。 治理结构:公司治理结构良好,管理规范,已建立起市场化经营机 制、决策效率高、对市场变化反应灵敏并内控有力。主要考核指标:财务

[品总页重、//河有农妇村,然立重争和1度、行总按路和1度等等。 营运状况:公司营运状况良好,股东和管理层结构稳定;各项财务指标状况良好;公司具有清晰的发展战略等。 核心音争力,公司主营业务可持续发展能力强,在行业中处于领势 被心克手灯;公司王吾亚野司持续及旅能力强;在打亚干处了现代 地位、具备核心竞争优势,比如专利技术、资源独占、销售网络垄断、独特 的市场形象、较高的品牌认知度等。 风险因素考察:公司在技术、营销、内部控制等方面不存在较大风

信息质量、所有权结构、独立董事制度、信息披露制度等等

险,同时公司具备与规模扩张匹配的较强的管理能力。

在对上市公司股票进行定量筛选和定性分析的基础上,基金经理结 合研究员对行业和个股的分析结果,精选优质企业,形成股票风格库,构 、债券投资策略

在保持组合高度流动性的前提下,结合对国内外宏观经济基本面、 金融市场运行趋势,市场资金面情况及市场供求、债市收益率水平,期限 和差及信用私差等各方面的分析,制定组合动态配置策略的基础上。合 理安排基金组合中债券投资组合的久期及期限结构,结合内部研究和信 理实计器並組合中級分及成组合的人的及购的混合的,這合同的的方允和信用评级积极优选个券进行投资。具体投资策略包括:
(一)久期及期限结构管理

久期管理是债券组合管理的核心环节,是提高收益、控制风险的有 效手段,也是衡量基金组合资产和负债是否匹配的关键指标。组合资产人期要与组合负债即募集资金人期匹配,以规避潜在的流动性风险。由 于久期也是衡量市场利率水平的变化对债券组合投资的收益影响程度 的指标。 本基金在保持资产和负债欠期基本匹配的基础上, 还会综合分

析中国宏观经济、财政金融政策和市场状况,对未来市场利率走预测,并根据预测结果微调组合债券久期: 当预期市场利率处于 道时 适度降低组合为期,当新期市场利索协干下降通道时 适度提高组 高升,這是中區3日八岁;3月89日7月9日 合久期,在有效控制风险基础上,有效提高组合整体的收益水平。 同时,在确定久期策略的基础上,本基金还将根据市场环境和期限 利差走势分析选择不同的组合期限结构策略, 主要的期限结构策略包

括: 骑乘策略、哑铃组合策略、子弹组合策略等。 (二)通过利率和信用利差分析确定券种配置 (一)理及利率和同用和是为利制是公司制度。 信用利差分析发现具有相对配置价值的债券种类、结合组合流动性需要

安巴拉:国顷、突儿等境、欧州王亚融顶、南亚银门、金融顶及公牧顶、正亚 债、公司债、短期融资券、中期票据,可转换债券和可分离债等监管机构 批准投资的品种。本基金在充分考虑不同类型债券流动性、税收、以及信 用风险等因素基础上,进行类属配置,优化组合收益。 (三)加强内部信用评估、优化个券选择 本基金在综合考虑久期、期限结构及券种配置的基础上,还要加强 信用品种的内部信用评估,优化个券选择。通过综合性的内部信用评估 后为6年13分配后用时已,从10年7523年。 2023年日注137年17月7日 系统对标的个券进行信用评级、将通过信用评级股的债券纳入各选库,再 结合对个体券种的价值分析在各选库内选择相应的最优投资对象。本基 金还将采取积极主动的策略,通过内部信用分析和研究判断找出市场定 价错误和回购套利机会,在确定存在超额收益的情况下,积极把握市场机会。本基金在已有组合基础上,根据对未来市场预期的变化,持续运用上述策略对债券组合进行动态调整。

更包括: 国债、央行票据、政策性金融债、商业银行金融债及次级债、企

(四)回购杠杆策略 本基金将密切跟踪市场收益率情况及资金成本水平,实时把握不同市场和不同期限品种之间的收益率差异,在控制流动性风险的基础上,积极采取适度的回购杠杆操作,有效增厚基金资产收益。 四、可转换债券投资策略

本基金根据对可转换债券的发行条款和对应基础证券的估值与价

关注可转换债券市场与股票市场之间的互动关系,选择恰当的时机进行 五、权证投资策略 在进行权证投资时, 将通过对权证标的证券基本面的研究, 结合权 证定价模型寻求其合理估值水平,并积极利用正股和权证之间的不同组

格变化的研究,采用买人低转换溢价率的债券并持有的投资策略,密切

六、股指期货投资策略 本基金在股指制货投资中将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,参与股指期货的投资。此外,本基金还将运用股指期货来管理特殊情况下的流动性风险,如预期大额申购赎回、大量

中小企业私募债投资策略 七、中小正业私务顷仅页束哈 利用自下而上的公司、行业层面定性分析,结合数量分析模型,测算 中小企业私募债的违约风险。考虑海外市场高收益债违约事件在不同行

合来套取无风险收益。

机会,积极调整投资策略。

中小正型私募(周17年9)从他。专总统苏州为(周市发出)成立(1949年)代于17年 地间的阴量差异。根据自上而下的宏观经济及行业特性分析,从行业层 面对中小企业私募债违约风险进行多维度的分析。个券的选择基于风险 溢价与通过公司内部模型测算所得违约风险之间的差异。结合流动性 信息披露、偿债保障等方面的考虑。 八、资产支持证券投资策略 依据风险可控和优化组合风险收益的原则。投资干资产支持证券产 品,以期获得长期稳定的收益。坚持价值投资理念,综合考虑信用等级债券期限结构、分散化投资、行业分布等因素,制定相应的资产支持证券

投资计划,并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化、把握市场交易

融机构一年期人民币存款基准利率。
本基金以实现绝对收益作为投资目标,力争在混合型基金的投资限 定之下,追求较高的投资回报。银行定期存款可以近似理解为定息产品,而一年期银行定期存款收益上浮3%较符合本基金的预期。因此,本基金采用一年期银行定期存款利率(税后)+3%作为业绩比较基准,与本基

金追求的预期收益水平相符。 如果今后法律法规发生变化,或该定期存款利率停止或调整发布,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出时,基金管理人可以在与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后变更业绩比 较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。 無开及的公司,加元兩日升基金的創作有八人云。 第十部分基金的风险收益特征 本基金为混合型基金,其预期风险、预期收益高于货币市场基金和

债券型基金,低于股票型基金。 第十一部分投资组合报告 本投资组合报告期为2018年4月1日至2018年6月30日。 (一)报告期末基金资产组合情况

(1				
代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)	
Α	农、林、牧、渔业	-	-	
В	采矿业	2,717,591.88	3.50	
C	制造业	16,575,455.82	21.37	
D	电力、热力、燃气及水生产和供 应业	379,115.00	0.49	
Ε	建筑业	3,380,089.00	4.36	
F	批发和零售业	-	_	
G	交通运输、仓储和邮政业	1,138,047.00	1.47	
Н	住宿和餐饮业	-	-	
Ι	信息传输、软件和信息技术服务 业	640,584.00	0.83	
J	金融业	34,744,734.20	44.79	
K	房地产业	2,048,592.00	2.64	
L	租赁和商务服务业	-	-	
М	科学研究和技术服务业	-	-	
Ν	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.10	
0	居民服务、修理和其他服务业		-	
Р	教育	_	_	

。 (2)报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注:以上行业分类以2018年6月30日的中国证监会行业分类标准为

文化、体育和娱乐业

注:本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。 (三)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名

)报告期末按债券品种分类的债券投资组合 注: 本基金本报告期末未持有债券投资 五)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

12 对明知 注: 本基金本报告期末未持有债券投资。 (六)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名 注:本基金本报告期末未持有资产支持证券

七)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

/應/文文/97431 注:本基金本报告期末未持有贵金属。 (八)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 注:本基金本报告期末未持有权证。

(九)报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 1、报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

2、本基金投资股指期货的投资政策 报告期内, 本基金投资干流动性较好的股指期货, 用干对冲部分股

票资产的下涉风险。 (十)报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 1、本期国债期货投资政策 报告期,本基金未投资国债期货。 2.报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细注:本基金本报告期未投资国债期货。

注: 本基並本投資期未投資國價期資。 3. 本期間橋期指投資评价 报告期内, 本基金未参与国债期货交易。 (十一)投资组合报告附注 1. 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体, 没有被监管部门立 案调查, 或在报告编制日前一年内受到公开谴责, 处罚。

2、基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票 3、其他资产构成 待摊费用

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明约 注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。 5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 股票名称 流通受限部分的 公允价值(元)

字号 股票代码

6、投资组合报告附注的其他文字描述部。 第十二部分基金的业绩 基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用 基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩 中不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅

读本基金的招募说明书及其更新。 读本基金的招募说明书及其更新。 (一)本基金合同生效日为2015年7月3日,基金合同生效以来(截至2018年6月30日)的基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收

of he i man and i and i and it											
016年1月1日至2016年12 月31日	1.40%	0.07%	4.47%	0.01%	-3.07%	0.06%					
017年1月1日至2017年12 月31日	21.46%	0.47%	4.27%	0.01%	17.19%	0.46%					
018年1月1日至2018年6月 30日	-9.89%	0.84%	2.03%	0.01%	-11.92%	0.83%	İ				
015年7月3日 (基金合同生 效日) 至2018年6月30日	11.20%	0.44%	13.79%	0.01%	-2.59%	0.43%					
主:本基金的业绩比较基准为:一年期银行定期存款利率(税后)											
二)自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业 交基准收益率变动的比较。											
更多于美国一个直通业并与 机水油性物质的收益 生物有重要的对比值											
26.018	11 3		10.1		1.1						
256.8			13 1	1 4 3	Ari.						

注:本基金基金合同生效日为2015年7月3日,图示日期为2015年7月3日 至2018年6月30日。 第十三部分费用概览

- 、基金费用的种类 一) 基金管理人的管理费; (二)基金片性人的目性疾; (二)基金片管人的托管费; (三)《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用; (四)《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼

(五)基金份额持有人大会费用

)基金的证券、期货交易费用)基金的银行汇划费用;)基金上市费及年费;

(九)基金的账户开户费用、账户维护费用: -)基金讲行外汇兑换交易的相关费用:)按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中

(十一)按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。 第十四部分对招募说明书更新部分的说明 国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(以下简称"本基金")招募说明书(更新)依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,对本基金管理人于2018年2月14日刊登的本基金招募说明书进行了更新、主要更新内容如下。

E要更新内容如下:

一、更新了"重要提示"中相关内容。

二、更新了"三、基金管理人"中相关内容。
三、更新了"四、基金托管人"中相关内容。
三、更新了"四、基金托管人"中相关信息。
五、更新了"九、县金份额的申购与赎回"中相关信息。
五、更新了"九、基金份额的申购与赎回"中相关信息。
五、更新了"九、基金份额的申购与财政"中相关信息。

五、更新 ·、基金的投资"中相关内容。 ·一、基金的业绩"中相关内容

、其他应披露事项",披露了自上次招募说明书

二零一八年八月十七日

更新截止日以来涉及本基金的相关公告。