国金众赢货币市场证券投资基金 2019年半年度报告摘要

基金管理人:国金基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
送出日期:2019年8月27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。

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

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

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

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至2019年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	国金众赢货币
基金主代码	001234
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月25日
基金管理人	国金基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	20,660,010,090.15份
基金合同存续期	不定期

注:无。

2.2 基金产品说明

投资目标	在综合考虑基金资产收益性、安全性和流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,力争为投资人创造稳定的收益。
投资策略	本基金在确保资产安全性和流动性的基础上,对短期货币市场利率的走势进行预测和判断,采取积极主动的投资策略,综合利用定性分析和定量分析方法,力争获取超越比较基准的投资回报。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:人民币七天通知存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种,其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。

注:无。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈广龙	张燕
	联系电话	010-88005888	0755-83199084
	电子邮箱	chenguanglong@gfund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4000-2000-18	95555
传真		010-88005666	0755-83195201

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.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

§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	324,798,161.68
本期利润	324,798,161.68
本期净值收益率	1.5232%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末基金资产净值	20,660,010,090.15
期末基金份额净值	1.0000

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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2.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.本基金收益分配为按日结转份额。

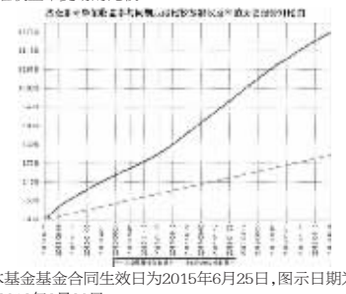
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.2494%	0.0021%	0.1110%	0.0000%	0.1384%	0.0021%
过去三个月	0.7347%	0.0021%	0.3366%	0.0000%	0.3981%	0.0021%
过去六个月	1.5232%	0.0022%	0.6695%	0.0000%	0.8537%	0.0022%
过去一年	3.3991%	0.0026%	1.3500%	0.0000%	2.0491%	0.0026%
过去三年	11.5453%	0.0023%	4.0500%	0.0000%	7.4953%	0.0023%
自基金合同生效起至今	15.7563%	0.0024%	5.4259%	0.0000%	10.3304%	0.0024%

注:本基金的业绩比较基准为:人民币七天通知存款利率(税后)

3.2.2 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绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金基金合同生效日为2015年6月25日,图示日期为2015年6月25日至2019年6月30日。

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

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,国金国鑫发起、国金及第七天理财、国金民丰回报、国金量化添利、国金惠鑫短债基金经理,固定收益投资部总经理	2015年6月25日	-	11	徐艳芳女士,清华大学硕士。2005年10月至2012年6月历任皓天财经公关公司财经咨询师、英大泰和财产保险股份有限公司投资经理。2012年6月加入国金基金管理有限公司,历任投资研究部基金经理;现任固定收益投资部总经理兼基金经理。
刘辉	本基金基金经理,国金鑫盈货币、国金金腾通货币基金经理	2018年1月25日	-	8	刘辉先生,对外经济贸易大学硕士。2011年8月至2013年8月在中债资信评估有限责任公司任评级分析师。2013年8月加入国金基金管理有限公司,历任投资研究部固定收益分析师、基金交易部债券交易员、上海资管事业部投资经理、上海资管事业部基金经理;现任固定收益投资部基金经理。

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遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《国金众赢货币市场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。

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

上半年全球经济下行趋势比较确定,因此引发避险情绪升温以及主要国家央行货币政策开始出现转松信号。国内方面,GDP下滑至6.2%,而通胀受猪肉及果蔬价格拉动影响持续走高, 整体经济呈现微滞涨状态。需求端上看,净出口是今年上半年GDP增速的最主要支撑,弥补了上半年消费和投资增长放缓带来的缺口,但进口大幅弱于出口的顺差反应出内需疲弱,对于经济的支撑并不具有持续性。上半年投资增速下滑主要受房地产投资和制造业投资的拖累,基建投资在专项债带动下保持平稳。6月的消费大幅反弹主要是受到汽车国5转国6的清理库存降价促销推动,也并不具备持续性。供给方面,工业增加值整体走低,与需求端趋势保持一致。

面对经济下行压力,政府通过逆周期政策托底经济。货币政策上年初降准并开展首次TMLF,货币政策的宽松空间被打开。5月底包商事件爆发,央行及时通过投放大量OMO来稳定市场流动性。此外,财政政策同时发力,地方债额度提前下达,发行进度明显提前;发改委密集批复基建项目,财政支出提前发力。上半年资金面整体呈现宽松局面,资金价格逐步下行,但波动加大。债市方面,由于上半年市场预期变化比较快,利率债整体呈现宽幅震荡格局,并未形成单边趋势。信用债跟随利率债震荡,但由于宽信用政策效果显现,利好信用资产,信用市场走势较利率市场略强,信用利差整体收窄。

组合在报告期间内维持稳健操作风格,在控制流动性风险和信用风险的基础上,积极进行货币工具的配置,提升组合的收益水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金份额净值收益率为1.5232%,同期业绩比较基准收益率为0.6695%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年经济下行压力进一步增加。此前净出口受国内需求下滑影响在二季度对GDP是正向贡献, 在下半年预计会随着基数效应影响走低。固定资产投资里面,基建投资在专项债的带动下继续回升,制造业受制于PPI增速回落,房地产投资受到一系列的监管政策严控下将继续回落。通胀的高点预计出现在三季度,之后大概率走低。货币政策方面,外部美联储降息概率升温,主要国家央行将开启新一轮宽松周期;国内货币政策维持宽松,流动性将继续保持充裕状态,央行之前表示关注经济增长和价格变化预调微调,进一步宽松动力不强,但如果三季度经济数据明显恶化,也可能再放松。资金面此前虽然波动增加,但整体处于较低的水平, 进一步下降的空间比较有限。债市方面, 中美10年利差已经超过100bp,意味着债市长端下行的空间较大,但由于目前市场对于基本面的悲观预期和货币政策的放松预期已经反映的比较充分,利率能否进一步向下突破还需要数据和政策的再一步验证。另外,中美之间的博弈成为长期影响债市的不确定性因素。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会相关规定及基金合同关于估值的约定,严格执行内部估值控制程序,对基金所持有的投资品种进行估值。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构,估值委员会由公司督察长、投资总监、运营总监、清算业务负责人、研究部门负责人、风控业务负责人、合规业务负责人组成,可根据需要邀请产品托管行代表、公司独立董事、会计师事务所代表等外部人员参加。公司运营总监为公司基金估值委员会主席。运营支持部根据估值委员会的估值意见进行相关具体的估值调整或处理, 并负责与托管行进行估值结果的核对,运营支持部业务人员复核后使用。基金经理作为估值委员会的成员之一,在基金估值定价过程中, 充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议,参与估值方案提议的制定,但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。本基金管理人参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

公司与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》,并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配方式为红利再投资,免收再投资的费用;本基金根据每日基金收益情况,以每万份基金已实现收益为基础,为投资人每日计算当日收益并分配,并每日进行支付。

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

托管人声明,招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度,我行在履行托管职责中,严格遵守有关法律法规、托管协议的规定,尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款,对托管产品的投资行为进行监督,并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则,独立地设置、登录和保管本产品的全套账册,进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本半年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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:国金众赢货币市场证券投资基金

报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	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	6.4.7.1	5,039,140,693.15	5,918,256,689.22
结算备付金		1,000,084.50	-
存出保证金		63,256.29	-
交易性金融资产	6.4.7.2	14,044,212,361.31	14,039,203,586.41
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		13,203,178,702.82	13,338,877,586.41
资产支持证券投资		841,033,658.49	700,326,000.00
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	1,526,934,610.40	1,958,305,897.45
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	81,710,393.57	74,924,337.18
应收股利		-	-
应收申购款		8,727,761.29	49,891,329.18
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		20,701,789,160.51	22,040,581,839.44
负债和所有者权益	附注号	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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		31,049,833.42	1,196,320,005.51
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		4,588,611.27	4,558,537.88
应付托管费		849,742.81	844,173.69
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	143,740.68	237,945.28
应交税费		381,975.70	571,041.86
应付利息		7,312.33	726,524.80
应付利润		4,534,198.40	7,774,554.99
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	223,655.75	409,300.00
负债合计		41,779,070.36	1,211,442,084.01
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	20,660,010,090.15	20,829,139,755.43
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		20,660,010,090.15	20,829,139,755.43
负债和所有者权益总计		20,701,789,160.51	22,040,581,839.44

注: 报告截止日2019年6月30日, 国金众赢货币基金份额净值1.0000元,基金份额总额20,660,010,090.15份。

6.2 利润表

会计主体:国金众赢货币市场证券投资基金

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	附注号	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		376,214,930.28	613,356,435.06
1.利息收入		364,540,742.80	612,420,517.42
其中:存款利息收入	6.4.7.11	89,017,945.51	185,346,230.79
债券利息收入		234,195,272.78	260,926,992.64
资产支持证券利息收入		15,511,016.76	-
买入返售金融资产收入		25,816,507.75	166,147,293.99
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		11,674,138.87	935,917.64
其中:股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	11,674,138.87	935,917.64
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	-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	-	-
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	48.61	-
减:二、费用		51,416,768.60	48,505,597.81
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	28,780,562.46	35,780,653.58
2. 托管费	6.4.10.2.2	5,329,733.84	6,626,046.99
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	-	-
5. 利息支出		16,948,374.88	5,821,316.20
其中:卖出回购金融资产支出		16,948,374.88	5,821,316.20
6. 税金及附加		187,733.41	16,808.62
7. 其他费用	6.4.7.20	170,364.01	260,772.42
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		324,798,161.68	564,850,837.25
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		324,798,161.68	564,850,837.25

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:国金众赢货币市场证券投资基金

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)	20,829,139,755.43	-	20,829,139,755.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	324,798,161.68	324,798,161.68
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)	-169,129,665.28	-	-169,129,665.28
其中:1.基金申购款	42,160,636,044.83	-	42,160,636,044.83
2.基金赎回款	-42,329,765,710.11	-	-42,329,765,710.11
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)	-	-324,798,161.68	-324,798,161.68
五、期末所有者权益(基金净值)	20,660,010,090.15	-	20,660,010,090.15
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)	21,514,463,962.70	-	21,514,463,962.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	564,850,837.25	564,850,837.25
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)	3,702,290,886.44	-	3,702,290,886.44
其中:1.基金申购款	85,541,587,199.52	-	85,541,587,199.52
2.基金赎回款	-81,839,296,313.08	-	-81,839,296,313.08
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)	-	-564,850,837.25	-564,850,837.25
五、期末所有者权益(基金净值)	25,216,754,849.14	-	25,216,754,849.14

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:

_____尹 庆 军_____ _____聂 武 鹏_____ _____于晓莲_____

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

国金众赢货币市场证券投资基金(原名称为“国金通用众赢货币市场证券投资基金”以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]580号文的核准,由国金基金管理有限公司于2015年6月5日至2015年6月19日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所 (特殊普通合伙) 验证并出具(2015)验字第61004823_A03验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2015年6月25日正式生效,本基金为契约型开放式,存续期限不定。2015年9月23日,本基金名称由“国金通用众赢货币市场证券投资基金”变更为“国金众赢货币市场证券投资基金”。本基金设立时,首次募集(不含认购费)的有效净认购金额为人民币200,256,821.00 元,折合200,256,821.00 份基金份额;有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币39.06 元,折合39.06 份基金份额;以上收到的实收基金共计人民币200,256,860.06元,折合200,256,860.06 份基金份额。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,基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具, 包括现金,通知存款,短期融资券,一年以内(含一年)的银行定期存款和大额存单,剩余期限(或回售期限)在397天以内(含397天)的债券、剩余期限在397天以内(含397天)的中期票据、剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券,期限在一年以内(含一年)的债券回购,期限在一年以内(含一年)的中央银行票据,以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金的业绩比较基准为:人民币七天通知存款利率(税后)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下统称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号(年度报告和半年度报告)》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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净值变动情况。

6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.4.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.5 税项

1.增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税;国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税;存款利息收入不征收增值税;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定,金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定,金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定,资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人;

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,自2018年1月1日起,资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为 (以下简称“资管产品运营业务”),暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税,资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定,自2018年1月1日起,资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务,按照以下规定确定销售额:提供贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额;转让2017年12月31日前取得的股票(不包括限售股)、债券、基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价(2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票, 为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值 (中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加,以实际缴纳的增值税税额为计税依据,分别按规定的比例缴纳。

2.企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》 的规定, 对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

3.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。

6.4.6 关联方关系

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 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
北京千石创富资本管理有限公司	基金管理人的子公司
招商银行股份有限公司	基金托管人

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.7.1.2 债券交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.7.1.3 债券回购交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.7.1.4 权证交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

注:本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 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	28,780,562.46	35,780,653.58
其中:支付销售机构的客户维护费	12,080,980.65	12,953,396.41

注:1.本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.27%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.27%÷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,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前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。

6.4.7.2.2 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	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托管费	5,329,733.84	6,626,046.99

注: 本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.05%÷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,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前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。

6.4.7.2.3 销售服务费

注:无

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

本期 2019年1月1日至2019年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
招商银行	-	-	-	-	1,700,000,000.00	110,117.94
上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
招商银行	-	-	-	-	3,981,142,000.00	440,225.82

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 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
期初持有的基金份额	0.00	3,153,064.08
期间申购/买入总份额	3,787,881.54	67,828.26
减:期间赎回/卖出总份额	3,012,012.02	-
期末持有的基金份额	775,869.52	3,220,892.34
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0038%	0.0128%

注:基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

6.4.7.4.2 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
北京千石创富资本管理有限公司	10,009,772.17	0.0484%	-	-

注:除基金管理人之外的其他关联方持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

6.4.7.5 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
招商银行	1,140,693.15	90,829.68	7,425,630.76	161,000.66

注: 本基金的银行存款由基金托管人招商银行股份有限公司保管,按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.7.6 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。

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

无

6.4.8 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.8.2 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暂时停牌等流通受限股票。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末2019年6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为人民币31,049,833.42元,是以如下债券作为质押的:

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
150208	15国开08	2019年7月1日	100.97	345,000	34,834,650.00
合计				345,000	34,834,650.00

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9 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	固定收益投资	14,044,212,361