国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

2018 第二季度 报告

2018年6月30日

基金管理人：国金基金管理有限公司
基金托管人：平安银行股份有限公司
报告送出日期：2018年7月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年7月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年4月1日至2018年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国金鑫新灵活配置（LOF）
场内简称	国金鑫新灵活配置（LOF）
交易代码	501000
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2015年7月3日
报告期末基金份额总额	69,773,932.70份
投资目标	本基金通过合理的资产配置和积极的证券选择，追求在严格控制风险的前提下实现资本的长期稳健回报。
投资策略	本基金将根据对宏观经济周期和市场运行阶段的判断来确定投资组合中各大类资产的权重，在权益类资产投资方面，本基金将综合运用定量分析和定性分析手段，精选出具有内在价值和成长潜力的股票来构建股票投资组合，在固定收益类资产投资方面，本基金全深入研究分析宏观经济和利率趋势，选择流动性好、预期收益率与信用质量相对较高的债券品种进行投资。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：一年期银行定期存款利率（税后）×3%
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。
基金管理人	国金基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司

注：无。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2018年4月1日 - 2018年6月30日）
1.本期已实现收益	2,781,242.93
2.本期利润	-3,706,997.54
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0530
4.期末基金资产净值	77,568,431.11
5.期末基金份额净值	1.112

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损益。

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。

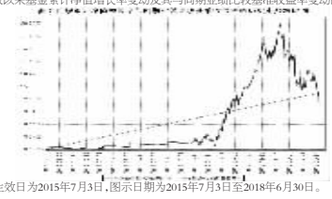
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
过去三个月	-4.55%	0.93%	1.01%	0.01%	-5.56%	0.92%

注：本基金的业绩比较基准为：一年期银行定期存款利率（税后）+3%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



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。

3.3 其他指标

注：无

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
宫雪	本基金基金经理，国金300指数增强、国金上证50、国金鑫瑞灵活基金经理，量化投资事业三部总经理	2015年7月3日	-	10	宫雪女士，中国科学院博士，2008年7月至2011年12月在博时基金管理有限公司股票投资部，任产业分析师；2012年2月至今在国金基金管理有限公司，历任产品经理、行业分析师、产品与金融工程部副总经理、指数投资部副总经理、指数投资事业部总经理，自2016年4月起任量化投资事业三部总经理。

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 管理人对投资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》《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《国金基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定，通过制度、流程和系统等方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下所有投资组合。在投资决策内部控制方面，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；在交易执行控制方面，通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；在行为监控和分析评估方面，通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控，确保做好公平交易的监控和分析。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，国金鑫新灵活配置（LOF）基金单位份额净值1.112元，累计单位净值1.112元。报告期内，本基金份额净值增长率-4.55%，同期业绩比较基准增长率1.01%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金资产的比例（%）
1	权益投资	61,705,435.04	79.05
	其中：股票	61,705,435.04	79.05
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	16,306,132.84	20.89
8	其他资产	46,884.99	0.06
9	合计	78,058,452.87	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	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
E	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
H	住宿和餐饮业	-	-
I	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	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.10
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	61,705,435.04	79.55

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依据。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 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股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	112,300	6,578,534.00	8.48
2	600519	贵州茅台	7,200	5,266,512.00	6.79
3	600036	招商银行	147,300	3,894,612.00	5.02
4	603156	养元饮品	52,804	2,896,827.44	3.73
5	601166	兴业银行	179,100	2,579,040.00	3.32
6	600887	伊利股份	89,500	2,497,050.00	3.22
7	600016	民生银行	340,300	2,382,100.00	3.07
8	601328	交通银行	394,300	2,263,282.00	2.92
9	601288	农业银行	546,700	1,880,648.00	2.42
10	600030	中信证券	112,300	1,860,811.00	2.40

5.4 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。

5.5 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债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

5.6 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资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
-	-	-	-	-	报告期内，本基金运用股指期货是出于追求基金充分投资，减少交易成本、降低跟踪误差的目的，总体风险可控且符合既定的投资政策和投资目标。
股指期货投资本期收益（元）					-57,125.24
股指期货投资本期公允价值变动（元）					0.00

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

报告期内，本基金投资于流动性较好的股指期货，用于对冲部分股票资产的下跌风险。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

报告期，本基金未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

本期基金投资组合前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	9,445.84
2	应收证券清算款	6,769,566.09
3	应收股利	-
4	应收利息	1,485.68
5	应收申购款	134,677.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,915,174.98

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	603156	养元饮品	2,896,827.44	7.89	非公开发行

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	70,025,329.40
报告期期间基金总申购份额	60,490.00
减：报告期期间基金总赎回份额	311,886.70
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
报告期期末基金份额总额	69,773,932.70

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本报告期，基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	2018年4月1日至2018年6月30日	68,640,048.17	0.00	0.00	68,640,048.17	98.37%
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有份额占比达到或超过20%的情形，由此可能导致的特有风险包括：产品流动性风险、巨额赎回风险以及净值波动风险等。本基金管理人将持续加强投资者集中度管理，审慎确认大额申购与大额赎回，同时进一步完善流动性风险管控机制，加强对基金份额持有人利益的保护。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，基金管理人根据《证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定，在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站进行了如下信息披露：

1.2018年04月21日披露了《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2018年第1季度报告》；

2.2018年04月26日披露了《国金基金管理有限公司关于公司直销系统升级的公告》；

3.2018年06月16日披露了《国金基金管理有限公司关于增加风凰金信（银川）基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告》；

4.2018年06月29日披露了《国金基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告》。

本报告期内，基金管理人按照《证券投资基金信息披露管理办法》的规定每个开放日公布基金份额净值和基金份额累计净值。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1.中国证监会核准基金募集的文件；

2.国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金基金合同；

3.国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金托管协议；

4.国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）；

5.基金管理人业务资格批件、营业执照；

6.基金托管人业务资格批件、营业执照；

7.报告期内披露的各项公告。

9.2 存放地点

北京市海淀区西三环北路87号国际财经中心D座14层。

9.3 查阅方式

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

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：4000-2000-18

公司网址：www.gfund.com

国金基金管理有限公司
2018年7月20日

国金上证50指数分级证券投资基金

2018 第二季度 报告

2018年6月30日

基金管理人：国金基金管理有限公司
基金托管人：中国民生银行股份有限公司
报告送出日期：2018年7月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年7月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年4月1日至2018年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国金上证50
场内简称	国金上证50
交易代码	502020
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5月27日
报告期末基金份额总额	40,818,994.90份
投资目标	采用指数化投资策略，紧密跟踪上证50指数，力争获取与标的指数相似的投资收益，并将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差偏离度绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。
投资策略	本基金采用指数完全复制方法，按照标的指数成份股及权重构建基金的投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整，以达到跟踪标的指数的目的，力争保持基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差偏离度绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。如遇特殊情况（如市场流动性不足、个别成份股被限制投资、法律法规禁止或限制投资等）致使基金无法按照足额数量的股票时，基金管理人将对投资组合管理进行适当变通和调整，并运用股指期货等金融衍生工具，以实现对跟踪误差的有效控制。
业绩比较基准	95%×上证50指数收益率+5%×同期银行活期存款利率（税后）。
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，从本基金三类基金份额来看，国金上证50份额具有与标的指数及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，国金上证50A份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征，国金上证50B份额具有高预期风险、高预期收益的特征。
基金管理人	国金基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	国金50A	国金50B	国金50
下属分级基金的内简称	国金50A	国金50B	国金50
下属分级基金的交易代码	502021	502022	502020
报告期末下属分级基金的份额总额	1,762,129.00份	1,762,129.00份	37,294,736.90份
下属分级基金的风险收益特征	国金上证50A份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征。	国金上证50B份额具有高预期风险、高预期收益的特征。	国金上证50份额具有与标的指数及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

注：无。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2018年4月1日 - 2018年6月30日）
1.本期已实现收益	2,470,365.90
2.本期利润	-2,871,936.85
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0314
4.期末基金资产净值	36,728,725.19
5.期末基金份额净值	0.900

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损益。

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。

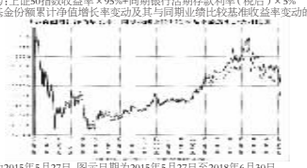
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
过去三个月	-4.96%	1.11%	-8.45%	1.09%	3.49%	0.02%

注：本基金的业绩比较基准为：上证50指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%

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



注：本基金基金合同生效日为2015年5月27日，图示日期为2015年5月27日至2018年6月30日。

3.3 其他指标

注：无

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
宫雪	本基金基金经理，国金300指数增强、国金上证50、国金鑫瑞灵活基金经理，量化投资事业三部总经理	2015年5月27日	-	10	宫雪女士，中国科学院博士，2008年7月至2011年12月在博时基金管理有限公司股票投资部，任产业分析师；2012年2月至今在国金基金管理有限公司，历任产品经理、行业分析师、产品与金融工程部副总经理、指数投资部副总经理、指数投资事业部总经理，自2016年4月起任量化投资事业三部总经理。

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 管理人对投资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》和其他有关法律法规的规定，以及《国金上证50指数分级证券投资基金基金合同》的约定，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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《国金基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定，通过制度、流程和系统等方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下所有投资组合。在投资决策内部控制方面，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；在交易执行控制方面，通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；在行为监控和分析评估方面，通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控，确保做好公平交易的监控和分析。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2018年6月30日，本基金单位份额净值1.0033元，累计单位净值1.0033元。报告期内，本基金份额净值增长率为-3.78%，同期业绩比较基准收益率为-3.98%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期，本基金未出现基金资产净值低于五千万元的情形。本基金存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形，出现该情况的时间范围为2018年3月7日至2018年5月8日。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	34,865,805.21	77.54
	其中：股票	34,865,805.21	77.54
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	3,184,742.01	7.08
8	其他资产	6,915,174.98	15.38
9	合计	44,965,722.20	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	1,327,103.00	3.61
C	制造业	6,973,687.38	18.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,839,561.00	5.01
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	548,561.00	1.49
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	320,292.00	0.87
J	金融业	17,744,661.03	48.31
K	房地产业	986,835.00	2.69
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	29,740,700.41	80.97

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依据。

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	4,962,958.66	13.51
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	80,920.00	0.22
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	81,226.14	0.22
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	5,125,104.80	13.95

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依据。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 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股票投资明细

5.3.1 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股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	75,700	4,434,506.00	12.07
2	600519	贵州茅台	3,478	2,544,017.88	6.93
3	600036	招商银行	72,100	1,906,324.00	5.19
4	601166	兴业银行	87,100	1,254,240.00	3.41
5	600887	伊利股份	42,500	1,185,750.00	3.23
6	600016	民生银行	165,200	1,156,400.00	3.15
7	601328	交通银行	192,000	1,102,080.00	3.00
8	601288	农业银行	267,200	919,168.00	2.50
9	600030	中信证券	55,000	911,350.00	2.48
10	600104	上汽集团	24,500	857,255.00	2.33

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603156	养元饮品	52,804	2,896,827.44	7.89
2	600276	恒瑞医药	15,400	1,166,704.00	3.18
3	600309	万华化学	11,500	522,330.00	1.42
4	600703	三安光电	17,100	328,662.00	0.89
5	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.22

5.4 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。

5.5 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债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

5.6 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资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
-	-	-	-	-	报告期内，本基金运用股指期货是出于追求基金充分投资，减少交易成本、降低跟踪误差的目的，总体风险可控且符合既定的投资政策和投资目标。
股指期货投资本期收益（元）					-410,400.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					306,660.00

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

报告期，本基金运用股指期货来控制预期大额申购赎回等情况下的流动性风险，有效减少基金组合资产配置与跟踪标的之间的差距，确保投资组合与指数跟踪的效果。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

报告期，本基金未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

本期基金投资组合前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	9,445.84
2	应收证券清算款	6,769,566.09
3	应收股利	-
4	应收利息	1,485.68
5	应收申购款	134,677.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,915,174.98

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	603156	养元饮品	2,896,827.44	7.89	非公开发行

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	1,776,579.00
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-14,450.00
报告期期末基金份额总额	1,762,129.00

注：拆分变动份额为本基金二级份额之间配对转换及基金份额拆/并算的变动份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本报告期基金管理人未投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	2018年4月1日至2018年6月13日	21,280,108	-	21,280,108	-	0.00%
	2	2018年6月14日至2018年6月28日	13,442,317	49,855,419	58,752,200	4,545,536	11.14%
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有份额占比达到或超过20%的情形，由此可能导致的特有风险包括：产品流动性风险、巨额赎回风险以及净值波动风险等。本基金管理人将持续加强投资者集中度管理，审慎确认大额申购与大额赎回，同时进一步完善流动性风险管控机制，加强对基金份额持有人利益的保护。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，基金管理人根据《证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定，在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站进行了如下信息披露：

1.2018年04月21日披露了《国金上证50指数分级证券投资基金2018年第1季度报告》；

2.2018年04月26日披露了《国金基金管理有限公司关于公司直销系统升级的公告》；

3.2018年06月29日披露了《国金基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告》。

本报告期内，基金管理人按照《证券投资基金信息披露管理办法》的规定每个开放日公布基金份额净值。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1.中国证监会核准基金募集的文件；

2.国