

国金及第七天理财债券型证券投资基金

2019 第二季度 报告

2019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:2019年7月18日

\$1 重要提示
基金管理人的董事会及监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2019年7月17日核对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未来表现。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。
本报告例示自2019年4月1日至2019年6月30日止。

\$2 基金产品概况

基金名称	国金及第七天理财债券型证券投资基金
基金简称	国金及第七天理财
基金代码	-
成立日期	2008年2月20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
注:无	

\$3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年4月1日-2019年6月30日)	本报告期
1.本期利润	3,076,499.62	
2.本期收入	3,076,499.62	
3.本期赎回金额	210,607,675.85	

注: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,本期利润为本基金已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于本基金采用摊余成本核算,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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金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

报告期	净值增长(%)	净值增长标准差(%)	业绩比较基准收益率(%)	①-③	②-④
过去三个月	0.33%	0.00%	0.38%	0.00%	0.00%
过去六个月	0.64%	0.00%	0.64%	0.00%	0.00%
过去一年	1.00%	0.00%	1.00%	0.00%	0.00%
过去三年	2.00%	0.00%	2.00%	0.00%	0.00%
过去五年	2.00%	0.00%	2.00%	0.00%	0.00%

注:本基金的业绩比较基准为人民币七天通知存款的税后收益。

3.2.2 本基金当期生息来衡量基金资产变化及其与同期业绩比较基准收益变动的比较



注:本基金第四季度为2016年4月1日至2019年6月30日。

4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介	姓名	性别	本基金的基金经理	任本基金的基金经理时间	说明
徐伟华	男	国金基金管理有限公司	2019年6月11日	-	II

(注:(1)任职日期和离任日期均根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期,前任基金经理的任职日期即为基金合同生效日;(2)证券从业年限包括基金管理人所控制的证券投资基金从业经历。)

4.2 管理人报告期内本基金运作报告情况的说明

报告期内,基金管理人所投组合参与的交易所公开竞价的交易,出现同向反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当年日均成交量的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,本基金严格按照《基金合同》的规定执行,严格遵守法律法规、行业监管规定、自律规则以及本基金合同的约定,在充分考虑流动性风险、信用风险、利率风险、操作风险、合规风险的基础上,严格执行投资比例限制,通过定期报告评估方法、DTT模型对持仓进行定期跟踪,确保公平交易、防范利益冲突、抑制操控风险、提升投资组合的稳定性,确保基金净值波动率较低,力争投资组合的收益水平。

4.5 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金未发现存在异常交易行为,且不存在影响交易价格或秩序的异常情况。

4.6 报告期内基金绩效评价结果

本基金的绩效评价结果为90.40%,同期业绩比较基准收益率为3.66%。

4.7 报告期内基金组合类产品的报告

本基金报告期内未有基金组合类产品的报告。

4.8 报告期内基金投资组合的重大关联交易

本基金报告期内未有基金投资组合的重大关联交易。

4.9 报告期内基金的抵押、质押及其他运用基金的情况

本基金报告期内未有基金的抵押、质押及其他运用基金的情况。

4.10 报告期内基金投资资产支持证券情况

本基金报告期内未有基金投资资产支持证券的情况。

4.11 报告期内基金投资国债期货情况

本基金报告期内未有基金投资国债期货的情况。

4.12 报告期内基金投资股票期权情况

本基金报告期内未有基金投资股票期权的情况。

4.13 报告期内基金投资商品期货、商品期权情况

本基金报告期内未有基金投资商品期货、商品期权的情况。

4.14 报告期内基金投资商品互换情况

本基金报告期内未有基金投资商品互换的情况。

4.15 报告期内基金投资嵌入式衍生工具情况

本基金报告期内未有基金投资嵌入式衍生工具的情况。

4.16 报告期内基金投资匿名衍生工具情况

本基金报告期内未有基金投资匿名衍生工具的情况。

4.17 报告期内基金投资远期合约情况

本基金报告期内未有基金投资远期合约的情况。

4.18 报告期内基金投资互换情况

本基金报告期内未有基金投资互换的情况。

4.19 报告期内基金投资商品及金融衍生工具情况

本基金报告期内未有基金投资商品及金融衍生工具的情况。

4.20 报告期内基金投资黄金衍生工具情况

本基金报告期内未有基金投资黄金衍生工具的情况。

4.21 报告期内基金投资普通股情况

本基金报告期内未有基金投资普通股的情况。

4.22 报告期内基金投资优先股情况

本基金报告期内未有基金投资优先股的情况。

4.23 报告期内基金投资权证情况

本基金报告期内未有基金投资权证的情况。

4.24 报告期内基金投资港股通情况

本基金报告期内未有基金投资港股通的情况。

4.25 报告期内基金投资基础设施证券投资基金情况

本基金报告期内未有基金投资基础设施证券投资基金的情况。

4.26 报告期内基金投资存托凭证情况

本基金报告期内未有基金投资存托凭证的情况。

4.27 报告期内基金投资商品及金融衍生工具情况

本基金报告期内未有基金投资商品及金融衍生工具的情况。

4.28 报告期内基金投资普通股情况

本基金报告期内未有基金投资普通股的情况。

4.29 报告期内基金投资优先股情况

本基金报告期内未有基金投资优先股的情况。

4.30 报告期内基金投资权证情况

本基金报告期内未有基金投资权证的情况。

4.31 报告期内基金投资港股通情况

本基金报告期内未有基金投资港股通的情况。

4.32 报告期内基金投资存托凭证情况

本基金报告期内未有基金投资存托凭证的情况。

4.33 报告期内基金投资商品及金融衍生工具情况

本基金报告期内未有基金投资商品及金融衍生工具的情况。

4.34 报告期内基金投资普通股情况

本基金报告期内未有基金投资普通股的情况。

4.35 报告期内基金投资优先股情况

本基金报告期内未有基金投资优先股的情况。

4.36 报告期内基金投资权证情况

本基金报告期内未有基金投资权证的情况。

4.37 报告期内基金投资港股通情况

本基金报告期内未有基金投资港股通的情况。

4.38 报告期内基金投资存托凭证情况

本基金报告期内未有基金投资存托凭证的情况。

4.39 报告期内基金投资商品及金融衍生工具情况

本基金报告期内未有基金投资商品及金融衍生工具的情况。

4.40 报告期内基金投资普通股情况

本基金报告期内未有基金投资普通股的情况。

4.41 报告期内基金投资优先股情况

本基金报告期内未有基金投资优先股的情况。

4.42 报告期内基金投资权证情况

本基金报告期内未有基金投资权证的情况。

4.43 报告期内基金投资港股通情况

本基金报告期内未有基金投资港股通的情况。

4.44 报告期内基金投资存托凭证情况

本基金报告期内未有基金投资存托凭证的情况。

4.45 报告期内基金投资商品及金融衍生工具情况

本基金报告期内未有基金投资商品及金融衍生工具的情况。

4.46 报告期内基金投资普通股情况

本基金报告期内未有基金投资普通股的情况。

4.47 报告期内基金投资优先股情况

本基金报告期内未有基金投资优先股的情况。

4.48 报告期内基金投资权证情况

本基金报告期内未有基金投资权证的情况。

4.49 报告期内基金投资港股通情况

本基金报告期内未有基金投资港股通的情况。

4.50 报告期内基金投资存托凭证情况

本基金报告期内未有基金投资存托凭证的情况。

4.51 报告期内基金投资商品及金融衍生工具情况

本基金报告期内未有基金投资商品及金融衍生工具的情况。

4.52 报告期内基金投资普通股情况

本基金报告期内未有基金投资普通股的情况。

4.53 报告期内基金投资优先股情况

本基金报告期内未有基金投资优先股的情况。

4.54 报告期内基金投资权证情况

本基金报告期内未有基金投资权证的情况。

4.55 报告期内基金投资港股通情况

本基金报告期内未有基金投资港股通的情况。

4.56 报告期内基金投资存托凭证情况

本基金报告期内未有基金投资存托凭证的情况。