国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

基金管理人：国金通用基金管理有限公司
基金托管人：中国光大银行股份有限公司
送出日期：2013年8月24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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年8月23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2013年1月1日起至2013年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	国金通用国鑫发起
基金主代码	762001
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	2012年8月28日
基金管理人	国金通用基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	57,815,798.22份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

注：本基金为发起式基金。

2.2 基金产品说明

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，本基金会深入研究分析宏观经济和利率趋势，选择流动性好，到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	60%×沪深300指数收益率+40%×上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。

注：本基金为发起式基金。

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		国金通用基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	徐炜瑜	张建春
	联系电话	010-88005601	010-63639180
	电子邮箱	xuweiyu@gfund.com	zhangjianchun@cebbank.com
客户服务电话		4000-2000-18	95595
传真		010-88005666	010-63639132

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(2013年1月1日 - 2013年6月30日)
本期已实现收益	4,379,522.57
本期利润	760,954.31
加权平均基金份额本期利润	0.0100
本期基金份额净值增长率	-1.73%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2013年6月30日)**
期末可供分配基金份额利润	-0.0298
期末基金资产净值	56,094,867.98
期末基金份额净值	0.9702

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。

2.期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分）抵补未实现部分。

3.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。

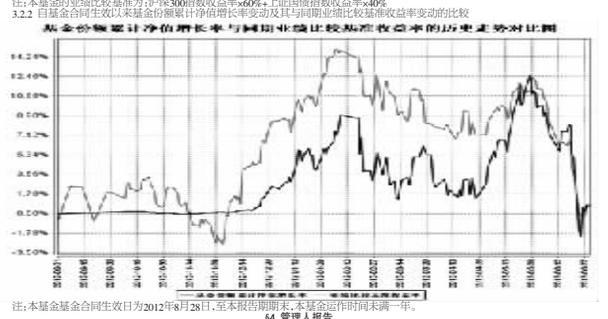
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	-8.17%	1.83%	-9.44%	1.12%	1.27%	0.71%
过去三个月	-4.42%	1.32%	-6.81%	0.87%	2.39%	0.45%
过去六个月	-1.73%	1.15%	-6.96%	0.90%	5.23%	0.25%
自基金合同生效起至今	0.66%	0.91%	0.82%	0.92%	-0.16%	-0.01%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%

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2012年8月28日，至本报告期期末，本基金运作时间未满一年。

§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

国金通用基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会《监监许可［2011］661号》批准，于2011年11月2日成立，总部设在北京。2012年9月公司注册资本由1.6亿元人民币增加至2.8亿元人民币。公司股东为国金证券股份有限公司、苏州工业园区地产经营管理公司、广东宝丽华新能源股份有限公司、中国通用技术（集团）控股有限责任公司，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%。截至2013年6月30日，国金通用基金管理有限公司共管理一只开放式基金——国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金。

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		
吴强	本基金基金经理、投资研究部总经理	2012年8月28日	-	13	吴强先生，江西财经大学学士、上海财经大学硕士。历任上海创达投资管理公司研究员、上海高维化学公司总经理助理、嘉新水泥（中国）控股股份有限公司证券部经理、国金通用基金管理有限公司行业分析师、投资研究部总经理。
徐艳芳	本基金基金经理	2013年2月27日	-	4	徐艳芳女士，中国青年政治学院学士、清华大学硕士，历任香港昊天财经公关公司咨询师、英大泰和财产保险股份有限公司投资经理、国金通用基金管理有限公司固定收益投资分析师。

注：1.任职日期和离任日期均指本基金管理人作出决定后正式对外公告之日；担任本基金管理人基金经理的，任职日期为基金合同生效日。

2.证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员基本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》、《证券投资基金运作管理办法》、《国金通用国鑫灵活配置混合型发起式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

在本报告期，本基金管理人仅管理一只基金产品，不存在非公平交易情况。

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《国金通用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。

在投资决策内部控制方面，本基金管理人建立了统一的投资决策管理平台和全公司适用的投资对象备选库和交易对象备选库，确保各投资组合在获取研究信息、投资建议及实施投资决策方面享有平等的机会。健全投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内自主决策。建立投资组合投资信息的管理及保密制度，通过岗位设置、制度约束、技术手段相结合的方式，对待全和交易等重大非公开投资信息实现保密措施。

在交易执行控制方面，本基金管理人实行集中交易制度，基金交易部运用交易系统中设置的公平交易功能并按照时间优先、价格优先的原则严格执行所有指令，对于一笔市场中购等场外交易，按照公平交易原则建立和完善了相关分配机制。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了对异常交易的监控制度，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

2013年上半年，A股市场呈现震荡态势，年初出于对经济回暖的乐观预期市场明显上涨，但随着各项宏观经济数据低于预期，市场回吐了之前涨幅，临近年中，资金面趋紧、宏观经济增长乏力等因素重新导致市场回落，银行间市场空前的资金紧张状况引发市场恐慌情绪，股指出现快速下跌。综合来看，上半年A股市场出现明显分化，以创业板为首的成长股明显跑赢沪深300成分股，体现了经济转型期的阵痛特点。本基金在报告期的操作中，总体上保持较为灵活的投资策略，积极跟踪宏观和中观各项数据的变化，平衡股票和债券的配置比例，主动调整大类资产和行业配置来应对市场波动。行业选择方面，竞争优势可持续长期的非周期行业是我们长期关注的重点。报告期内，本基金净值小幅下跌，跑赢了业绩比较基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止至2013年6月30日，本基金份额净值为0.9702，累计单位净值为1.0102元，本报告期份额净值增长率为-1.73%，同期业绩比较基准增长率为-6.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2013年下半年，中国经济继续面临挑战，美联储QE退出渐近，国内基建投资与房地产开发投资存在回落风险，消费、出口增长动力偏弱，金融和实体领域的去杠杆带来的流动性趋紧将逐步对实体经济产生影响。宏观经济总体疲软的压时，市场对中央政府政策在下半年有较多期待，各项改革措施或将陆续推出，虽然会短期阵痛，但是相信改革会使中国经济长期受益。证券市场在经历了一季度的大幅下跌后，预计将出现一定的反弹迹象格，疲弱的经济基本面状况和环比趋紧的流动性状况制约指数总体表现，行业和股块继续分化，优质成长股和大消费板块中有较多投资机会。

感谢各位投资者的支持，本基金将根据拟握机会，坚持国金通用基金管理有限公司《勤用心为老百姓赚钱的财富管理公司》的愿景，规范运作，审慎投资，勤勉尽责的为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，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，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金会计法律法规，具备较强专业潜在能力的基金经理、数量研究员、风险管理人员、监察稽核人员及基金清算人员组成。基金清算部根据估值委员会的估值意见进行相关技术的估值调整改处理，并负责与托管行进行估值结果的核对，涉及模型定价的，由数量研究员和风险控制人员向基金清算部提供模型定价的结果，基金清算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》，并依照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

本基金每年收益分配次数最多为6次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的10%，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。

报告期内，本基金于2013年5月15日发布《国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金分红公告》，以2013年5月10日为分配基准日，实施了本年度第一次分红，分红金额为0.47万元份基金份额。

§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

2013年上半年，中国光大银行股份有限公司在国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定，依法安全托管了基金的全部资产，对国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，或实质用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人的应尽职责义务。

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

2013年上半年，中国光大银行股份有限公司依照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人——国金通用基金管理有限公司的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规的要求，各重要方面出投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人——国金通用基金管理有限公司编制的《国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金2013年半年度报告》进行了复核，报告中相关财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容是真实、准确的。

§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：国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2013年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资 产：			
银行存款		3,215,169.18	6,502,011.57
结算备付金		1,228,197.61	2,981,818.18
存出保证金		237,906.34	250,000.00
交易性金融资产		46,576,666.61	93,571,032.73
其中：股票投资		27,146,606.72	36,556,032.73
基金投资		-	-
债券投资		19,430,059.89	57,015,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		5,000,000.00	9,700,000.00
应收证券清算款		1,194,759.78	5,399,823.41
应收利息		579,886.95	525,496.79
应收股利		-	-
应收申购款		11,067.20	296.44
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		58,043,653.67	118,930,479.12
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2013年6月30日**	**上年度末 2012年12月31日**
负 债：			
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		-	-
应付证券清算款		1,137,029.94	3,532,544.07
应付赎回款		80,776.97	1,962,792.05
应付管理人报酬		73,613.18	149,419.76
应付托管费		12,268.87	24,903.29
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		417,142.83	65,740.37
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		227,953.90	336,897.36
负债合计		1,948,785.69	6,072,296.90
所有者权益：			
实收基金		57,815,798.22	110,175,572.03
未分配利润		-1,720,930.24	2,682,610.19
所有者权益合计		56,094,867.98	112,858,182.22
负债和所有者权益总计		58,043,653.67	118,930,479.12

注：2013年6月30日，基金份额净值人民币0.9702元，基金份额总额57,815,798.22份。

2.本期财务报表上年度的实际编制期间系2012年8月28日（基金合同生效日）至2012年12月31日止。

6.2 利润表

会计主体：国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2013年1月1日 至 2013年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入		2,942,457.30	-
1.利息收入		677,097.25	-
其中：存款利息收入		49,647.35	-
债券利息收入		599,731.13	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		27,718.77	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以"-"填列）		5,813,166.04	-
其中：股票投资收益		4,986,596.45	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		481,898.22	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		344,671.37	-
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）		-3,618,568.26	-
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）		-	-
5.其他收入（损失以"-"号填列）		70,762.27	-
减：二、费用		2,181,502.99	-
1.管理人报酬		592,946.73	-
2.托管费		98,824.44	-
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		1,167,447.74	-
5.利息支出		81,944.61	-
其中：卖出回购金融资产支出		81,944.61	-
6.其他费用		240,339.47	-
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）		760,954.31	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）		760,954.31	-

注：本基金基金合同于2012年8月28日起生效，无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2013年1月1日 至 2013年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013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）	110,175,572.03	2,682,610.19	112,858,182.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	760,954.31	760,954.31
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）	-52,359,773.81	-2,594,178.97	-54,953,952.78
其中：1.基金申购款	1,546,085.30	106,615.68	1,652,700.98
2.基金赎回款	-53,905,859.11	-2,700,794.65	-56,606,653.76
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）	-	-2,570,315.77	-2,570,315.77
五、期末所有者权益（基金净值）	57,815,798.22	-1,720,930.24	56,094,867.98

项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-	-
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	-	-	-

注：本基金基金合同于2012年8月28日起生效，无上年度可比期间数据。

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：

王小安 毛伟

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

国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金（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［2012］953号文件批准，由国金通用基金管理有限公司于2012年8月13日至2012年8月24日向社会公开募集。募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明（2012）验字第61004823_A01号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料，基金合同于2012年8月28日生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。首次募集扣除认购费后的有效净认购金额为人民币178,508,167.97元，折合178,508,167.97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24,651.66元，折合24,651.66份基金份额；以上收到的实收基金共计人民币178,532,819.63元，折合178,532,819.63份基金份额。本基金的基金管理人为国金通用基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

本基金为发起式基金。基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为100万份以上；基金经理持有本基金份额总量的数量区间为50万份-100万份（含）。基金管理人的股东：国金证券股份有限公司认购本基金份额2,000,482.40份，占本基金份额的1.12%。基金管理人的股东广东宝丽华新能源股份有限公司认购本基金份额6,500,650.10份，占本基金份额的3.64%。根据《国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》的规定，基金管理人股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员、基金经理等人员资金认购本基金的金额不少于人民币1,000万元，且承诺认购的本基金份额持有期不少于3年。

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股票（含中小板股票、创业板股票，以及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、债券、可转换债券（含分离交易可转债）、资产支持证券、银行存款、货币市场工具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：本基金股票投资占基金资产的比例为80%-80%，权证投资占基金资产净值的比例为0-3%，债券及其他金融工具投资占基金资产的比例为20%-70%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券合计比例不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为：60%×沪深300指数收益率+40%×上证国债指数收益率。

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2006年2月颁布的《企业会计准则——基本准则》和138项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称"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，也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>、<企业会计准则——应用指南>有关事项的通知》、《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2013年6月30日的财务状况以及2013年1月1日至2013年6月30日止会计期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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

本基金本报告期无需要说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局印发决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局印发决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税［2005］103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税［2004］78号《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，继续给予营业税和企业所得税免税。

根据财政部、国家税务总局财税［2005］103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税［2008］1号《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［2002］128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税［2005］107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自2005年6月13日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税［2005］102号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按50%计算应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局财税［2005］103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税［2008］132号《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》，自2008年10月9日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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

本报告期内未发生变化。

6.4.7.2 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
国金通用基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
中国光大银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
国金证券股份有限公司	基金管理人股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国金证券	223,218,060.40	25.27%	-	-

注：本基金基金合同于2012年8月28日起生效，无上年度可比期间数据。

债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国金证券	6,963,547.67	17.71%	-	-

注：本基金基金合同于2012年8月28日起生效，无上年度可比期间数据。

债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国金证券	108,500,000.00	24.11%	-	-

注：本基金基金合同于2012年8月28日起生效，无上年度可比期间数据。

6.4.8.1.2 权证交易

注：1.本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

2.本基金基金合同于2012年8月28日起生效，无上年度可比期间数据。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国金证券	158,572.43	25.62%	-	-

关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例

注：1.上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2.该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

3.本基金基金合同于2012年8月28日起生效，无上年度可比期间数据。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	592,946.73	-
其中：支付销售机构的客户维护费	105,803.43	-

注：1.本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费计算方法如下：

H=E×1.50%/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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前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。

3.本基金基金合同于2012年8月28日起生效，无上年度可比期间数据。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	98,824.44	-

注：1.本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.25%/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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前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。

2.本基金基金合同于2012年8月28日起生效，无上年度可比期间数据。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：1.本基金本报告期未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（回购）交易。

2.本基金基金合同于2012年8月28日起生效，无上年度可比期间数据。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
基金合同生效日（2012年8月28日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注：1.本基金本报告期末未持有投资于关联方承销证券的情况。

2.本基金基金合同于2012年8月28日起生效，无上年度可比期间数据。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无

6.4.9 期末（2013年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601886	江河创建	2013年6月20日	重大事项	12.19	2013年7月16日	13.78	220,000	2,891,849.00	2,681,800.00	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

§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	27,146,606.72	46.77
	其中：股票	27,146,606.72	46.77
2	固定收益投资	19,430,059.89	33.47
	其中：债券	19,430,059.89	33.47
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	5,000,000.00	8.61
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计