国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金

2014 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:2015年3月30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2015年3月27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已经审计,安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2014年1月1日起至2014年12月31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
场内简称	–
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	64,912,868.61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:无。

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: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

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.gfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2014年	2013年	2012年8月28日(基金合同生效日)-2012年12月31日
本期已实现收益	15,222,639.60	6,398,217.55	1,212,414.21
本期利润	25,707,281.77	3,260,162.20	2,828,628.32
加权平均基金份额本期利润	0.5132	0.0498	0.0210
本期基金份额净值增长率	57.12%	2.89%	2.43%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额利润	0.1457	-0.0412	0.0099
期末基金资产净值	84,118,762.15	69,846,199.59	112,858,182.22
期末基金份额净值	1.2959	0.9588	1.0243

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(已实现部分相抵未实现部分)。

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。

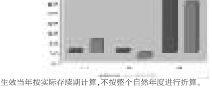
3.2 基金净值表现

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

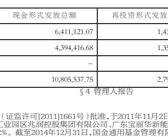
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	31.95%	1.88%	25.54%	0.99%	6.41%	0.89%
过去六个月	54.10%	1.44%	35.92%	0.79%	18.18%	0.65%
过去一年	57.12%	1.31%	31.20%	0.73%	25.92%	0.58%
自基金合同生效起至今	65.59%	1.06%	37.79%	0.79%	27.80%	0.27%

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



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金基金合同生效日为2013年7月26日,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2014	2.00	6,411,121.07	1,435,796.52	7,846,917.59	
2013	1.00	4,394,416.68	1,355,978.17	5,750,394.85	
2012	–	–	–	–	
合计	3.00	10,805,537.75	2,791,774.69	13,597,312.44	

§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(证监许可[2011]1661号)批准,于2011年11月2日月成立,总部设在北京。2012年9月公司的注册资本由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、苏州工业园区兆润控股集团有限公司、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2014年12月31日,国金通用基金管理有限公司共管理6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、国金通用沪深300指数分级证券投资基金、国金通用鑫盈货币市场证券投资基金、国金通用鑫利分级债券型证券投资基金、国金通用金腾通货币市场证券投资基金、国金通用鑫安保本混合型证券投资基金。

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		
徐艳芳	本基金基金经理	2013年2月27日	–	6	徐艳芳女士,中国青年政治学院学士、清华大学硕士,历任香港皓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;截止至本报告公告之日,徐艳芳女士同时兼任国金通用鑫盈货币基金、国金通用鑫利分级债基金、国金通用金腾通货币基金的基金经理。
齐达铮	基金经理	2013年8月10日	–	8	齐达铮先生,北京师范大学文学学士、经济学学士。历任有色金属技术经济研究院分析员、国金证券股份有限公司交易员、云南国际信托有限公司资产管理总部交易员、分析员等职,2012年3月加入国金通用基金管理有限公司,担任行业分析员、基金经理助理等职,2013年8月10日起任本基金基金经理。
滕祖光	基金经理	2014年4月11日	–	9	滕祖光先生,东北财经大学管理学学士。历任中国工商银行深圳分行国际业务职员、中大期货经纪有限公司北京营业部期货交易员、和讯信息科技有限公司高级编辑、国投信托有限公司北京交易员等职;2009年11月加入国金通用基金管理有限公司(筹备组),任高级交易员;2014年4月11日起担任本基金基金经理,滕祖光先生同时兼任国金通用鑫盈货币基金的基金经理。

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及其他相关法律法规,制定了《国金通用基金管理有限公司公平交易管理办法》,在投资管理活动中公平对待不同投资组合,严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。该公平交易管理方法规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行(集中竞价及非集中竞价交易)、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

第一,明确公平交易的原则:(1)信息获取公平原则,不同投资组合经理可公平获得研究成果;(2)交易机会公平原则,不同投资组合经理可获得交易执行的机会。

第二,对开放式基金和特定客户资产管理计划等不同类型业务,公司分别设立独立的投资部门;研究团队对所有的投资业务同时提供研究支持;设立独立的基金交易部,实行集中交易制度,将投资管理职能和交易执行职能相隔离;设立独立的合规风控部,对研究、投资、交易业务的公平交易进行监控、分析、预警、报告等。

第三,通过岗位设置、制度约束、流程规范、技术手段相结合的方式,实现公平交易的控制,具体如下:(1)总经理、督察长、风险控制委员会负责指导建立公平交易制度,并对公平交易的执行情况进行审核。(2)产品开发:风险分析师根据相关法律法规、公司规章制度以及产品合同的风险控制指标,在投资交易系统中完成风控参数设置,确保做好公平交易的事前控制。(3)研究与投资:投资人员负责在各自的职责及权限范围内从事相应的投资决策行为,其中,投资组合经理需对有可能涉及非公平交易的行为作出合理解释。研究人员负责以客观的研究方法开展研究工作,并根据研究结果建立及维护全公司适用的投资对象备选库和交易对手备选库。研究结果通过策略会、行业及个股报告会、投研平台、邮件系统等共享机制统一开放给所有的投资组合经理,以确保各投资组合享有公平的信息获取机会。(4)交易执行:交易人员负责建立并执行公平的集中交易制度和交易分配制度,合规风控部利用投资交易系统等对交易执行进行实时监控,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。(5)事后分析:合规风控部利用公平交易系统对不同投资组合之间的同向、反向交易及交易时机和价差进行事后分析。(6)报告备案:合规风控部根据实时监控及事后分析的结果撰写定期报告,并由投资组合经理、督察长、总经理签署后,妥善保存分析报告备查。(7)信息披露环节:信息披露部门在各投资组合的定期报告中,至少披露公司整体公平交易制度执行情况、公平交易执行情况及异常交易行为专项说明等事项。(8)反馈完善:根据事后分析报告及信息披露结果,公平交易各相关部门对相关环节予以不断完善,以确保公平交易的执行日臻完善。(9)监督检查:合规风控部监察稽核人员根据法规规定及公司公平交易制度规定,监督、检查、评价公司公平交易制度执行情况,并提出改进建议。会计师事务所在公司年度内部控制评价报告中对公司公平交易制度的执行情况做出专项评价。

4.3.2 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研究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,对持仓和交易等重大非公开投资信息采取保密措施。

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。对于一级市场申购等场外交易,按照公平交易原则建立和完善了相关分配机制。在本报告期,本基金管理人管理有六只基金产品,其中两只混合型基金、一只指数基金、一只债券型基金和两只货币基金,不存在非公平交易情况。

4.3.3 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控制制度,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

2014年宏观经济震荡下行,非标资产的兑付风险小范围出现但并未扩散;央行运用多种中短期货币工具保证市场流动性相对充裕,下半年不对称降息意在降低实体经济融资成本,股票市场应声走高。从全年看,成长、价值风格类标的均出现较好的盈利机会。

国金通用国鑫灵活配置发起式基金秉承价值投资理念,全年组合配置以低估值蓝筹股为基础,根据市场情况灵活参与成长股的交易性机会,全年业绩回报57%,为投资者获取了较好的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年12月31日,本基金份额净值1.2959元,累计单位净值1.5959元。本报告期份额净值增长率为57.12%,同期业绩比较基准增长率为31.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015年宏观经济增速继续放缓,GDP增速预计下降至7%左右,基建投资力度加大难以完全对冲房地产投资增速下滑,出口增速受制于人民币汇率实际升值,消费增速平稳在11-12%的水平。

之于A股市场,经过2014年4季度的快速上涨,蓝筹股估值修复;成长股虽有回落,但估值仍处于高位。随着经济增速下行,蓝筹、成长的业绩压力增加,分化在所难免。注册制将于15年下半年推出,新股供应量的增加将逐渐消除新股申购无风险套利的模式。

2015年A股市场存在两个关键变数,一是为了应对经济下行,货币政策或出现连续放松;二是从市场制度建设角度,A股国际化大势所趋,加入MSCI指数后,将迎来外资的被动配置,具备股息率优势的蓝筹股主要受益。这两点催化剂出现之前,市场波动将从关注分母变为关注分子,回归业绩主线。

2015年,信用风险出现的案例或明显高于2014年,加大市场短期波动。短期阵痛后,无风险收益率可能真正下降,企业融资成本得以有效降低,进而带动业绩回升。我们认为具备股息率优势的低估值蓝筹股仍是首选的配置标的,成长类公司则需要加倍研判、审慎甄别,具备业绩基础。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,本基金管理人从合法、合规、保障基金持有人利益出发,由督察长领导独立于各业务部门的监察稽核部对基金投资运作、公司经营管理及员工行为的合法、合规性等进行了监察稽核,通过实时监控、定期检查、专项检查、日常不定期抽查等方式,及时发现情况,提出整改意见、督促有关业务部门整改并跟踪改进落实情况,并按照相关要求定期制作监察稽核报告报公司管理层、董事会以及监管部门。

本报告期内本基金管理人内部监察稽核的重点包括:

(1)进一步完善制度建设。本基金管理人根据公司实际业务情况不断细化制度流程,及时拟定了相关管理制度,并对原有制度体系进行了持续的更新和完善,截至报告出具日,本基金管理人共制订规章制度110个,涵盖公司主要业务范围。

(2)强化合规教育和培训。本基金管理人及时传达与基金相关的法律法规,将相关规定不断贯彻到相关制度及具体执行过程中,同时以组织公司内部培训、聘请外部律师提供法律专业培训等多种形式,提高全体员工的合规守法意识。

(3)有计划地开展监察稽核工作。本报告期内,本基金管理人根据年度监察稽核工作计划、通过日常监察与专项稽核相结合的方式,开展各项监察稽核工作,包括对基金销售、宣传材料、合同、反洗钱工作、基金投资运作、交易(包括公平交易)等方面进行稽核,对于稽核中发现的问题会通过专项稽核报告的形式,及时将潜在风险通报部门负责人、督察长及公司总经理,督促改进并跟踪改进效果。通过日常监察与专项稽核的方式,保证了内部监察稽核的全面性、实时性,强化内部控制流程,提高了业务部门及人员的风险意识水平,从而较好地预防风险。

4.7 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,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估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、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。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。涉及模型定价的,由数量研究员或风险控制人员向运营支持部提供模型定价的结果,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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金相关法律法规和基金合同,结合本基金实际运作情况,本报告期内,本基金每10份基金份额分红2元。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无

4.10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

自2014年8月21日起至2014年12月3日止,本基金的基金资产净值连续60个工作日低于人民币5000万元,并于2014年12月4日高于人民币5000万元。本基金为发起式基金,且截至2014年12月31日本基金基金合同生效未满3年,根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第二款的规定,本基金暂不依照《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定执行。

§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

2014年度,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,诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

2014年度,中国光大银行股份有限公司依据《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;各重要方面由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2014年年度报告"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、准确和完整的。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2015)审字61004823_A01号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金财务报表,包括2014年12月31日的资产负债表,2014年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人国金通用基金管理有限公司的责任。这种责任包括:(1)按照企业会计准则的规定编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。 我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。	
审计意见段	我们认为,上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金2014年12月31日的财务状况以及2014年度的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	汤 骏	王珊珊
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层	
审计报告日期	2015年3月26日	

§7 年度财务报表

7.1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:2014年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资 产:			
银行存款		11,984,960.19	4,536,805.22
结算备付金		391,249.68	1,448,013.63
存出保证金		93,076.17	82,418.60
交易性金融资产		82,460,384.94	53,351,371.67
其中:股票投资		63,656,878.66	39,671,971.15
基金投资		–	–
债券投资		18,803,506.28	13,679,400.52
资产支持证券投资		–	–
贵金属投资		–	–
衍生金融资产		–	–
买入返售金融资产		–	9,000,000.00
应收证券清算款		–	–
应收利息		183,760.24	273,631.02
应收股利		–	–
应收申购款		113,764.65	3,629,781.22
递延所得税资产		–	–
其他资产		–	–
资产总计		95,227,195.87	72,322,021.36
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013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		4,000,000.00	–
应付证券清算款		5,047,067.01	1,692,911.52
应付赎回款		728,761.99	152,921.51
应付管理人报酬		74,045.47	76,911.81
应付托管费		12,340.90	12,818.65
应付销售服务费		–	–
应付交易费用		985,400.65	485,380.72
应交税费		15.00	15.00
应付利息		–	–
应付利润		–	–
递延所得税负债		–	–
其他负债		260,802.70	54,862.56
负债合计		11,108,433.72	2,475,821.77
所有者权益:			
实收基金		64,912,868.61	72,844,349.98
未分配利润		19,205,893.54	-2,998,150.39
所有者权益合计		84,118,762.15	69,846,199.59
负债和所有者权益总计		95,227,195.87	72,322,021.36

注:报告截止日2014年12月31日,基金份额净值为人民币1.2959元,基金份额总额为64,912,868.61份。

7.2 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:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
一、收入		28,421,037.43	6,617,442.01
1.利息收入		403,556.41	1,087,948.73
其中:存款利息收入		42,473.16	68,124.04
债券利息收入		298,394.82	882,706.60
资产支持证券利息收入		–	–
买入返售金融资产收入		62,688.43	137,118.09
其他利息收入		–	–
2.投资收益(损失以"-"填列)		17,472,469.19	8,578,457.17
其中:股票投资收益		15,505,312.07	8,359,322.83
基金投资收益		–	–
债券投资收益		1,611,336.60	-188,439.49
资产支持证券投资收益		–	–
贵金属投资收益		–	–
衍生工具收益		–	–
股利收益		355,820.52	407,573.83
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		10,484,642.17	-3,138,055.35
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		–	–
5.其他收入(损失以"-"号填列)		60,369.66	89,091.46
减:二、费用		2,713,755.66	3,357,279.81
1.管理人报酬		782,155.88	1,015,323.27
2.托管费		130,359.38	169,220.55
3.销售服务费		–	–
4.交易费用		1,367,582.27	1,602,981.93
5.利息支出		42,758.13	84,564.06
其中:卖出回购金融资产支出		42,758.13	84,564.06
6.其他费用		390,900.00	485,190.00
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		25,707,281.77	3,260,162.20
减:所得税费用		–	–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		25,707,281.77	3,260,162.20

7.3 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:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31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)	72,844,349.98	-2,998,150.39	69,846,199.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	–	25,707,281.77	25,707,281.77
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)	-7,931,481.37	4,343,679.75	-3,587,801.62
其中:1.基金申购款	50,004,744.77	8,084,454.98	58,089,199.75
2.基金赎回款	-57,936,226.14	-3,740,775.23	-61,677,001.37
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)	–	-7,846,917.59	-7,846,917.59
五、期末所有者权益(基金净值)	64,912,868.61	19,205,893.54	84,118,762.15

项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31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)	–	3,260,162.20	3,260,162.20
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)	-37,331,222.05	-3,190,527.93	-40,521,749.98
其中:1.基金申购款	34,838,066.61	-202,960.13	34,635,106.48
2.基金赎回款	-72,169,288.66	-2,987,567.80	-75,156,856.46
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)	–	-5,750,394.85	-5,750,394.85
五、期末所有者权益(基金净值)	72,844,349.98	-2,998,150.39	69,846,199.59

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 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"),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[2012]953号文的核准,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,基金合同于2012年8月28日生效。首次募集规模为178,532,819.63份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均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,以及其它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30%-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。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《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《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>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《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2号《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。

采用若干修订后/新会计准则

2014年1至3月,财政部制定了《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》和《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》;修订了《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》和《企业会计准则第33号——合并财务报表》;上述7项会计准则均自2014年7月1日起施行。2014年6月,财政部修订了《企业会计准则第37号——金融工具列报》,在2014年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本财务报表无重大影响。

7.4.3 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2014年12月31日的财务状况以及2014年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则及应用指南、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

会计政策变更的说明可参见7.4.2会计报表的编制基础。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,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、国家税务总局研究决定,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号文《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,继续免征营业税和企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《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[2002]128号文《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、储蓄存款利息收入,由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自2013年1月1日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《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。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
上海国金通用财富资产管理有限公司	基金管理人的子公司
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
中国通用技术(集团)控股有限责任公司	基金管理人股东
国金证券股份有限公司	基金管理人股东、基金代销机构
广东宝丽华新能源股份有限公司	基金管理人股东
北京千石创富资本管理有限公司	基金管理人子公司
苏州工业园区兆润控股集团有限公司	基金管理人股东
中国光大银行股份有限公司	基金托管人、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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

–

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31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	219,727,446.41	21.82%	223,218,060.40	18.77%

债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31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	17,748,239.65	22.99%	6,974,155.89	9.60%

债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31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	337,000,000.00	60.63%	108,500,000.00	9.41%

7.4.8.1.2 权证交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例

注:本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31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	156,094.08	20.94%	156,094.08	15.84%

关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31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	18.23%	–	–

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。债券及权证交易不计佣金。

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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	782,155.88	1,015,323.27
其中:支付销售机构的客户维护费	99,764.26	171,548.55

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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	130,359.38	169,220.55

注: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。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
获得销售服务费各关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

注:无

7.4.8.3 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 2014年1月1日至2014年12月31日						
银行间市场交易的	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
各关联方名称	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日						
银行间市场交易的	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
各关联方名称	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出

注:本基金本报告期末发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31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:本基金的管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 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 2014年12月31日		上年度末 2013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
国金证券	2,000,482.40	3.0818%	2,074,718.69	2.8482%
宝新能源	6,500,650.10	10.0144%	6,500,650.10	8.9240%
千石创富	0.00	0.0000%	5,250,549.60	7.2079%
国金财富	4,728,264.82	7.2840%	0.00	0.0000%

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。

7.4.8.5 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 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
光大银行	11,984,960.19	30,652.82	4,536,805.22	46,500.88

注:本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行保管,按银行同业利率计算。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位:人民币元

本期 2014年1月1日至2014年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:份)	总金额
上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:份)	总金额

注:本基金于本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无

7.4.9 期末(2014年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量	期末成本总额	期末估值总额	备注
7.4.10.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
7.4.10.1.2 受限证券类别:债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
110030	格力转债	2014年12月30日	2015年1月13日	新债未上市	100.00	100.00	1,140	114,000.00	114,000.00	–
7.4.10.1.3 受限证券类别:权证										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:份)	期末成本总额	期末估值总额	备注

7.4.9.2 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

注:本基金本报告期末未持有因暂时停牌而流通受限的股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

–

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
合计				–	–

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014年12月31日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额4,000,000.00元,于2015年1月5日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1公允价值

银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、应收申购款、应付证券清算款等,因其剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

(1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为人民币82,346,384.94元,属于第二层级的余额为人民币114,000.00元,属于第三层级余额为人民币零元。

(2) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确认金融工具公允价值层次之间转移的时点。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具,在第一层次和第二层次之间无重大转移。

本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具未发生转入或转出第三层次公允价值的情况。

7.4.14.2承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.3其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.14.4财务报表的批准

本财务报表已于2015年3月26日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.1 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	63,656,878.66	66.85
	其中:股票	63,656,878.66	66.85
2	固定收益投资	18,803,506.28	19.75
	其中:债券	18,803,506.28	19.75
	资产支持证券	–	–
3	贵金属投资	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	银行存款和结算备付金合计	12,376,209.87	13.00
7	其他各项资产	390,601.06	0.41
8	合计	95,227,195.87	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	7,838,860.72	9.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	3,846,024.00	4.57
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	–	–
J	金融业	27,282,276.75	32.43
K	房地产业	18,221,981.19	21.66
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	6,467,736.00	7.69
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	63,656,878.66	75.68

8.3 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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000024	招商地产	250,607	6,613,518.73	7.86
2	000069	华侨城A	783,968	6,467,736.00	7.69
3	600000	浦发银行	402,933	6,322,018.77	7.52
4	601318	中国平安	83,044	6,204,217.24	7.38
5	600376	首开股份	451,300	4,549,104.00	5.41
6	601377	兴业证券	262,813	3,973,732.56	4.72
7	601668	中国建筑	528,300	3,846,024.00	4.57
8	000402	金 融 街	305,800	3,770,514.00	4.48
9	601601	中国太保	116,100	3,750,030.00	4.46
10	601336	新华保险	74,100	3,672,396.00	4.37

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	14,227,194.53	20.37
2	600000	浦发银行	11,948,199.00	17.11
3	601377	兴业证券	7,370,606.33	10.55
4	600016	民生银行	7,180,016.00	10.28
5	000001	平安银行	6,982,178.00	10.00
6	000402	金 融 街	6,675,197.92	9.56
7	600376	首开股份	6,279,339.14	8.99
8	600325	华发股份	6,212,033.65	8.89
9	600673	东阳光科	5,898,389.62	8.44
10	000069	华侨城A	5,855,476.34	8.38
11	600999	招商证券	5,739,188.00	8.22
12	002340	格 林 美	5,656,696.50	8.10
13	601668	中国建筑	5,636,104.00	8.07
14	300271	华宇软件	5,543,547.20	7.94
15	000024	招商地产	5,407,890.49	7.74
16	000816	江淮动力	5,343,032.37	7.65
17	603766	隆鑫通用	4,370,058.00	6.26
18	002085	万丰奥威	4,328,660.39	6.20
19	600115	东方航空	4,283,305.70	6.13
20	600699	均胜电子	4,219,944.92	6.04
21	300139	福星晓程	4,144,918.00	5.93
22	600066	宇通客车	4,115,162.96	5.89
23	300175	朗源股份	4,103,827.48	5.88
24	002303	美 盈 森	4,069,757.00	5.83
25	002005	德豪润达	4,060,718.21	5.81
26	600330	天通股份	3,965,741.58	5.68
27	600406	国电南瑞	3,944,019.91	5.65
28	601166	兴业银行	3,922,586.24	5.62
29	600885	宏发股份	3,705,106.43	5.30
30	600030	中信证券	3,679,179.00	5.27
31	601231	环旭电子	3,646,367.00	5.22
32	600690	青岛海尔	3,625,317.37	5.19
33	300085	银 之 杰	3,588,811.56	5.14
34	600340	华夏幸福	3,588,502.72	5.14
35	601000	唐 山 港	3,586,632.61	5.14
36	601601	中国太保	3,384,875.44	4.85
37	600588	用友软件	3,288,395.40	4.71
38	002117	东港股份	3,281,557.70	4.70
39	600048	保利地产	3,272,555.00	4.69
40	002605	姚记扑克	3,266,146.78	4.68
41	002049	同方国芯	3,229,488.39	4.62
42	601336	新华保险	3,228,605.44	4.62
43	000778	新兴铸管	3,196,001.10	4.58
44	300128	锦富新材	3,195,497.20	4.58
45	600073	上海梅林	3,167,225.00	4.53
46	601989	中国重工	3,163,859.65	4.53
47	600108	亚盛集团	3,129,012.00	4.48
48	600316	洪都航空	3,087,988.16	4.42
49	000021	长城开发	3,086,629.21	4.42
50	601222	林洋电子	3,060,477.00	4.38
51	300334	津膜科技	3,020,623.01	4.32
52	000541	佛山照明	3,007,660.48	4.31
53	002271	东方雨虹	2,941,368.75	4.21
54	300227	光 韵 达	2,919,687.96	4.18
55	002111	威海广泰	2,881,368.31	4.13
56	002241	歌尔声学	2,851,114.25	4.08
57	300238	冠昊生物	2,770,830.31	3.97
58	600879	航天电子	2,710,947.98	3.88
59	002584	西陇化工	2,662,402.35	3.81
60	002415	海康威视	2,659,079.00	3.81
61	600081	东风科技	2,650,573.49	3.79
62	601288	农业银行	2,632,584.00	3.77
63	600580	卧龙电气	2,625,998.85	3.76
64	600104	上汽集团	2,614,659.50	3.74
65	600240	华业地产	2,598,867.00	3.72
66	002325	洪涛股份	2,584,097.00	3.70
67	002557	洽洽食品	2,564,949.94	3.67
68	600261	阳光照明	2,552,544.16	3.65
69	002642	荣 之 联	2,548,948.00	3.65
70	002330	得 利 斯	2,543,341.00	3.64
71	000425	徐工机械	2,539,251.00	3.64
72	300030	阳普医疗	2,528,804.07	3.62
73	002458	益生股份	2,496,269.05	3.57
74	002465	海格通信	2,471,915.04	3.54
75	000049	德赛电池	2,453,719.00	3.51
76	002482	广田股份	2,438,793.32	3.49
77	002488	金固股份	2,425,523.00	3.47
78	000938	紫光股份	2,387,628.70	3.42
79	600008	首创股份	2,365,470.00	3.39
80	000997	新 大 陆	2,355,308.20	3.37
81	000712	锦龙股份	2,315,048.00	3.31
82	600037	歌华有线	2,303,915.78	3.30
83	600062	华润双鹤	2,255,922.85	3.23
84	601012	隆基股份	2,226,393.64	3.19
85	000732	泰禾集团	2,214,809.86	3.17
86	002666	德联集团	2,212,836.61	3.17
87	300104	乐 视 网	2,195,173.30	3.14
88	000547	闽福发A	2,189,046.00	3.13
89	600256	广汇能源	2,180,239.00	3.12
90	000919	金陵药业	2,174,333.00	3.11
91	000726	鲁 泰 A	2,167,334.00	3.10
92	300068	南都电源	2,161,125.00	3.09
93	600741	华域汽车	2,136,306.00	3.06
94	600763	通策医疗	2,127,275.76	3.05
95	002299	圣农发展	2,124,985.00	3.04
96	002683	宏大爆破	2,122,569.00	3.04
97	600067	冠城大通	2,112,901.00	3.03
98	002285	世 联 行	2,112,010.62	3.02
99	600875	东方电气	2,108,197.00	3.02
100	300223	北京君正	2,108,142.04	3.02
101	002249	大洋电机	2,092,845.30	3.00
102	000006	深振业A	2,063,153.50	2.95
103	601992	金隅股份	2,048,948.25	2.93
104	600429	三元股份	2,036,463.00	2.92
105	300021	大禹节水	2,008,429.00	2.88
106	600573	惠泉啤酒	1,991,339.00	2.85
107	300065	海 兰 信	1,991,118.95	2.85
108	600998	九 州 通	1,951,869.00	2.79
109	300063	天龙集团	1,926,641.00	2.76
110	600497	驰宏锌锗	1,916,211.00	2.74
111	002549	凯美特气	1,858,241.73	2.66
112	600455	博通股份	1,856,335.50	2.66
113	300356	光一科技	1,856,004.89	2.66
114	002179	中航光电	1,808,951.38	2.59
115	600804	鹏 博 士	1,808,074.00	2.59
116	300183	东软载波	1,794,943.30	2.57
117	600372	中航电子	1,790,986.00	2.56
118	601009	南京银行	1,755,472.95	2.51
119	600662	强生控股	1,746,022.00	2.50
120	001696	宗申动力	1,735,014.00	2.48
121	600192	长城电工	1,641,905.00	2.35
122	000400	许继电气	1,633,055.00	2.34
123	600315	上海家化	1,625,900.00	2.33
124	600249	两 面 针	1,612,214.44	2.31
125	600337	美克家居	1,599,224.38	2.29
126	600863	内蒙华电	1,594,812.00	2.28
127	002237	恒邦股份	1,594,089.00	2.28
128	300267	尔康制药	1,591,222.00	2.28
129	000860	顺鑫农业	1,590,923.00	2.28
130	600708	海博股份	1,588,695.99	2.27
131	000895	双汇发展	1,588,668.57	2.27
132	600383	金地集团	1,587,774.00	2.27
133	300293	蓝英装备	1,583,342.10	2.27
134	002497	雅化集团	1,581,535.00	2.26
135	600519	贵州茅台	1,574,880.00	2.25
136	600266	北京城建	1,572,529.00	2.25
137	300043	互动娱乐	1,568,052.57	2.25
138	000060	中金岭南	1,561,916.00	2.24
139	601098	中南传媒	1,549,297.26	2.22
140	600572	康 恩 贝	1,540,587.00	2.21
141	600686	金龙汽车	1,535,995.00	2.20
142	600377	宁沪高速	1,534,824.26	2.20
143	000507	珠 海 港	1,530,492.00	2.19
144	002108	沧州明珠	1,526,424.00	2.19
145	600166	福田汽车	1,514,126.00	2.17
146	601088	中国神华	1,508,101.00	2.16
147	600737	中粮屯河	1,503,555.00	2.15
148	600150	中国船舶	1,494,071.00	2.14
149	002024	苏宁云商	1,490,848.00	2.13
150	000582	北部湾港	1,487,860.00	2.13
151	000963	华东医药	1,487,368.00	2.13
152	600720	祁 连 山	1,438,861.00	2.06
153	603000	人 民 网	1,431,077.36	2.05
154	002229	鸿博股份	1,407,782.00	2.02

注:上述买入金额为买入成交金额(成交单价乘以成交数量),不包括相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	10,108,289.11	14.47
2	600673	东阳光科	8,112,337.60	11.61
3	600016	民生银行	7,684,478.69	11.00
4	002340	格 林 美	7,112,555.83	10.18
5	000001	平安银行	6,962,361.51	9.97
6	000816	江淮动力	6,645,694.78	9.51
7	600000	浦发银行	6,344,115.63	9.08
8	600763	通策医疗	5,794,854.66	8.30
9	601231	环旭电子	5,742,012.55	8.22
10	300271	华宇软件	5,713,126.33	8.18
11	002465	海格通信	5,679,981.68	8.13
12	002085	万丰奥威	5,409,628.78	7.75
13	603766	隆鑫通用	5,280,593.20	7.56
14	601006	大秦铁路	5,248,786.72	7.51
15	600073	上海梅林	5,057,565.01	7.24
16	002303	美 盈 森	4,937,546.48	7.07
17	002605	姚记扑克	4,573,481.07	6.55
18	600429	三元股份	4,523,423.99	6.48
19	300139	福星晓程	4,453,333.52	6.38
20	600699	均胜电子	4,422,806.92	6.33
21	300175	朗源股份	4,380,877.94	6.27
22	601377	兴业证券	4,367,453.45	6.25
23	600406	国电南瑞	4,337,558.52	6.21
24	600372	中航电子	4,277,172.28	6.12
25	601000	唐 山 港	4,275,478.44	6.12
26	601166	兴业银行	4,215,723.10	6.04
27	600066	宇通客车	4,209,850.13	6.03
28	600325	华发股份	4,130,768.67	5.91
29	002005	德豪润达	4,018,708.97	5.75
30	600115	东方航空	4,007,061.00	5.74
31	600885	宏发股份	3,922,757.86	5.62
32	600588	用友软件	3,886,044.54	5.56
33	000778	新兴铸管	3,825,894.50	5.48
34	600330	天通股份	3,771,417.54	5.40
35	600030	中信证券	3,721,097.01	5.33
36	002144	宏达高科	3,559,390.95	5.10
37	000860	顺鑫农业	3,552,794.02	5.09
38	300085	银 之 杰	3,545,869.00	5.08
39	601222	林洋电子	3,544,927.66	5.08
40	300128	锦富新材	3,491,948.86	5.00
41	600690	青岛海尔	3,454,155.74	4.95
42	600340	华夏幸福	3,386,636.00	4.85
43	002117	东港股份	3,291,260.99	4.71
44	000021	长城开发	3,273,810.84	4.69
45	002049	同方国芯	3,258,248.77	4.66
46	600108	亚盛集团	3,158,945.00	4.52
47	002330	得 利 斯	3,153,905.18	4.52
48	601989	中国重工	3,150,467.89	4.51
49	600048	保利地产	3,095,993.90	4.43
50	000541	佛山照明	3,063,824.55	4.39
51	000402	金 融 街	3,054,852.80	4.37
52	600316	洪都航空	3,053,475.98	4.37
53	300334	津膜科技	3,043,853.55	4.36
54	600081	东风科技	3,002,704.02	4.30
55	002111	威海广泰	2,975,588.88	4.26
56	002584	西陇化工	2,884,959.78	4.13
57	603000	人 民 网	2,866,159.40	4.10
58	002325	洪涛股份	2,848,804.00	4.08
59	600879	航天电子	2,764,784.01	3.96
60	002241	歌尔声学	2,728,054.72	3.91
61	002458	益生股份	2,702,495.35	3.87
62	300227	光 韵 达	2,701,189.89	3.87
63	300030	阳普医疗	2,693,524.45	3.86
64	300104	乐 视 网	2,680,054.70	3.84
65	002488	金固股份	2,666,082.59	3.82
66	600008	首创股份	2,665,130.67	3.82
67	601288	农业银行	2,637,415.17	3.78
68	600104	上汽集团	2,622,210.00	3.75
69	000997	新 大 陆	2,618,222.03	3.75
70	300238	冠昊生物	2,606,761.64	3.73
71	600580	卧龙电气	2,593,937.95	3.71
72	000776	广发证券	2,589,678.00	3.71
73	600999	招商证券	2,582,168.31	3.70
74	600240	华业地产	2,580,830.72	3.70
75	002557	洽洽食品	2,545,093.90	3.64
76	002482	广田股份	2,501,700.64	3.58
77	002415	海康威视	2,461,804.89	3.52
78	000049	德赛电池	2,449,113.00	3.51
79	000938	紫光股份	2,448,289.16	3.51
80	300065	海 兰 信	2,440,824.14	3.49
81	601607	上海医药	2,408,057.00	3.45
82	600037	歌华有线	2,358,441.01	3.38
83	600261	阳光照明	2,339,018.88	3.35
84	000712	锦龙股份	2,336,116.50	3.34
85	600376	首开股份	2,333,252.97	3.34
86	000547	闽福发A	2,327,801.92	3.33
87	002642	荣 之 联	2,276,340.94	3.26
88	000919	金陵药业	2,271,252.98	3.25
89	002666	德联集团	2,253,489.52	3.23
90	002299	圣农发展	2,238,077.34	3.20
91	002249	大洋电机	2,195,947.12	3.14
92	002285	世 联 行	2,164,293.72	3.10
93	600741	华域汽车	2,137,976.00	3.06
94	600276	恒瑞医药	2,136,557.49	3.06
95	600875	东方电气	2,130,739.29	3.05
96	601009	南京银行	2,125,160.63	3.04
97	000732	泰禾集团	2,123,573.93	3.04
98	000726	鲁 泰 A	2,113,387.00	3.03
99	600256	广汇能源	2,108,580.00	3.02
100	601668	中国建筑	2,089,752.00	2.99
101	601688	华泰证券	2,077,274.71	2.97
102	601012	隆基股份	2,073,757.51	2.97
103	601992	金隅股份	2,067,829.00	2.96
104	300021	大禹节水	2,059,995.35	2.95
105	600067	冠城大通	2,056,991.85	2.95
106	600573	惠泉啤酒	2,053,744.00	2.94
107	600062	华润双鹤	2,021,336.80	2.89
108	000006	深振业A	1,978,103.50	2.83
109	002683	宏大爆破	1,971,111.71	2.82
110	300223	北京君正	1,953,455.78	2.80
111	300068	南都电源	1,942,808.00	2.78
112	001696	宗申动力	1,873,158.00	2.68
113	600249	两 面 针	1,867,885.56	2.67
114	600497	驰宏锌锗	1,859,868.29	2.66
115	002179	中航光电	1,841,726.31	2.64
116	600315	上海家化	1,840,448.09	2.64
117	300063	天龙集团	1,826,170.22	2.61
118	600998	九 州 通	1,820,297.31	2.61
119	300356	光一科技	1,792,497.20	2.57
120	300183	东软载波	1,777,733.50	2.55
121	600804	鹏 博 士	1,756,943.61	2.52
122	000507	珠 海 港	1,749,527.20	2.50
123	002549	凯美特气	1,748,368.00	2.50
124	600863	内蒙华电	1,686,420.00	2.41
125	600455	博通股份	1,653,018.00	2.37
126	600377	宁沪高速	1,644,001.28	2.35
127	600708	海博股份	1,643,278.96	2.35
128	600266	北京城建	1,641,146.33	2.35
129	300282	汇冠股份	1,632,766.00	2.34
130	300267	尔康制药	1,616,733.30	2.31
131	002497	雅化集团	1,615,311.07	2.31
132	600337	美克家居	1,599,620.80	2.29
133	600662	强生控股	1,597,886.00	2.29
134	600192	长城电工	1,590,654.00	2.28
135	000963	华东医药	1,579,245.49	2.26
136	000400	许继电气	1,570,847.40	2.25
137	002570	贝 因 美	1,564,745.44	2.24
138	600383	金地集团	1,556,616.00	2.23
139	600686	金龙汽车	1,545,170.00	2.21
140	000060	中金岭南	1,536,424.00	2.20
141	300293	蓝英装备	1,529,433.50	2.19
142	002237	恒邦股份	1,522,220.00	2.18
143	601098	中南传媒	1,505,312.00	2.16
144	601088	中国神华	1,501,322.73	2.15
145	600519	贵州茅台	1,487,832.94	2.13
146	600572	康 恩 贝	1,487,020.30	2.13
147	600166	福田汽车	1,468,750.00	2.10
148	600150	中国船舶	1,464,157.63	2.10
149	002024	苏宁云商	1,458,780.00	2.09
150	600737	中粮屯河	1,451,436.00	2.08
151	000895	双汇发展	1,424,325.89	2.04
152	601800	中国交建	1,415,456.00	2.03
153	002108	沧州明珠	1,413,097.90	2.02
154	000915	山大华特	1,397,356.00	2.00

注:上述卖出金额为卖出成交金额(成交单价乘以成交数量),不包括相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	503,583,478.97
卖出股票收入(成交)总额	503,508,647.54

注:上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额(成交单价乘以成交数量),不包括相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	1,925,988.00	2.29
2	央行票据	–	–
3	金融债券	–	–
	其中:政策性金融债	–	–
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	14,925,648.28	17.74
8	其他	1,951,870.00	2.32
9	合计	18,803,506.28	22.35

8.6 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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	20,000	2,698,400.00	3.21
2	110027	东方转债	15,000	2,568,150.00	3.05
3	110029	浙能转债	18,000	2,519,280.00	2.99
4	110028	冠城转债	15,000	2,210,100.00	2.63
5	018001	国开1301	19,000	1,951,870.00	2.32

8.7 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

金额单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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

金额单位:人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)

注:本基金本报告期末未持有权证。

8.10报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2本基金投资股指期货的投资政策

报告期,本基金未投资股指期货。

8.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1本期国债期货投资政策

报告期,本基金未投资国债期货。

8.11.2报告期末本基金投资的国债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)	风险指标说明
公允价值变动总额合计(元)					–
国债期货投资本期收益(元)					–
国债期货投资本期公允价值变动(元)					–

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3本期国债期货投资评价

本基金未参与国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本期基金投资组合前十名证券的发行主体中,未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、处罚的情况。

8.12.2

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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	93,076.17
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	183,760.24
5	应收申购款	113,764.65
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	390,601.06

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	2,698,400.00	3.21
2	110020	南山转债	1,396,100.00	1.66
3	110023	民生转债	1,382,700.00	1.64
4	110017	中海转债	1,358,640.00	1.62
5	127002	徐工转债	536,418.00	0.64
6	128005	齐翔转债	97,311.00	0.12

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
2,152	30,163.97	13,229,397.32	20.38%	51,683,471.29	79.62%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	2,461,906.84	3.7926%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	>=100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

9.5发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	0.00	0.00	0.00	0.00	–
基金管理人高级管理人员	1,808,081.40	2.79	1,400,342.78	2.16	3年
基金经理等人员	612,958.53	0.94	500,080.64	0.77	3年
基金管理人股东	8,501,132.50	13.10	8,501,132.50	13.10	3年
其他	600,084.67	0.92	600,084.67	0.92	3年
合计	11,522,257.10	17.75	11,001,640.59	16.95	3年

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2012年8月28日)基金份额总额	178,532,819.63
本报告期期初基金份额总额	72,844,349.98
本报告期基金总申购份额	50,004,744.77
减:本报告期基金总赎回份额	57,936,226.14
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	–
本报告期期末基金份额总额	64,912,868.61

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。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2014年07月16日,张丽女士新任基金管理人督察长,毛伟先生不再担任基金管理人督察长职务。2014年12月18日李修辞先生不再担任基金管理人副总经理职务。除上述人事调整以外,本报告期内基金管理人无其他重大人事变动。

本报告期内,基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内,无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内,国金通用国鑫发起式基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为50,000元人民币。截至本报告期末,该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	273,989,707.48	27.21%	224,530.83	30.13%	–
国金证券	1	219,727,446.41	21.82%	156,094.08	20.94%	–
华创证券	1	179,410,917.79	17.81%	127,453.85	17.10%	–
东方证券	1	173,134,288.94	17.19%	122,995.25	16.50%	–
方正证券	1	160,829,765.89	15.97%	114,253.09	15.33%	–

注:1.本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基字[2007]48号)的有关规定要求,本基金管理人在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后,向多家券商租用了基金专用交易席位。

(1)基金专用交易席位的选择标准如下:

① 经营行为规范,在近一年内未出现重大违规行为;

② 财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定;

③ 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施满足基金进行证券交易需要;

④ 具有较强的研究能力,能及时、全面地提供高质量的宏观、策略、行业、上市公司、证券市场研究、固定收益研究、数量研究等报告及信息资讯服务;

⑤交易佣金收取标准合理。

(2)基金专用交易席位的选择程序如下:

① 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构;

② 本基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

2.本报告期新增方正证券、中信证券(山东)各一个交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券	29,628,603.47	38.38%	121,300,000.00	21.82%	–	–
国金证券	17,748,239.65	22.99%	337,000,000.00	60.63%	–	–
华创证券	3,293,241.90	4.27%	–	–	–	–
东方证券	1,686,605.47	2.18%	9,455,000.00	1.70%	–	–
方正证券	24,847,985.40	32.18%	88,100,000.00	15.85%	–	–

§12 影响投资者决策的其他重要信息

无

国金通用基金管理有限公司

2015年3月30日