国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金

【2015】第一季度报告

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
报告送出日期:2015年4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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年4月17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2015年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国金通用国鑫发起
场内简称	-
交易代码	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
报告期末基金份额总额	57,810,462.27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	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。
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。
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

注:本基金为发起式基金。

§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(2015年1月1日 - 2015年3月31日)
1.本期已实现收益	15,337,373.25
2.本期利润	12,461,684.68
3.加权平均基金份额本期利润	0.2555
4.期末基金资产净值	88,470,608.01
5.期末基金份额净值	1.5304

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.自2015年3月27日起,本公司对旗下证券投资基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)的估值方法进行调整,采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

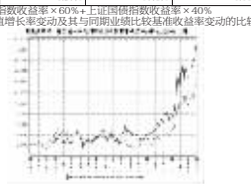
3.2 基金净值表现

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	18.10%	1.57%	9.48%	1.10%	8.62%	0.47%

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



3.3 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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
徐艳芳	本基金经理	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、美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、国投信托有限公司证券交易员等职;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》、《公开募集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 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。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1,中国证监会核准基金募集的文件;

2,国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同;

3,国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议;

4,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;

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。

10.2 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。

10.3 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

国金通用基金管理有限公司
2015年4月20日

注:以上行业分类以2015年3月31日的中国证监会行业分类标准为依据。

5.2 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	002557	洽洽食品	164,000	4,190,200.00	4.74
2	601166	兴业银行	228,200	4,189,752.00	4.74
3	600315	上海家化	95,300	4,053,109.00	4.58
4	601688	华泰证券	130,200	3,920,322.00	4.43
5	601628	中国人寿	105,100	3,893,955.00	4.40
6	000816	江淮动力	377,884	3,824,186.08	4.32
7	600703	三安光电	179,500	3,816,170.00	4.31
8	600030	中信证券	114,900	3,771,018.00	4.26
9	002073	软控股份	185,866	3,717,320.00	4.20
10	300124	汇川技术	84,500	3,529,565.00	3.99

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	1,918,500.00	2.17
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,634,200.00	6.37
	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	9,068,776.40	10.25
8	其他	-	-
9	合计	16,621,476.40	18.79

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	018001	国开1301	55,000	5,634,200.00	6.37
2	110023	民生转债	23,810	3,268,398.70	3.69
3	110029	浙能转债	15,000	2,090,850.00	2.36
4	110030	格力转债	11,030	1,871,460.10	2.12
5	113008	电气转债	10,100	1,402,284.00	1.59

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

注:本基金本报告期末投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

报告期,本基金未投资股指期货。

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:本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

报告期,本基金未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本期基金投资组合前十名证券的发行主体中:

上海家化因涉嫌信息披露违法违规被中国证监会立案调查,上海家化公告称:2014年12月23日公司收到中国证券监督管理委员会上海监管局下发的《行政处罚事先告知书》(编号:沪证监处罚字[2014]10号),上海家化信息披露违法违规案已由上海证监局调查、审理完毕,上海证监局依法拟对公司及相关人员作出行政处罚,对上海家化予以警告,并处以30万元罚款;

鉴于公司信息披露涉嫌违法违规发生在14年管理层更替之前,且对公司的调查、审理已经完毕,处罚30万元,买入时公司在新管理层的带领下业绩增长出现企稳迹象,且估值较低,具有投资价值;

证监会1月16日通报,中信证券因存在违规为到期融资融券合约展期的问题,受到暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施。

证监会4月3日通报,华泰证券在融资融券业务开展中存在向不符合条件的客户融资融券、向风险承担能力不足的客户融资融券、未按照规定方式为部分客户开立融资融券信用账户等问题。

中信证券、华泰证券已经制定相关的整改措施,且整改对公司业绩影响较小,在A股交易量持续攀升、融资融券业务收入持续增加的背景下,公司15年业绩具有较大的增长潜力,具有投资价值。

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	99,103.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	129,185.28
5	应收申购款	690,589.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	918,878.45

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110023	民生转债	3,268,398.70	3.69
2	128005	齐翔转债	376,462.80	0.43

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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

序号	64,912,868.61
报告期期间基金总申购份额	20,183,274.78
减:报告期期间基金总赎回份额	27,285,681.12
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	57,810,462.27

注:1.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。

2.本报告期末,基金管理人的股东国金证券股份有限公司和广东证券股份有限公司持有本基金的份额分别为2,000,482.40份和6,500,650.10份,基金管理人的股东广公司上海国金通用财富资产管理有限公司(以下简称"国金财富")持有本基金的份额为4,728,264.82份,前述持有人均按照本基金《基金合同》及《招募说明书》规定的申购规则及申购费率办理申购业务,国金财富已按照法规规定向中国证监会进行了报告。

§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。

§8 报告期末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	3.13	1,400,342.78	2.42	3年
基金经理等人员	612,958.53	1.06	500,080.64	0.87	3年
基金管理人股东	8,501,132.50	14.71	8,501,132.50	14.71	3年
其他	600,084.67	1.04	600,084.67	1.04	3年
合计	11,522,257.10	19.93	11,001,640.59	19.03	3年

§9 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:

1,2015年1月5日披露了《国金通用基金管理有限公司关于旗下基金的基金资产净值、基金份额净值及基金份额累计净值的公告》;

2,2015年1月22日披露了《国金通用鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金2014年第4季度报告》;

3,2015年2月7日披露了《国金通用基金管理有限公司关于旗下基金持有的"华侨城A"股票估值调整的公告》;

4,2015年2月13日披露了《国金通用基金管理有限公司关于旗下基金持有的"14北营钢铁CP001"估值调整的公告》;

5,2015年2月26日披露了《国金通用基金管理有限公司关于旗下基金持有的"万丰奥威"股票估值调整的公告》;

6,2015年3月20日披露了《国金通用基金管理有限公司关于旗下基金参加齐鲁证券有限公司申购费率优惠活动的公告》;

7,2015年3月23日披露了《国金通用基金管理有限公司关于在齐鲁证券有限公司开通定期定额投资业务的公告》;

8,2015年3月28日披露了《国金通用基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告》;

9,2015年3月30日披露了《国金通用基金管理有限公司关于增加上海利得基金销售有限公司为旗下基金销售机构并参加相关费率优惠活动的公告》;

10,2015年3月30日披露了《国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金2014年年度报告》;

11,2015年3月30日披露了《国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金2014年年度报告(摘要)》;

12,2015年3月31日披露了《国金通用基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司个人电子银行申购费率优惠活动的公告》;

13,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。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1,中国证监会核准基金募集的文件;

2,国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同;

3,国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议;

4,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;

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。

10.2 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。

10.3 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

国金通用基金管理有限公司
2015年4月20日

国金通用沪深300指数分级证券投资基金

【2015】第一季度报告

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
报告送出日期:2015年4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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年4月17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2015年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国金通用沪深300
场内简称	国金300
交易代码	167601
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	2013年7月26日
报告期末基金份额总额	161,243,145.28份
投资目标	本基金采用指数化投资策略,紧密跟踪沪深300指数,在严格控制基金的日均跟踪误差偏离度和年跟踪误差的前提下,力争获取与标的指数相似的投资收益。
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,以达到跟踪和复制指数的目的,力争保持日均跟踪偏离度的绝对值不超过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)致使基金无法购得足够数量的股票时,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	本基金的业绩比较基准为:95%×沪深300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,属于较高风险、较高预期收益的基金品种,其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分属的两类基金份额来看,国金沪深300A份额具有低风险、收益相对稳定的特征;国金沪深300B份额具有高风险、高预期收益的特征。
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

下属分级基金简称	国金300A	国金300B	国金300
下属分级场内简称	国金300A	国金300B	国金300
下属分级基金交易代码	150140	150141	167601
下属分级基金报告期末基金份额总额	68,734,676.00份	68,734,676.00份	23,773,793.28份
下属分级基金的风险收益特征	国金沪深300指数分级A份额具有低风险、收益相对稳定的特征。	国金沪深300指数分级B份额具有高风险、高预期收益的特征。	本基金为股票型基金,属于较高风险、较高预期收益的基金品种,其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

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(2015年1月1日 - 2015年3月31日)
1.本期已实现收益	7,227,950.00
2.本期利润	21,513,911.91
3.加权平均基金份额本期利润	0.0937
4.期末基金资产净值	180,156,664.35
5.期末基金份额净值	1.1173

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.自2015年3月27日起,本公司对旗下证券投资基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)的估值方法进行调整,采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

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	11.73%	5.35%	10.71%	8.00%	1.02%	-2.65%

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300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

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
宫雪	基金经理	2013年7月26日	-	6	宫雪女士,中国科学院数学与系统科学研究院管理科学与工程专业博士,2008年7月至2011年11月在博时基金管理有限公司股票投资部工作,任产业分析师。2012年2月加盟国金通用基金管理有限公司,历任战略发展部产品经理兼投资研究部行业分析师、产品与金融工程部量化分析师、产品与金融工程部总经理、指数投资部副总经理等职,自2014年11月起任指数投资事业部总经理。2013年7月26日起至今担任国金通用沪深300指数分级证券投资基金基金经理。截至本公告之日,宫雪女士同时担任国金通用鑫安保本混合型证券投资基金基金经理。

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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《国金通用沪深300指数分级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 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6只基金产品,分别为2只混合型基金、1只指数基金、2只货币基金和1只债券型基金,不存在非公平交易情况。

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年1季度,本基金严格遵守基金合同,采取完全复制标的指数沪深300的投资策略,同时为控制大额申购对跟踪误差的影响,本基金适当投资股指期货。基金持仓包括沪深300指数成份股、股指期货及现金等,其中股票持仓不低于90%,股指期货市值不高于10%,现金类资产不低于5%,以日均跟踪偏离度最小(绝对值不超过0.35%)、年化跟踪误差尽量小(不超过4%)为管理目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期,本基金份额净值增长率为11.73%,同期业绩比较基准收益率为10.71%;报告期内,基金的日均跟踪偏离度0.064%,远低于合同约定的日均跟踪偏离度为0.35%,年化跟踪误差为1.961%,超过合同约定的年化跟踪误差为4%的水平。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

1季度,进出口数据、消费数据、房屋销售数据等仍然十分疲弱,整体经济仍然处于低位,需求的回升仍需要一段时间。持续宽松的货币推升市场估值,但除个别行业,多数行业的业绩不见明显的好转迹象。未来货币仍将持续宽松,随着人民币国际化的加快,资本的流入将有助于银依融资成本的下降,以及互联网技术的进而推动实体经济的回升。未来最大的风险在于资本的外流,这将加剧经济回升的难度。1季度证券市场也在经济筑底回升的预期下快速上涨。2季度,经济整体可能仍然难见明显的提升迹象,但局部风为技术改革的提升以及财政政策的推动,医药生物、商业服务、金融等行业都将逐步显现增长,也将有助于推动证券市场保持震荡上行的态势。

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	161,915,630.56	88.44
	其中:股票	161,915,630.56	88.44
2	固定收益投资	187,434.00	0.10
	其中:债券	187,434.00	0.10
	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	17,340,479.80	9.47
7	其他资产	3,633,196.72	1.98
8	合计	183,076,741.08	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	453,480.07	0.25
B	采矿业	7,008,511.63	3.89
C	制造业	54,183,817.76	30.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,937,979.95	2.74
E	建筑业	7,565,878.41	4.20
F	批发和零售业	4,094,934.30	2.27
G	交通运输、仓储和邮政业	4,176,908.22	2.32
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,611,067.72	4.22
J	金融业	58,510,170.69	32.48
K	房地产业	6,578,765.57	3.65
L	租赁和商务服务业	2,211,767.66	1.23
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,760,545.54	0.98
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	151,609.65	0.08
R	文化、体育和娱乐业	2,190,060.51	1.22
S	综合	480,132.88	0.27
	合计	161,915,630.56	89.87

注:以上行业分类以2015年3月31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	采掘业	-	-
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	-	-
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	-	-
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	-	-

注:本基金本报告期末未持有积极投资部分股票。

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 报告期末指数投资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	84,986	6,649,304.64	3.69
2	600016	民生银行	445,593	4,322,252.10	2.40
3	600030	中信证券	129,345	4,245,102.90	2.36
4	600036	招商银行	271,282	4,223,860.74	2.34
5	601166	兴业银行	187,932	3,450,431.52	1.92
6	600837	海通证券	133,019	3,113,974.79	1.73
7	600000	浦发银行	184,039	2,905,975.81	1.61
8	000002	万 科A	159,451	2,203,612.82	1.22
9	601668	中国建筑	246,461	1,890,355.87	1.05
10	601818	光大银行	398,879	1,886,697.67	1.05

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

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
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	187,434.00	0.10
8	其他	-	-
9	合计	187,434.00	0.10

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113008	电气转债	1,350	187,434.00	0.10

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

注:本基金本报告期末投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

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:本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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收到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2

本基金本报告期末未投资股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,869,527.04
2	应收证券清算款	1,671,373.59
3	应收股利	-
4	应收利息	3,659.26
5	应收申购款	88,636.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,633,196.72

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128007	通鼎转债	5,310	735,116.40	16.53

注:本基金本报告期末持有的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

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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