国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金

【2015】第三季度报告

基金管理人:国金基金管理有限公司
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10月27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10月26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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国金国鑫发起
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	722,977,115.94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	金融机构人民币三年期定期存款基准利率(税后)。
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。

本报告期内,基金管理人的公司名称于2015年7月23日变更为"国金基金管理有限公司",并于2015年7月24日对外公告。根据《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》等法律法规的规定,经托管人同意、并报请中国证监会备案,基金管理人于2015年9月23日起将本基金的基金名称变更为"国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金",并对基金合同及托管协议相应修订,具体请见基金管理人于2015年9月23日在中国证监会指定媒体和基金管理人网站发布的《国金基金管理有限公司关于变更公司旗下基金名称的公告》。

§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7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-9,847,095.54
2.本期利润	-11,862,137.01
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0133
4.期末基金资产净值	1,198,242,780.83
5.期末基金份额净值	1.6574

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。

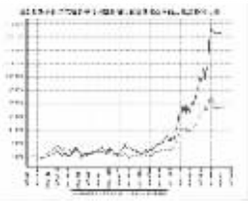
3.2 基金净值表现

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	-0.51%	0.12%	0.81%	0.01%	-1.32%	0.11%

注:本基金的业绩比较基准为:金融机构人民币三年期定期存款基准利率(税后)

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

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		
彭俊斌	基金经理	2015年4月17日	-	4	彭俊斌先生,清华大学博士。2008年5月至2011年4月在北京控制工程研究所任副主任工艺师;2011年5月至2012年6月在民生证券股份有限公司任电子行业分析师,2012年7月加入国金基金管理有限公司,任投资研究部高级分析师;2014年11月起任国金基金管理有限公司权益投资事业部副总经理兼基金经理助理。2015年4月起任国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理;2015年5月起任国金鑫安保本混合型证券投资基金基金经理。
徐艳芳	基金经理	2013年2月25日	-	7	徐艳芳女士,清华大学硕士。2005年10月至2012年6月历任哈天财经公关公司财经咨询、美大泰和财产保险股份有限公司投资经理。2012年6月加盟国金基金管理有限公司,任投资研究部固定收益基金经理。2013年2月起增聘为国金鑫盈货币市场证券投资基金基金经理;2013年12月起增聘为国金鑫盈货币市场证券投资基金基金经理;2014年1月起任国金鑫利分级债券型证券投资基金基金经理;2014年2月起任国金鑫通货币市场证券投资基金基金经理;2015年6月起任国金金赢货币市场证券投资基金基金经理。
滕祖光	基金经理	2014年4月11日	-	9	滕祖光先生,硕士。2003年至2009年先后历任中国工商银行深圳分行国际业务员、中大期货经纪有限公司期货交易员、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。2009年11月加入国金基金管理有限公司,任高级交易员。2014年4月起被增聘为国金鑫盈货币市场证券投资基金基金经理、国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理;2015年8月起被增聘为国金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,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。

本基金管理人管理有9只基金产品,分别为4只混合型基金、2只指数基金和3只货币基金,通过交易系统中的公平交易程序,对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配,报告期内,系统的公平交易程序运作良好,未出现异常情况。针对场外网下交易业务,公司依照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。本报告期内,场外、网下业务公平交易制度执行情况良好,未出现异常情况。

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,报告期内严格执行公司相关制度,严格控制旗下非指数型投资组合参与交易所公开竞价同日反向交易,未发现存在异常交易行为。

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3季度,在经济持续下行、猪肉引发CPI上行、美元存在加息、以及货币宽松边际效益递减的担忧下,3季度股市延续了6月下旬的调整态势。本基金根据3季度投资策略展开操作,仓位控制在低位,避开了市场的大幅调整。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金单位份额净值1.6574元,累计单位净值2.2874元。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

3季度经济增速继续回落,猪肉上行导致CPI上行,但9月份趋于缓和,美国9月并未加息,12月份加息的概率也正在下降,国内货币政策保持了较为宽松的环境,10年期国债收益率下行较大,人民币在一次性贬值后趋于稳定,央行继续采取了降准、降息以及定向放流动性等方式进行对冲外汇占款的减少,4季度也还有降息降准可能。2015年4季度经济增速将继续寻底,重点关注地产投资能否企稳,美国12月份是否会加息,人民币汇率是否稳定。

3季度市场整体以调整为主,特别是前期涨幅较大的成长股。我们认为随着市场的巨幅调整,4季度市场会存在一些结构性的投资机会。在美元还未加息,国内通胀水平较低的情况下,国内货币政策具备较大放松空间。从风格角度,未来蓝筹和成长均会出现分化,业绩的重要性提高,低估值蓝筹股和低估值成长股的表现仍然值得期待。

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)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	465,321,014.00	38.70
	其中:债券	465,321,014.00	38.70
	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	300,000,890.00	24.95
	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	423,015,195.92	35.18
7	其他资产	14,024,379.95	1.17
8	合计	1,202,361,479.87	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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	41,788,014.00	3.49
	其中:政策性金融债	31,827,014.00	2.66
4	企业债券	70,805,000.00	5.91
5	企业短期融资券	271,711,000.00	22.68
6	中期票据	81,017,000.00	6.76
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	465,321,014.00	38.83

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	011599599	15机床SCP002	1,000,000	100,170,000.00	8.36
2	1220026	12泉州银行债	700,000	70,805,000.00	5.91
3	011599571	15陕众SCP001	400,000	40,024,000.00	3.34
4	018001	国开1301	315,400	31,827,014.00	2.66
5	1282495	12正邦MTN1	300,000	30,405,000.00	2.54

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

本基金未参与国债期货投资。

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受到公开谴责、处罚的情况。

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	291,762.30
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	13,417,827.42
5	应收申购款	314,790.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,024,379.95

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

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.6 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	1,640,705,899.38
报告期期间基金总申购份额	274,451,720.39
减:报告期期间基金总赎回份额	1,192,180,503.83
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	722,977,115.94

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,基金管理人的股东广东宝丽华新能源股份有限公司持有本基金的份额为6,500,650.10份、基金管理人的子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,基金管理人的子公司北京千石创富资本管理有限公司旗下的资管计划千石资本-鑫新1号资产管理计划、千石资本-鑫新2号资产管理计划持有本基金的份额分别为250,687,955.12份、359,303,551.11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:基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§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	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	364,265.69	0.05	170,157.25	0.02	3年
基金经理等人员	46,335.42	0.01	-	-	3年
基金管理人股东	6,500,650.10	0.90	6,500,650.10	0.90	3年
其他	10,378.84	-	-	-	3年
合计	6,921,630.05	0.96	6,670,807.35	0.92	-

注:发起份额承诺持有期限为3年,自2012年8月28日起至2015年8月27日止,自2015年8月28日起发起份额解禁。截至本报告期末,发起份额承诺持有期限已经届满。

§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7月1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7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"长江电力"股票估值调整的公告》;

3、2015年7月9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"国投电力"股票估值调整的公告》;

4、2015年7月10日披露了《关于参加数米基金网费率优惠活动的公告》;

5、2015年7月16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"华东医药"股票估值调整的公告》;

6、2015年7月21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2015年第2季度报告》;

7、2015年7月24日披露了《国金通用基金管理有限公司法定名称变更公告》;

8、2015年8月21日披露了《国金基金管理有限公司关于参加同花顺基金费率优惠活动的公告》;

9、2015年8月25日披露了《国金基金管理有限公司关于参加天天基金网费率优惠的公告》;

10、2015年8月26日披露了《国金基金管理有限公司关于旗下基金持有股票估值调整的公告》;

11、2015年8月27日披露了《国金基金管理有限公司关于旗下基金持有股票估值调整的公告》;

12、2015年8月28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2015年半年度报告》、《国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金2015年半年度报告摘要》;

13、2015年9月16日披露了《国金基金管理有限公司关于旗下基金所持"铜陵有色"股票估值调整的公告》、《国金基金管理有限公司关于增加上海基煜基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告》;

14、2015年9月23日披露了《国金基金管理有限公司关于变更公司旗下基金名称的公告》;

15、2015年9月26日披露了《国金基金管理有限公司关于增加上海汇付金融服务有限公司为旗下基金销售机构的公告》;

16、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

国金基金管理有限公司
2015年10月27日

国金鑫运灵活配置混合型证券投资基金

【2015】第三季度报告

基金管理人:国金基金管理有限公司
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10月27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10月26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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国金鑫运灵活配置
场内简称	-
交易代码	001465
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6月24日
报告期末基金份额总额	1,085,333.91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	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	中国光大银行股份有限公司

注:本报告期内,基金管理人的公司名称于2015年7月23日变更为"国金基金管理有限公司",并于2015年7月24日对外公告。根据《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》等法律法规的规定,经托管人同意、并报请中国证监会备案,基金管理人于2015年9月23日起将本基金的基金名称变更为"国金鑫运灵活配置混合型证券投资基金",并对基金合同及托管协议相应修订,具体请见基金管理人于2015年9月23日在中国证监会指定媒体和基金管理人网站发布的《国金基金管理有限公司关于变更公司旗下基金名称的公告》。

§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7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	12,133,449.70
2.本期利润	13,289,169.13
3.加权平均基金份额本期利润	0.0324
4.期末基金资产净值	1,410,945.85
5.期末基金份额净值	1.300

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、本基金合同自2015年6月24日起生效。

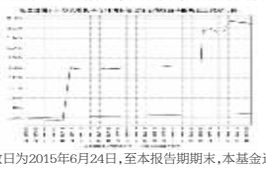
3.2 基金净值表现

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	30.65%	2.30%	1.25%	0.01%	29.40%	2.29%

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:1、本基金基金合同生效日为2015年6月24日,至本报告期期末,本基金运作时间未满一年。

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	基金经理	2015年6月24日	-	7	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。自2014年11月起任指数投资事业部总经理。2013年7月起任国金沪深300指数分级证券投资基金基金经理;2014年8月起任国金鑫安保本混合型证券投资基金基金经理;2015年5月起任国金上证50指数分级证券投资基金基金经理;2015年6月起任国金鑫运灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2015年7月起任国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金(LOF)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》、《国金鑫运灵活配置混合型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,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。

本基金管理人管理有9只基金产品,分别为4只混合型基金、2只指数基金和3只货币基金,通过交易系统中的公平交易程序,对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配,报告期内,系统的公平交易程序运作良好,未出现异常情况。针对场外网下交易业务,公司依照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。本报告期内,场外、网下业务公平交易制度执行情况良好,未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析,对各投资组合不同时间窗口(1日、3日、5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了检验,统计了溢价率占优比例。本报告期内,未出现违反公平交易制度的情况,公司旗下各基金不存在利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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,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。

本基金管理人管理有9只基金产品,分别为4只混合型基金、2只指数基金和3只货币基金,通过交易系统中的公平交易程序,对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配,报告期内,系统的公平交易程序运作良好,未出现异常情况。针对场外网下交易业务,公司依照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。本报告期内,场外、网下业务公平交易制度执行情况良好,未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析,对各投资组合不同时间窗口(1日、3日、5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了检验,统计了溢价率占优比例。本报告期内,未出现违反公平交易制度的情况,公司旗下各基金不存在利益输送的行为。

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,报告期内严格执行公司相关制度,严格控制旗下非指数型投资组合参与交易所公开竞价同日反向交易,未发现存在异常交易行为。

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3季度,本基金严格遵守基金合同,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,本基金主要进行回购投资进行现金管理。

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30.65%,同期业绩比较基准收益率为1.25%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

3季度中国经济主要指标未见明显好转。投资增速仍然趋缓,消费增速平稳,出口暂时出现改善迹象,工业增速仍不见回升,结构性通货紧缩严重。但消费市场的结构性变化显现,短期需求端的下行压力有望逐步缓解,但传统投资需求的持续回落不可避免,未来消费市场的稳定和增长将成为经济增长的稳定器。短期外资流出的压力仍然较大。目前货币环境持续宽松,未来进一步有进一步宽松的预期,有助于融资成本的进一步下降,有助于微观层面结构性行业、企业的收益空间回归,这对风险资产收益是正向预期。从证券市场整体来看,市场投资机会逐步显现,尤其有利于收益的长期配置。

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,自2015年8月7日起至2015年9月30日止,本基金已连续三十七个工作日出现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)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	48,790.00	2.63
	其中:股票	48,790.00	2.63
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	1,632,668.63	88.01
7	其他资产	173,676.64	9.36
8	合计	1,855,135.27	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	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	-	-
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	48,790.00	3.46
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	48,790.00	3.46

注:以上行业分类以2015年9月30日的中国证监会行业分类标准为依据。

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	000839	中信国安	3,400	48,790.00	3.46

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

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

本基金未参与国债期货投资。

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基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	173,272.24
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	404.40
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	173,676.64

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

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	000839	中信国安	48,790.00	3.46	筹划重大事项

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	2,544,931,816.38
报告期期间基金总申购份额	302,750,349.64
减:报告期期间基金总赎回份额	2,846,596,832.11
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	1,085,333.91

注:1、总申购份额含红利再投、转