国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金

【2017】第一季度报告

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:2017年4月22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约定,于2017年4月21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2017年1月1日起至2017年3月31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	266,731,187.49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。

§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(2017年1月1日 – 2017年3月31日)
1.本期已实现收益	9,852,964.40
2.本期利润	19,246,315.92
3.加权平均基金份额本期利润	0.0821
4.期末基金资产净值	519,203,915.09
5.期末基金份额净值	1.9465

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。

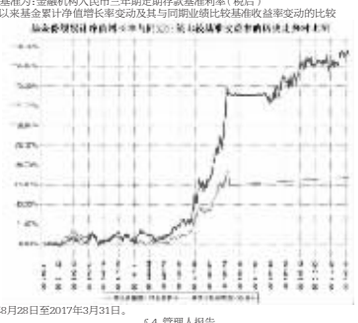
3.2 基金净值表现

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	4.57%	0.56%	0.69%	0.01%	3.88%	0.55%

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



注:图示日期为2012年8月28日至2017年3月31日。

§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		
徐艳芳	本基金基金经理,国金金腾通货币、国金及第七天理财基金经理,投资管理部总经理	2013年2月26日	–	9	徐艳芳女士,清华大学硕士。2005年10月至2012年6月历任柏天财经公关公司财经咨询师、英大泰和财产保险股份有限公司投资经理。2012年6月加入国金基金管理有限公司,历任投资研究部基金经理、固定收益投资部总经理兼基金经理;自2017年3月起任投资管理部总经理兼基金经理。
滕祖光	本基金基金经理,国鑫安保本基金经理	2014年4月11日	–	12	滕祖光先生,中央财经大学硕士。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,历任基金交易部高级交易员、投资研究部基金经理、固定收益投资部基金经理。
李安心	本基金基金经理,国金鑫安保本基金经理	2016年8月29日	–	13	李安心先生,复旦大学硕士,2004年1月至2005年5月在金元证券有限责任公司任研究员;2005年6月至2012年8月在中邮创业基金管理有限公司任研究员、基金经理;2012年9月至2013年1月在国金基金管理有公司任特定资产管理部副总经理;2013年1月至2016年8月在北京千石创富资本管理有限公司历任特定资产管理部投资副总监、乾石投资工作室投资副总监、证券投资部投资副总监。2016年8月再次加入国金基金管理有限公司,历任权益投资事业部基金经理;自2017年3月起任投资管理部基金经理。

注:(1)任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期,首任基金经理的任职日期按基金合同生效日填写;(2)证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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》《公开募集证券投资基金运作管理办法》和其他有关法律法规的规定,以及《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》的约定,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。

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《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,各投资组合按投资管理制度和流程独立决策,并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;在交易执行控制方面,通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进,确保公平交易原则的实现;在行为监控和分析评估方面,通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控,确保做好公平交易的监控和分析。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内,本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易,未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度经济增速平稳,通胀下行,原材料价格维持高位,基本面对债市的支撑不强;美国加息,人民币贬值压力阶段性暂缓,央行继续推动金融去杠杆,MPA考核趋严,货币政策中性偏紧,债市信用风险事件频发,山东邹平板块金融风险抬升,资金面成本持续高位,债券市场延续调整格局。

在资金面偏紧、债券市场调整风险延续的环境下,组合投资操作偏谨慎,组合安排了充裕的流动性以应对市场的流动性冲击和赎回压力,同时整体维持较低的债券仓位和较短久期,以应对市场调整的风险。在充分考虑资金的流动性和安全性考虑的基础上,择机配置优质的流动性和收益性兼具的现金管理工具,在保持短久期策略的基础上,适度提升组合资产的收益性。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金份额净值收益率为0.6788%,同期业绩比较基准收益率为0.3329%。

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	固定收益投资	20,538,790.58	39.54
	其中:债券	20,538,790.58	39.54
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	29,000,135.00	55.83
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
3	银行存款和结算备付金合计	1,726,927.92	3.32
4	其他资产	674,656.93	1.30
5	合计	51,940,510.43	100.00

5.2 报告期末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	1,985,600.00	0.38
B	采矿业	35,959,772.95	6.93
C	制造业	123,730,952.54	23.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	77,936,315.52	15.01
F	批发和零售业	18,659,131.00	3.59
G	交通运输、仓储和邮政业	19,040,894.79	3.67
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	79,131.20	0.02
J	金融业	4,736,345.00	0.91
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	16,054,799.79	3.09
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	1,106,000.00	0.21
S	综合	–	–
	合计	299,281,942.79	57.64

注:以上行业分类以2017年3月31日的中国证监会行业分类标准为依据。

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

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

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	600887	伊利股份	1,300,000	24,583,000.00	4.73
2	601186	中国铁建	1,800,000	23,382,000.00	4.50
3	601800	中国交建	1,200,000	21,492,000.00	4.14
4	600597	光明乳业	1,599,805	20,797,465.00	4.01
5	600028	中国石化	3,400,000	19,516,000.00	3.76
6	000963	华东医药	199,980	18,528,147.00	3.57
7	600820	隧道股份	1,700,000	17,765,000.00	3.42
8	600428	中远海特	2,300,000	16,997,000.00	3.27
9	002353	杰瑞股份	799,904	16,582,009.92	3.19
10	601808	中海油服	1,299,903	16,443,772.95	3.17

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	4,996,000.00	0.96
2	央行票据	–	–
3	金融债券	20,088,000.00	3.87
	其中:政策性金融债	20,088,000.00	3.87
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债(可交换债)	653,560.00	0.13
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	25,737,560.00	4.96

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	140438	14农发38	200,000	20,088,000.00	3.87
2	019557	17国债03	50,000	4,996,000.00	0.96
3	110033	国投转债	5,000	574,550.00	0.11
4	113012	骆驼转债	790	79,000.00	0.02

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国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期末投资股指期货。

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	342,795.79
2	应收证券清算款	76,944.44
3	应收股利	–
4	应收利息	79,077.51
5	应收申购款	4,421,168.09
6	其他应收款	–
7	待摊费用	20,379.96
8	其他	–
9	合计	5,660,364.89

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	110033	国投转债	574,550.00	0.11

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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	216,877,927.60
报告期期间基金总申购份额	86,717,024.32
减:报告期期间基金总赎回份额	36,863,764.43
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	266,731,187.49

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。

§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金。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

注:本基金成立后有11,001,640.59份额为发起份额,发起份额承诺的持有期限为3年,自2012年8月28日起至2015年8月27日止。自2015年8月28日起发起份额承诺持有期限届满,发起份额可以自由申请赎回退出。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

注:本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

9.2 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:

1,2017年1月31日披露了《国金基金管理有限公司2017年1月份公告》;

2,2017年1月4日披露了《国金基金管理有限公司关于增加北京银行为旗下基金销售机构的公告》;

3,2017年1月10日披露了《国金基金管理有限公司关于增加上海华信证券有限责任公司和贵州华阳众惠基金销售有限公司为国金基金旗下基金销售机构的公告》;

4,2017年1月12日披露了《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金投资托管人关联方承销证券的关联交易公告》;

5,2017年1月14日披露了《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金投资托管人关联方承销证券的关联交易公告》;

6,2017年1月19日披露了《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金参加招商证券股份有限公司基金申购费率优惠的公告》;

7,2017年1月20日披露了《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金投资托管人关联方承销证券的关联交易公告》;

8,2017年1月21日披露了《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金2016年第4季度报告》;

9,2017年1月25日披露了《关于增加北京肯特瑞财富投资管理有限公司为旗下基金销售机构的公告》《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金投资托管人关联方承销证券的关联交易公告》;

10,2017年2月9日披露了《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金投资托管人关联方承销证券的关联交易公告》;

11,2017年2月10日披露了《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金投资托管人关联方承销证券的关联交易公告》;

12,2017年2月16日披露了《国金基金管理有限公司参加北京钱景财富投资管理有限公司基金申购费率优惠的公告》;

13,2017年3月3日披露了《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金投资托管人关联方承销证券的关联交易公告》;

14,2017年3月4日披露了《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金投资托管人关联方承销证券的关联交易公告》;

15,2017年3月11日披露了《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金投资托管人关联方承销证券的关联交易公告》;

16,2017年3月28日披露了《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金2016年年度》《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金2016年年度报告摘要》;

17,2017年3月30日披露了《国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资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》《国金基金管理有限公司关于深圳前海微众银行股份有限公司开通本公司旗下基金定期定额投资业务的公告》。

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
2017年4月22日

国金沪深300指数分级证券投资基金

【2017】第一季度报告

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:2017年4月22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2017年4月21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2017年1月1日起至2017年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国金沪深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	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	185,330,553.08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。
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

下属分级基金的基金简称	国金300A	国金300B	国金300
下属分级基金场内简称	国金300A	国金300B	国金300
下属分级基金的交易代码	150140	150141	167601
报告期末下属分级基金的份额总额	82,349,722.00份	82,349,722.00份	20,631,109.08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。

§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(2017年1月1日 – 2017年3月31日)
1.本期已实现收益	–350,350.04
2.本期利润	4,711,810.25
3.加权平均基金份额本期利润	0.0336
4.期末基金资产净值	162,717,868.01
5.期末基金份额净值	0.8780

注:本期已实现收益指本期利息收入、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。

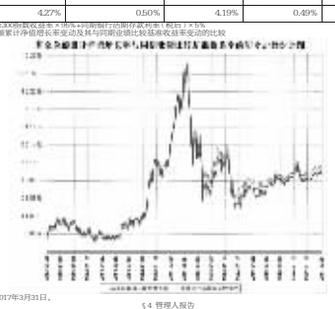
3.2 基金净值表现

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	4.27%	0.50%	4.19%	0.49%	0.08%	0.01%

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



注:图示日期为2013年7月26日至2017年3月31日。

§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	本基金基金经理,国金鑫安保本,国金上证50,国金鑫新灵活配置(LOF)基金经理,量化投资事业三部总经理	2013年7月26日	–	9	宫雪女士,中国科学院博士。2006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,指数投资事业部总经理,自2016年4月起任量化投资事业三部总经理。

注:(1)首任基金经理的任职日期按基金合同生效日填写;(2)证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《中华人民共和国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:

1,2017年1月31日披露了《国金基金管理有限公司2016年12月31日旗下基金净值公告》;

2,2017年1月4日披露了《国金基金管理有限公司关于增加北京银行为旗下基金销售机构的公告》《国金沪深300指数分级证券投资基金参加中国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》;

3,2017年1月5日披露了《国金沪深300分级实盘份额折算日次日拆股盘价调整的公告》《国金沪深300分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告》;

4,2017年1月21日披露了《国金沪深300指数分级证券投资基金2016年第4季度报告》;

5,2017年1月25日披露了《关于增加北京肯特瑞财富投资管理有限公司为旗下基金销售机构的公告》;

6,2017年2月13日披露了《国金基金管理有限公司关于基金经理恢复履行职责的公告》;

7,2017年2月16日披露了《国金基金管理有限公司参加北京钱景财富投资管理有限公司基金申购费率优惠的公告》;

8,2017年3月4日披露了《国金沪深300指数分级证券投资基金投资人关联方承销证券的关联交易公告》;

9,2017年3月11日披露了《国金沪深300指数分级证券投资基金投资人关联方承销证券的关联交易公告》《国金沪深300指数分级证券投资基金招募说明书(更新)》《国金沪深300指数分级证券投资基金招募说明书(更新)摘要》;

10,2017年3月22日披露了《国金沪深300指数分级证券投资基金投资托管人发行债券的关联交易公告》;

11,2017年3月28日披露了《国金沪深300指数分级证券投资基金2016年年度报告》《国金沪深300指数分级证券投资基金2016年年度报告摘要》;

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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1,中国证监会核准基金募集的文件;

2,国金沪深300指数分级证券投资基金基金合同;

3,国金沪深300指数分级证券投资基金托管协议;

4,国金沪深300指数分级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。

9.2 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。

9.3 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
2017年4月22日

国金及第七天理财债券型证券投资基金

【2017】第一季度报告

基金管理人:国金基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:2017年4月22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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月21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2017年1月1日起至2017年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国金及第七天理财
场内简称	–
交易代码	003002
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	2016年8月4日
报告期末基金份额总额	51,738,793.24份
投资目标	在严格控制投资风险和保持资产流动性的前提下,追求稳定的当期收益,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金的投资将以保证资产的安全性和流动性为基本原则,在对国内外宏观经济走势、财政政策、货币政策变动等因素充分评估的基础上,判断金融市场利率的走势,择优筛选并优化配置投资范围内的各种金融工具,进行积极的投资组合管理,将组合的平均剩余期限控制在合理的水平,提高基金的收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:人民币七天通知存款税后利率。
风险收益特征	本基金为短期理财债券型基金,属于较高预期风险水平低于混合型基金、股票型基金和普通债券型基金,高于货币市场基金。
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

§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(2017年1月1日 – 2017年3月31日)
1. 本期已实现收益	463,590.50
2. 本期利润	463,590.50
3. 期末基金资产净值	51,738,793.24

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,本期利润为本期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法核算,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。

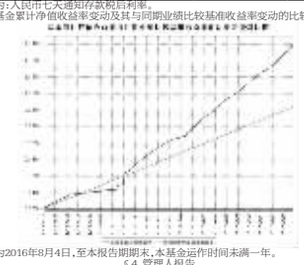
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.6788%	0.0030%	0.3329%	0.0000%	0.3459%	0.0030%

注:本基金的业绩比较基准为:人民币七天通知存款税后利率。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益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2016年8月4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		
徐艳芳	本基金基金经理,国金国鑫发起,国金金腾通货币、国金众赢货币基金经理,投资管理部总经理	2016年8月4日	–	9	徐艳芳女士,请华大学硕士。2005年10月至2012年6月历任柏天财经公关公司财经咨询师、英大泰和财产保险股份有限公司投资经理。2012年6月加入国金基金管理有限公司,历任投资研究部基金经理、固定收益投资部总经理兼基金经理;自2017年3月起任投资管理部总经理兼基金经理。

注:(1)首任基金经理的任职日期按基金合同生效日填写;(2)证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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》《公开募集证券投资基金运作管理办法》和其他有关法律法规的规定,以及《国金及第七天理财债券型证券投资基金基金合同》的约定,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《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,各投资组合按投资管理制度和流程独立决策,并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;在交易执行控制方面,通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进,确保公平交易原则的实现;在行为监控和分析评估方面,通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控,确保做好公平交易的监控和分析。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内,本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易,未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度经济增速平稳,通胀下行,原材料价格维持高位,基本面对债市的支撑不强;美国加息,人民币贬值压力阶段性暂缓,央行继续推动金融去杠杆,MPA考核趋严,货币政策中性偏紧,债市信用风险事件频发,山东邹平板块金融风险抬升,资金面成本持续高位,债券市场延续调整格局。

在资金面偏紧、债券市场调整风险延续的环境下,组合投资操作偏谨慎,组合安排了充裕的流动性以应对市场的流动性冲击和赎回压力,同时整体维持较低的债券仓位和较短久期,以应对市场调整的风险。在充分考虑资金的流动性和安全性考虑的基础上,择机配置优质的流动性和收益性兼具的现金管理工具,在保持短久期策略的基础上,适度提升组合资产的收益性。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金份额净值收益率为0.6788%,同期业绩比较基准收益率为0.3329%。

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	固定收益投资	20,538,790.58	39.54
	其中:债券	20,538,790.58	39.54
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	29,000,135.00	55.83
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
3	银行存款和结算备付金合计	1,726,927.92	3.32
4	其他资产	674,656.93	1.30
5	合计	51,940,510.43	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.29	
	其中:买断式回购融资	–	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	–	–
	其中:买断式回购融资	–	–

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。