

# 国金沪深 300 指数分级证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

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

送出日期：2016 年 8 月 27 日

## § 1 重要提示及目录

### 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 2016 年 8 月 26 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 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
<b>§4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 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	12
<b>§5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
<b>§7 投资组合报告</b>	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
7.6 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	51
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	51
7.8 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	51
7.9 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	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52

7.12 投资组合报告附注.....	52
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>54</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	55
8.4 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.....	55
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>55</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>56</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
10.2 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.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57
10.8 其他重大事件.....	58
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>61</b>
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>61</b>
12.1 备查文件目录.....	61
12.2 存放地点.....	61
12.3 查阅方式.....	61

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国金沪深 300 指数分级证券投资基金		
基金简称	国金 300		
场内简称	国金 300		
基金主代码	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		
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		
报告期末基金份额总额	35,788,448.41 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2013 年 8 月 23 日		
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份额总额	7,430,405.00 份	7,430,405.00 份	20,927,638.41 份

注：无。

### 2.2 基金产品说明

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其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，以实现跟踪误差的有效控制。
业绩比较基准	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。从本基金所分离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。		
下属分级基金的风险收益特征	从本基金所分离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。	从本基金所分离的两类基金份额来看，国金沪深 300B 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。

### 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
注册地址		北京市怀柔区府前街三号楼 3-6	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心
办公地址		北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 层	北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心
邮政编码		100089	100033
法定代表人		尹庆军	唐双宁

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》。
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

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

### § 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(2016年1月1日 - 2016年6月30日)
本期已实现收益	-1,070,993.14
本期利润	-5,091,443.73
加权平均基金份额本期利润	-0.1376
本期加权平均净值利润率	-17.08%
本期基金份额净值增长率	-14.83%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配利润	7,518,078.60
期末可供分配基金份额利润	0.2101
期末基金资产净值	29,332,816.49
期末基金份额净值	0.8196
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	34.45%

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
过去一个月	0.05%	0.99%	-0.46%	0.93%	0.51%	0.06%
过去三个月	-0.98%	1.03%	-1.88%	0.96%	0.90%	0.07%
过去六个月	-14.83%	1.85%	-14.66%	1.75%	-0.17%	0.10%
过去一年	-29.98%	2.33%	-28.01%	2.19%	-1.97%	0.14%
自基金合同生效起至今	34.45%	1.84%	39.43%	1.75%	-4.98%	0.09%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、图示日期为 2013 年 7 月 26 日至 2016 年 6 月 30 日。

2、本基金基金合同生效日为 2013 年 7 月 26 日。

### 3.3 其他指标

注：无

## § 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

国金基金管理有限公司（原名称为“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。2015 年 7 月，公司名称由“国金通用基金管理有限公司”变更为“国金基金管理有限公司”。公司股东为国金证券股份有限公司、苏州



工业园区兆润投资控股集团有限公司、广东宝丽华新能源股份有限公司、涌金投资控股有限公司，股权比例分别为 49%、19.5%、19.5% 和 12%。截至 2016 年 6 月 30 日，国金基金管理有限公司共管理 8 只开放式基金——国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金、国金沪深 300 指数分级证券投资基金、国金鑫盈货币市场证券投资基金、国金金腾货币市场证券投资基金、国金鑫安保本混合型证券投资基金、国金上证 50 指数分级证券投资基金、国金众赢货币市场证券投资基金、国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）。

#### 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		
宫雪	基金经理	2013 年 7 月 26 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、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，截至本季度末，宫雪女士同时兼任国金上证 50 指数分级基金、国金鑫安保本混合型基金、国金鑫新灵活配置混合型基金（LOF）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 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

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 8 只基金产品，分别为 3 只混合型基金、2 只指数基金和 3 只货币基金，通过交易系统内的公平交易程序，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 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

报告期，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-14.83%，同期业绩比较基准收益率为-14.66%；报告期内，基金的日均跟踪偏离度 0.065%，低于合同约定的日均跟踪偏离度为 0.35%，年化跟踪误差为 1.526%，低于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

2016 年经济增长呈现阶段性企稳态势。从国际看，世界经济复苏不及预期，黑天鹅事件频发，贸易持续低迷，不确定性增加；从国内看，中国经济调整的阵痛还在持续，下行压力依然较大。上半年供给侧改革进入实质性推进阶段，在去产能的大背景下，工业将继续保持低位运行；世界局势动荡及美国指数上升引发人民币贬值，但贬值预期稳定；得益于人民币汇率的贬值及世界经济恢复，出口得到边际性改善。预期下半年全市场继续延续震荡态势，较难出现趋势性机会，但个别行业仍存结构性机会。

## 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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同约定，在存续期内，本基金（包括国金沪深 300 份额、国金沪深 300A 份额、国金沪深 300B 份额）不进行收益分配。

#### 4.8 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

本报告期内，自 2016 年 1 月 4 日起至 2016 年 2 月 22 日止，本基金已连续三十一个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形；自 2016 年 2 月 25 日起至 2016 年 5 月 16 日止，本基金已连续五十六个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形；自 2016 年 05 月 19 日起至 2016 年 06 月 30 日止，本基金已连续二十九个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 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

2016 年上半年度，中国光大银行股份有限公司在国金沪深 300 指数分级证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《公开募集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，对国金沪深 300 指数分级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

2016 年上半年度，中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《公开募集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基金管理有限公司编制的“国金沪深 300 指数分级证券投资基金 2016 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：国金沪深 300 指数分级证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	2,399,796.23	2,251,144.87
结算备付金		687,941.14	952,082.80
存出保证金		567,459.77	726,001.06
交易性金融资产	6.4.7.2	26,221,992.08	30,769,202.46
其中：股票投资		26,219,619.48	30,765,702.46
基金投资		-	-
债券投资		2,372.60	3,500.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	480.99	645.46
应收股利		-	-
应收申购款		1,998.59	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		29,879,668.80	34,699,076.65
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		2,515.19	56,748.12

应付管理人报酬		19,062.21	24,230.75
应付托管费		4,765.55	6,057.70
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	187,955.60	266,718.38
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	332,553.76	316,213.88
负债合计		546,852.31	669,968.83
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	21,814,737.89	21,556,946.41
未分配利润	6.4.7.10	7,518,078.60	12,472,161.41
所有者权益合计		29,332,816.49	34,029,107.82
负债和所有者权益总计		29,879,668.80	34,699,076.65

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，国金沪深 300 份额净值人民币 0.8196 元，国金沪深 300A 份额净值人民币 1.0249 元，国金沪深 300B 份额净值人民币 0.6144 元，基金份额总额 35,788,448.41 份，其中国金沪深 300 份额 20,927,638.41 份，国金沪深 300A 份额 7,430,405.00 份，国金沪深 300B 份额 7,430,405.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国金沪深 300 指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-4,752,607.55	41,993,840.12
1.利息收入		13,591.00	64,378.31
其中：存款利息收入	6.4.7.11	13,588.05	64,288.55
债券利息收入		2.95	89.76
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-803,184.00	44,518,892.35
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-761,616.22	38,374,040.71
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,390.51	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-290,820.00	5,240,841.82

股利收益	6.4.7.16	247,861.71	904,009.82
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-4,020,450.59	-3,101,248.88
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	57,436.04	511,818.34
<b>减：二、费用</b>		338,836.18	2,156,775.72
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	117,692.40	776,341.28
2. 托管费	6.4.10.2.2	29,423.14	194,085.34
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	9,176.36	1,003,780.30
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	182,544.28	182,568.80
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-5,091,443.73	39,837,064.40
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-5,091,443.73	39,837,064.40

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国金沪深 300 指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	21,556,946.41	12,472,161.41	34,029,107.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-5,091,443.73	-5,091,443.73
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）	257,791.48	137,360.92	395,152.40
其中：1.基金申购款	35,729,716.53	11,091,765.72	46,821,482.25
2.基金赎回款	-35,471,925.05	-10,954,404.80	-46,426,329.85
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）	21,814,737.89	7,518,078.60	29,332,816.49
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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）	42,232,685.64	22,886,020.97	65,118,706.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	39,837,064.40	39,837,064.40
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）	14,370,767.35	-10,637,543.06	3,733,224.29
其中：1.基金申购款	255,736,283.76	159,859,587.43	415,595,871.19
2.基金赎回款	-241,365,516.41	-170,497,130.49	-411,862,646.90
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）	56,603,452.99	52,085,542.31	108,688,995.30

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：

\_\_\_\_\_  
尹庆军

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
聂武鹏

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
于晓莲

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

国金沪深 300 指数分级证券投资基金（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”）[2013]694 号文《关于核准国金通用沪深 300 指数分级证券投资基金募集的批复》的核准，由国金基金管理有限公司于 2013 年 7 月 1 日至 2013 年 7 月 19 日向社会公开募集。基金合同于 2013 年 7 月 26 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。首次募集规模为 323,127,755.17 份基金份额。根据《基金合同》的约定，场外认购的全部份额确认为国金沪深 300 份额；场内认购的全部份额按 1:1 的比例确认为国金沪深 300A 份额和国金沪深 300B



份额。其中场外认购的基金份额确认为 257,031,393.17 份国金沪深 300 份额（含募集期利息结转的份额）；场内认购的基金份额按 1:1 比例确认为 33,048,181.00 份国金沪深 300A 份额和 33,048,181.00 份国金沪深 300B 份额。本基金的基金管理人为国金通用基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

本基金的基金份额包括国金沪深 300 指数分级的基础份额（简称“国金沪深 300 份额”）、国金沪深 300 指数分级的稳健收益类份额（简称“国金沪深 300A 份额”）和国金沪深 300 指数分级的积极收益类份额（简称“国金沪深 300B 份额”）。其中，国金沪深 300A 份额和国金沪深 300B 份额的基金份额配比始终保持 1:1 的比例不变。国金沪深 300 指数分级发售结束后，投资人在募集期通过场内认购的全部国金沪深 300 份额将按照 1:1 的比例自动分离成预期收益与预期风险不同的两个份额类别，即稳健收益类的国金沪深 300A 份额和积极收益类的国金沪深 300B 份额，两类基金份额的基金资产与基础份额对应的基金资产合并运作。基金成立并开放申购赎回后，投资人可在场内申购国金沪深 300 份额，并可选择将其申购的每两份国金沪深 300 份额按 1:1 的比例分拆为国金沪深 300A 份额和国金沪深 300B 份额各一份。投资人在场外认购和申购的国金沪深 300 份额不进行分拆，该份额通过跨系统转托管至场内后，投资人可选择将其持有的每两份国金沪深 300 份额按 1:1 的比例分拆为国金沪深 300A 份额和国金沪深 300B 份额各一份。

在国金沪深 300A 份额和国金沪深 300B 份额存续期内的每个会计年度第一个工作日，本基金进行定期份额折算。折算方式为对国金沪深 300A 份额的应得收益进行定期份额折算，国金沪深 300 份额持有人持有的每 2 份国金沪深 300 份额将按 1 份国金沪深 300A 份额获得应得约定收益的新增折算份额。在基金份额定期折算前与折算后，国金沪深 300A 份额和国金沪深 300B 份额的份额配比保持 1:1 的比例不变。对于国金沪深 300A 份额期末的约定应得收益，即国金沪深 300A 份额每个会计年度最后一日份额参考净值超出人民币 1.000 元部分，将被折算为场内国金沪深 300 份额分配给国金沪深 300A 份额持有人。国金沪深 300 份额持有人持有的每 2 份国金沪深 300 份额将获得按照 1 份国金沪深 300A 份额应得约定收益分配的新增国金沪深 300 份额。持有场外国金沪深 300 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外国金沪深 300 份额；持有场内国金沪深 300 份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内国金沪深 300 份额；经过上述份额折算，国金沪深 300A 份额的参考净值和国金沪深 300B 份额的基金份额净值将相应调整。除此之外，本基金还将在以下两种情况进行不定期份额折算，即：当国金沪深 300 份额的基金份额净值大于或等于人民币 1.500 元时；当国金沪深 300B 份额的参考净值小于或等于人民币 0.250 元时。

本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括沪深 300 指数的成份股、备选成份股（包括中小板、创业板及其它中国证监会核准上市的股票）、新股（一级市场初次发行或增发）、

债券、债券回购、资产支持证券、权证、股指期货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）。本基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的市值加上买入、卖出股指期货合约的轧差合计值不低于基金资产净值的 90%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的市值不低于非现金基金资产的 85%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券；投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 5\% \times \text{同期银行活期存款利率（税后）}$ 。

#### 6.4.2 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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

##### 6.4.4.1 会计年度

-

##### 6.4.4.2 记账本位币

-

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

-

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

-

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

-

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

-

#### 6.4.4.7 实收基金

-

#### 6.4.4.8 损益平准金

-

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

-

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

-

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

-

#### 6.4.4.12 分部报告

-

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

-

#### 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

本基金本报告期末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、增值税

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；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，买断式买入返售金融商品、同业存单以及持有金融债券的利息收入免征增值税。

### 3. 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。

#### 4. 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、中国证监会财税[2015]101 号文《关于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 2015 年 9 月 8 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，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税；

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。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
活期存款	2,399,796.23
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	2,399,796.23

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	32,373,271.09	26,219,619.48	-6,153,651.61
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	2,372.60	372.60
	银行间市场	-	-
	合计	2,372.60	372.60
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	32,375,271.09	26,221,992.08	-6,153,279.01

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日			备注
	合同/名义金 额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	2,715,000.00	-	-	
其中：股指期货投资	2,715,000.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	2,715,000.00	-	-	

注：股指期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中，具体投资情况如下：

期货合约 IF1607 买入持仓 3 手，期货合约市值为 2,802,060.00 元，公允价值变动 87,060.00 元。

股指期货投资本期收益-290,820.00 元，股指期货投资本期公允价值变动 57,360.00 元。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	476.39
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	1.40
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	3.20
合计	480.99

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	187,955.60
银行间市场应付交易费用	-
合计	187,955.60

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
----	-------------------

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	9.48
预提费用	232,544.28
其他应付款-指数使用费	100,000.00
合计	332,553.76

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	34,187,556.82	21,556,946.41
本期申购	801.30	505.27
本期赎回(以“-”号填列)	-206,451.46	-130,182.40
2016年1月4日 基金拆分/份额折算前	33,981,906.66	21,427,269.28
基金拆分/份额折算变动份额	1,168,898.87	-
本期申购	58,614,323.41	35,729,211.25
本期赎回(以“-”号填列)	-57,976,680.53	-35,341,742.64
本期末	35,788,448.41	21,814,737.89

注：申购含转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,567,553.31	1,904,608.10	12,472,161.41
本期利润	-1,070,993.14	-4,020,450.59	-5,091,443.73
本期基金份额交易产生的变动数	112,957.01	24,403.91	137,360.92
其中：基金申购款	16,403,863.24	-5,312,097.52	11,091,765.72
基金赎回款	-16,290,906.23	5,336,501.43	-10,954,404.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,609,517.18	-2,091,438.58	7,518,078.60

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	13,369.47



定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	68.36
其他	150.22
合计	13,588.05

### 6.4.7.12 股票投资收益

#### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	3,070,619.92
减：卖出股票成本总额	3,832,236.14
买卖股票差价收入	-761,616.22

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	1,390.51
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,390.51

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	12,892.60
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	11,500.00
减：应收利息总额	2.09
买卖债券差价收入	1,390.51

**6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期无债券赎回差价收入。

**6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期无债券申购差价收入。

**6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.14 贵金属投资收益****6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益**

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2016年1月1日至2016年6月30日
权证投资收益	-
股指期货-投资收益	-290,820.00

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日

股票投资产生的股利收益	247,861.71
基金投资产生的股利收益	-
合计	247,861.71

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-4,077,810.59
——股票投资	-4,078,183.19
——债券投资	372.60
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	57,360.00
——权证投资	-
——股指期货投资	57,360.00
3. 其他	-
合计	-4,020,450.59

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	57,436.04
合计	57,436.04

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	9,176.36
银行间市场交易费用	-
合计	9,176.36

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	24,863.02
信息披露费	57,681.26
指数使用费	100,000.00
合计	182,544.28

#### 6.4.7.21 分部报告

无

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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

本报告期未发生变化。

##### 6.4.9.2 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
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
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	基金管理人的子公司
苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司	基金管理人股东
涌金投资控股有限公司	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。

##### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	-	-	138,435,737.19	18.81%

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016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
	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日			
关联方名称	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	98,344.31	18.00%	119,507.98	28.59%

注：本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6 月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30 日
	当期发生的基金应支付的管理费	117,692.40
其中：支付销售机构的客户维护费	14,751.84	34,573.24

注：1. 基金管理费按前一日基金资产净值的0.80%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.80\% / \text{当年天数}$$

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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	29,423.14	194,085.34

注：1. 基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：无

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	国金 300A	国金 300B	国金 300
基金合同生效日 ( 2013 年 7 月 26 日 ) 持有的基金份额	-	-	-
期初持有的基金份额	-	-	953,393.37
期间申购/买入总份额	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	32,794.55
减: 期间赎回/卖出总 份额	-	-	-
期末持有的基金份额	-	-	986,187.92
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-	2.7556%

项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	国金 300A	国金 300B	国金 300
基金合同生效日 ( 2013 年 7 月 26 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. 基金管理人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。

2. 本基金的管理人于上年度可比期间未运用自有资金交易本基金。

#### 6.4.10.4.2 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

国金 300A		
关联方名称	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 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
--	-------------	--------------------------	-------------	--------------------------

份额单位：份

国金 300B				
关联方名称	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015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

份额单位：份

国金 300				
关联方名称	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015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
上海国金通用财富资产管理有限公司	4,979,252.94	13.9130%	4,813,673.57	14.0802%
北京千石创富资本管理有限公司	2,987,153.34	8.3467%	2,887,818.97	8.4470%

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。

#### 6.4.10.5 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 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行	2,399,796.23	13,369.47	10,094,575.11	57,020.68

注：本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无



## 6.4.11 利润分配情况

### 6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

## 6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

### 6.4.12.1 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/增发证券而流通受限的证券。

### 6.4.12.2 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
000002	万科A	2015年12月18日	临时停牌	18.20	2016年7月4日	21.99	24,451	338,995.01	445,008.20	-
000651	格力电器	2016年2月22日	临时停牌	19.22	-	-	15,232	333,299.29	292,759.04	-
600019	宝钢股份	2016年6月27日	临时停牌	4.90	-	-	15,233	103,466.96	74,641.70	-
600649	城投控股	2016年6月20日	临时停牌	14.36	-	-	4,636	57,957.99	66,572.96	-
002465	海格通信	2016年6月13日	临时停牌	12.44	-	-	5,310	78,981.80	66,056.40	-
002065	东华软件	2015年12月21日	临时停牌	25.10	2016年7月4日	22.59	2,455	62,439.92	61,620.50	-
000728	国元证券	2016年6月8日	临时停牌	16.72	2016年7月8日	17.37	3,662	103,254.33	61,228.64	-
000415	渤海金控	2016年2月1日	临时停牌	6.82	2016年8月11日	7.50	5,900	49,241.00	40,238.00	-
600005	武钢股份	2016年6月27日	临时停牌	2.76	-	-	12,400	70,388.69	34,224.00	-
002129	中环股份	2016年4月25日	临时停牌	8.29	-	-	4,029	55,512.78	33,400.41	-

		日								
000629	*ST 钒 钛	2016 年 5 月 26 日	临时 停牌	2.39	-	-	13,443	50,947.61	32,128.77	-

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 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。

#### 6.4.12.3.2 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。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

-

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人的风险管理政策是通过事前充分到位的防范、事中实时有效的过程控制、事后完备可追踪的检查和反馈，将风险管理贯穿于投研运作的整个流程，从而使基金投资风险可测、可控、可承担，有效防范和化解投研业务的市场风险、信用风险、流动性风险及操作风险。

本基金管理人建立了董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险管理组织体系，合规风控部风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险控制委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

董事会负责公司整体风险的预防和控制，审核、监督公司风险控制制度的有效执行。董事会下设风险管理委员会，并制定《风险管理委员会议事规则》，规范其组成人员、职责、议事规则等事宜。

督察长负责公司及其投资组合运作的监察稽核工作，向董事会汇报。

总经理负责公司日常经营管理中的风险控制工作。总经理下设风险控制委员会，负责对公司经营及投资组合运作中的风险进行识别、评估和防控，负责对投资组合风险评估报告中提出的重大问题进行讨论和决定应对措施。公司制定《风险控制委员会议事规则》，规范其组成人员、职责、议事规则等事宜。

本基金管理人推行全员风险管理理念，公司各部门是风险管理的一线部门，公司各部门负责人是其部门风险管理的第一责任人，根据公司制度规定的各项作业流程和规范，加强对风险的控

制。

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制，基金经理是本基金风险管理的第一责任人。

合规风控部监察稽核团队负责对风险控制制度的建立和落实情况进行监督，在职权范围内独立履行检查、评价、报告、建议职能；合规风控部风险管理团队独立于投资研究体系，负责落实具体的风险管理政策，对投资进行事前、事中及事后的风险管理。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、到期未能及时足额兑付本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，并对证券交割方式进行限制，以控制相应的信用风险。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	-	-

注：本基金本报告期末未持有短期信用评级的债券。

##### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
AAA	2,372.60	0.00
AAA 以下	0.00	3,500.00
未评级	0.00	0.00
合计	2,372.60	3,500.00

注：表中所列示的债券投资为除短期融资券、超短期融资券、同业存单、其他按短期信用评级的债券投资、国债、政策性金融债、央行票据以外的债券。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理团队设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金资产净值的 40%。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险等。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本报告期内，本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

## 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	2,399,796.23	-	-	-	-	-	2,399,796.23
结算备付金	687,941.14	-	-	-	-	-	687,941.14
存出保证金	7,047.77	-	-	-	-	560,412.00	567,459.77
交易性金融资产	-	-	2,372.60	-	-	26,219,619.48	26,221,992.08
应收利息	-	-	-	-	-	480.99	480.99
应收申购款	-	-	-	-	-	1,998.59	1,998.59
资产总计	3,094,785.14	-	2,372.60	-	-	26,782,511.06	29,879,668.80
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,515.19	2,515.19
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	19,062.21	19,062.21
应付托管费	-	-	-	-	-	4,765.55	4,765.55
应付交易费用	-	-	-	-	-	187,955.60	187,955.60
其他负债	-	-	-	-	-	332,553.76	332,553.76
负债总计	-	-	-	-	-	546,852.31	546,852.31
利率敏感度缺口	3,094,785.14	0.00	2,372.60	-	-	26,235,658.75	29,332,816.49
上年度末 2015年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	2,251,144.87	-	-	-	-	-	2,251,144.87
结算备付金	952,082.80	-	-	-	-	-	952,082.80
存出保证金	64,897.06	-	-	-	-	661,104.00	726,001.06
交易性金融资产	-	-	3,500.00	-	-	30,765,702.46	30,769,202.46
衍生金融资产	-	-	-	-	-	29,700.00	29,700.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-29,700.00	-29,700.00
应收利息	-	-	-	-	-	645.46	645.46
资产总计	3,268,124.73	0.00	3,500.00	0.00	0.00	31,427,451.92	34,699,076.65
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	56,748.12	56,748.12
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	24,230.75	24,230.75
应付托管费	-	-	-	-	-	6,057.70	6,057.70
应付交易费用	-	-	-	-	-	266,718.38	266,718.38
其他负债	-	-	-	-	-	316,213.88	316,213.88
负债总计	-	-	-	-	-	669,968.83	669,968.83
利率敏感度缺口	3,268,124.73	-	3,500.00	-	-	30,757,483.09	34,029,107.82

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日、行权日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金于本报告期末持有的交易性债券资产公允价值占基金资产净值的比例为 0.01%，因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股，所面临的其他价格风险来源于标的指数成份股和备选成份股证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制的方法，按照个股在标的指数中的基准权重构建投资组合。基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发等变化，对基金投资组合进行相应调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金主要投资于指数的成份股及其备选成份股（投资比例不低于基金资产净值的 90%）。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金的风险及潜在价格风险进行度量和测试，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	26,219,619.48	89.39	30,765,702.46	90.41
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	2,372.60	0.01	3,500.00	0.01
交易性金融资产—贵金属投	-	-	-	-

资				
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	26,221,992.08	89.39	30,769,202.46	90.42

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定沪深 300 指数（000300.SH）变化 5%，其他变量不变；		
	Beta 系数是根据组合在过去一年所有交易日的净值数据和沪深 300 指数数据回归得出，反映了基金和沪深 300 指数的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	+5%	1,477,812.98	1,813,998.65
	-5%	-1,477,812.98	-1,813,998.65

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无

## § 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	26,219,619.48	87.75
	其中：股票	26,219,619.48	87.75
2	固定收益投资	2,372.60	0.01
	其中：债券	2,372.60	0.01
	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	3,087,737.37	10.33
7	其他各项资产	569,939.35	1.91

8	合计	29,879,668.80	100.00
---	----	---------------	--------

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	20,185.49	0.07
B	采矿业	946,537.03	3.23
C	制造业	8,305,292.95	28.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,036,760.12	3.53
E	建筑业	855,573.73	2.92
F	批发和零售业	702,477.26	2.39
G	交通运输、仓储和邮政业	795,046.91	2.71
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,609,904.96	5.49
J	金融业	9,457,372.09	32.24
K	房地产业	1,326,804.23	4.52
L	租赁和商务服务业	318,839.58	1.09
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	184,676.33	0.63
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	43,580.29	0.15
R	文化、体育和娱乐业	487,458.08	1.66
S	综合	129,110.43	0.44
	合计	26,219,619.48	89.39

注：以上行业分类以 2016 年 6 月 30 日的证监会行业分类标准为依据。

### 7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 7.2.3 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。



### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 7.3.1 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所有股票投资明细

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	601318	中国平安	33,372	1,069,238.88	3.65
2	600016	民生银行	72,893	650,934.49	2.22
3	601166	兴业银行	41,132	626,851.68	2.14
4	600036	招商银行	31,782	556,185.00	1.90
5	601328	交通银行	84,703	476,877.89	1.63
6	600519	贵州茅台	1,541	449,848.72	1.53
7	000002	万科A	24,451	445,008.20	1.52
8	600000	浦发银行	26,663	415,142.91	1.42
9	600030	中信证券	24,245	393,496.35	1.34
10	600837	海通证券	24,919	384,250.98	1.31
11	601288	农业银行	117,726	376,723.20	1.28
12	601398	工商银行	74,693	331,636.92	1.13
13	601169	北京银行	31,196	323,502.52	1.10
14	600887	伊利股份	18,714	311,962.38	1.06
15	000651	格力电器	15,232	292,759.04	1.00
16	601601	中国太保	9,723	262,909.92	0.90
17	601766	中国中车	28,227	258,841.59	0.88
18	600900	长江电力	20,305	253,609.45	0.86
19	601668	中国建筑	46,261	246,108.52	0.84
20	000333	美的集团	9,879	234,329.88	0.80
21	600153	建发股份	17,650	211,800.00	0.72
22	601988	中国银行	64,953	208,499.13	0.71
23	600104	上汽集团	10,203	207,018.87	0.71
24	601688	华泰证券	10,113	191,337.96	0.65
25	000858	五粮液	5,809	188,966.77	0.64
26	601818	光大银行	49,079	184,537.04	0.63
27	000001	平安银行	21,146	183,970.20	0.63
28	601989	中国重工	28,630	181,227.90	0.62
29	600276	恒瑞医药	4,337	173,957.07	0.59
30	600048	保利地产	19,887	171,624.81	0.59
31	000725	京东方A	73,264	169,239.84	0.58
32	600015	华夏银行	16,459	162,779.51	0.55
33	300104	乐视网	2,900	153,439.00	0.52

34	600028	中国石化	32,409	152,970.48	0.52
35	000776	广发证券	9,091	152,365.16	0.52
36	600999	招商证券	8,970	148,005.00	0.50
37	300059	东方财富	6,600	146,520.00	0.50
38	600518	康美药业	9,526	144,699.94	0.49
39	600958	东方证券	8,100	136,161.00	0.46
40	002450	康得新	7,958	136,081.80	0.46
41	002304	洋河股份	1,880	135,209.60	0.46
42	002736	国信证券	7,600	131,100.00	0.45
43	002024	苏宁云商	11,441	124,249.26	0.42
44	002415	海康威视	5,658	121,420.68	0.41
45	601390	中国中铁	17,236	120,134.92	0.41
46	002594	比亚迪	1,948	118,847.48	0.41
47	000783	长江证券	10,190	118,204.00	0.40
48	601006	大秦铁路	18,353	118,193.32	0.40
49	000166	申万宏源	13,697	115,191.77	0.39
50	601939	建设银行	23,684	112,499.00	0.38
51	002739	万达院线	1,400	111,860.00	0.38
52	002673	西部证券	4,280	110,680.80	0.38
53	601857	中国石油	14,953	108,110.19	0.37
54	601377	兴业证券	14,419	106,556.41	0.36
55	601628	中国人寿	5,117	106,535.94	0.36
56	600795	国电电力	36,299	106,356.07	0.36
57	601186	中国铁建	10,661	106,183.56	0.36
58	601009	南京银行	11,221	105,365.19	0.36
59	601336	新华保险	2,588	104,555.20	0.36
60	001979	招商蛇口	7,316	104,253.00	0.36
61	000063	中兴通讯	7,267	104,208.78	0.36
62	600570	恒生电子	1,512	100,956.24	0.34
63	000538	云南白药	1,558	100,179.40	0.34
64	600050	中国联通	26,199	99,818.19	0.34
65	600637	东方明珠	4,088	99,215.76	0.34
66	601899	紫金矿业	29,213	98,447.81	0.34
67	601985	中国核电	14,400	98,352.00	0.34
68	600011	华能国际	12,986	97,654.72	0.33
69	601901	方正证券	12,708	97,343.28	0.33
70	300017	网宿科技	1,429	96,028.80	0.33
71	000625	长安汽车	6,906	94,405.02	0.32
72	002230	科大讯飞	2,768	90,928.80	0.31

73	600585	海螺水泥	6,141	89,290.14	0.30
74	600111	北方稀土	6,682	88,937.42	0.30
75	000503	海虹控股	2,211	88,904.31	0.30
76	002142	宁波银行	5,980	88,384.40	0.30
77	601555	东吴证券	6,521	87,381.40	0.30
78	601088	中国神华	6,131	86,263.17	0.29
79	300024	机器人	3,397	86,249.83	0.29
80	600010	包钢股份	30,078	86,023.08	0.29
81	601099	太平洋	14,000	85,820.00	0.29
82	000423	东阿阿胶	1,622	85,690.26	0.29
83	600547	山东黄金	2,201	85,640.91	0.29
84	600690	青岛海尔	9,460	84,004.80	0.29
85	600893	中航动力	2,416	83,714.40	0.29
86	601211	国泰君安	4,700	83,613.00	0.29
87	600271	航天信息	3,436	81,776.80	0.28
88	600705	中航资本	13,904	81,755.52	0.28
89	600066	宇通客车	4,111	81,397.80	0.28
90	600100	同方股份	5,423	81,128.08	0.28
91	300027	华谊兄弟	5,967	80,793.18	0.28
92	002241	歌尔股份	2,795	80,160.60	0.27
93	600703	三安光电	3,966	79,201.02	0.27
94	600009	上海机场	2,990	77,889.50	0.27
95	600029	南方航空	10,763	75,986.78	0.26
96	601198	东兴证券	3,100	75,764.00	0.26
97	600109	国金证券	5,578	75,191.44	0.26
98	600019	宝钢股份	15,233	74,641.70	0.25
99	000100	TCL 集团	22,571	74,258.59	0.25
100	002202	金风科技	4,794	72,533.22	0.25
101	601669	中国电建	12,702	72,528.42	0.25
102	000839	中信国安	3,400	72,454.00	0.25
103	600383	金地集团	6,952	72,022.72	0.25
104	600535	天士力	2,006	71,734.56	0.24
105	300070	碧水源	4,801	71,438.88	0.24
106	600115	东方航空	10,455	69,107.55	0.24
107	600886	国投电力	10,454	68,996.40	0.24
108	601727	上海电气	9,100	68,796.00	0.23
109	600089	特变电工	8,006	68,211.12	0.23
110	000768	中航飞机	3,452	67,969.88	0.23
111	601888	中国国旅	1,545	67,949.10	0.23

112	600340	华夏幸福	2,738	66,752.44	0.23
113	000009	中国宝安	4,864	66,636.80	0.23
114	002456	欧菲光	2,258	66,611.00	0.23
115	600649	城投控股	4,636	66,572.96	0.23
116	600196	复星医药	3,496	66,493.92	0.23
117	002465	海格通信	5,310	66,056.40	0.23
118	600177	雅戈尔	4,728	65,199.12	0.22
119	600485	信威集团	3,644	65,008.96	0.22
120	000069	华侨城 A	10,137	64,876.80	0.22
121	601607	上海医药	3,576	64,546.80	0.22
122	000568	泸州老窖	2,157	64,062.90	0.22
123	002252	上海莱士	1,698	63,980.64	0.22
124	601600	中国铝业	16,926	63,811.02	0.22
125	600023	浙能电力	12,535	63,803.15	0.22
126	000895	双汇发展	3,041	63,496.08	0.22
127	600804	鹏博士	3,472	63,294.56	0.22
128	600369	西南证券	8,716	63,278.16	0.22
129	300315	掌趣科技	6,000	62,940.00	0.21
130	000793	华闻传媒	6,298	62,224.24	0.21
131	002065	东华软件	2,455	61,620.50	0.21
132	600118	中国卫星	1,824	61,286.40	0.21
133	000728	国元证券	3,662	61,228.64	0.21
134	601788	光大证券	3,600	60,984.00	0.21
135	600061	国投安信	3,400	60,588.00	0.21
136	002008	大族激光	2,648	60,480.32	0.21
137	600867	通化东宝	2,923	60,476.87	0.21
138	600352	浙江龙盛	6,996	60,305.52	0.21
139	600489	中金黄金	5,336	59,976.64	0.20
140	601919	中国远洋	11,800	59,944.00	0.20
141	600660	福耀玻璃	4,279	59,906.00	0.20
142	600406	国电南瑞	4,466	59,710.42	0.20
143	600739	辽宁成大	3,815	59,399.55	0.20
144	600208	新湖中宝	14,015	59,283.45	0.20
145	600031	三一重工	11,752	58,995.04	0.20
146	000338	潍柴动力	7,510	58,653.10	0.20
147	601018	宁波港	11,833	58,573.35	0.20
148	002236	大华股份	4,425	57,967.50	0.20
149	000917	电广传媒	3,498	57,821.94	0.20
150	300124	汇川技术	2,976	57,734.40	0.20

151	600309	万华化学	3,332	57,643.60	0.20
152	002500	山西证券	3,480	57,628.80	0.20
153	600221	海南航空	18,152	57,541.84	0.20
154	002475	立讯精密	2,878	56,552.70	0.19
155	000686	东北证券	4,376	56,494.16	0.19
156	600718	东软集团	3,060	56,059.20	0.19
157	000157	中联重科	13,571	56,048.23	0.19
158	002183	怡亚通	3,900	55,848.00	0.19
159	600674	川投能源	6,754	55,788.04	0.19
160	601618	中国中冶	15,043	55,508.67	0.19
161	000623	吉林敖东	2,200	54,890.00	0.19
162	000559	万向钱潮	3,494	54,506.40	0.19
163	600741	华域汽车	3,876	54,302.76	0.19
164	000540	中天城投	8,700	54,201.00	0.18
165	000876	新希望	6,510	54,163.20	0.18
166	600446	金证股份	1,500	53,925.00	0.18
167	601998	中信银行	9,437	53,507.79	0.18
168	601111	中国国航	7,856	53,106.56	0.18
169	000630	铜陵有色	20,635	52,412.90	0.18
170	600663	陆家嘴	2,291	52,120.25	0.18
171	601933	永辉超市	12,536	51,773.68	0.18
172	600415	小商品城	8,326	51,454.68	0.18
173	002385	大北农	6,323	50,963.38	0.17
174	600018	上港集团	9,978	50,887.80	0.17
175	600839	四川长虹	11,424	50,494.08	0.17
176	000060	中金岭南	4,785	49,907.55	0.17
177	603993	洛阳钼业	11,970	49,675.50	0.17
178	600068	葛洲坝	8,520	49,586.40	0.17
179	600085	同仁堂	1,658	49,391.82	0.17
180	002081	金螳螂	4,928	49,378.56	0.17
181	000963	华东医药	730	49,202.00	0.17
182	601800	中国交建	4,654	49,006.62	0.17
183	000046	泛海控股	4,800	48,528.00	0.17
184	000826	启迪桑德	1,583	48,360.65	0.16
185	000792	盐湖股份	2,277	48,044.70	0.16
186	600150	中国船舶	2,156	47,992.56	0.16
187	000413	东旭光电	5,557	47,734.63	0.16
188	000750	国海证券	6,455	47,702.45	0.16
189	300003	乐普医疗	2,600	47,424.00	0.16

190	600398	海澜之家	4,182	47,256.60	0.16
191	002292	奥飞娱乐	1,568	46,961.60	0.16
192	600583	海油工程	6,787	46,898.17	0.16
193	002007	华兰生物	1,477	46,377.80	0.16
194	600816	安信信托	2,700	45,549.00	0.16
195	600157	永泰能源	11,508	45,341.52	0.15
196	300144	宋城演艺	1,800	44,838.00	0.15
197	000977	浪潮信息	1,900	44,555.00	0.15
198	000402	金融街	4,581	44,527.32	0.15
199	600588	用友网络	2,254	44,133.32	0.15
200	600060	海信电器	2,469	43,651.92	0.15
201	300015	爱尔眼科	1,193	43,580.29	0.15
202	600895	张江高科	2,400	43,392.00	0.15
203	601106	中国一重	8,100	42,201.00	0.14
204	600074	保千里	2,800	41,776.00	0.14
205	300058	蓝色光标	4,292	41,675.32	0.14
206	002422	科伦药业	2,684	41,360.44	0.14
207	600332	白云山	1,676	41,296.64	0.14
208	600688	上海石化	6,720	40,992.00	0.14
209	601333	广深铁路	10,415	40,722.65	0.14
210	600642	申能股份	7,023	40,312.02	0.14
211	600820	隧道股份	4,800	40,272.00	0.14
212	000415	渤海金控	5,900	40,238.00	0.14
213	000425	徐工机械	13,131	40,180.86	0.14
214	600256	广汇能源	9,711	39,815.10	0.14
215	601098	中南传媒	2,177	39,425.47	0.13
216	002470	金正大	4,880	39,284.00	0.13
217	300002	神州泰岳	3,619	38,506.16	0.13
218	601866	中海集运	9,711	38,455.56	0.13
219	601258	庞大集团	13,944	38,346.00	0.13
220	600376	首开股份	3,400	37,808.00	0.13
221	600027	华电国际	7,511	37,179.45	0.13
222	600252	中恒集团	8,535	37,041.90	0.13
223	600737	中粮屯河	3,200	36,960.00	0.13
224	000738	中航动控	1,400	36,960.00	0.13
225	600875	东方电气	3,715	36,481.30	0.12
226	000709	河钢股份	13,121	36,345.17	0.12
227	601718	际华集团	4,700	35,908.00	0.12
228	600873	梅花生物	5,774	35,856.54	0.12

229	601991	大唐发电	9,200	35,788.00	0.12
230	600373	中文传媒	1,678	34,818.50	0.12
231	600005	武钢股份	12,400	34,224.00	0.12
232	600362	江西铜业	2,537	34,198.76	0.12
233	300133	华策影视	2,157	33,584.49	0.11
234	601021	春秋航空	700	33,558.00	0.11
235	600170	上海建工	8,752	33,520.16	0.11
236	002129	中环股份	4,029	33,400.41	0.11
237	601117	中国化学	6,030	33,345.90	0.11
238	000729	燕京啤酒	4,332	32,879.88	0.11
239	600704	物产中大	3,510	32,853.60	0.11
240	000039	中集集团	2,308	32,704.36	0.11
241	000629	*ST 钒钛	13,443	32,128.77	0.11
242	000061	农产品	2,628	31,956.48	0.11
243	600037	歌华有线	2,100	31,941.00	0.11
244	601179	中国西电	6,294	31,910.58	0.11
245	601225	陕西煤业	6,168	31,888.56	0.11
246	300251	光线传媒	2,740	31,674.40	0.11
247	600372	中航电子	1,615	31,444.05	0.11
248	601633	长城汽车	3,710	31,312.40	0.11
249	000778	新兴铸管	6,695	31,064.80	0.11
250	300146	汤臣倍健	2,252	30,492.08	0.10
251	601872	招商轮船	6,500	30,420.00	0.10
252	601992	金隅股份	3,859	29,907.25	0.10
253	002027	分众传媒	1,800	29,718.00	0.10
254	601898	中煤能源	5,662	29,215.92	0.10
255	600827	百联股份	2,413	29,149.04	0.10
256	603000	人民网	1,752	29,100.72	0.10
257	601216	君正集团	3,894	29,088.18	0.10
258	000712	锦龙股份	1,400	29,064.00	0.10
259	600008	首创股份	7,456	29,003.84	0.10
260	000999	华润三九	1,172	28,385.84	0.10
261	600038	中直股份	684	28,372.32	0.10
262	002195	二三四五	2,300	28,267.00	0.10
263	000883	湖北能源	5,992	27,742.96	0.09
264	000800	一汽轿车	2,524	27,461.12	0.09
265	600863	内蒙华电	8,943	27,007.86	0.09
266	002146	荣盛发展	4,018	27,000.96	0.09
267	600021	上海电力	2,600	26,702.00	0.09

268	002294	信立泰	961	26,139.20	0.09
269	002153	石基信息	958	25,272.04	0.09
270	600959	江苏有线	1,800	25,128.00	0.09
271	600600	青岛啤酒	863	25,087.41	0.09
272	601958	金钼股份	3,014	24,564.10	0.08
273	601928	凤凰传媒	2,310	24,347.40	0.08
274	600666	奥瑞德	700	24,332.00	0.08
275	300085	银之杰	800	23,920.00	0.08
276	000156	华数传媒	1,288	23,892.40	0.08
277	000027	深圳能源	3,694	23,567.72	0.08
278	600648	外高桥	1,174	23,139.54	0.08
279	600582	天地科技	5,100	22,950.00	0.08
280	002424	贵州百灵	1,300	22,360.00	0.08
281	000825	太钢不锈	7,056	22,296.96	0.08
282	601808	中海油服	1,797	21,833.55	0.07
283	000898	鞍钢股份	5,674	21,731.42	0.07
284	601608	中信重工	4,000	21,480.00	0.07
285	600871	石化油服	5,500	21,120.00	0.07
286	002399	海普瑞	1,162	20,288.52	0.07
287	600685	中船防务	800	20,288.00	0.07
288	601118	海南橡胶	3,611	20,185.49	0.07
289	600317	营口港	6,000	20,160.00	0.07
290	600098	广州发展	2,500	19,550.00	0.07
291	600783	鲁信创投	883	19,081.63	0.07
292	600578	京能电力	4,298	18,395.44	0.06
293	600998	九州通	1,029	18,017.79	0.06
294	600188	兖州煤业	1,156	12,646.64	0.04
295	600022	山东钢铁	5,200	12,324.00	0.04
296	600606	绿地控股	1,100	11,902.00	0.04
297	002568	百润股份	500	11,000.00	0.04
298	603885	吉祥航空	400	10,500.00	0.04
299	601016	节能风电	700	6,951.00	0.02

### 7.3.2 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所有股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。



## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 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	601328	交通银行	90,636.00	0.27
2	600958	东方证券	88,550.00	0.26
3	002739	万达院线	84,262.20	0.25
4	600900	长江电力	74,022.00	0.22
5	601318	中国平安	73,456.00	0.22
6	601377	兴业证券	70,729.04	0.21
7	002736	国信证券	63,315.00	0.19
8	000839	中信国安	62,628.00	0.18
9	600016	民生银行	58,681.00	0.17
10	600061	国投安信	57,608.00	0.17
11	002183	怡亚通	53,312.00	0.16
12	600000	浦发银行	52,875.00	0.16
13	601398	工商银行	52,069.00	0.15
14	600446	金证股份	50,775.00	0.15
15	601166	兴业银行	45,956.00	0.14
16	600816	安信信托	44,277.00	0.13
17	000977	浪潮信息	43,808.00	0.13
18	600074	保千里	42,084.00	0.12
19	601198	东兴证券	40,229.00	0.12
20	600036	招商银行	38,188.00	0.11

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。

### 7.4.2 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	600016	民生银行	228,334.00	0.67
2	600000	浦发银行	137,399.65	0.40
3	601318	中国平安	81,334.00	0.24
4	600315	上海家化	52,757.56	0.16
5	601166	兴业银行	49,426.00	0.15

6	600637	东方明珠	49,014.80	0.14
7	600036	招商银行	43,116.00	0.13
8	002038	双鹭药业	39,958.60	0.12
9	000983	西山煤电	39,648.50	0.12
10	600549	厦门钨业	39,207.58	0.12
11	601238	广汽集团	38,040.72	0.11
12	601018	宁波港	36,909.00	0.11
13	002024	苏宁云商	36,508.15	0.11
14	601919	中国远洋	34,651.00	0.10
15	600030	中信证券	32,893.00	0.10
16	000581	威孚高科	32,124.54	0.09
17	000598	兴蓉环境	31,798.36	0.09
18	000400	许继电气	31,776.55	0.09
19	600633	浙报传媒	31,647.40	0.09
20	002353	杰瑞股份	31,641.10	0.09

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。

### 7.4.3 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	3,306,817.27
卖出股票收入（成交）总额	3,070,619.92

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。

### 7.5 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	-	-
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（可交换债）	2,372.60	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,372.60	0.01

### 7.6 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	113009	广汽转债	20	2,372.60	0.01

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

### 7.8 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。

### 7.9 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

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指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)	风险说明
IF1607	IF1607	3	2,802,060.00	87,060.00	报告期内，本基金运用股指期货是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的，总体风险可控且符合既定的投资政策和投资目标。
公允价值变动总额合计（元）					87,060.00
股指期货投资本期收益（元）					-290,820.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					57,360.00

## 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

报告期，本基金运用股指期货来控制预期大额申购赎回等情况下的流动性风险，有效减少基金组合资产配置与跟踪标的之间的差距，确保投资组合对指数跟踪的效果。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

报告期，本基金未投资国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

-

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

本期基金投资组合前十名证券的发行主体中，海通证券（600837.SH）于 2015 年 1 月 19 日发布公告《海通证券股份有限公司公告》，公司存在为少数融资融券六个月到期并提出逾期负债暂缓平仓申请的客户，在维持担保比例处于 150%以上的前提下暂缓平仓的行为，存在违规为到期融资融券合约展期问题，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；2015 年 8 月 26 日海通证券发布公告《海通证券关于收到中国证券监督管理委员会立案调查通知书的公告》，公司于 2015 年 8 月 24 日收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》，因公司涉嫌未按规定审查、了解客户身份等违法违规行为，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，中国证监会决定对公司进行立案调查，2015 年 9 月 12 日发布公告《海通证券关于收到中国证监会行政处罚事先告知书的公告》，公司于 2015 年 9 月 10 日收到中国证券监督管理委员会行政处罚事先告知书，行政处罚如下：对海通证券责令改正，给予警告，没收违法所得并处罚款，同时对相关工作人员予以警告并处罚款；中信证券（600030.SH）于 2015 年 1 月 18 日发布公告《中信证券股份有限公司公告》，中信证券存在为到期融资融券合约展期的问题（根据相关规定，融资融券合约期限最长为 6 个月），中信证券被中国证监会采取暂停新开融资融券客户信用账户 3 个月的行政监管措施。2015 年 11 月 26 日，中信证券发布公告称收到中国证券监督管理委员会调查通知书（稽查总队调查通字 153121 号），其中提及：因公司涉嫌违反《证券公司监督管理条例》相关规定，中国证监会决定对公司进行立案调查。

由于海通证券（600837.SH）和中信证券（600030.SH）是沪深 300 指数的成份股，故将其纳

入本基金的投资组合。

### 7.12.2

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。

### 7.12.3 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	567,459.77
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	480.99
5	应收申购款	1,998.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	569,939.35

### 7.12.4 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债。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资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
1	000002	万科A	445,008.20	1.52	临时停牌

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五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积极投资股票。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
国金 300A	129	57,600.04	1,455,442.00	19.59%	5,974,963.00	80.41%
国金 300B	508	14,626.78	730,653.00	9.83%	6,699,752.00	90.17%
国金 300	922	22,698.09	9,003,845.20	43.02%	11,923,793.21	56.98%
合计	1,559	22,956.03	11,189,940.20	31.27%	24,598,508.21	68.73%

注：对于分级基金，下属分级份额比例的分母采用各自级别的份额，合计数比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

国金 300A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	黄松友	2,433,050.00	32.74%
2	中国太平洋财产保险-传统-普通保险产品-013C-CT001 深	744,800.00	10.02%
3	史宏鹏	670,000.00	9.02%
4	嘉实资本-海通证券-嘉实资本-华夏未来盈时对冲 3 号资产管理计划	300,000.00	4.04%
5	程鑫	300,000.00	4.04%
6	李桃	237,865.00	3.20%
7	方春娣	210,000.00	2.83%
8	南京佳瑞税务师事务所有限公司	202,400.00	2.72%
9	单文佳	142,712.00	1.92%
10	高明桂	122,913.00	1.65%

国金 300B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	临沭县茂华林业有限公司	730,000.00	9.82%
2	郑敏	461,328.00	6.21%
3	王毅志	185,000.00	2.49%
4	刘海平	180,000.00	2.42%

5	傅晓东	170,600.00	2.30%
6	赵伟	168,600.00	2.27%
7	甄德龙	134,000.00	1.80%
8	翟小三	133,300.00	1.79%
9	乐偲	112,700.00	1.52%
10	叶志忠	110,100.00	1.48%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	国金 300A	-	-
	国金 300B	-	-
	国金 300	361,134.71	1.7256%
	合计	361,134.71	1.0091%

注：对于分级基金，下属分级份额比例的分母采用各自级别的份额，合计数比例的分母采用期末基金份额总额。

### 8.4 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	份额级别	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	国金 300A	-
	国金 300B	-
	国金 300	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	国金 300A	-
	国金 300B	-
	国金 300	-
	合计	-

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国金 300A	国金 300B	国金 300
基金合同生效日（2013年7月26日）基金份额总额	33,048,181.00	33,048,181.00	257,031,393.17
本报告期期初基金份额总额	6,942,590.00	6,942,590.00	20,302,376.82

本报告期基金总申购份额	-	-	59,784,023.58
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	58,183,131.99
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	487,815.00	487,815.00	-975,630.00
本报告期期末基金份额总额	7,430,405.00	7,430,405.00	20,927,638.41

注: 1. 拆分变动份额为本基金三级份额之间配对转换及基金份额折算的变动份额。

2. 本报告期末, 基金管理人持有本基金的份额为 986,187.92 份, 基金管理人的子公司北京千石创富资本管理有限公司(以下简称“千石资本”)、上海国金通用财富资产管理有限公司(以下简称“国金财富”)持有本基金的份额分别为 2,987,153.34 份、4,979,252.94 份, 基金管理人、千石资本和国金财富均按照本基金《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, 并已按照法规规定向中国证监会进行了报告。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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

本报告期内, 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 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。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期, 本基金采取对标的沪深 300 指数完全复制的投资策略, 未发生投资策略的改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务至今, 本报告期内会计师事务所未发生改变。

### 10.6 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。



## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 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	
方正证券	1	3,191,107.06	50.04%	2,333.63	50.04%	-
财达证券	1	1,191,958.00	18.69%	871.60	18.69%	-
国融证券	1	1,014,860.06	15.91%	742.17	15.91%	-
华创证券	1	510,537.00	8.01%	373.31	8.00%	-
光大证券	1	468,975.07	7.35%	343.01	7.35%	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信证券山东	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-

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. 本报告期新增国融证券一个交易单元。

## 10.7.2 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
方正证券	1,292.20	10.02%	-	-	-	-
财达证券	7,592.20	58.89%	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	4,008.20	31.09%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信证券山东	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《国金基金管理有限公司关于直销系统、电子交易系统升级的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年6月30日
2	《国金基金管理有限公司关于在上海陆金所资产管理有限公司推出定期定额投资业务并参加费率优惠活动的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年6月22日
3	《国金基金管理有限公司关于增加平安证券有限责任公司为旗下基金销售机构的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年6月21日
4	《国金基金管理有限公司关于增加武汉市伯嘉基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年6月18日
5	《国金基金管理有限公司关于参加上海联泰资产管理有限公司费率优惠活动的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年6月18日
6	《国金基金管理有限公司关于调	指定披露媒体和本	2016年6月2日

	整直销电子交易系统开放式基金单笔最低申购金额和追加申购金额的公告》	基金基金管理人网站	
7	《国金基金管理有限公司关于增加泰诚财富基金销售（大连）有限公司为旗下基金销售机构的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年6月2日
8	《国金基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金单笔最低申购金额和追加申购金额的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年6月1日
9	《国金基金管理有限公司关于关闭淘宝基金理财平台相关服务的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年5月5日
10	《国金基金管理有限公司关于关闭支付宝渠道基金支付服务的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年5月5日
11	《国金基金管理有限公司关于增加上海凯石财富基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年4月28日
12	《国金基金管理有限公司关于国金沪深300指数分级证券投资基金2016年第1季度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年4月22日
13	《国金基金管理有限公司关于参加新兰德费率优惠的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年3月30日
14	《国金沪深300指数分级证券投资基金2015年度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年3月28日
15	《国金沪深300指数分级证券投资基金2015年度报告摘要》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年3月28日
16	《国金基金管理有限公司国金300指数分级基金招募说明书更新》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年3月11日
17	《国金基金管理有限公司国金300指数分级基金招募说明书更新摘要》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年3月11日
18	《国金基金管理有限公司关于电子直销业务增加通联支付第三方支付业务的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年3月9日
19	《国金基金管理有限公司关于增加厦门鑫鼎盛和深圳富济财富为旗下基金销售机构的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年3月8日
20	《国金基金管理有限公司关于直销系统、订单系统升级的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网	2016年2月26日

		站	
21	《国金基金管理有限公司关于旗下基金所持“浦发银行”、“信威集团”股票估值调整的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年2月23日
22	《国金基金管理有限公司关于增加上海联泰资产管理有限公司为旗下基金销售机构的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年2月19日
23	《国金沪深300指数分级证券投资基金2015年第4季度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年1月20日
24	《国金基金管理有限公司关于增加浙江金观诚财富管理有限公司和大泰金石投资管理有限公司为旗下基金销售机构的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年1月20日
25	《国金基金管理有限公司关于旗下基金所持“万科A”股票估值调整的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年1月8日
26	《国金基金管理有限公司关于2016年1月7日指数熔断后旗下基金调整开放时间的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年1月8日
27	《国金基金管理有限公司关于国金沪深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》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年1月6日
28	《国金基金管理有限公司关于国金沪深300A份额定期份额折算后次日前收盘价调整的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年1月6日
29	《国金基金管理有限公司关于旗下深交所场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年1月6日
30	《国金基金管理有限公司关于2016年1月4日指数熔断后旗下基金调整开放时间的补充公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年1月6日
31	《国金基金管理有限公司关于办理定期份额折算业务期间国金300A份额停复牌的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年1月5日
32	《国金基金管理有限公司关于国金沪深300A份额2016年度约定年基准收益率的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年1月4日
33	《国金基金管理有限公司关于国金基金2015年12月31日旗下基金净值公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年1月4日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

无

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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。

### 12.2 存放地点

本基金基金管理人的办公场所：北京海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 87 号 D 座 14 层。

### 12.3 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  
2016 年 8 月 27 日