

国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金 2012 年第 4 季度报告

2012 年 12 月 31 日

基金管理人：国金通用基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

报告送出日期：2013 年 1 月 19 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 2013 年 1 月 18 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 2012 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国金通用国鑫发起
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	110,175,572.03 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	本基金通过定性与定量分析，动态把握不同资产类别在不同时期的投资价值、投资时机以及其风险收益特征的相对变化，对股票和固定收益证券等大类资产在投资组合中的权重进行灵活配置。同时，本基金将通过深入的基本面研究，挖掘投资品种的内在价值，寻找具备估值优势和长期增长潜力的个股及个券，合理控制投资风险，力争在实现长期资本增值的同时兼顾当期收益。
业绩比较基准	60%×沪深 300 指数收益率+40%×上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高

	于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。
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(2012 年 10 月 1 日 — 2012 年 12 月 31 日)
1. 本期已实现收益	955,617.88
2. 本期利润	2,571,831.99
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0197
4. 期末基金资产净值	112,858,182.22
5. 期末基金份额净值	1.0243

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动损益）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

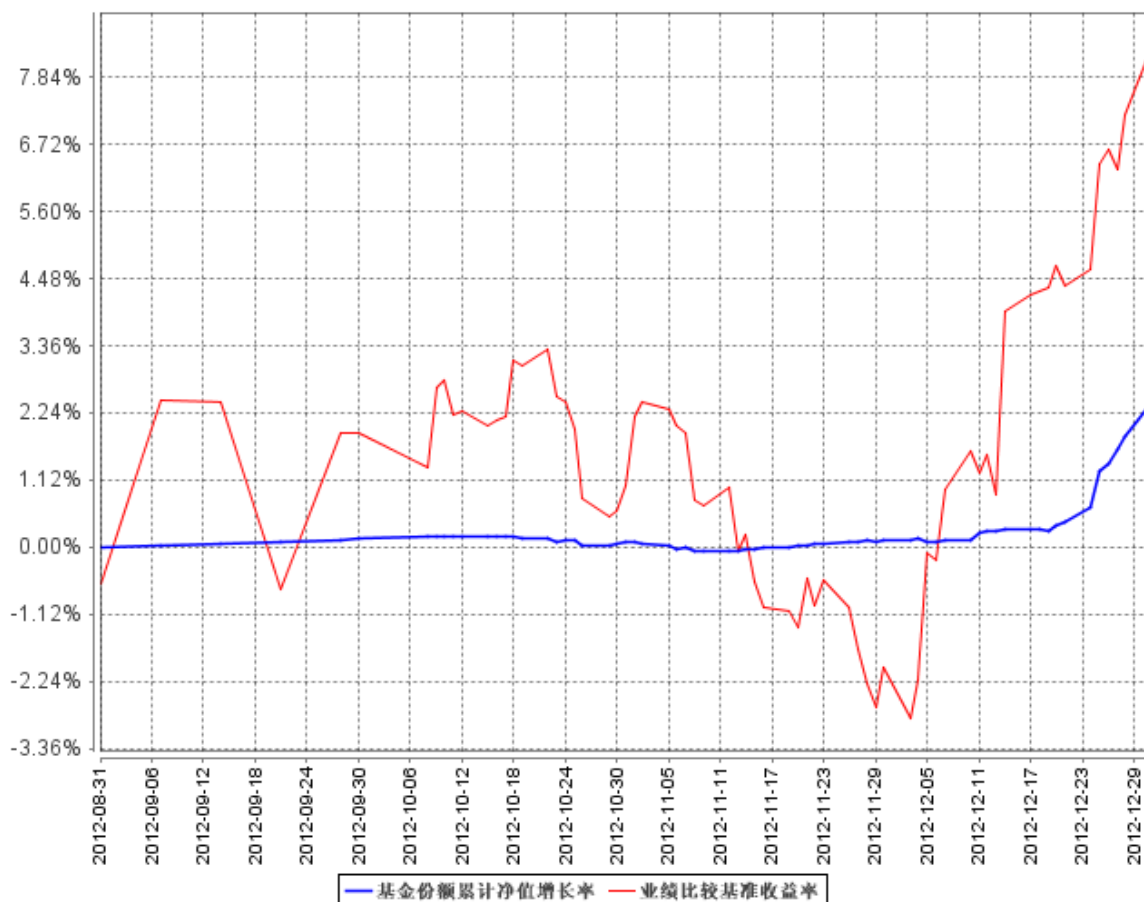
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	2.29%	0.12%	6.33%	0.77%	-4.04%	-0.65%

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

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 2012 年 8 月 28 日至 2012 年 12 月 31 日。

2、本基金基金合同生效日为 2012 年 8 月 28 日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。

3、按基金合同或招募说明书的约定，本基金自合同生效日起 6 个月内为建仓期，截止报告期末本基金仍处于建仓期。

§ 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		
吴强	本基金基金经理、投资研究部副总经	2012 年 8 月 28 日	-	13	吴强先生，江西财经大学学士、上海财经大学硕士。历任上海创达投资管理公司研

	理				究员、上海高维化学公司总经理助理、嘉新水泥（中国）控股股份有限公司证券部经理、国金通用基金管理有限公司行业分析师、投资研究部副总经理。
--	---	--	--	--	---

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 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。

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控制制度，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

2012 年 4 季度，本基金仍然处在建仓期内，为规避下行风险，总体上采取了较为稳健的投资策略。初期主要配置企业债等固定收益品种，后期随着月度经济数据好转，经济出现企稳迹象，A 股市场在改革预期带动下确认出现回升后，增加了股票仓位配置。整体而言，本基金在四季度避免了给投资者造成损失，取得了正收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2012 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.0243 元，本报告期份额净值增长率为 2.29%，同期业绩比较基准增长率为 6.33%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2013 年，中国经济增长将出现回升，但是多年积累的结构性问题仍将造成困扰，改革措施如何推进将对经济增长状况产生重大影响。A 股市场经过过去几年的持续调整后，总体上估值水平已经较为合理，2013 年有所表现的概率较大，并且总市值近 25 万亿的巨大市场规模也将提供更多结构性机会。行业方面，竞争优势可持续积累的非周期行业中仍然有较多机会，周期类行业表现的持续性和上涨的幅度取决于总体经济回升的力度。

感谢各位投资者的支持，本基金将积极把握机会，坚持国金通用基金管理有限公司“做用心为老百姓赚钱的财富管理公司”的愿景，规范运作，审慎投资，勤勉尽责的为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

§ 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	36,556,032.73	30.74
	其中：股票	36,556,032.73	30.74
2	固定收益投资	57,015,000.00	47.94
	其中：债券	57,015,000.00	47.94
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	9,700,000.00	8.16
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	9,483,829.75	7.97
6	其他资产	6,175,616.64	5.19

7	合计	118,930,479.12	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	-	-
B	采掘业	7,541,971.06	6.68
C	制造业	25,170,061.67	22.30
C0	食品、饮料	10,081,300.50	8.93
C1	纺织、服装、皮毛	790,635.25	0.70
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	1,553,528.62	1.38
C4	石油、化学、塑胶、塑料	493,200.00	0.44
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	8,557,383.46	7.58
C7	机械、设备、仪表	1,832,600.00	1.62
C8	医药、生物制品	1,861,413.84	1.65
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	1,410,000.00	1.25
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	506,000.00	0.45
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	1,928,000.00	1.71
M	综合类	-	-
	合计	36,556,032.73	32.39

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	600809	山西汾酒	140,000	5,832,400.00	5.17
2	600199	金种子酒	125,000	2,401,250.00	2.13
3	000778	新兴铸管	359,951	2,325,283.46	2.06
4	600117	西宁特钢	470,000	2,317,100.00	2.05
5	601088	中国神华	89,972	2,280,790.20	2.02
6	000629	攀钢钒钛	500,000	2,060,000.00	1.83

7	600880	博瑞传播	200,000	1,928,000.00	1.71
8	002603	以岭药业	79,992	1,861,413.84	1.65
9	600559	老白干酒	49,950	1,847,650.50	1.64
10	600395	盘江股份	99,993	1,701,880.86	1.51

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	25,095,000.00	22.24
5	企业短期融资券	9,978,000.00	8.84
6	中期票据	20,015,000.00	17.73
7	可转债	1,927,000.00	1.71
8	其他	-	-
9	合计	57,015,000.00	50.52

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	112121	12 景兴债	200,000	20,120,000.00	17.83
2	1282430	12 湖交投 MTN2	100,000	10,019,000.00	8.88
3	1282415	12 龙高速 MTN1	100,000	9,996,000.00	8.86
4	041260075	12 广安爱 众 CP002	100,000	9,978,000.00	8.84
5	122206	12 赛轮债	50,000	4,975,000.00	4.41

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

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。

5.8.2

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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	5,399,823.41
3	应收股利	-
4	应收利息	525,496.79
5	应收申购款	296.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,175,616.64

5.8.4 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	113001	中行转债	1,927,000.00	1.71

5.8.5 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。

5.8.6 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

本报告期期初基金份额总额	178,532,819.63
本报告期基金总申购份额	43,364.84
减：本报告期基金总赎回份额	68,400,612.44

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	110,175,572.03

注：1、基金管理公司未运用自有资金购买本基金。

2、发起资金持有份额情况：基金管理公司高级管理人员持有本基金份额总数为 2,000,427.45 份，占基金总份额比例为 1.1205%；基金经理等人员持有本基金份额总数为 500,080.64 份，占基金总份额比例为 0.2801%；基金管理公司股东持有本基金份额总数为 8,501,132.50 份，占基金总份额比例为 4.7617%。上述份额全部为发起份额，合计份额总数为 11,001,640.59 份，占基金总份额比例为 6.1623%，发起份额承诺持有期限为 3 年，本报告期内未发生变化。

§ 7 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，公司根据《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》、《证券日报》及管理人网站进行了如下信息披露：

1、2012 年 10 月 8 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》。

2、2012 年 12 月 18 日披露了《国金通用基金管理有限公司关于增加杭州数米基金为代销机构并参加基金申购费率优惠活动的公告》。

3、2012 年 12 月 28 日披露了《国金通用基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告》。

4、2012 年 12 月 31 日披露了《关于国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金基金资产净值、基金份额净值及基金份额累计净值的公告》。

5、本报告期内，公司按照《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。

§ 8 备查文件目录

8.1 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。

8.2 存放地点

北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 20 层。

8.3 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
二〇一三年一月十九日