

国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金 2013 年半年度报告

2013 年 6 月 30 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

送出日期：2013 年 8 月 24 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 2013 年 8 月 23 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 2013 年 1 月 1 日起至 2013 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
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.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	8
§4 管理人报告	8
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.....	9
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
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.....	11
§5 托管人报告	12
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.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
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
§7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
7.6 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.....	45
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	45
7.8 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.....	45
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	45
7.10 投资组合报告附注.....	45
§8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
8.3 发起式基金发起资金持有份额情况	47
§9 开放式基金份额变动	47
§10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
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	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
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	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8 其他重大事件	49
§11 影响投资者决策的其他重要信息	52
§12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录	52
12.2 存放地点	52
12.3 查阅方式	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金
基金简称	国金通用国鑫发起
基金主代码	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
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
报告期末基金份额总额	57,815,798.22份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

注：本基金为发起式基金。

2.2 基金产品说明

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，本基金将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	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。

注：本基金为发起式基金。

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		国金通用基金管理有限公司	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、甲 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》、《证券日报》。
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	国金通用基金管理有限公司	北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 层

§ 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(2013 年 1 月 1 日 - 2013 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	4,379,522.57
本期利润	760,954.31
加权平均基金份额本期利润	0.0100
本期加权平均净值利润率	0.96%
本期基金份额净值增长率	-1.73%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-1,720,930.24
期末可供分配基金份额利润	-0.0298
期末基金资产净值	56,094,867.98
期末基金份额净值	0.9702

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2013年6月30日)
基金份额累计净值增长率	0.66%

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

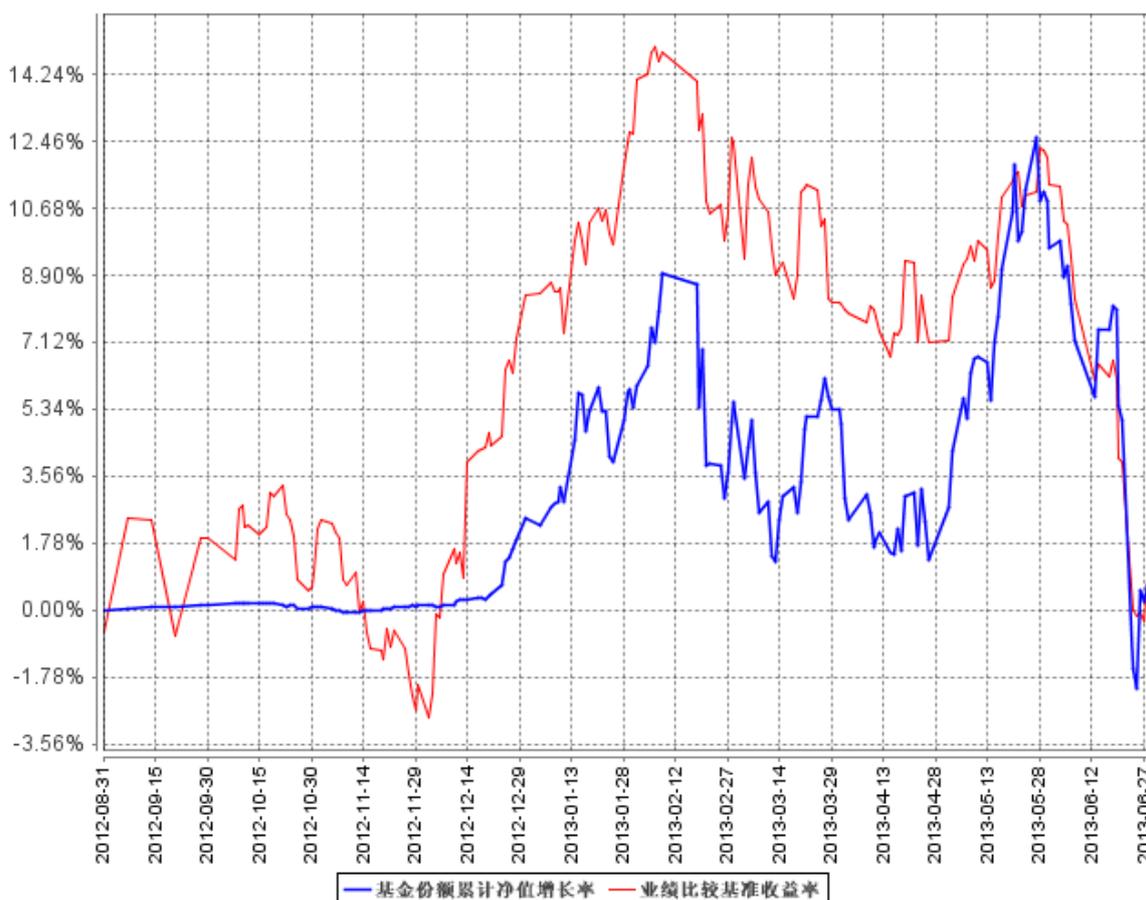
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-8.17%	1.83%	-9.44%	1.12%	1.27%	0.71%
过去三个月	-4.42%	1.32%	-6.81%	0.87%	2.39%	0.45%
过去六个月	-1.73%	1.15%	-6.96%	0.90%	5.23%	0.25%
自基金合同生效起至今	0.66%	0.91%	0.82%	0.92%	-0.16%	-0.01%

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：本基金基金合同生效日为 2012 年 8 月 28 日，至本报告期末，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。公司股东为国金证券股份有限公司、苏州工业园区地产经营管理公司、广东宝丽华新能源股份有限公司、中国通用技术（集团）控股有限责任公司，四家企业共同出资 2.8 亿元人民币，出资比例分别为 49%、19.5%、19.5%和 12%。截至 2013 年 6 月 30 日，国金通用基金管理

有限公司共管理一只开放式基金——国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金。

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		
吴强	本基金基金经理、投资研究部总经理	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、投资研究部总经理。
徐艳芳	本基金基金经理	2013年2月27日	-	4	徐艳芳女士，中国青年政治学院学士、清华大学硕士，历任香港昊天财经公关公司咨询师、英大泰和财产保险股份有限公司投资经理、国金通用基金管理有限公司固定收益投资分析师。

注：1. 任职日期和离任日期均指本基金管理人作出决定后正式对外公告之日；担任本基金首任基金经理的，任职日期为基金合同生效日。

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员基本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》、《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 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

在本报告期，本基金管理人仅管理一只基金产品，不存在非公平交易情况。

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监控制度，报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

2013 年上半年，A 股市场呈现震荡态势，年初出于对经济回暖的乐观预期市场明显上涨，但随着各项宏观经济数据低于预期，市场回吐了之前涨幅，临近年中，资金面趋紧、宏观经济增长乏力等因素重新导致市场回落，银行间市场空前的资金紧张状况引发市场恐慌情绪，股指出现快速下跌。综合来看，上半年 A 股市场出现明显分化，以创业板为首的成长股明显跑赢沪深 300 成分股，体现了经济转型期的鲜明特点。本基金在报告期的操作中，总体上保持较为灵活的投资策略，积极跟踪宏观和中观各项数据的变化，平衡股票和债券的配置比例，主动调整大类资产和行业配置来应对市场波动。行业选择方面，竞争优势可持续积累的非周期行业是我们长期关注的重点。报告期内，本基金净值小幅下跌，跑赢了业绩比较基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止至 2013 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.9702，累计单位净值为 1.0102 元，本报告期份额净值增长率为-1.73%，同期业绩比较基准增长率为-6.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2013 年下半年，中国经济继续面临挑战，美联储 QE 退出渐近，国内基建投资与房地产开发投资存在回落风险，消费、出口增长动力偏弱，金融和实体领域的去杠杆带来的流动性趋紧将逐步对实体经济产生影响。宏观经济总体疲软的同时，市场对中央政府政策在下半年有较多期待，各项改革措施或将陆续推出，虽然会有短期阵痛，但是相信改革会使中国经济长期受益。证券市场在经历了二季度的大幅下跌后，预计将出现一定阶段的震荡态势，疲弱的经济基本面状况和环

比趋紧的流动性状况制约指数总体表现，行业和板块继续分化，优质成长股和大消费板块中有较多投资机会。

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。

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。基金清算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基金清算部提供模型定价的结果，基金清算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

本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

报告期内，本基金于 2013 年 5 月 15 日发布《国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金分红公告》，以 2013 年 5 月 10 日为分配基准日，实施了本年度第一次分红，分红金额为 0.4 元/10 份基金份额。

§ 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

2013 年上半年，中国光大银行股份有限公司在国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《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，对国金通用国鑫灵活配置混合型发起式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

2013 年上半年，中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《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——国金通用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——国金通用基金管理有限公司编制的《国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金 2013 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：国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金
报告截止日：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
----	-----	------------------------	--------------------------

资产：			
银行存款	6.4.7.1	3,215,169.18	6,502,011.57
结算备付金		1,228,197.61	2,981,818.18
存出保证金		237,906.34	250,000.00
交易性金融资产	6.4.7.2	46,576,666.61	93,571,032.73
其中：股票投资		27,146,606.72	36,556,032.73
基金投资		-	-
债券投资		19,430,059.89	57,015,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	5,000,000.00	9,700,000.00
应收证券清算款		1,194,759.78	5,399,823.41
应收利息	6.4.7.5	579,886.95	525,496.79
应收股利		-	-
应收申购款		11,067.20	296.44
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		58,043,653.67	118,930,479.12
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
负 债：			
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		1,137,029.94	3,532,544.07
应付赎回款		80,776.97	1,962,792.05
应付管理人报酬		73,613.18	149,419.76
应付托管费		12,268.87	24,903.29
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	417,142.83	65,740.37
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	227,953.90	336,897.36
负债合计		1,948,785.69	6,072,296.90
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	57,815,798.22	110,175,572.03
未分配利润	6.4.7.10	-1,720,930.24	2,682,610.19
所有者权益合计		56,094,867.98	112,858,182.22
负债和所有者权益总计		58,043,653.67	118,930,479.12

注：1. 本报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 0.9702 元，基金份额总额

57,815,798.22 份。

2. 本期财务报表上年度的实际编制期间系 2012 年 8 月 28 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日止。

6.2 利润表

会计主体：国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
一、收入		2,942,457.30	-
1.利息收入		677,097.25	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	49,647.35	-
债券利息收入		599,731.13	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		27,718.77	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		5,813,166.04	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	4,986,596.45	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	481,898.22	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	344,671.37	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-3,618,568.26	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	70,762.27	-
减：二、费用		2,181,502.99	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	592,946.73	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	98,824.44	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	1,167,447.74	-
5. 利息支出		81,944.61	-
其中：卖出回购金融资产支出		81,944.61	-
6. 其他费用	6.4.7.19	240,339.47	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		760,954.31	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		760,954.31	-

注：本基金基金合同自 2012 年 8 月 28 日起生效，无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 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)	110,175,572.03	2,682,610.19	112,858,182.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	760,954.31	760,954.31
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)	-52,359,773.81	-2,594,178.97	-54,953,952.78
其中：1.基金申购款	1,546,085.30	106,615.68	1,652,700.98
2.基金赎回款	-53,905,859.11	-2,700,794.65	-56,606,653.76
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)	-	-2,570,315.77	-2,570,315.77
五、期末所有者权益(基金净值)	57,815,798.22	-1,720,930.24	56,094,867.98
项目	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 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)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-	-
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)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-

2. 基金赎回款	-	-	-
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）	-	-	-

注：本基金基金合同自 2012 年 8 月 28 日起生效，无上年度可比期间数据。

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：

<u>尹庆军</u>	<u>毛伟</u>	<u>毛伟</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”），经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2012]953 号文的核准，由国金通用基金管理有限公司于 2012 年 8 月 13 日至 2012 年 8 月 24 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2012)验字第 61004823_A01 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料，基金合同于 2012 年 8 月 28 日生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。首次募集扣除认购费后的有效净认购金额为人民币 178,508,167.97 元，折合 178,508,167.97 份基金份额；有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币 24,651.66 元，折合 24,651.66 份基金份额；以上收到的实收基金共计人民币 178,532,819.63 元，折合 178,532,819.63 份基金份额。本基金的基金管理人为国金通用基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

本基金为发起式基金。基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 100 万份以上；基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 50 万份-100 万份（含）。基金管理人的股东国金证券股份有限公司认购本基金份额 2,000,482.40 份，占本基金份额的 1.12%。基金管理人的股东广东宝丽华新能源股份有限公司认购本基金份额 6,500,650.10 份，占本基金份额的 3.64%。根据《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》的规定，基金管理人股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员、基金经理等人员资金认购本基金的金额不少于人民币 1,000 万元，且承诺认购的本基金份额持有期不少于 3 年。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板

股票、创业板股票，以及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、债券、可转换债券（含分离交易可转债）、资产支持证券、银行存款、货币市场工具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）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 30%-80%，权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%，债券及其他金融工具投资占基金资产的比例为 20%-70%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券合计比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为： $60\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 40\% \times \text{上证国债指数收益率}$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、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，也参考了中国证券业协会制定的《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 3 号——半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 2013 年 6 月 30 日的财务状况以及 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日止会计期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 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的说明

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。

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、国家税务总局财税字[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、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[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，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[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。

3. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[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、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自 2005 年 6 月 13 日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102 号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按 50%计算应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局财税字[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《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》，自 2008 年 10 月 9 日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

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 2013 年 6 月 30 日
活期存款	3,215,169.18
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	3,215,169.18

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	28,717,073.65	27,146,606.72	-1,570,466.93	
债券	交易所市场	19,861,947.11	19,430,059.89	-431,887.22
	银行间市场	-	-	-
	合计	19,861,947.11	19,430,059.89	-431,887.22
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	48,579,020.76	46,576,666.61	-2,002,354.15	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	5,000,000.00	-
合计	5,000,000.00	-

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 2013 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	674.21
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	552.70
应收债券利息	577,142.86
应收买入返售证券利息	1,410.18
应收申购款利息	-
其他	107.00
合计	579,886.95

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 2013 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	417,142.83
银行间市场应付交易费用	-
合计	417,142.83

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	304.43
预提费用	227,649.47
合计	227,953.90

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	110,175,572.03	110,175,572.03
本期申购	1,546,085.30	1,546,085.30
本期赎回(以“-”号填列)	-53,905,859.11	-53,905,859.11
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	57,815,798.22	57,815,798.22

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

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	1,088,407.97	1,594,202.22	2,682,610.19
本期利润	4,379,522.57	-3,618,568.26	760,954.31
本期基金份额交易产生的变动数	-1,842,716.42	-751,462.55	-2,594,178.97
其中：基金申购款	52,275.90	54,339.78	106,615.68
基金赎回款	-1,894,992.32	-805,802.33	-2,700,794.65
本期已分配利润	-2,570,315.77	-	-2,570,315.77
本期末	1,054,898.35	-2,775,828.59	-1,720,930.24

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
	活期存款利息收入
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	12,355.69
其他	1,197.91

合计	49,647.35
----	-----------

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 2013年1月1日至2013年6月30日
卖出股票成交总额	447,341,192.86
减：卖出股票成本总额	442,354,596.41
买卖股票差价收入	4,986,596.45

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	53,902,507.31
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	52,701,635.14
减：应收利息总额	718,973.95
债券投资收益	481,898.22

6.4.7.13.1 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 衍生工具收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
股票投资产生的股利收益	344,671.37
基金投资产生的股利收益	-
合计	344,671.37

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-3,618,568.26
——股票投资	-3,103,478.71
——债券投资	-515,089.55
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-3,618,568.26

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	70,762.27
合计	70,762.27

注：1. 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。

2. 本基金的转换费由申购费补差和赎回费两部分构成，其中不低于赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,166,922.74
银行间市场交易费用	525.00
合计	1,167,447.74

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	198,354.28
债券托管账户维护费	15,000.00
银行费用	1,790.00

其他	400.00
合计	240,339.47

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

本报告期内未发生变化。

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
国金通用基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
中国光大银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
国金证券股份有限公司	基金管理人股东、基金代销机构

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

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 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	223,218,060.40	25.27%	-	-

注：本基金基金合同自 2012 年 8 月 28 日起生效，无上年度可比期间数据。

债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
-------	----------------------------	---------------------------------

	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国金证券	6,963,547.67	17.71%	-	-

注：本基金基金合同自 2012 年 8 月 28 日起生效，无上年度可比期间数据。

债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国金证券	108,500,000.00	24.11%	-	-

注：本基金基金合同自 2012 年 8 月 28 日起生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.2 权证交易

注：1. 本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

2. 本基金基金合同自 2012 年 8 月 28 日起生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013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
国金证券	158,572.43	25.62%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

3. 本基金基金合同自 2012 年 8 月 28 日起生效，无上年度可比期间数据。

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 2013年1月1日至2013年6月 30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	592,946.73	-
其中：支付销售机构的客户维护费	105,803.43	-

注：1. 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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。

3. 本基金基金合同自 2012 年 8 月 28 日起生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	98,824.44	-

注：1. 本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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。

2. 本基金基金合同自 2012 年 8 月 28 日起生效，无上年度可比期间数据。

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：1. 本基金本报告期未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（回购）交易。

2. 本基金基金合同自 2012 年 8 月 28 日起生效，无上年度可比期间数据。

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自有资金投资本基金的情况

注：1. 本基金本报告期未发生管理人运用自有资金投资本基金的情况。

2. 本基金基金合同自 2012 年 8 月 28 日起生效，无上年度可比期间数据。

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

关联方名称	本期末 2013 年 6 月 30 日		上年度末 2012 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
国金证 券股份 有限公 司	2,074,718.69	3.59%	2,000,482.40	1.82%
广东宝 丽华新 能源股 份有限 公司	6,500,650.10	11.24%	6,500,650.10	5.90%

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 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 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
光大银行	3,215,169.18	36,093.75	-	-

注：本基金基金合同自 2012 年 8 月 28 日起生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无

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

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分 配 合计	备注
		场内	场外					
1	2013 年 5 月 21 日	-	2013 年 5 月 21 日	0.40	2,062,144.79	508,170.98	2,570,315.77	
合计	-	-		0.40	2,062,144.79	508,170.98	2,570,315.77	

6.4.12 期末（ 2013 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/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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
601886	江河 创建	2013 年 6 月 20 日	重大 事项	12.19	2013 年 7 月 16 日	13.78	220,000	2,891,849.00	2,681,800.00	-

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，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管理委员会，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。

监察稽核部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；风险管理部独立于投资研究体系，负责落实具体的风险管理政策，侧重于对投资事前及事中的风险管理。

本基金管理人推行全员风险管理理念，公司各部门是风险控制的一线部门，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直接责任人。

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、拒绝支付到期本息，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；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。

6.4.13.3 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随时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部门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。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

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持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

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。

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现金流量受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。

本基金持有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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2013年 6月30日	1个月以内	1-3个月	6个月以内 3个月-1年	6个月-1年 1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产								
银行存款	3,215,169.18	-	-	-	-	-	-	3,215,169.18
结算备付金	1,228,197.61	-	-	-	-	-	-	1,228,197.61
交易性金融资产	-	2,827,170.00	-	-	5,188,429.60	11,414,460.29	27,146,606.72	46,576,666.61
买入返售金融资产	5,000,000.00	-	-	-	-	-	-	5,000,000.00

应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	1,194,759.78	1,194,759.78
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	579,886.95	579,886.95
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	11,067.20	11,067.20
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	237,906.34	237,906.34
资产总计	9,443,366.79	2,827,170.00	-	-	-	5,188,429.60	11,414,460.29	29,170,226.99	58,043,653.67
负债									
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	1,137,029.94	1,137,029.94
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	80,776.97	80,776.97
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	73,613.18	73,613.18

应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	12,268.87	12,268.87	
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	417,142.83	417,142.83	
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	227,953.90	227,953.90	
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	1,948,785.69	1,948,785.69	
利率敏感度缺口	9,443,366.79	2,827,170.00	-	-	-	-5,188,429.60	11,414,460.29	27,221,441.30	56,094,867.98	
上年度末 2012年12月31日	1个月以内	1-3个月	6个月以内	3个月-1年	6个月-1年	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产										
银行存款	6,502,011.57	-	-	-	-	-	-	-	-	6,502,011.57
结算备	2,981,818.18	-	-	-	-	-	-	-	-	2,981,818.18

付金								
存出保证金	-	-	-	-	-	-	250,000.00	250,000.00
交易性金融资产	-	-	-32,025,000.00	-	-24,990,000.00	-	-36,556,032.73	-93,571,032.73
买入返售金融资产	9,700,000.00	-	-	-	-	-	-	9,700,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-5,399,823.41	-5,399,823.41
应收利息	-	-	-	-	-	-	525,496.79	525,496.79
应收申购款	-	-	-	-	-	-	296.44	296.44
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	19,183,829.75	-	-32,025,000.00	-	-24,990,000.00	-	-42,731,649.37	118,930,479.12

计									
负债									
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	3,532,544.07	3,532,544.07
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	1,962,792.05	1,962,792.05
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	149,419.76	149,419.76
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	24,903.29	24,903.29
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	65,740.37	65,740.37
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	336,897.36	336,897.36
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	6,072,296.90	6,072,296.90
利率敏感	19,183,829.75	-	32,025,000.00	-	24,990,000.00	-	36,659,352.47	112,858,182.22	

度 缺 口									
-------------	--	--	--	--	--	--	--	--	--

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变；		
	此项影响并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
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（2013 年 6 月 30 日）	上年度末（2012 年 12 月 31 日）
	-25 个基点	179,011.45	526,310.14
	+25 个基点	-179,011.45	-526,310.14

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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 30%-80%，权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%，债券及其他金融工具投资占基金资产的比例为 20%-70%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券合计比例不低于基金资产净值的 5%。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进行风险度量，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	上年度末
----	-----	------

	2013 年 6 月 30 日		2012 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	27,146,606.72	48.39	36,556,032.73	32.39
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	19,430,059.89	34.64	57,015,000.00	50.52
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	46,576,666.61	83.03	93,571,032.73	82.91

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据自基金合同生效日至 2013 年 6 月 30 日所有交易日的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
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（2013 年 6 月 30 日）	上年度末（2012 年 12 月 31 日）
	-5%	-1,637,795.22	-179,383.79
	+5%	1,637,795.22	179,383.79

§ 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	27,146,606.72	46.77
	其中：股票	27,146,606.72	46.77
2	固定收益投资	19,430,059.89	33.47
	其中：债券	19,430,059.89	33.47
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	5,000,000.00	8.61
	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	4,443,366.79	7.66

6	其他各项资产	2,023,620.27	3.49
7	合计	58,043,653.67	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	15,830,245.32	28.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	8,035,761.40	14.33
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,955,000.00	5.27
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	325,600.00	0.58
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	27,146,606.72	48.39

注：以上行业分类以 2013 年 6 月 30 日的证监会行业分类标准为依据。

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

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	300079	数码视讯	150,000	3,144,000.00	5.60
2	002051	中工国际	109,220	3,043,961.40	5.43

3	000002	万 科 A	300,000	2,955,000.00	5.27
4	601886	江河创建	220,000	2,681,800.00	4.78
5	600252	中恒集团	179,920	2,497,289.60	4.45
6	002482	广田股份	110,000	2,310,000.00	4.12
7	600073	上海梅林	329,906	2,055,314.38	3.66
8	600066	宇通客车	110,000	2,016,300.00	3.59
9	600135	乐凯胶片	199,980	1,455,854.40	2.60
10	002005	德豪润达	149,994	1,394,944.20	2.49
11	300282	汇冠股份	76,904	1,229,694.96	2.19
12	000786	北新建材	38,669	681,347.78	1.21
13	600887	伊利股份	20,000	625,600.00	1.12
14	002022	科华生物	30,000	444,300.00	0.79
15	002573	国电清新	20,000	325,600.00	0.58
16	601012	隆基股份	30,000	285,600.00	0.51

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	601888	中国国旅	9,263,008.60	8.21
2	002241	歌尔声学	8,876,771.17	7.87
3	002415	海康威视	8,724,707.53	7.73
4	600016	民生银行	8,692,410.79	7.70
5	000937	冀中能源	7,895,836.30	7.00
6	601699	潞安环能	7,703,544.60	6.83
7	000002	万 科 A	7,453,733.24	6.60
8	002482	广田股份	6,663,525.71	5.90
9	600519	贵州茅台	6,329,022.85	5.61
10	002167	东方锆业	6,270,659.49	5.56
11	600315	上海家化	6,179,034.55	5.48
12	000059	辽通化工	6,118,493.94	5.42
13	600880	博瑞传播	6,017,690.47	5.33
14	600546	山煤国际	5,958,147.20	5.28
15	000401	冀东水泥	5,912,882.65	5.24
16	600318	巢东股份	5,868,365.79	5.20

17	300070	碧水源	5,747,765.02	5.09
18	600079	人福医药	5,724,107.06	5.07
19	600887	伊利股份	5,546,218.50	4.91
20	000060	中金岭南	5,534,587.20	4.90
21	300282	汇冠股份	5,390,553.24	4.78
22	600585	海螺水泥	5,376,178.60	4.76
23	600395	盘江股份	5,346,208.20	4.74
24	002297	博云新材	5,054,796.49	4.48
25	000786	北新建材	5,019,087.53	4.45
26	000998	隆平高科	4,918,590.43	4.36
27	601678	滨化股份	4,874,850.00	4.32
28	002005	德豪润达	4,832,087.52	4.28
29	600549	厦门钨业	4,688,520.75	4.15
30	000983	西山煤电	4,599,195.58	4.08
31	300079	数码视讯	4,555,043.80	4.04
32	300128	锦富新材	4,510,294.83	4.00
33	000338	潍柴动力	4,500,217.94	3.99
34	002375	亚厦股份	4,363,520.70	3.87
35	000826	桑德环境	4,186,573.27	3.71
36	002033	丽江旅游	4,154,095.50	3.68
37	600252	中恒集团	4,086,274.79	3.62
38	002028	思源电气	4,049,719.00	3.59
39	000423	东阿阿胶	4,015,289.70	3.56
40	601166	兴业银行	4,011,183.99	3.55
41	600801	华新水泥	3,975,040.00	3.52
42	601886	江河创建	3,951,849.00	3.50
43	000430	张家界	3,815,293.00	3.38
44	000895	双汇发展	3,756,577.62	3.33
45	601006	大秦铁路	3,718,890.00	3.30
46	600406	国电南瑞	3,645,926.30	3.23
47	000861	海印股份	3,542,741.00	3.14
48	600135	乐凯胶片	3,429,396.10	3.04
49	601992	金隅股份	3,424,525.67	3.03
50	000538	云南白药	3,200,975.26	2.84
51	002051	中工国际	3,192,366.20	2.83
52	600066	宇通客车	3,145,256.20	2.79

53	600498	烽火通信	3,144,304.42	2.79
54	600582	天地科技	3,121,399.65	2.77
55	000422	湖北宜化	2,993,138.38	2.65
56	000100	TCL 集团	2,959,500.00	2.62
57	000629	攀钢钒钛	2,906,000.00	2.57
58	000651	格力电器	2,887,243.96	2.56
59	600085	同仁堂	2,831,234.70	2.51
60	601012	隆基股份	2,795,372.87	2.48
61	600837	海通证券	2,747,800.00	2.43
62	300088	长信科技	2,729,757.00	2.42
63	000024	招商地产	2,727,600.00	2.42
64	002081	金螳螂	2,643,453.10	2.34
65	002458	益生股份	2,596,624.55	2.30
66	002146	荣盛发展	2,594,019.18	2.30
67	600348	阳泉煤业	2,584,724.80	2.29
68	002111	威海广泰	2,581,044.00	2.29
69	000876	新希望	2,571,565.00	2.28
70	000099	中信海直	2,566,737.50	2.27
71	002378	章源钨业	2,547,240.00	2.26
72	000858	五粮液	2,515,896.35	2.23
73	601717	郑煤机	2,509,500.00	2.22
74	002049	同方国芯	2,505,681.91	2.22
75	002069	獐子岛	2,464,265.00	2.18
76	002023	海特高新	2,417,503.00	2.14
77	600104	上汽集团	2,417,200.00	2.14
78	000528	柳工	2,416,539.00	2.14
79	002447	壹桥苗业	2,414,100.04	2.14
80	600352	浙江龙盛	2,411,237.00	2.14
81	000792	盐湖股份	2,410,111.00	2.14
82	002294	信立泰	2,401,538.31	2.13
83	600750	江中药业	2,397,843.38	2.12
84	600011	华能国际	2,365,100.00	2.10
85	000748	长城信息	2,359,543.52	2.09
86	300219	鸿利光电	2,329,180.00	2.06
87	600073	上海梅林	2,289,585.30	2.03
88	002236	大华股份	2,264,532.97	2.01

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	002241	歌尔声学	9,914,510.10	8.78
2	601888	中国国旅	9,529,472.92	8.44
3	002415	海康威视	8,994,428.40	7.97
4	600016	民生银行	8,910,806.17	7.90
5	000937	冀中能源	7,996,741.41	7.09
6	600880	博瑞传播	7,894,383.66	6.99
7	600809	山西汾酒	7,580,206.01	6.72
8	601699	潞安环能	7,439,799.00	6.59
9	600395	盘江股份	7,088,341.15	6.28
10	000059	辽通化工	6,479,704.29	5.74
11	000060	中金岭南	6,337,751.38	5.62
12	300070	碧水源	6,317,733.57	5.60
13	600315	上海家化	6,255,690.09	5.54
14	002167	东方锆业	6,151,736.74	5.45
15	600519	贵州茅台	6,122,616.58	5.43
16	600079	人福医药	5,930,000.21	5.25
17	600318	巢东股份	5,867,773.97	5.20
18	000401	冀东水泥	5,865,962.92	5.20
19	600546	山煤国际	5,507,060.57	4.88
20	600585	海螺水泥	5,505,296.03	4.88
21	002297	博云新材	5,235,949.93	4.64
22	000998	隆平高科	5,178,466.52	4.59
23	000983	西山煤电	5,166,332.00	4.58
24	600887	伊利股份	4,934,362.40	4.37
25	000629	攀钢钒钛	4,923,012.72	4.36
26	600549	厦门钨业	4,902,972.13	4.34
27	000861	海印股份	4,825,850.00	4.28
28	601678	滨化股份	4,806,307.94	4.26
29	300128	锦富新材	4,667,680.52	4.14
30	000826	桑德环境	4,631,883.42	4.10
31	002375	亚厦股份	4,589,019.24	4.07
32	600406	国电南瑞	4,577,461.29	4.06

33	002033	丽江旅游	4,382,019.26	3.88
34	002005	德豪润达	4,329,736.07	3.84
35	000338	潍柴动力	4,283,204.56	3.80
36	002482	广田股份	4,277,481.83	3.79
37	601088	中国神华	4,209,406.08	3.73
38	601166	兴业银行	4,173,940.00	3.70
39	000895	双汇发展	4,152,038.50	3.68
40	002028	思源电气	4,125,816.00	3.66
41	000786	北新建材	4,114,201.64	3.65
42	000002	万科A	4,004,200.00	3.55
43	600801	华新水泥	3,998,841.00	3.54
44	000430	张家界	3,854,261.32	3.42
45	300282	汇冠股份	3,745,760.67	3.32
46	601006	大秦铁路	3,644,000.00	3.23
47	000538	云南白药	3,410,814.36	3.02
48	601992	金隅股份	3,349,796.92	2.97
49	600498	烽火通信	3,345,598.39	2.96
50	000423	东阿阿胶	3,305,324.00	2.93
51	600123	兰花科创	3,232,649.74	2.86
52	002078	太阳纸业	3,199,916.55	2.84
53	000100	TCL 集团	3,099,000.00	2.75
54	300088	长信科技	3,031,888.36	2.69
55	002236	大华股份	2,895,379.81	2.57
56	600582	天地科技	2,875,423.00	2.55
57	000422	湖北宣化	2,841,427.42	2.52
58	600085	同仁堂	2,820,037.64	2.50
59	600837	海通证券	2,795,500.00	2.48
60	002069	獐子岛	2,759,102.00	2.44
61	002603	以岭药业	2,735,933.00	2.42
62	002081	金螳螂	2,730,668.17	2.42
63	002049	同方国芯	2,687,613.50	2.38
64	601126	四方股份	2,668,012.38	2.36
65	002378	章源钨业	2,605,976.03	2.31
66	000876	新希望	2,596,455.00	2.30
67	600352	浙江龙盛	2,594,154.97	2.30
68	002447	壹桥苗业	2,572,681.58	2.28
69	000651	格力电器	2,549,131.00	2.26
70	002111	威海广泰	2,526,773.73	2.24

71	600348	阳泉煤业	2,523,161.95	2.24
72	000099	中信海直	2,512,817.30	2.23
73	002023	海特高新	2,507,429.64	2.22
74	600835	上海机电	2,457,440.46	2.18
75	000858	五粮液	2,453,456.62	2.17
76	601717	郑煤机	2,434,132.28	2.16
77	002458	益生股份	2,429,985.69	2.15
78	002294	信立泰	2,401,004.92	2.13
79	600104	上汽集团	2,379,550.00	2.11
80	600117	西宁特钢	2,376,966.40	2.11
81	600199	金种子酒	2,370,785.15	2.10
82	000792	盐湖股份	2,368,553.14	2.10
83	000748	长城信息	2,361,158.00	2.09
84	000778	新兴铸管	2,352,264.02	2.08
85	002573	国电清新	2,320,572.00	2.06
86	000528	柳工	2,291,549.36	2.03

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	436,048,649.11
卖出股票收入（成交）总额	447,341,192.86

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	2,827,170.00	5.04
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	12,890,443.49	22.98
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	3,712,446.40	6.62
8	其他	-	-
9	合计	19,430,059.89	34.64

7.6 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

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	112121	12 景兴债	99,998	9,985,300.29	17.80
2	010308	03 国债(8)	28,300	2,827,170.00	5.04
3	110015	石化转债	23,000	2,295,860.00	4.09
4	110018	国电转债	13,180	1,416,586.40	2.53
5	122181	12 山鹰债	11,000	1,121,120.00	2.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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 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。

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10 投资组合报告附注**7.10.1**

报告期内基金投资的前十名证券除中恒集团（股票代码 600252）外其他证券的发行主体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。

广西梧州中恒集团股份有限公司（简称中恒集团）及其董事长兼总经理许淑清、董事兼常务副总经理刘伟湘、董事兼副总经理赵学伟等 13 名董事、监事或高管于 2012 年 7 月 9 日受到上海证券交易所公开谴责。原因是在信息披露、规范运作方面，其相关责任人在履行职责方面存在违规事项。

经过了本基金管理人内部的投资决策流程，认为该公司未来利润增长确定性较强，故将其纳入本基金的实际投资组合。

7.10.2

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。

7.10.3 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	237,906.34
2	应收证券清算款	1,194,759.78
3	应收股利	-
4	应收利息	579,886.95
5	应收申购款	11,067.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,023,620.27

7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110015	石化转债	2,295,860.00	4.09
2	110018	国电转债	1,416,586.40	2.53

7.10.5 期末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	601886	江河创建	2,681,800.00	4.78	重大事项

§ 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

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
973	59,420.14	8,575,368.79	14.83%	49,240,429.43	85.17%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	2,399,973.63	4.15%

8.3 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	1,452,308.37	2.51	1,400,342.78	2.42	3
基金经理等人员	539,137.78	0.93	500,080.64	0.86	3
基金管理人股东	8,575,368.79	14.83	8,501,132.50	14.70	3
其他	600,084.67	1.04	600,084.67	1.04	3
合计	11,166,899.61	19.31	11,001,640.59	19.03	3

注：本报告期基金管理公司高级管理人员持有份额总数减少 548,119.08 份，发起份额总数减少 600,084.67 份；基金经理等人员持有份额总数增加 39,057.14 份；基金管理公司股东持有份额总数增加 74,236.29 份；其他持有份额总数增加 600,084.67 份，发起份额总数增加 600,084.67 份。合计持有份额总数增加 165,259.02 份。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012年8月28日）基金份额总额	178,532,819.63
本报告期期初基金份额总额	110,175,572.03
本报告期基金总申购份额	1,546,085.30
减：本报告期基金总赎回份额	53,905,859.11
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	57,815,798.22

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。

§ 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

2013 年 2 月 27 日，本基金增聘一名基金经理徐艳芳女士，由吴强先生和徐艳芳女士共同管理本基金，除此以外，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

本报告期本基金投资策略未发生改变。

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	
申银万国	1	273,253,423.30	30.93%	187,152.02	30.23%	-
国金证券	1	223,218,060.40	25.27%	158,572.43	25.62%	-
东方证券	1	223,013,695.01	25.25%	156,877.74	25.34%	-
银河证券	1	163,904,663.26	18.55%	116,437.54	18.81%	-
中信证券	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. 本报告期新增东方证券、银河证券及中信证券各一个交易单元。

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
申银万国	206,652.47	0.53%	87,700,000.00	19.49%	-	-
国金证券	6,963,547.67	17.71%	108,500,000.00	24.11%	-	-
东方证券	12,998,645.97	33.06%	219,351,000.00	48.75%	-	-
银河证券	19,143,722.00	48.70%	34,400,000.00	7.65%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

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	国金通用基金管理有限公司关于国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资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	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2013 年 7 月 1 日

2	国金通用基金管理有限公司关于开通支付宝网上直销业务的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2013 年 6 月 27 日
3	国金通用基金管理有限公司关于旗下基金持有的“江河创建”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	2013 年 6 月 25 日
4	国金通用基金管理有限公司关于旗下基金开通好买基金基金定期定额业务及参加基金定投申购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	2013 年 6 月 25 日
5	关于增加上海天天基金销售有限公司为国金通用基金旗下基金销售机构并参加相关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	2013 年 6 月 25 日
6	国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金分红公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2013 年 5 月 15 日
7	国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金 2013 年第 1 季度报告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2013 年 4 月 22 日
8	国金通用基金管理有限公司关于增加北京展恒基金销售有限公司为代销机构并参加相关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	2013 年 4 月 18 日
9	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（更新）摘要	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2013 年 4 月 12 日
10	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（更新）	本基金基金管理人网站	2013 年 4 月 12 日
11	国金通用基金管理有限公司办公地址变更公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2013 年 3 月 30 日

12	国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金继续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	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2013 年 3 月 30 日
13	国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金 2012 年度报告	本基金基金管理人网站	2013 年 3 月 27 日
14	国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金 2012 年度报告摘要	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2013 年 3 月 27 日
15	国金通用基金管理有限公司关于增加浙江同花顺基金销售有限公司为代销机构并参加相关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	2013 年 3 月 22 日
16	国金通用基金管理有限公司关于增加上海好买基金销售有限公司为代销机构并参加相关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	2013 年 3 月 2 日
17	国金通用基金管理有限公司关于国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金增聘基金经理的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2013 年 2 月 27 日
18	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基金定投业务申购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	2013 年 2 月 20 日
19	国金通用基金管理有限公司关于成立北京千石创富资本管理有限公司的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2013 年 2 月 6 日
20	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	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2013 年 1 月 19 日

注：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，在打开申购、赎回后，每个开放日公布基金份额净值和基金份额累计净值。

§ 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。

12.2 存放地点

本基金基金管理人的办公场所

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

国金通用基金管理有限公司
2013年8月24日