

# 国金通用沪深 300 指数分级证券投资基金 2015 年半年度报告

2015 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：2015 年 8 月 28 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 2015 年 8 月 27 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 2015 年 1 月 1 日起至 2015 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>6</b>
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
<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 .....	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 .....	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 .....	11
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 .....	12
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
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
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>37</b>
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 .....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	52
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 .....	52
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 .....	52
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 .....	53
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 .....	53
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	53

7.12 投资组合报告附注 .....	54
<b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>55</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	55
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	56
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 .....	57
<b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>57</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>57</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	57
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 .....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	58
10.4 基金投资策略的改变 .....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	58
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 .....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	58
10.8 其他重大事件 .....	59
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>62</b>
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>62</b>
12.1 备查文件目录 .....	62
12.2 存放地点 .....	62
12.3 查阅方式 .....	62

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国金通用沪深 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	89,770,768.11 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	38,306,431.00 份	38,306,431.00 份	13,157,906.11 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	沪深 300 指数收益率*60%+上证国债指数收益率×40%		
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。		
下属分级基金的风险收益特征	国金沪深 300A 份额具有低风险、收益相	国金沪深 300B 份额具有高风险、高预期	本基金为股票型基金，属于较高风险、

	对稳定的特征。	收益的特征。	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(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	42,938,313.28

本期利润	39,837,064.40
加权平均基金份额本期利润	0.2216
本期加权平均净值利润率	20.08%
本期基金份额净值增长率	24.54%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2015年6月30日)</b>
期末可供分配利润	40,231,246.87
期末可供分配基金份额利润	0.4482
期末基金资产净值	108,688,995.30
期末基金份额净值	1.2107
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2015年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	21.07%

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。

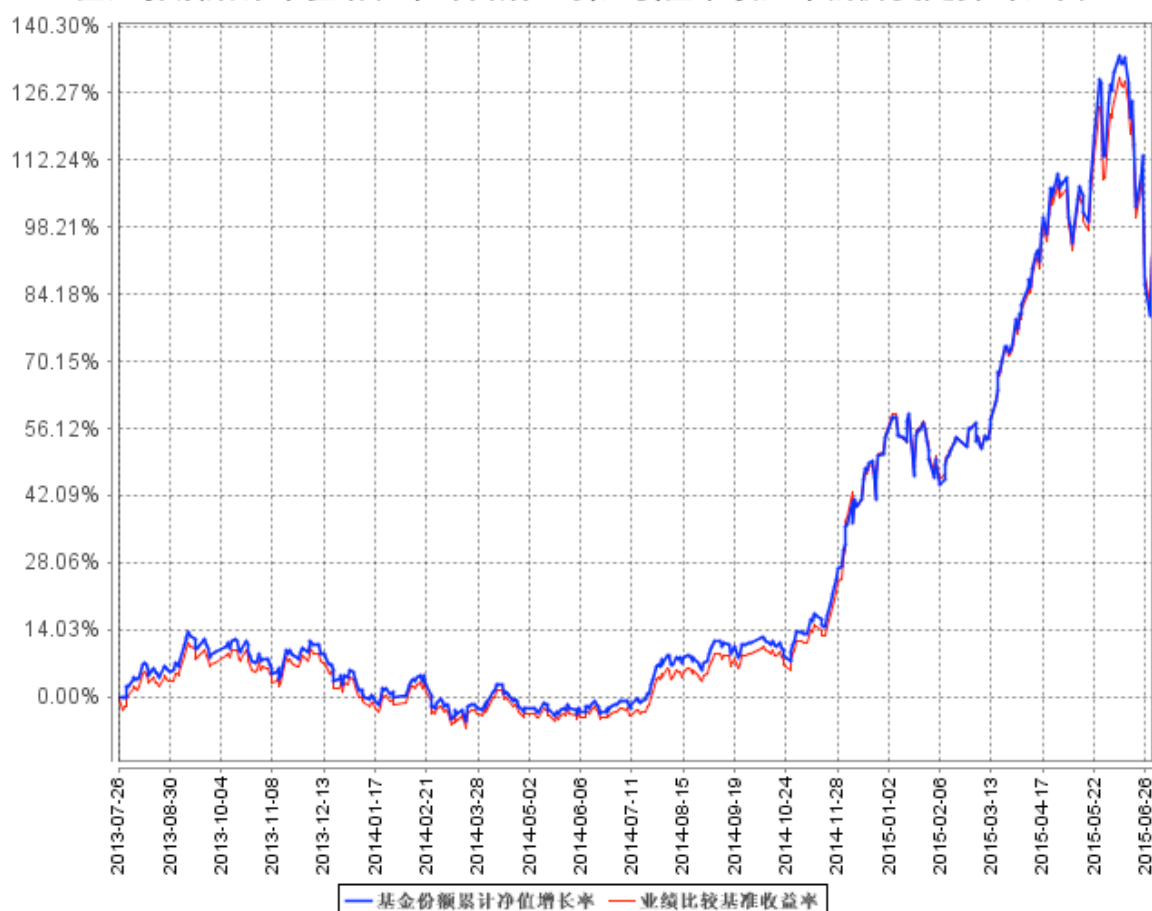
## 3.2 基金净值表现

### 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	-9.94%	3.66%	-7.18%	3.32%	-2.76%	0.34%
过去三个月	8.36%	2.70%	9.98%	2.48%	-1.62%	0.22%
过去六个月	24.54%	2.32%	25.29%	2.15%	-0.75%	0.17%
过去一年	94.68%	1.83%	99.67%	1.75%	-4.99%	0.08%
自基金合同生效起至今	92.01%	1.50%	93.67%	1.46%	-1.66%	0.04%

### 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 2015 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、苏州工业园区兆润控股集团有限公司、广东宝丽华新能源股份有限公司、涌金投资控股有限公司，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 2015 年 06 月 30 日，国金基金管理有限公司共管理 8



只开放式基金——国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金、国金通用沪深 300 指数分级证券投资基金、国金通用鑫盈货币市场证券投资基金、国金通用金腾货币市场证券投资基金、国金通用鑫安保本混合型证券投资基金、国金通用上证 50 指数分级证券投资基金、国金通用鑫运灵活配置混合型证券投资基金、国金通用众赢货币市场证券投资基金。

#### 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		
宫雪	基金 经理	2013 年 7 月 26 日	-	6	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 月至今在国金通用基金管理有限公司，历任产品经理、行业分析师、产品与金融工程部副总经理、基金经理。2013 年 7 月起任国金通用沪深 300 指数分级证券投资基金基金经理；2014 年 8 月起任国金通用鑫安保本混合型证券投资基金基金经理；2015 年 5 月起任国金通用上证 50 指数分级证券投资基金基金经理；2015 年 6 月起任国金通用鑫运灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《国金通用沪深 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，对于不同投资合同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

报告期内，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。

报告期，沪深 300 指数于 2015 年 6 月 15 日进行了 1 次成份股调整，增加跟踪误差难度。指数管理过程中，为控制跟踪偏离度，本基金按照沪深 300 成份股的调整公告，结合指数波动特点，适时进行投资组合的调整。报告期，本基金的日跟踪偏离度和跟踪误差均为正常水平，低于基金

合同的规定。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期，本基金份额净值增长率为 24.54%，同期业绩比较基准收益率为 25.29%；报告期内，相对沪深 300 指数收益，日均跟踪偏离度的绝对值 0.098%，年化跟踪误差为 2.897%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2 季度投资增速下降趋势有所放缓，消费增速出现企稳，出口的降幅也在收窄，三大需求初步改善显示经济正逐步逼近周期底部，企稳迹象初显。虽然货币持续宽松，但由于对场外配资杠杆的严格监管，导致证券市场短期出现了较大幅度的调整，A 股的估值也大幅回落，市场整体波动率大幅提升。但货币环境持续宽松，财政支持也在加大，企业的融资成本已较之前有了较为显著的降低，随着改革的逐步推进和落地，有助于市场整体的回升。

#### 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，本基金无连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### § 5 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

2015 年上半年度，中国光大银行在国金通用沪深 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，对国金通用沪深 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

2015 年上半年度，中国光大银行依据《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

中国光大银行依法对基金管理人——国金基金管理有限公司编制的“国金通用沪深 300 指数分级证券投资基金 2015 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：国金通用沪深 300 指数分级证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	10,094,575.11	3,601,089.97
结算备付金		1,007,329.68	753.05
存出保证金		1,286,106.78	9,618.78
交易性金融资产	6.4.7.2	99,972,958.72	61,783,185.31
其中：股票投资		99,700,945.82	61,783,185.31
基金投资		-	-
债券投资		272,012.90	-
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		6,828,703.64	-
应收利息	6.4.7.5	2,540.89	833.49
应收股利		-	-
应收申购款		74,444.01	765,370.24
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		119,266,658.83	66,160,850.84
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2014 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	1,683,141.82	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	0.73
应付赎回款		8,083,306.31	477,995.93
应付管理人报酬		104,352.93	41,465.38
应付托管费		26,088.25	10,366.34
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	418,003.81	210,514.38
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	262,770.41	301,801.47
负债合计		10,577,663.53	1,042,144.23
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	56,603,452.99	42,232,685.64

未分配利润	6.4.7.10	52,085,542.31	22,886,020.97
所有者权益合计		108,688,995.30	65,118,706.61
负债和所有者权益总计		119,266,658.83	66,160,850.84

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，国金沪深 300 份额净值人民币 1.2107 元，国金沪深 300A 份额净值人民币 1.0301 元，国金沪深 300B 份额净值人民币 1.3913 元；基金份额总额 89,770,768.11 份，其中国金沪深 300 份额 13,157,906.11 份，国金沪深 300A 份额 38,306,431.00 份，国金沪深 300B 份额 38,306,431.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国金通用沪深 300 指数分级证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		41,993,840.12	-8,766,745.00
1.利息收入		64,378.31	21,327.60
其中：存款利息收入	6.4.7.11	64,288.55	21,327.60
债券利息收入		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）		44,518,892.35	-534,837.01
其中：股票投资收益	6.4.7.12	38,374,040.71	-858,313.60
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	5,240,841.82	-
股利收益	6.4.7.16	904,009.82	323,476.59
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-3,101,248.88	-8,423,335.14
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	511,818.34	170,099.55
<b>减：二、费用</b>		2,156,775.72	852,733.53
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	776,341.28	218,133.71
2. 托管费	6.4.10.2.2	194,085.34	54,533.40
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-

4. 交易费用	6.4.7.19	1,003,780.30	276,752.62
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	182,568.80	303,313.80
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		39,837,064.40	-9,619,478.53
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		39,837,064.40	-9,619,478.53

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国金通用沪深 300 指数分级证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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	162,458,257.46	8,941,316.17	171,399,573.63

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-9,619,478.53	-9,619,478.53
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)	-132,631,089.66	232,165.23	-132,398,924.43
其中: 1.基金申购款	3,786,680.25	-106,816.19	3,679,864.06
2.基金赎回款	-136,417,769.91	338,981.42	-136,078,788.49
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)	29,827,167.80	-445,997.13	29,381,170.67

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	_____ 聂武鹏	_____ 于晓莲
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作为发起人于 2013 年 7 月 1 日至 2013 年 7 月 19 日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具(2013)验字第 61004823\_A12 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 2013 年 7 月 26 日正式生效,首次设立募集规模为 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 的比例确认为 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。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为国金基金管理有限公司,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。

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）。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%。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。业绩比较基准： $95\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 5\% \times \text{同期银行活期存款利率（税后）}$ 。

#### 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。

采用若干修订后/新会计准则

2014 年 1 至 3 月，财政部制定了《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》和《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》；修订了《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》和《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》；上述 7 项会计准则均自 2014 年 7 月 1 日起施行。2014 年 6 月，财政部修订了《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》，在 2014 年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本财务报表无重大影响。

### 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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 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。

#### 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

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24 号《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》的规定,自 2015 年 03 月 27 日起,交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

#### 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、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，继续免征营业税和企业所得税；

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。

## 3. 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《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 2015 年 6 月 30 日
活期存款	10,094,575.11
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	10,094,575.11

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	90,414,814.10	99,700,945.82	9,286,131.72
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	272,012.90	118,012.90
	银行间市场	-	-
	合计	272,012.90	118,012.90
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	90,568,814.10	99,972,958.72	9,404,144.62

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 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	10,504,320.00	-	1,683,141.82	

其中：股指期货投资	10,504,320.00	-	1,683,141.82	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	10,504,320.00	-	1,683,141.82	

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，具体投资情况详见投资组合报告中报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细表。

#### 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 2015年6月30日
应收活期存款利息	2,342.33
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	2.70
应收债券利息	89.76
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	106.10
合计	2,540.89

#### 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 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	418,003.81
银行间市场应付交易费用	-
合计	418,003.81

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	30,451.61
预提费用	182,318.80
其他应付款-指数使用费	50,000.00
合计	262,770.41

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	42,813,289.13	42,813,289.13
本期申购	301,518.06	301,518.06
本期赎回(以“-”号填列)	-5,097.33	-5,097.33
2015 年 1 月 5 日 基金拆分/份额折算前	43,109,709.86	43,109,709.86
基金拆分/份额折算变动份额	24,337,955.66	-
本期申购	405,176,073.11	405,176,073.11
本期赎回(以“-”号填列)	-382,852,970.52	-382,852,970.52
本期末	89,770,768.11	89,770,768.11

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	8,269,696.33	14,616,324.64	22,886,020.97
本期利润	42,938,313.28	-3,101,248.88	39,837,064.40
本期基金份额交易产生的变动数	-10,976,762.74	339,219.68	-10,637,543.06
其中：基金申购款	58,910,371.64	100,949,215.79	159,859,587.43
基金赎回款	-69,887,134.38	-100,609,996.11	-170,497,130.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	40,231,246.87	11,854,295.44	52,085,542.31

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	57,020.68
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	4,643.55
其他	2,624.32
合计	64,288.55

**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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	367,570,173.00
减：卖出股票成本总额	329,196,132.29
买卖股票差价收入	38,374,040.71

**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**

注：本基金本报告期无债券投资收益。

**6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

注：本基金本报告期无买卖债券差价收入。

**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：本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	904,009.82
基金投资产生的股利收益	-
合计	904,009.82

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-1,418,107.06
——股票投资	-1,536,119.96
——债券投资	118,012.90
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-

2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-1,683,141.82
合计	-3,101,248.88

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	511,818.34
合计	511,818.34

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。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,003,780.30
银行间市场交易费用	-
合计	1,003,780.30

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	57,523.61
银行费用	250.00
指数使用费	100,000.00
合计	182,568.80

#### 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
中国光大银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

注：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 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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%	25,895,598.90	17.51%

#### 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。

#### 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。

### 6.4.10.1.2 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。

### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民

币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015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	98,344.31	18.00%	119,507.98	28.59%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	18,396.73	15.15%	18,396.73	6.15%

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。

### 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 2015年1月1日至2015年6 月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30 日
	当期发生的基金应支付 的管理费	776,341.28
其中：支付销售机构的客 户维护费	34,573.24	25,782.53

注：1. 基金管理费按前一日的基金资产净值的 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
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	194,085.34	54,533.40

注：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

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 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

注：本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

#### 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	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 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	10,094,575.11	57,020.68	1,721,377.20	20,246.96

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国光大银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 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：无

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

-

#### 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：本基金本报告期末进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2015 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300487	蓝晓科技	2015年6月24日	2015年7月2日	新股流通受限	14.83	14.83	500	7,415.00	7,415.00	-

##### 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
600886	国投电力	2015年6月23日	临时停牌	14.87	-	-	40,054	439,875.40	595,602.98	-
000024	招商地产	2015年4月2日	临时停牌	31.64	-	-	17,783	424,868.60	562,654.12	-
000778	新兴铸管	2015年6月12日	临时停牌	12.96	-	-	29,495	200,182.53	382,255.20	-
601111	中国	2015年	临时	15.36	2015年	13.78	22,956	244,217.94	352,604.16	-

	国航	6月29日	停牌		7月29日						
000917	电广传媒	2015年5月27日	临时停牌	42.89	2015年7月29日	13.78	7,498	138,261.84	321,589.22	-	
600153	建发股份	2015年6月26日	临时停牌	17.51	-	-	17,650	225,795.69	309,051.50	-	
000630	铜陵有色	2015年3月6日	临时停牌	8.44	-	-	32,254	246,941.21	272,223.76	-	
000709	河北钢铁	2015年6月29日	临时停牌	7.00	2015年8月24日	6.30	38,221	155,740.62	267,547.00	-	
000793	华闻传媒	2015年5月25日	临时停牌	20.75	-	-	12,498	152,688.74	259,333.50	-	
002375	亚厦股份	2015年6月16日	临时停牌	29.21	2015年7月20日	26.29	8,616	174,855.92	251,673.36	-	
000839	中信国安	2015年6月26日	临时停牌	23.57	-	-	9,761	145,408.53	230,066.77	-	
002353	杰瑞股份	2015年5月26日	临时停牌	44.35	-	-	5,102	176,058.51	226,273.70	-	
601633	长城汽车	2015年6月18日	临时停牌	42.76	2015年7月13日	38.50	4,770	216,600.73	203,965.20	-	
000963	华东医药	2015年6月25日	临时停牌	71.48	2015年8月5日	69.00	2,530	154,722.69	180,844.40	-	
000878	云南铜业	2015年6月5日	临时停牌	24.50	-	-	7,360	105,190.78	180,320.00	-	
601021	春秋航空	2015年6月25日	临时停牌	126.09	2015年7月21日	113.48	1,400	189,011.53	176,526.00	-	
002310	东方园林	2015年5月26日	临时停牌	38.30	-	-	4,288	80,965.80	164,230.40	-	
002292	奥飞动漫	2015年5月15日	临时停牌	37.85	-	-	4,268	71,121.34	161,543.80	-	

601216	内蒙君正	2015年6月26日	临时停牌	24.07	2015年7月2日	24.20	6,430	114,860.62	154,770.10	-
600277	亿利能源	2015年5月29日	临时停牌	14.62	-	-	8,785	81,219.02	128,436.70	-
002001	新和成	2015年6月29日	临时停牌	17.09	2015年7月13日	18.49	4,918	89,414.37	84,048.62	-
600395	盘江股份	2015年6月8日	临时停牌	15.71	2015年8月19日	14.00	5,142	61,227.82	80,780.82	-
002416	爱施德	2015年5月4日	临时停牌	20.67	2015年7月29日	18.60	2,985	38,028.27	61,699.95	-

### 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

本基金本期末未持有银行间市场正回购抵押债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本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。

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、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。

于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

##### **6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资**

#### **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 7.4.12 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约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。

#### **6.4.13.3.1 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。

##### **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、结算备付金和存出保证金等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 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	10,094,575.11	-	-	-	-	-	10,094,575.11
结算备付金	1,007,329.68	-	-	-	-	-	1,007,329.68
存出保证金	-	-	-	-	-	1,050,432.00	1,050,432.00
交易性金融资产	-	-	272,012.90	-	-	99,700,945.82	99,972,958.72
应收证券清算款	-	-	-	-	-	6,828,703.64	6,828,703.64
应收利息	-	-	-	-	-	2,540.89	2,540.89
应收申购款	-	-	-	-	-	74,444.01	74,444.01
其他资产	-	-	-	-	-	-1,447,467.04	-1,447,467.04
资产总计	11,101,904.79	-	272,012.90	-	-	106,209,599.32	117,583,517.01
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	8,083,306.31	8,083,306.31
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	104,352.93	104,352.93
应付托管费	-	-	-	-	-	26,088.25	26,088.25
应付交易费用	-	-	-	-	-	418,003.81	418,003.81
其他负债	-	-	-	-	-	262,770.41	262,770.41
负债总计	-	-	-	-	-	8,894,521.71	8,894,521.71
利率敏感度缺口	11,101,904.79	-	272,012.90	-	-	97,315,077.61	108,688,995.30
上年度末 2014 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	3,601,089.97	-	-	-	-	-	3,601,089.97
结算备付金	753.05	-	-	-	-	-	753.05
交易性金融资产	-	-	-	-	-	61,783,185.31	61,783,185.31
应收利息	-	-	-	-	-	833.49	833.49
应收申购款	1,196.40	-	-	-	-	764,173.84	765,370.24
其他资产	-	-	-	-	-	9,618.78	9,618.78
资产总计	3,603,039.42	-	-	-	-	62,557,811.42	66,160,850.84
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	0.73	0.73
应付赎回款	-	-	-	-	-	477,995.93	477,995.93

应付管理人报酬	-	-	-	-	41,465.38	41,465.38
应付托管费	-	-	-	-	10,366.34	10,366.34
应付交易费用	-	-	-	-	210,514.38	210,514.38
其他负债	-	-	-	-	301,801.47	301,801.47
负债总计	-	-	-	-	1,042,144.23	1,042,144.23
利率敏感度缺口	3,603,039.42	-	-	-	61,515,667.19	65,118,706.61

#### 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利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金，其他金融资产和金融负债均不计息，因此市场利率的变动对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。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，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%。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 2015年6月30日		上年度末 2014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	99,700,945.82	91.73	61,783,185.31	94.88
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	272,012.90	0.25	-	-

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	99,972,958.72	91.98	61,783,185.31	94.88

#### 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 系数是根据组合在本报告期所有交易日的净值数据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（2015 年 6 月 30 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	+5%	5,807,674.89	3,115,766.00
-5%	-5,807,674.89	-3,115,766.00	

#### 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。			
假设	1. 置信区间 -		
	2. 观察期 -		
分析	风险价值 (单位：人民币元)	本期末（2015 年 6 月 30 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）

#### 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	99,700,945.82	84.79
	其中：股票	99,700,945.82	84.79

2	固定收益投资	272,012.90	0.23
	其中：债券	272,012.90	0.23
	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	11,101,904.79	9.44
7	其他各项资产	6,508,653.50	5.54
8	合计	117,583,517.01	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	234,359.14	0.22
B	采矿业	4,575,976.99	4.21
C	制造业	33,261,123.18	30.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,593,611.29	4.23
E	建筑业	4,480,102.85	4.12
F	批发和零售业	2,190,197.17	2.02
G	交通运输、仓储和邮政业	4,080,610.68	3.75
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,613,485.17	5.16
J	金融业	33,321,155.28	30.66
K	房地产业	3,878,037.03	3.57
L	租赁和商务服务业	996,208.93	0.92
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	788,356.06	0.73
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	106,232.18	0.10
R	文化、体育和娱乐业	1,223,796.19	1.13
S	综合	268,623.68	0.25
	合计	99,611,875.82	91.65

注：以上行业分类以 2015 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	采掘业	24,750.00	0.02
C	制造业	7,415.00	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	34,340.00	0.03
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	22,565.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	89,070.00	0.08

注：以上行业分类以 2015 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

### 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	45,886	3,759,898.84	3.46
2	600036	招商银行	139,682	2,614,847.04	2.41
3	600016	民生银行	250,193	2,486,918.42	2.29
4	600030	中信证券	66,645	1,793,416.95	1.65

5	601166	兴业银行	96,732	1,668,627.00	1.54
6	600000	浦发银行	94,739	1,606,773.44	1.48
7	600837	海通证券	68,519	1,493,714.20	1.37
8	601766	中国南车	77,627	1,425,231.72	1.31
9	601328	交通银行	166,203	1,369,512.72	1.26
10	000651	格力电器	20,366	1,301,387.40	1.20
11	000002	万科A	82,151	1,192,832.52	1.10
12	601989	中国重工	77,730	1,150,404.00	1.06
13	601398	工商银行	205,393	1,084,475.04	1.00
14	601668	中国建筑	127,061	1,055,876.91	0.97
15	600519	贵州茅台	3,828	986,284.20	0.91
16	600887	伊利股份	51,814	979,284.60	0.90
17	600900	长江电力	66,955	960,804.25	0.88
18	601988	中国银行	196,353	960,166.17	0.88
19	601169	北京银行	71,513	952,553.16	0.88
20	601818	光大银行	168,579	903,583.44	0.83
21	601288	农业银行	224,126	831,507.46	0.77
22	601601	中国太保	26,623	803,482.14	0.74
23	601390	中国中铁	57,836	791,774.84	0.73
24	601006	大秦铁路	50,353	706,956.12	0.65
25	000001	平安银行	48,422	704,055.88	0.65
26	000333	美的集团	17,853	665,559.84	0.61
27	601688	华泰证券	27,713	641,001.69	0.59
28	600104	上汽集团	28,003	632,867.80	0.58
29	300059	东方财富	10,000	630,900.00	0.58
30	600028	中国石化	88,909	627,697.54	0.58
31	600048	保利地产	54,487	622,241.54	0.57
32	000166	申万宏源	37,697	612,576.25	0.56
33	600886	国投电力	40,054	595,602.98	0.55
34	600795	国电电力	83,099	579,200.03	0.53
35	601939	建设银行	81,184	578,841.92	0.53
36	600015	华夏银行	37,749	574,162.29	0.53
37	002024	苏宁云商	37,441	572,847.30	0.53
38	000776	广发证券	24,991	566,046.15	0.52
39	000024	招商地产	17,783	562,654.12	0.52
40	600050	中国联通	71,799	526,286.67	0.48
41	600999	招商证券	19,670	520,468.20	0.48
42	000858	五粮液	16,009	507,485.30	0.47
43	600011	华能国际	35,486	497,868.58	0.46



44	000768	中航飞机	11,252	490,362.16	0.45
45	601377	兴业证券	35,261	482,723.09	0.44
46	600570	恒生电子	4,212	471,954.60	0.43
47	600637	百视通	11,169	469,991.52	0.43
48	601857	中国石油	41,153	466,263.49	0.43
49	002415	海康威视	10,339	463,187.20	0.43
50	600518	康美药业	26,026	461,440.98	0.42
51	000725	京东方 A	86,164	447,191.16	0.41
52	601628	中国人寿	14,117	442,144.44	0.41
53	600276	恒瑞医药	9,914	441,569.56	0.41
54	600705	中航资本	18,952	438,738.80	0.40
55	601336	新华保险	7,088	432,793.28	0.40
56	600029	南方航空	29,663	431,300.02	0.40
57	600010	宝钢股份	82,678	429,098.82	0.39
58	601901	方正证券	34,808	413,867.12	0.38
59	601899	紫金矿业	80,313	411,202.56	0.38
60	000100	TCL 集团	72,271	408,331.15	0.38
61	601186	中国铁建	26,061	407,333.43	0.37
62	000625	长安汽车	19,106	404,091.90	0.37
63	300104	乐视网	7,800	403,728.00	0.37
64	000069	华侨城 A	30,737	398,966.26	0.37
65	601669	中国电建	35,002	396,922.68	0.37
66	000063	中兴通讯	16,606	395,388.86	0.36
67	000783	长江证券	28,090	391,855.50	0.36
68	600690	青岛海尔	12,880	390,650.40	0.36
69	601009	南京银行	17,045	388,626.00	0.36
70	000778	新兴铸管	29,495	382,255.20	0.35
71	600703	三安光电	12,166	380,795.80	0.35
72	000728	国元证券	9,962	378,356.76	0.35
73	000538	云南白药	4,358	375,964.66	0.35
74	600109	国金证券	15,378	375,223.20	0.35
75	601727	上海电气	25,000	373,250.00	0.34
76	002450	康得新	12,132	371,239.20	0.34
77	600019	宝钢股份	41,833	365,620.42	0.34
78	600585	海螺水泥	16,941	363,384.45	0.33
79	600115	东方航空	28,655	353,029.60	0.32
80	601111	中国国航	22,956	352,604.16	0.32
81	600415	小商品城	23,026	351,837.28	0.32
82	601088	中国神华	16,731	348,841.35	0.32

83	601600	中国铝业	37,126	346,385.58	0.32
84	600111	北方稀土	18,482	335,263.48	0.31
85	000338	潍柴动力	10,305	326,256.30	0.30
86	600089	特变电工	21,906	324,427.86	0.30
87	601919	中国远洋	25,800	321,984.00	0.30
88	000917	电广传媒	7,498	321,589.22	0.30
89	600221	海南航空	49,952	319,193.28	0.29
90	600100	同方股份	15,023	315,332.77	0.29
91	601788	光大证券	11,600	312,620.00	0.29
92	600031	三一重工	32,252	312,521.88	0.29
93	600583	海油工程	18,687	311,325.42	0.29
94	600153	建发股份	17,650	309,051.50	0.28
95	600839	四川长虹	31,324	308,228.16	0.28
96	000157	中联重科	37,271	302,267.81	0.28
97	600271	航天信息	4,668	302,066.28	0.28
98	600150	中国船舶	5,856	301,584.00	0.28
99	000503	海虹控股	6,111	299,439.00	0.28
100	601618	中国中冶	41,343	298,909.89	0.28
101	300024	机器人	3,844	296,987.44	0.27
102	002142	宁波银行	13,783	291,510.45	0.27
103	601018	宁波港	32,533	287,591.72	0.26
104	600118	中国卫星	5,024	286,167.04	0.26
105	000402	金融街	20,181	285,157.53	0.26
106	300027	华谊兄弟	7,385	281,663.90	0.26
107	600196	复星医药	9,696	280,602.24	0.26
108	600804	鹏博士	9,372	279,847.92	0.26
109	600256	广汇能源	26,511	275,714.40	0.25
110	600535	天士力	5,506	273,978.56	0.25
111	600068	葛洲坝	23,420	273,779.80	0.25
112	600352	浙江龙盛	19,296	273,424.32	0.25
113	600588	用友网络	5,954	273,169.52	0.25
114	000630	铜陵有色	32,254	272,223.76	0.25
115	600340	华夏幸福	8,938	272,162.10	0.25
116	601099	太平洋	20,900	270,028.00	0.25
117	002304	洋河股份	3,880	269,116.80	0.25
118	002673	西部证券	9,480	268,947.60	0.25
119	601106	中国一重	22,200	268,842.00	0.25
120	000709	河北钢铁	38,221	267,547.00	0.25
121	600893	中航动力	4,916	261,285.40	0.24

122	002736	国信证券	10,400	260,936.00	0.24
123	600009	上海机场	8,190	259,623.00	0.24
124	000793	华闻传媒	12,498	259,333.50	0.24
125	600406	国电南瑞	12,366	255,852.54	0.24
126	600958	东方证券	8,900	254,718.00	0.23
127	601866	中海集运	26,811	254,704.50	0.23
128	002202	金风科技	12,994	252,993.18	0.23
129	600739	辽宁成大	10,315	252,201.75	0.23
130	002375	亚厦股份	8,616	251,673.36	0.23
131	002230	科大讯飞	7,168	250,449.92	0.23
132	600177	雅戈尔	13,228	241,543.28	0.22
133	600383	金地集团	19,052	241,007.80	0.22
134	000423	东阿阿胶	4,422	240,999.00	0.22
135	600005	武钢股份	34,200	240,426.00	0.22
136	000039	中集集团	7,308	236,048.40	0.22
137	601333	广深铁路	28,715	236,037.30	0.22
138	600369	西南证券	11,908	233,992.20	0.22
139	601555	东吴证券	11,421	233,787.87	0.22
140	600674	川投能源	18,654	233,361.54	0.21
141	002241	歌尔声学	6,495	233,170.50	0.21
142	600066	宇通客车	11,211	230,386.05	0.21
143	000839	中信国安	9,761	230,066.77	0.21
144	600023	浙能电力	22,935	227,515.20	0.21
145	601800	中国交建	12,954	227,472.24	0.21
146	002353	杰瑞股份	5,102	226,273.70	0.21
147	300070	碧水源	4,567	222,823.93	0.21
148	601888	中国国旅	3,345	221,773.50	0.20
149	600309	万华化学	9,132	220,811.76	0.20
150	002594	比亚迪	3,948	218,048.04	0.20
151	002465	海格通信	6,755	217,443.45	0.20
152	000559	万向钱潮	9,694	211,910.84	0.19
153	600085	同仁堂	5,858	210,360.78	0.19
154	002081	金螳螂	7,452	210,071.88	0.19
155	000060	中金岭南	11,285	209,788.15	0.19
156	600398	海澜之家	11,482	208,168.66	0.19
157	601998	中信银行	26,937	207,684.27	0.19
158	600875	东方电气	10,115	207,054.05	0.19
159	002008	大族激光	7,148	205,290.56	0.19
160	000623	吉林敖东	6,100	204,960.00	0.19

161	601633	长城汽车	4,770	203,965.20	0.19
162	601991	大唐发电	25,400	202,692.00	0.19
163	600863	内蒙华电	24,643	201,579.74	0.19
164	600027	华电国际	18,011	200,282.32	0.18
165	601933	永辉超市	17,218	199,556.62	0.18
166	600688	上海石化	18,520	198,719.60	0.18
167	000750	国海证券	11,670	196,056.00	0.18
168	600157	永泰能源	28,408	195,447.04	0.18
169	000629	攀钢钒钛	36,443	195,334.48	0.18
170	600315	上海家化	4,496	195,126.40	0.18
171	000568	泸州老窖	5,957	194,257.77	0.18
172	000686	东北证券	9,930	193,337.10	0.18
173	002500	山西证券	10,680	193,201.20	0.18
174	600642	申能股份	19,223	192,422.23	0.18
175	300017	网宿科技	4,129	191,668.18	0.18
176	300124	汇川技术	3,938	189,024.00	0.17
177	600741	华域汽车	8,776	187,367.60	0.17
178	002065	东华软件	6,455	185,581.25	0.17
179	601607	上海医药	8,176	182,079.52	0.17
180	300058	蓝色光标	11,492	181,688.52	0.17
181	000963	华东医药	2,530	180,844.40	0.17
182	600252	中恒集团	7,845	180,435.00	0.17
183	000878	云南铜业	7,360	180,320.00	0.17
184	601179	中国西电	17,394	178,288.50	0.16
185	000895	双汇发展	8,341	177,913.53	0.16
186	002456	欧菲光	5,258	177,404.92	0.16
187	601898	中煤能源	15,462	176,576.04	0.16
188	601021	春秋航空	1,400	176,526.00	0.16
189	000009	中国宝安	10,764	175,560.84	0.16
190	601168	西部矿业	16,072	175,506.24	0.16
191	600663	陆家嘴	3,473	172,747.02	0.16
192	000876	新希望	8,855	171,875.55	0.16
193	002385	大北农	12,682	171,460.64	0.16
194	600018	上港集团	21,578	170,681.98	0.16
195	000046	泛海控股	11,600	169,940.00	0.16
196	000800	一汽轿车	6,824	169,781.12	0.16
197	600660	福耀玻璃	11,879	169,632.12	0.16
198	000826	桑德环境	4,283	166,565.87	0.15
199	300003	乐普医疗	4,100	166,337.00	0.15

200	600873	梅花生物	15,774	164,680.56	0.15
201	002310	东方园林	4,288	164,230.40	0.15
202	600060	海信电器	6,669	163,990.71	0.15
203	601117	中国化学	16,730	163,619.40	0.15
204	002292	奥飞动漫	4,268	161,543.80	0.15
205	002146	荣盛发展	12,918	161,475.00	0.15
206	600489	中金黄金	12,407	159,678.09	0.15
207	600208	新湖中宝	20,615	159,147.80	0.15
208	000425	徐工机械	11,977	158,934.79	0.15
209	000883	湖北能源	18,092	157,762.24	0.15
210	600718	东软集团	7,260	157,759.80	0.15
211	600372	中航电子	4,515	157,708.95	0.15
212	002236	大华股份	4,930	157,365.60	0.14
213	601216	内蒙君正	6,430	154,770.10	0.14
214	600332	白云山	4,476	154,242.96	0.14
215	300002	神州泰岳	10,119	154,213.56	0.14
216	000581	威孚高科	4,973	154,113.27	0.14
217	002129	中环股份	7,729	152,956.91	0.14
218	000792	盐湖股份	5,377	152,599.26	0.14
219	600362	江西铜业	7,037	151,365.87	0.14
220	002252	上海莱士	2,299	150,446.56	0.14
221	601258	庞大集团	27,444	149,844.24	0.14
222	000970	中科三环	7,204	148,474.44	0.14
223	600547	山东黄金	6,001	148,224.70	0.14
224	000061	农产品	7,228	147,451.20	0.14
225	600867	通化东宝	6,719	147,347.67	0.14
226	000598	兴蓉环境	15,114	144,640.98	0.13
227	002475	立讯精密	4,219	142,644.39	0.13
228	600170	上海建工	15,127	141,891.26	0.13
229	002153	石基信息	1,086	141,169.14	0.13
230	601808	中海油服	4,997	139,616.18	0.13
231	000413	东旭光电	14,257	139,433.46	0.13
232	601098	中南传媒	6,077	139,224.07	0.13
233	600600	青岛啤酒	2,963	138,046.17	0.13
234	601225	陕西煤业	16,868	137,980.24	0.13
235	000825	太钢不锈	19,256	136,910.16	0.13
236	600108	亚盛集团	13,171	136,451.56	0.13
237	600827	百联股份	6,513	135,535.53	0.12
238	002410	广联达	5,701	133,403.40	0.12

239	000712	锦龙股份	3,800	133,380.00	0.12
240	002038	双鹭药业	2,335	132,277.75	0.12
241	000738	中航动控	3,900	129,324.00	0.12
242	000400	许继电气	5,113	128,643.08	0.12
243	600277	亿利能源	8,785	128,436.70	0.12
244	000831	五矿稀土	4,991	127,669.78	0.12
245	600316	洪都航空	3,648	126,147.84	0.12
246	000983	西山煤电	13,254	125,647.92	0.12
247	000027	深圳能源	10,094	124,660.90	0.11
248	600166	福田汽车	14,050	124,061.50	0.11
249	603000	人民网	2,376	123,860.88	0.11
250	002422	科伦药业	3,092	123,803.68	0.11
251	000729	燕京啤酒	11,832	123,052.80	0.11
252	600497	驰宏锌锗	8,430	122,993.70	0.11
253	600038	中直股份	1,984	122,908.80	0.11
254	600597	光明乳业	5,239	120,497.00	0.11
255	600008	首创股份	8,178	117,354.30	0.11
256	000960	锡业股份	5,800	116,870.00	0.11
257	002470	金正大	5,290	114,845.90	0.11
258	000898	鞍钢股份	15,674	114,420.20	0.11
259	601929	吉视传媒	7,444	112,553.28	0.10
260	600373	中文传媒	4,678	112,084.88	0.10
261	601928	凤凰传媒	6,510	111,321.00	0.10
262	601992	金隅股份	9,159	109,450.05	0.10
263	002007	华兰生物	2,461	108,997.69	0.10
264	600717	天津港	7,100	106,429.00	0.10
265	300015	爱尔眼科	3,293	106,232.18	0.10
266	600578	京能电力	11,798	105,356.14	0.10
267	600516	方大炭素	8,752	104,236.32	0.10
268	600317	营口港	16,500	103,950.00	0.10
269	600348	阳泉煤业	10,139	103,924.75	0.10
270	000999	华润三九	3,372	102,475.08	0.09
271	600633	浙报传媒	5,062	99,215.20	0.09
272	601118	海南橡胶	10,011	97,907.58	0.09
273	601699	潞安环能	10,059	97,270.53	0.09
274	300146	汤臣倍健	2,476	97,257.28	0.09
275	601958	金钼股份	8,214	96,760.92	0.09
276	002051	中工国际	3,242	96,546.76	0.09
277	002344	海宁皮城	4,761	93,458.43	0.09

278	600783	鲁信创投	2,483	93,062.84	0.09
279	300251	光线传媒	3,720	92,628.00	0.09
280	600549	厦门钨业	3,649	92,173.74	0.08
281	300133	华策影视	3,311	89,397.00	0.08
282	002001	新和成	4,918	84,048.62	0.08
283	600648	外高桥	2,374	83,279.92	0.08
284	002570	贝因美	4,284	83,152.44	0.08
285	600395	盘江股份	5,142	80,780.82	0.07
286	002294	信立泰	2,661	76,104.60	0.07
287	603288	海天味业	2,318	74,036.92	0.07
288	000937	冀中能源	9,059	72,653.18	0.07
289	002399	海普瑞	1,989	67,606.11	0.06
290	600998	九州通	2,829	63,256.44	0.06
291	600809	山西汾酒	2,197	62,043.28	0.06
292	002416	爱施德	2,985	61,699.95	0.06
293	600485	信威集团	1,244	54,599.16	0.05
294	601158	重庆水务	4,889	52,507.86	0.05
295	002653	海思科	1,802	48,654.00	0.04
296	600188	兖州煤业	3,256	44,770.00	0.04
297	000156	华数传媒	1,088	38,928.64	0.04
298	600649	城投控股	4,136	38,671.60	0.04
299	601231	环旭电子	1,842	31,332.42	0.03
300	601969	海南矿业	1,700	30,991.00	0.03
301	603993	洛阳钼业	2,490	30,776.40	0.03

### 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

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	601211	国泰君安	1,000	34,340.00	0.03
2	603979	金诚信	1,000	24,750.00	0.02
3	002769	普路通	500	22,565.00	0.02
4	300487	蓝晓科技	500	7,415.00	0.01

## 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	601318	中国平安	16,125,134.92	24.76
2	600016	民生银行	11,267,706.39	17.30
3	600030	中信证券	10,608,363.00	16.29
4	600036	招商银行	10,220,776.82	15.70
5	600837	海通证券	7,615,492.00	11.69
6	601166	兴业银行	7,603,747.00	11.68
7	600000	浦发银行	6,688,377.00	10.27
8	000002	万科 A	5,236,531.14	8.04
9	601766	中国南车	4,606,114.26	7.07
10	601328	交通银行	4,595,903.64	7.06
11	000651	格力电器	4,149,780.50	6.37
12	601668	中国建筑	4,058,465.12	6.23
13	601601	中国太保	3,978,495.00	6.11
14	601288	农业银行	3,884,371.00	5.97
15	601398	工商银行	3,865,649.00	5.94
16	600887	伊利股份	3,614,611.28	5.55
17	601818	光大银行	3,542,534.00	5.44
18	600519	贵州茅台	3,512,962.32	5.39
19	000001	平安银行	3,481,600.20	5.35
20	600104	上汽集团	3,253,614.08	5.00
21	000776	广发证券	3,184,616.30	4.89
22	601169	北京银行	3,160,383.00	4.85
23	601988	中国银行	3,087,310.00	4.74
24	601688	华泰证券	3,003,955.00	4.61
25	000166	申万宏源	2,989,359.00	4.59
26	601989	中国重工	2,930,606.35	4.50
27	600048	保利地产	2,783,286.00	4.27
28	601006	大秦铁路	2,727,256.00	4.19
29	000333	美的集团	2,702,525.00	4.15
30	600999	招商证券	2,626,531.19	4.03
31	601088	中国神华	2,614,201.88	4.01



32	601390	中国中铁	2,555,787.00	3.92
33	601939	建设银行	2,423,610.00	3.72
34	600015	华夏银行	2,347,050.00	3.60
35	601628	中国人寿	2,239,903.00	3.44
36	601901	方正证券	2,180,363.69	3.35
37	601377	兴业证券	2,169,398.93	3.33
38	600900	长江电力	2,160,522.00	3.32
39	601857	中国石油	2,127,611.00	3.27
40	000783	长江证券	2,078,957.00	3.19
41	600028	中国石化	2,006,321.00	3.08
42	600383	金地集团	1,925,562.00	2.96
43	002024	苏宁云商	1,916,263.08	2.94
44	601186	中国铁建	1,846,079.00	2.83
45	600050	中国联通	1,839,789.00	2.83
46	600585	海螺水泥	1,805,863.36	2.77
47	601299	中国北车	1,782,286.00	2.74
48	000858	五粮液	1,780,312.00	2.73
49	600637	百视通	1,700,718.22	2.61
50	600795	国电电力	1,671,785.00	2.57
51	600010	包钢股份	1,662,526.00	2.55
52	600109	国金证券	1,660,574.00	2.55
53	000625	长安汽车	1,656,749.89	2.54
54	000063	中兴通讯	1,615,371.00	2.48
55	600111	北方稀土	1,604,219.00	2.46
56	601336	新华保险	1,591,040.00	2.44
57	600886	国投电力	1,502,377.00	2.31
58	600011	华能国际	1,439,045.86	2.21
59	000100	TCL 集团	1,432,772.00	2.20
60	600705	中航资本	1,411,033.00	2.17
61	000725	京东方 A	1,407,035.00	2.16
62	600089	特变电工	1,394,750.00	2.14
63	600570	恒生电子	1,394,373.00	2.14
64	002415	海康威视	1,382,359.80	2.12
65	600276	恒瑞医药	1,374,417.79	2.11
66	000538	云南白药	1,367,372.00	2.10
67	601899	紫金矿业	1,361,507.30	2.09

68	600690	青岛海尔	1,319,975.00	2.03
69	600019	宝钢股份	1,315,192.00	2.02

注：“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	601318	中国平安	15,271,196.38	23.45
2	600016	民生银行	10,468,805.66	16.08
3	600036	招商银行	9,818,767.11	15.08
4	600030	中信证券	9,281,068.30	14.25
5	601166	兴业银行	7,290,517.32	11.20
6	600837	海通证券	7,287,816.53	11.19
7	600000	浦发银行	6,570,858.11	10.09
8	000002	万 科 A	5,020,763.42	7.71
9	000651	格力电器	4,250,037.03	6.53
10	601668	中国建筑	4,229,243.82	6.49
11	601328	交通银行	4,171,873.83	6.41
12	601601	中国太保	4,004,397.26	6.15
13	601766	中国南车	3,948,959.83	6.06
14	600887	伊利股份	3,689,867.24	5.67
15	000001	平安银行	3,656,865.74	5.62
16	601288	农业银行	3,624,516.15	5.57
17	600519	贵州茅台	3,616,632.54	5.55
18	601818	光大银行	3,526,121.39	5.41
19	601398	工商银行	3,404,585.56	5.23
20	601390	中国中铁	3,189,990.38	4.90
21	600104	上汽集团	3,082,962.69	4.73
22	601989	中国重工	2,922,447.23	4.49
23	000776	广发证券	2,875,723.27	4.42
24	601169	北京银行	2,864,862.83	4.40
25	600048	保利地产	2,786,256.59	4.28
26	601688	华泰证券	2,727,139.55	4.19
27	000333	美的集团	2,633,942.17	4.04
28	601006	大秦铁路	2,633,409.40	4.04
29	600999	招商证券	2,586,407.12	3.97
30	601988	中国银行	2,556,049.03	3.93

31	601088	中国神华	2,529,425.10	3.88
32	600015	华夏银行	2,354,236.76	3.62
33	601939	建设银行	2,298,545.11	3.53
34	002024	苏宁云商	2,270,239.23	3.49
35	601628	中国人寿	2,236,897.37	3.44
36	600383	金地集团	2,211,555.95	3.40
37	601901	方正证券	2,173,821.71	3.34
38	000166	申万宏源	2,080,783.27	3.20
39	601377	兴业证券	2,042,768.28	3.14
40	600050	中国联通	1,994,652.25	3.06
41	601857	中国石油	1,989,357.74	3.05
42	000783	长江证券	1,964,188.55	3.02
43	601186	中国铁建	1,961,924.13	3.01
44	600900	长江电力	1,784,604.30	2.74
45	600010	宝钢股份	1,772,216.79	2.72
46	000858	五粮液	1,764,705.70	2.71
47	000625	长安汽车	1,763,077.93	2.71
48	600570	恒生电子	1,754,325.27	2.69
49	000063	中兴通讯	1,730,097.42	2.66
50	600795	国电电力	1,718,635.80	2.64
51	601336	新华保险	1,705,606.18	2.62
52	600109	国金证券	1,691,364.04	2.60
53	601299	中国北车	1,679,273.48	2.58
54	600585	海螺水泥	1,667,243.80	2.56
55	600028	中国石化	1,606,550.73	2.47
56	600518	康美药业	1,577,688.79	2.42
57	000100	TCL 集团	1,552,149.60	2.38
58	600111	北方稀土	1,543,182.17	2.37
59	000725	京东方 A	1,479,698.04	2.27
60	600011	华能国际	1,476,806.09	2.27
61	000768	中航飞机	1,465,181.02	2.25
62	002415	海康威视	1,461,500.85	2.24
63	600705	中航资本	1,408,538.93	2.16
64	600637	百视通	1,399,045.90	2.15
65	600089	特变电工	1,395,304.31	2.14
66	600276	恒瑞医药	1,368,719.51	2.10
67	601899	紫金矿业	1,366,927.51	2.10
68	600690	青岛海尔	1,365,688.18	2.10

69	000538	云南白药	1,362,640.24	2.09
70	600019	宝钢股份	1,362,238.03	2.09
71	600739	辽宁成大	1,354,157.26	2.08

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 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	371,472,088.36
卖出股票收入（成交）总额	367,570,173.00

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 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	272,012.90	0.25
8	其他	-	-
9	合计	272,012.90	0.25

### 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	113008	电气转债	1,350	244,404.00	0.22
2	110031	航信转债	190	27,608.90	0.03

### 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
IF1507	IF1507	8	10,504,320.00	-1,683,141.82	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)					-1,683,141.82
股指期货投资本期收益(元)					5,240,841.82
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-1,683,141.82

### 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

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 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（600827.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；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。

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	1,286,106.78
2	应收证券清算款	5,145,561.82
3	应收股利	-
4	应收利息	2,540.89
5	应收申购款	74,444.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,508,653.50

### 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**

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

**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**

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	300487	蓝晓科技	7,415.00	0.01	新股锁定

**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	342	112,007.11	11,565,204.00	30.19%	26,741,227.00	69.81%
国金 300B	818	46,829.38	20,105,423.00	52.49%	18,201,008.00	47.51%
国金 300	1,035	12,712.95	570,227.00	4.33%	12,587,679.11	95.67%
合计	2,195	40,897.84	32,240,854.00	35.91%	57,529,914.11	64.09%

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。

**8.2 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	孙思浩	8,518,338.00	22.24%
2	李鹏楚	3,500,000.00	9.14%
3	巩环	3,000,000.00	7.83%

4	平安大华基金-平安银行-平安大华固定收益增强三号特定客户资产管理计划	2,307,593.00	6.02%
5	尹爱勤	2,280,000.00	5.95%
6	北京千石创富-光大银行-千石资本-道冲套利 2 号资产管理计划	2,251,389.00	5.88%
7	银河资本-光大银行-银河资本青昀套利 2 号资产管理计划	2,000,000.00	5.22%
8	银河资本-光大银行-银河资本-青昀 1 号资产管理计划	1,000,000.00	2.61%
9	中国太平洋财产保险-传统-普通保险产品-013C-CT001 深	1,000,000.00	2.61%
10	上海国际信托有限公司-多元凯利证券投资集合资金信托	1,000,000.00	2.61%

## 国金 300B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	北京千石创富-光大银行-千石资本-道冲套利 5 号资产管理计划	10,428,173.00	27.22%
2	长江证券-招商银行-长江证券超越理财基金管家 II 集合资产管理计划	5,090,959.00	13.29%
3	银河资本-光大银行-银河资本青昀套利 2 号资产管理计划	2,000,000.00	5.22%
4	临沭县茂华林业有限公司	1,551,300.00	4.05%
5	银河资本-光大银行-银河资本-青昀 1 号资产管理计划	1,000,000.00	2.61%
6	林德达	980,000.00	2.56%
7	于航	911,537.00	2.38%
8	周德理	585,300.00	1.53%
9	杜志刚	500,000.00	1.31%
10	阮国华	428,000.00	1.12%

## 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	134,622.29	1.0231%
	合计	134,622.29	1.0231%

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	16,387,905.00	16,387,905.00	10,037,479.13
本报告期基金总申购份额	-	-	429,815,546.83
减：本报告期基金总赎回份额	-	-	382,858,067.85
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	21,918,526.00	21,918,526.00	-43,837,052.00
本报告期末基金份额总额	38,306,431.00	38,306,431.00	13,157,906.11

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，基金管理人的子公司北京千石创富资本管理有限公司旗下的资管计划千石资本一道冲套利 5 号资产管理计划、千石资本一道冲套利 2 号资产管理计划及千石资本一东海恒信 4 期资产管理计划持有本基金的份额分别为 11,255,217.00 份、2,251,389.00 份及 1.00 份，前述持有人均按照本基金《基金合同》及《招募说明书》规定的申购规则及申购费率办理申购业务。

### § 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

经国金通用基金管理有限公司第一届董事会审议并通过，并向中国证券投资基金业协会完成备案，基金管理人于 2015 年 4 月 16 日增聘吴富佳先生担任公司副总经理。

除了上述情况以外，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	277,248,025.27	37.67%	196,957.19	36.04%	-
国金证券	1	138,435,737.19	18.81%	98,344.31	18.00%	-
中信证券	1	117,884,634.20	16.02%	107,322.76	19.64%	-
中信证券山东	1	106,764,974.75	14.50%	75,845.81	13.88%	-
华创证券	1	49,159,533.01	6.68%	34,923.16	6.39%	-
东方证券	1	46,589,621.34	6.33%	33,097.48	6.06%	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
银河证券	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。

### 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	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券山东	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

### 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旗下基金的基金资产净值、基金份额净值及基金份额累计净值的公告	指定信息披露媒体及基金管理人网站	2015 年 1 月 5 日

2	国金通用沪深 300 指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务的公告	指定信息披露媒体及基金管理人网站	2015 年 1 月 5 日
3	国金通用沪深 300 指数分级证券投资基金 2015 约定年收益率公告	指定信息披露媒体及基金管理人网站	2015 年 1 月 5 日
4	国金通用沪深 300 指数分级证券投资基金办理不定期份额折算期间国金 300A	指定信息披露媒体及基金管理人网站	2015 年 1 月 6 日
5	国金通用沪深 300 指数分级证券投资基金不定期份额折算后次日收盘价调整的公告	指定信息披露媒体及基金管理人网站	2015 年 1 月 7 日
6	国金通用沪深 300 指数分级证券投资基金不定期份额折算结果及恢复交易的公告	指定信息披露媒体及基金管理人网站	2015 年 1 月 7 日
7	国金通用沪深 300 指数分级证券投资基金 2014 年第 4 季度报告	指定信息披露媒体及基金管理人网站	2015 年 1 月 22 日
8	国金通用沪深 300 指数分级证券投资基金招募说明书（更新）	基金管理人网站	2015 年 3 月 12 日
9	国金通用沪深 300 指数分级证券投资基金招募说明书（更新）摘要	指定信息披露媒体及基金管理人网站	2015 年 3 月 12 日
10	国金通用基金管理有限公司关于旗下部分基金参加齐鲁证券有限公司申购费率优惠活动的公告	指定信息披露媒体及基金管理人网站	2015 年 3 月 20 日
11	国金通用基金管理有限公司关于在齐鲁证券有限公司开通定期定额投资业务的公告	指定信息披露媒体及基金管理人网站	2015 年 3 月 23 日
12	国金通用沪深 300 指数分级证券投资基金份额计算位数变更及修改基金合同	指定信息披露媒体及基金管理人网站	2015 年 3 月 25 日
13	国金通用基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	指定信息披露媒体及基金管理人网站	2015 年 3 月 28 日
14	国金通用沪深 300 指数分级证券投资基金 2014 年年度报告	基金管理人网站	2015 年 3 月 30 日
15	国金通用沪深 300 指数分级证券投资基金 2014 年年度报告摘要	指定信息披露媒体及基金管理人网站	2015 年 3 月 30 日
16	国金通用基金管理有限公司关于增加上海利得基金销售有限公司为旗下基金销售机构并参加相关费率优惠活动的公告	指定信息披露媒体及基金管理人网站	2015 年 3 月 30 日
17	国金通用基金管理有限公司高级管理人员变更公告	指定信息披露媒体及基金管理人网站	2015 年 4 月 18 日
18	国金通用沪深 300 指数分级证券投资基金 2015 年第 1 季度报告	指定信息披露媒体及基金管理人网站	2015 年 4 月 20 日

19	国金通用基金管理有限公司关于旗下基金持有的“歌尔声学”股票估值调整的公告	指定信息披露媒体及基金管理人网站	2015 年 4 月 23 日
20	国金通用基金管理有限公司关于旗下基金持有的“芭田股份”股票估值调整的公告	指定信息披露媒体及基金管理人网站	2015 年 5 月 12 日
21	国金通用基金管理有限公司关于旗下基金持有的“中国南车”股票估值调整的公告	指定信息披露媒体及基金管理人网站	2015 年 5 月 22 日
22	国金通用基金管理有限公司关于旗下基金持有的“芭田股份”股票估值调整的公告	指定信息披露媒体及基金管理人网站	2015 年 5 月 28 日
23	国金通用基金管理有限公司关于旗下基金持有的“三安光电”股票估值调整的公告	指定信息披露媒体及基金管理人网站	2015 年 5 月 29 日
24	国金通用沪深 300 指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的第一次提示公告	指定信息披露媒体及基金管理人网站	2015 年 6 月 5 日
25	国金通用沪深 300 指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的第二次提示公告	指定信息披露媒体及基金管理人网站	2015 年 6 月 6 日
26	国金通用沪深 300 指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的第三次提示公告	指定信息披露媒体及基金管理人网站	2015 年 6 月 9 日
27	国金通用沪深 300 指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的第四次提示公告	指定信息披露媒体及基金管理人网站	2015 年 6 月 10 日
28	国金通用沪深 300 指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的第五次提示公告	指定信息披露媒体及基金管理人网站	2015 年 6 月 11 日
29	国金通用沪深 300 指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的第六次提示公告	指定信息披露媒体及基金管理人网站	2015 年 6 月 12 日
30	国金通用沪深 300 指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的第七次提示公告	指定信息披露媒体及基金管理人网站	2015 年 6 月 13 日
31	国金通用基金管理有限公司关于旗下基金持有的“中国重工”股票估值调整的公告	指定信息披露媒体及基金管理人网站	2015 年 6 月 19 日

注：经国金通用基金管理有限公司（以下简称“公司”）股东会审议通过，根据 2015 年 6 月 8 日中国证券监督管理委员会印发的《关于核准国金通用基金管理有限公司变更股权的批复》（证监许可〔2015〕1153 号），公司原股东之一中国通用技术（集团）控股有限责任公司将所持有的国金通用基金管理有限公司 12% 的股权转让给涌金投资控股有限公司。变更后的股权结构为：国金证

券股份有限公司持股比例 49%、苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司持股比例 19.5%、广东宝丽华新能源股份有限公司持股比例 19.5%、涌金投资控股有限公司持股比例 12%。同时公司名称变更为“国金基金管理有限公司”。

上述公司股权和公司名称变更事项，已按有关规定在北京市工商行政管理局办理完毕相关变更登记手续，并于 2015 年 7 月 23 日领取了变更后的营业执照。

具体请参见公司于 2015 年 7 月 24 日发布在中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站的相关公告。

## § 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、国金通用沪深 300 指数分级证券投资基金基金合同；
- 3、国金通用沪深 300 指数分级证券投资基金托管协议；
- 4、国金通用沪深 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](http://www.gfund.com)

国金基金管理有限公司  
2015 年 8 月 28 日