宝盈中证100指数增强型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30日

基金管理人:宝盈基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年十月二十三日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	宝盈中证100指数增强
基金主代码	213010
交易代码	213010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年2月8日
报告期末基金份额总额	76,512,631.69份
投资目标	在基金合同规定的范围内,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,结合增强收益的主动投资,力争取得基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%、年跟踪误差不超过7.75%,基金总体投资业绩超越中证100指数的表现。
投资策略	本基金为增强型指数基金,对指数投资部分采用完全复制法,按照成份股在中证100指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。本基金对主动投资部分实行双向积极配置策略。采用利率预期、收益率曲线变动分析、信用度分析、收益率利差分析、相对价值评估等债券投资策略。采用市场公认的定价技术,适当参与金融衍生产品的投资。
业绩比较基准	中证100指数×95%+活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金投资于中证100指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产的80%,预期风险收益高于混合型基金、债券基金和货币市场基金,属于较高风险收益预期的证券投资基金产品。
基金管理人	宝盈基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	-224,287.78
2.本期利润	4,300,432.30
3.加权平均基金份额本期利润	0.0560
4.期末基金资产净值	55,176,682.98
5.期末基金份额净值	0.721

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。
2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
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 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

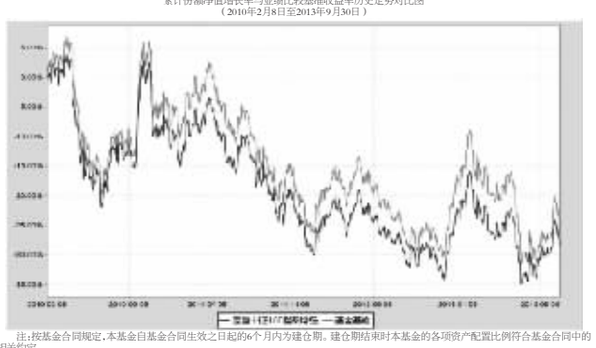
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	8.42%	1.40%	7.14%	1.44%	1.28%	-0.04%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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

宝盈中证100指数增强型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2010年2月8日至2013年9月30日)



注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起的6个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同中的相关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
温胜普	本基金基金经理	2010-2-8	-	7年	温胜普先生,经济学硕士。2006年7月加入宝盈基金管理有限公司,历任金融工程部风险管理岗,现任宝盈中证100指数增强型证券投资基金基金经理。中国国籍,证券投资基金从业人员资格。
张小仁	本基金基金经理	2013-8-23	-	6年	张小仁先生,中山大学经济学硕士。2007年7月加入宝盈基金管理有限公司,历任研究部核心研究员、宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金基金经理助理。中国国籍,证券投资基金从业人员资格。
余述胜	本基金基金经理兼宝盈策略增长股票型证券投资基金基金经理	2011-8-17	2013-8-1	15年	余述胜先生,金融学博士。1998年3月至2007年10月就职于南方基金管理有限公司,历任研究员、投资部副总监、交通运输行业首席分析师。2007年11月加入宝盈基金管理有限公司,历任投资部副总监、研究部总监。中国国籍,证券投资基金从业人员资格。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同等有关基金法律文件的规定,以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下,为基金持有人谋求最大利益。在本报告期内,基金运作合法合规,无损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《宝盈基金管理有限公司公平交易制度》对本基金的日常交易行为进行监控,并定期制作公平交易分析报告,对不同投资组合的收益率、同向交易价差、反向交易价差作专项分析。报告结果表明,本基金在本报告期内的同向交易价差均在可合理解释范围之内;在本报告期内基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定,在投资活动中公平对待不同投资组合,公平交易制度执行情况良好,无损害基金持有人利益的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

今年7、8月份经济数据有所回升,出口、工业增加值和发电量反弹明显,从已披露的9月份PMI数据看,基本企稳,但亦有高频数据显示经济波动周期回暖化。短期数据转弱的支撑因素主要包括:过去6-12个月房地产市场和基础设施投资反弹的滞后性影响开始在7月份显现,部分产品价格在去库存进行一段时间后下跌趋缓,离流感等短期因素的消除带来社会零售总额增速再度回升。流动性方面,6月份银行间流动性冲击事件后,货币政策钝向稳健审慎,边际改善明显,但总体的流动性环境并未发生重大改变。整个三季度上证指数表现良好,呈普涨态势;传统大盘股有一定修复性的反弹,包括航运、银行等;热门板块如传媒、计算机等继续表现优异;而沉寂已久的商业股则表现极为强眼。风格上,创业板、中小板指数优于代表大盘监筹的上证50、中证100,市场的结构性特征明显。报告期,本基金的股票仓位基本维持在高位水平,结构上在复制中证100指数权重的基础上,配置机械设备、非银行金融等行业进行增强型投资。整个三季度看,上证指数收益率为9.88%,中证100指数收益率为7.48%,本基金三季度的净值增长好于中证100指数。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本基金在本报告期内净值增长率是8.42%,同期业绩比较基准收益率是7.14%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

过去4个季度的起起落落显示出中国经济在改革与增长之间的艰难平衡,中长期的转型压力与短期内增速过快下行的担忧交叉作用,使政策钟摆难以单方向稳定。今年三季度经济数据再度反弹很大程度上仍然依靠政府重提“稳增长”背景下的投资回升与企业预期改变,但随着房地产和基础设施再度膨胀,原有增长模式进一步固化。历史一再证明宽松货币政策推动的基础设施、房地产扩张只能带来短期的经济反弹,而不太可能引领经济进入一轮全新的可持续上升周期。伴随全球流动性环境改变和国内货币政策趋向稳健审慎,中国社会融资规模和M2增速开始放缓,四季度以后房地产和基础设施投资可能再度回落,经济下行压力或再次上升。

展望2013年四季度,我们认为应该密切关注十八届三中全会召开前后带来的相关主题性机会,并从大会中发现资本市场未来五年乃至十年的投资方向。

综合以上因素,我们认为四季度市场将呈现波动震荡走势,三季报业绩增速较高、估值合理的板块存在结构性机会,而受益于三中全会主题的板块仍将是市场的热点所在。

我们将严格按照基金合同的规定,被动投资为主,适当辅之以增强型投资,继续努力尽责地做好本基金的管理工作,尽力为投资者谋取较好的回报。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	52,070,092.48	93.63
	其中:股票	52,070,092.48	93.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	3,347,210.98	6.02
7	其他各项资产	193,020.74	0.35
8	合计	55,610,324.20	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	998,400.00	1.81
C	制造业	4,541,800.00	8.23
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	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	5,540,200.00	10.04

5.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,201,307.00	5.80
C	制造业	11,799,318.20	21.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,267,230.00	2.30
E	建筑业	1,678,934.00	3.04
F	批发和零售业	768,430.00	1.39
G	交通运输、仓储和邮政业	1,007,976.00	1.83
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	671,980.00	1.22
J	金融业	23,447,853.28	42.50
K	房地产业	1,999,940.00	3.62
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	284,780.00	0.52
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	402,144.00	0.73
	合计	46,529,892.48	84.33

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1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前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600837	海通证券	239,300	2,993,643.00	5.43
2	600016	民生银行	303,000	2,896,680.00	5.25
3	600036	招商银行	233,557	2,550,442.44	4.62
4	601318	中国平安	48,000	1,713,600.00	3.11
5	601166	兴业银行	153,400	1,713,478.00	3.11
6	600000	浦发银行	151,000	1,523,590.00	2.76
7	601398	工商银行	314,650	1,214,549.00	2.20
8	000002	万 科A	130,000	1,186,900.00	2.15
9	600030	中信证券	93,000	1,142,970.00	2.07
10	601288	农业银行	372,000	930,000.00	1.69

5.3.2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前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002698	博实股份	100,000	2,332,000.00	4.23
2	300159	新研股份	60,000	1,012,800.00	1.84
3	002554	惠博普	80,000	998,400.00	1.81
4	002549	凯美特气	50,000	703,500.00	1.27
5	600765	中航重机	35,000	493,500.00	0.89

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 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投资股指期货。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露等,本基金暂不参与股指期货交易。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本基金投资国债期货的投资政策

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等,本基金暂不参与国债期货交易。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.9.3 本基金投资国债期货的投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚,但中国平安控股子公司平安证券有限责任公司受到中国证监会行政处罚。

中国平安2013年5月21日公告,其控股子公司平安证券有限责任公司因万福生科发行上市项目受到中国证监会行政处罚,没收项目收入2555万元,罚款5110万元,暂停其保荐机构资格3个月。

5.10.2 本基金所投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	9,794.97
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	7,208.66
4	应收利息	901.72
5	应收申购款	175,115.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	193,020.74

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5.1期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况的说明

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的情况。

5.10.5.2 期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	78,974,510.63
本报告期基金总申购份额	8,019,111.16
减:本报告期基金总赎回份额	10,480,990.10
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	76,512,631.69

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本公司管理的基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

中国证监会批准宝盈中证100指数增强型证券投资基金设立的文件。

《宝盈中证100指数增强型证券投资基金基金合同》。

《宝盈中证100指数增强型证券投资基金基金托管协议》。

宝盈基金管理有限公司批准成立批件、营业执照和公司章程。

本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告。

8.2 存放地点

基金管理人办公地址:深圳市深南路6008号特区报业大厦1501

基金托管人办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

8.3 查阅方式

上述备查文件文本存放在基金管理人和基金托管人的办公场所,在办公时间内基金持有人可免费查阅。

宝盈基金管理有限公司

二〇一三年十月二十三日

国金通用沪深300指数分级证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9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
报告送出日期:2013年10月23日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月26日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国金沪深300指数分级 (场内简称:国金300)		
交易代码	167601		
前端交易代码	-		
后端交易代码	-		
基金运作方式	上市契约型开放式		
基金合同生效日	2013年7月26日		
报告期末基金份额总额	246,471,007.42份		
投资目标	本基金采用指数化投资策略,紧密跟踪沪深300指数,在严格控制基金的日均跟踪误差偏离度和年跟踪误差的前提下,力争获取与标的指数相似的投资收益。		
投资策略	本基金采用指数完全复制方法,按照标的指数成份股及权重构建基金的投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整,以达到跟踪和复制指数的目的,力争保持日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。如遇特殊情况(如市场流动性不足、个别成份股被限制投资、法律法规禁止或限制投资等)致使基金无法购得足够数量的股票时,基金管理人将对投资组合管理进行适当变通和调整,并运用股指期货等金融衍生工具,以实现对跟踪误差的有效控制。		
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:95%×沪深300指数收益率+5%×同期银行活期存款利率(税后)。		
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于较高风险、较高预期收益的基金品种,其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看,国金沪深300A份额具有低风险、收益相对稳定的特征;国金沪深300B份额具有高风险、高预期收益的特征。		
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		
下属三级基金简称	国金沪深300指数分级A	国金沪深300指数分级B	国金沪深300指数分级
下属三级基金交易代码	150140	150141	167601
下属三级基金报告期末基金份额总额	21,030,357.00份	21,030,357.00份	204,410,293.42份
下属三级基金的风险收益特征	国金沪深300指数分级A份额具有低风险、收益相对稳定的特征。	国金沪深300指数分级B份额具有高风险、高预期收益的特征。	本基金为股票型基金,属于较高风险、较高预期收益的基金品种,其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

注:无

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月26日 - 2013年9月30日)
1.本期已实现收益	5,678,364.19
2.本期利润	27,939,349.10
3.加权平均基金份额本期利润	0.0955
4.期末基金资产净值	269,437,734.87
5.期末基金份额净值	1.093

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
3、本基金合同自2013年7月26日起生效,至2013年9月30日未满三个月。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	9.30%	1.09%	7.35%	1.13%	1.95%	-0.04%

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+同期银行活期存款利率(税后)×5%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1、图示日期为2013年7月26日至2013年9月30日。
2、本基金基金合同生效日为2013年7月26日,基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间未满一年。
3、按基金合同或招募说明书的约定,本基金自合同生效日起6个月内为建仓期,截止报告期末本基金仍处于建仓期。

3.3 其他指标

注:无

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
宫雪	基金经理	2013年7月26日	-	5	宫雪女士,博士,毕业于中国科学院数学与系统科学研究院,管理科学与工程专业。2008年7月至2011年11月在博时基金管理有限公司股票投资部工作,任产业分析师。2012年2月加盟国金通用基金管理有限公司,任战略发展部产品经理兼投资研究部行业分析师。2012年7月起任产品与金融工程部量化分析师。

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《国金通用基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定,通过制度、流程和系统等方式在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相关分配机制。

在本报告期,本基金管理人管理有两只基金产品,一只为混合型基金,另一只为指数基金,不存在非公平交易情况。

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金成立以来至9月30日的运作期以采用完全复制法,对沪深300指数成份股进行复制,基金持仓仅包括沪深300指数成份股及现金,其中股票持仓不低于90%,现金类资产不低于5%。

报告期,沪深300指数表现出较大的波动性,波动范围在(-2.1%,3.5%),波动率达到了1.23%。这提高了基金调整的频率,并且增加了跟踪误差难度。指数管理过程中,为控制跟踪偏离度,本基金对停牌股票均以沪深300指数成份股的可交易股票进行替代,股票复牌后迅速按照沪深300指数成份股权重进行调整;对股票增发、分红等也以沪深300指数成份股的权重为调整基准进行处理。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期,相对沪深300指数收益,基金净值收益的日均跟踪偏离度为0.05%,基金净值的年化跟踪误差为0.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

3季度经济表现出明显的企稳迹象,出口、投资、消费等主要经济数据均出现回升。加之“改革创新”的驱动,中国经济结构转型将会逐步展现实质性突破,这一过程中会逐渐呈现出明显的行业变迁,而且这一过程会推动经济的逐步转入良性循环,这将推动证券市场的又一春天。此外,随着金融工具的逐渐丰富,投资者的投资行为将日渐成熟和稳定,这也有利于证券市场的平稳发展。

短期经济继续回升是大概率事件,可能会面临通胀风险,证券市场会表现出先行迹象。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	255,943,870.65	94.56
	其中:股票	255,943,870.65	94.56
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	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	14,448,023.44	5.34
6	其他资产	276,894.46	0.10
7	合计	270,668,788.55	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,922,386.50	0.71
B	采矿业	18,059,441.35	6.70
C	制造业	91,705,790.63	34.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,664,059.67	2.84
E	建筑业	9,107,603.98	3.38
F	批发和零售业	8,645,863.51	3.21
G	交通运输、仓储和邮政业	5,828,552.63	2.16
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,523,296.59	2.42
J	金融业	86,196,341.42	31.99
K	房地产业	12,737,581.90	4.73
L	租赁和商务服务业	1,949,618.62	0.72
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,901,928.88	0.71
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,006,683.81	0.37
S	综合	2,694,721.16	1.00
	合计	255,943,870.65	94.99

注:以上行业分类以2013年9月30日的中国证监会行业分类标准为依据。

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有积极投资部分股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600016	民生银行	1,134,242	10,843,353.52	4.02
2	600036	招商银行	828,748	9,049,928.16	3.36
3	601166	兴业银行	574,010	6,411,691.70	2.38
4	601318	中国平安	168,275	6,007,417.50	2.23
5	600000	浦发银行	562,034	5,670,923.06	2.10
6	600837	海通证券	406,388	5,083,913.88	1.89
7	000002	万 科A	486,106	4,438,147.78	1.65
8	600030	中信证券	345,868	4,250,717.72	1.58
9	601328	交通银行	788,213	3,389,315.90	1.26
10	000651	格力电器	120,819	3,208,952.64	1.19

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券投资。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券投资。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末投资股指期货。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

注:本基金本报告期末投资股指期货。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

注:本基金本报告期末投资国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末投资国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

注:本基金未参与国债期货投资。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

本期基金投资组合前十名证券的发行主体中,海通证券(600837.SH)于2013年4月23日公告《海通证券股份有限公司关于收到上海证监局行政监管措施决定书的公告》,上海证监局针对海通证券(600837.SH)发行的“一海通财”系列产品未按照《证券公司业务(产品)创新工作指引(试行)》的规定,向中国证监会机构监管部银行创新产品方案报送义务的行为提出责令改正。

由于海通证券(600837.SH)是沪深300指数的成份股,故将其纳入本基金的投资组合。

报告期内基金投资的前十名证券除海通证券(600837.SH)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。

5.10.2

本期基金投资组合前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	145,667.98
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	27,695.47
4	应收利息	3,010.31
5	应收申购款	62,759.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	37,761.10
8	其他	-
9	合计	276,894.46

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.10.5.1 报告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。

5.10.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注:无

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	国金沪深300指数分级A	国金沪深300指数分级B	国金沪深300指数分级
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
报告期期初基金份额总额	-	-	-
报告期期间基金总申购份额	-	-	2,030,572.93
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-	78,687,320.68
报告期期间基金拆分变动份额	-12,017,824.00	-12,017,824.00	24,035,648.00
报告期期末基金份额总额	21,030,357.00	21,030,357.00	204,410,293.42

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.本基金合同生效日为2013年7月26日。

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

注:基金管理人未运用固有资金投资本公司管理基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内,公司根据《证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及管理人网站进行了如下信息披露:

1.2013年7月27日披露了《国金通用沪深300指数分级证券投资基金基金合同生效公告》;
2.2013年7月27日披露了《关于修改国金通用沪深300指数分级证券投资基金基金合同的公告》;
3.2013年7月27日披露了《关于修改国金通用沪深300指数分级证券投资基金托管协议的公告》;
4.2013年7月27日披露了《国金通用沪深300指数分级证券投资基金基金合同(修订版)》;
5.2013年7月27日披露了《国金通用沪深300指数分级证券投资基金托管协议(修订版)》;
6.2013年7月27日披露了《国金通用沪深300指数分级证券投资基金上市前周净值公告》;
7.2013年8月3日披露了《国金通用沪深300指数分级证券投资基金上市前周净值公告》;
8.2013年8月10日披露了《国金通用沪深300指数分级证券投资基金上市前周净值公告》;
9.2013年8月15日披露了《国金通用基金管理有限公司关于增加宏源证券投资有限公司为旗下基金销售机构的公告》;
10.2013年8月17日披露了《国金通用沪深300指