

## 国金通用沪深300指数分级证券投资基金

### 2014 第一季度报告

2014年3月31日

基金管理人:国金通用基金管理有限公司  
基金管理人:中国东方资产管理股份有限公司  
报告送出日期:2014年4月19日

**1.1 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。  
基金管理人中国东方资产管理股份有限公司根据本基金合同约定,于2014年4月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。  
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,基金资产净值不必然增长。  
基金的投资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。  
本报告期内基金无分红事项。  
本报告期自2014年1月1日起至3月31日止。

**1.2 基金产品概况**

基金名称	国金通用沪深300指数分级证券投资基金
交易代码	167601
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	61,366,156.17份
投资目标	本基金采用指数化投资方法,紧密跟踪沪深300指数,在严格控制基金跟踪误差的前提下,力争实现长期投资增值。
投资策略	本基金采用指数化投资方法,跟踪标的指数成份股及权重构建基金的投资组合,并跟踪标的指数成份股及其权重的变化进行动态调整,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%,跟踪误差控制在0.4%以内。同时,本基金还将根据标的指数的流动性,适当调整投资组合,力争实现基金跟踪标的指数的目标。本基金管理人将投资管理流程与日常估值流程,并运用股指期货等金融衍生工具,力求对跟踪误差的有效控制。
风险收益特征	本基金的风险收益特征为:95%*沪深300指数收益率+5%*银行定期存款利率(税后)。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为:95%*沪深300指数收益率+5%*银行定期存款利率(税后)。
基金管理人	国金通用基金管理有限公司
基金托管人	中国东方资产管理股份有限公司
下属二级基金名称	国金通用沪深300指数分级证券投资基金
下属二级基金代码	150410
下属二级基金报告期末基金份额总额	5,024,731,000份
下属二级基金的风险收益特征	国金通用沪深300指数分级证券投资基金,其风险和预期收益高于普通公募基金,收益相对稳定的特征,国金通用沪深300指数有高风险、高预期收益的特征。

**3.1 主要财务指标**

项目	报告期(2014年1月1日—2014年3月31日)
1.本期已实现收益	-494,181.22
2.本期利润	-10,253,144.47
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1254
4.期末基金份额净值	58,922,616.83

注:1.本期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.本基金收益指标中不涉及有人认购交易的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。  
3.加权平均基金份额本期利润=期末基金份额净值-基金成立时的基金份额净值。  
注: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对比



注:本基金基金合同生效日为2013年7月26日,本报告自基金合同生效以来开始计算。

**3.2 基金管理人**

姓名	职务	任职日期	离任日期	说明
曹首	基金经理	2013年7月26日	5	曹首先生,中国东方资产管理股份有限公司资产管理部总经理,2008年12月加入国金通用基金管理有限公司,2012年7月加入国金通用基金管理有限公司,曾任国金通用基金管理有限公司资产管理部副经理,产品及衍生品部副经理,自2013年7月起担任国金通用沪深300指数分级证券投资基金基金经理职务。

**4.2 基金管理人**  
基金管理人:国金通用基金管理有限公司  
基金管理人:中国东方资产管理股份有限公司  
报告送出日期:2014年4月19日

**5.2 报告期末按行业分类的资产配置**

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	医药、生物制品	361,996.75	0.61
B	制造业	3,303,988.15	5.61
C	建筑业	20,093,047.11	34.10
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	1,824,314.26	3.10
E	建筑业	1,858,478.78	3.15
F	批发和零售业	1,665,955.15	2.83
G	交通运输、仓储和邮政业	1,492,478.48	2.53
H	金融业	1,688,743.59	2.83
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,528,842.27	32.46
J	金融业	2,958,599.69	4.73
K	房地产业	375,484.89	0.64
L	批发和零售业	530,173.00	0.90
N	水利、环境和公共设施管理业	530,173.00	0.90
O	建筑业	530,173.00	0.90
P	教育	530,173.00	0.90
Q	金融业	530,173.00	0.90
R	文化、体育和娱乐业	530,173.00	0.90
S	合计	55,930,519.34	94.02

注:以上行业分类依据2014年4月31日的中国证监会行业分类标准为准。

**5.3 报告期末按行业分类的资产配置**

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	股票投资	4,019,976.75	8.99
2	其中:沪市	4,019,976.75	8.99
3	其中:债券	-	-
4	其中:资产支持证券	-	-
5	其中:贵金属	-	-
6	其中:其他	-	-
7	其中:权证	-	-
8	其中:股指期货	-	-
9	其中:国债期货	-	-
10	其中:其他金融衍生品	-	-
11	其他	6,200,121.10	13.86
12	银行存款和结算备付金合计	34,269,935.55	76.62
13	其中:活期存款	21,748.17	0.05
14	合计	44,724,833.40	100.00

注:本基金基金合同生效日为2013年7月26日,本报告自基金合同生效以来开始计算。

**5.4 基金管理人**

姓名	职务	任职日期	离任日期	说明
曹首	基金经理	2013年7月26日	5	曹首先生,中国东方资产管理股份有限公司资产管理部总经理,2008年12月加入国金通用基金管理有限公司,2012年7月加入国金通用基金管理有限公司,曾任国金通用基金管理有限公司资产管理部副经理,产品及衍生品部副经理,自2013年7月起担任国金通用沪深300指数分级证券投资基金基金经理职务。

**5.5 投资组合报告**

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	股票投资	4,019,976.75	8.99
2	其中:沪市	4,019,976.75	8.99
3	其中:债券	-	-
4	其中:资产支持证券	-	-
5	其中:贵金属	-	-
6	其中:其他	-	-
7	其中:权证	-	-
8	其中:股指期货	-	-
9	其中:国债期货	-	-
10	其中:其他金融衍生品	-	-
11	其他	6,200,121.10	13.86
12	银行存款和结算备付金合计	34,269,935.55	76.62
13	其中:活期存款	21,748.17	0.05
14	合计	44,724,833.40	100.00

注:本基金基金合同生效日为2013年7月26日,本报告自基金合同生效以来开始计算。

**5.6 开放式基金申购赎回**

项目	金额(元)
报告期基金份额总额	72,844,349.98
报告期基金份额申购总额	2,402,956.03
报告期基金份额赎回总额	23,701,694.71
报告期基金份额净申购(赎回)额	51,545,611.30

注:本报告期基金份额净申购(赎回)额指报告期内申购赎回资金净额(即申购资金总额减去赎回资金总额)。

**5.7 基金管理人**

姓名	职务	任职日期	离任日期	说明
曹首	基金经理	2013年7月26日	5	曹首先生,中国东方资产管理股份有限公司资产管理部总经理,2008年12月加入国金通用基金管理有限公司,2012年7月加入国金通用基金管理有限公司,曾任国金通用基金管理有限公司资产管理部副经理,产品及衍生品部副经理,自2013年7月起担任国金通用沪深300指数分级证券投资基金基金经理职务。

**5.8 投资组合报告**

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	股票投资	27,678,786.63	47.82
2	其中:沪市	27,678,786.63	47.82
3	其中:债券	2,635,815.77	4.07
4	其中:资产支持证券	-	-
5	其中:贵金属	-	-
6	其中:其他	-	-
7	其中:权证	-	-
8	其中:股指期货	-	-
9	其中:国债期货	-	-
10	其中:其他金融衍生品	-	-
11	其他	4,019,976.75	7.03
12	银行存款和结算备付金合计	742,520.00	1.28
13	其中:活期存款	579,964.28	1.02
14	合计	37,878,262.85	100.00

注:本报告期基金份额净申购(赎回)额指报告期内申购赎回资金净额(即申购资金总额减去赎回资金总额)。

**5.9 基金管理人**

姓名	职务	任职日期	离任日期	说明
曹首	基金经理	2013年7月26日	5	曹首先生,中国东方资产管理股份有限公司资产管理部总经理,2008年12月加入国金通用基金管理有限公司,2012年7月加入国金通用基金管理有限公司,曾任国金通用基金管理有限公司资产管理部副经理,产品及衍生品部副经理,自2013年7月起担任国金通用沪深300指数分级证券投资基金基金经理职务。

**5.10 投资组合报告**

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	股票投资	4,019,976.75	8.99
2	其中:沪市	4,019,976.75	8.99
3	其中:债券	-	-
4	其中:资产支持证券	-	-
5	其中:贵金属	-	-
6	其中:其他	-	-
7	其中:权证	-	-
8	其中:股指期货	-	-
9	其中:国债期货	-	-
10	其中:其他金融衍生品	-	-
11	其他	6,200,121.10	13.86
12	银行存款和结算备付金合计	34,269,935.55	76.62
13	其中:活期存款	21,748.17	0.05
14	合计	44,724,833.40	100.00

注:本基金基金合同生效日为2013年7月26日,本报告自基金合同生效以来开始计算。

**5.11 基金管理人**

姓名	职务	任职日期	离任日期	说明
曹首	基金经理	2013年7月26日	5	曹首先生,中国东方资产管理股份有限公司资产管理部总经理,2008年12月加入国金通用基金管理有限公司,2012年7月加入国金通用基金管理有限公司,曾任国金通用基金管理有限公司资产管理部副经理,产品及衍生品部副经理,自2013年7月起担任国金通用沪深300指数分级证券投资基金基金经理职务。

**5.12 投资组合报告**

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	股票投资	4,019,976.75	8.99
2	其中:沪市	4,019,976.75	8.99
3	其中:债券	-	-
4	其中:资产支持证券	-	-
5	其中:贵金属	-	-
6	其中:其他	-	-
7	其中:权证	-	-
8	其中:股指期货	-	-
9	其中:国债期货	-	-
10	其中:其他金融衍生品	-	-
11	其他	6,200,121.10	13.86
12	银行存款和结算备付金合计	34,269,935.55	76.62
13	其中:活期存款	21,748.17	0.05
14	合计	44,724,833.40	100.00

注:本基金基金合同生效日为2013年7月26日,本报告自基金合同生效以来开始计算。

**5.13 基金管理人**

姓名	职务	任职日期	离任日期	说明
曹首	基金经理	2013年7月26日	5	曹首先生,中国东方资产管理股份有限公司资产管理部总经理,2008年12月加入国金通用基金管理有限公司,2012年7月加入国金通用基金管理有限公司,曾任国金通用基金管理有限公司资产管理部副经理,产品及衍生品部副经理,自2013年7月起担任国金通用沪深300指数分级证券投资基金基金经理职务。

**5.14 投资组合报告**

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	股票投资	4,019,976.75	8.99
2	其中:沪市	4,019,976.75	8.99
3	其中:债券	-	-
4	其中:资产支持证券	-	-
5	其中:贵金属	-	-
6	其中:其他	-	-
7	其中:权证	-	-
8	其中:股指期货	-	-
9	其中:国债期货	-	-
10	其中:其他金融衍生品	-	-
11	其他	6,200,121.10	13.86
12	银行存款和结算备付金合计	34,269,935.55	76.62
13	其中:活期存款	21,748.17	0.05
14	合计	44,724,833.40	100.00

注:本基金基金合同生效日为2013年7月26日,本报告自基金合同生效以来开始计算。

**5.15 基金管理人**

姓名	职务	任职日期	离任日期	说明
曹首	基金经理	2013年7月26日	5	曹首先生,中国东方资产管理股份有限公司资产管理部总经理,2008年12月加入国金通用基金管理有限公司,2012年7月加入国金通用基金管理有限公司,曾任国金通用基金管理有限公司资产管理部副经理,产品及衍生品部副经理,自2013年7月起担任国金通用沪深300指数分级证券投资基金基金经理职务。

**5.16 开放式基金申购赎回**

项目	金额(元)
报告期基金份额总额	72,844,349.98
报告期基金份额申购总额	2,402,956.03
报告期基金份额赎回总额	23,701,694.71
报告期基金份额净申购(赎回)额	51,545,611.30

注:本报告期基金份额净申购(赎回)额指报告期内申购赎回资金净额(即申购资金总额减去赎回资金总额)。

**5.17 基金管理人**

姓名	职务	任职日期	离任日期	说明
曹首	基金经理	2013年7月26日	5	曹首先生,中国东方资产管理股份有限公司资产管理部总经理,2008年12月加入国金通用基金管理有限公司,2012年7月加入国金通用基金管理有限公司,曾任国金通用基金管理有限公司资产管理部副经理,产品及衍生品部副经理,自2013年7月起担任国金通用沪深300指数分级证券投资基金基金经理职务。

**5.18 投资组合报告**

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	股票投资	27,678,786.63	47.82
2	其中:沪市	27,678,786.63	47.82
3	其中:债券	2,635,815.77	4.07
4	其中:资产支持证券	-	-
5	其中:贵金属	-	-
6	其中:其他	-	-
7	其中:权证	-	-
8	其中:股指期货	-	-
9	其中:国债期货	-	-
10	其中:其他金融衍生品	-	-
11	其他	4,019,976.75	7.03
12	银行存款和结算备付金合计	742,520.00	1.28
13	其中:活期存款	579,964.28	1.02
14	合计	37,878,262.85	100.00

注:本报告期基金份额净申购(赎回)额指报告期内申购赎回资金净额(即申购资金总额减去赎回资金总额)。

**5.19 基金管理人**

姓名	职务	任职日期	离任日期	说明
曹首	基金经理	2013年7月26日	5	曹首先生,中国东方资产管理股份有限公司资产管理部总经理,2008年12月加入国金通用基金管理有限公司,2012年7月加入国金通用基金管理有限公司,曾任国金通用基金管理有限公司资产管理部副经理,产品及衍生品部副经理,自2013年7月起担任国金通用沪深300指数分级证券投资基金基金经理职务。

**5.20 投资组合报告**

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	股票投资	4,019,976.75	8.99
2	其中:沪市	4,019,976.75	8.99
3	其中:债券	-	-
4	其中:资产支持证券	-	-
5	其中:贵金属	-	-
6	其中:其他	-	-
7	其中:权证	-	-
8	其中:股指期货	-	-
9	其中:国债期货	-	-
10	其中:其他金融衍生品	-	-
11	其他	6,200,121.10	13.86
12	银行存款和结算备付金合计	34,269,935.55	76.62
13	其中:活期存款	21,748.17	0.05
14	合计	44,724,833.40	100.00

注:本基金基金合同生效日为2013年7月26日,本报告自基金合同生效以来开始计算。

**5.21 基金管理人**

姓名	职务	任职日期	离任日期	说明
曹首	基金经理	2013年7月26日	5	曹首先生,中国东方资产管理股份有限公司资产管理部总经理,2008年12月加入国金通用基金管理有限公司,2012年7月加入国金通用基金管理有限公司,曾任国金通用基金管理有限公司资产管理部副经理,产品及衍生品部副经理,自2013年7月起担任国金通用沪深300指数分级证券投资基金基金经理职务。

**5.22 投资组合报告**

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	股票投资	4,019,976.75	8.99
2	其中:沪市	4,019,976.75	8.99
3	其中:债券	-	-
4	其中:资产支持证券	-	-
5	其中:贵金属	-	-
6	其中:其他	-	-
7	其中:权证	-	-