国金通用沪深 300 指数分级证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014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
报告送出日期:2014 年 7 月 19 日

§1 重要提示

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

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2014 年 7 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国金 300		
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	30,211,892.19 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 300A	国金 300B	国金 300
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	4,950,861.00 份	4,950,861.00 份	20,310,170.19 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。

§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(2014 年 4 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)
1.本期已实现收益	-501,962.17
2.本期利润	633,635.94
3.加权平均基金份额本期利润	0.0195
4.期末基金资产净值	29,381,170.67
5.期末基金份额净值	0.973

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

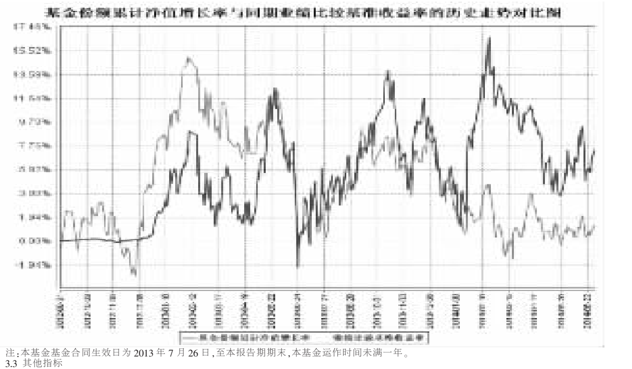
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.35%	0.82%	2.74%	0.85%	-1.39%	-0.03%

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:本基金基金合同生效日为 2013 年 7 月 26 日,至本报告期期末,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,中国科学院数学与系统科学研究院管理科学与工程专业博士,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,历任战略发展部产品经理兼投资研究部行业分析师、产品与金融工程部量化分析师等职,自 2013 年 7 月起任产品与金融工程部副总经理,2014 年 6 月起兼任指数投资部副总经理。

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。

在本报告期,本基金管理人管理有 5 只基金产品,分别为 1 只混合型基金、1 只指数基金、2 只货币基金和 1 只债券型基金,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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014 年 2 季度,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,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%,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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2 季度,按净值计算,基金的日均跟踪偏离度 0.05%,年化跟踪误差为 1.16%,远低于合同约定的日均跟踪偏离度为 0.35%,年化跟踪误差为 4% 的水平。

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,经济基本面不佳,市场情绪也十分低迷。市场出现结构性机会,但整体波动率再次触碰历史低点,短期这一现况较难发生逆转。但现在是黎明前的黑暗,下半年资金的冲击可能带动股票市场逆袭。

§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	28,215,863.91	93.98
	其中:股票	28,215,863.91	93.98
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	1,721,887.83	5.73
7	其他资产	86,811.62	0.29
8	合计	30,024,563.36	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	88,778.78	0.30
B	采矿业	1,572,663.86	5.35
C	制造业	10,165,694.20	34.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	973,718.72	3.31
E	建筑业	886,828.84	3.02
F	批发和零售业	758,772.80	2.58
G	交通运输、仓储和邮政业	693,342.91	2.36
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,100,323.22	3.74
J	金融业	9,680,789.73	32.95
K	房地产业	1,285,408.48	4.37
L	租赁和商务服务业	261,776.44	0.89
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	260,655.74	0.89
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	241,621.68	0.82
S	综合	245,488.51	0.84
	合计	28,215,863.91	96.03

注:以上行业分类以 2014 年 6 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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	601318	中国平安	26,835	1,055,688.90	3.59
2	600036	招商银行	92,522	947,425.28	3.22
3	600016	民生银行	151,990	943,857.90	3.21
4	601166	兴业银行	64,089	642,812.67	2.19
5	600000	浦发银行	62,743	567,824.15	1.93
6	600030	中信证券	44,064	504,973.44	1.72
7	000002	万 科A	54,280	448,895.60	1.53
8	600837	海通证券	45,369	415,126.35	1.41
9	000651	格力电器	13,495	397,427.75	1.35
10	601288	农业银行	145,596	366,901.92	1.25

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

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

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序的前五名债券投资明细

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序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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

报告期,本基金未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

报告期,本基金未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未参与国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本期基金投资组合前十名证券的发行主体中,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、处罚的情况。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	56,104.26
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	360.86
5	应收申购款	99.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	30,247.10
8	其他	-
9	合计	86,811.62

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 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

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。

5.11.5.2 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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

－§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	国金 300A	国金 300B	国金 300
报告期期初基金份额总额	5,024,731.00	5,024,731.00	51,316,894.17
报告期期间基金总申购份额	-	-	367,228.88
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-	31,521,692.86
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-73,870.00	-73,870.00	147,740.00
报告期期末基金份额总额	4,950,861.00	4,950,861.00	20,310,170.19

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、本季度末,基金管理人的子公司北京千石创富资本管理有限公司所管理的"千石创富光大银行鑫瑞 12 号资产管理计划"(以下简称"鑫瑞 12 号")持有本基金的份额为 1,028.00 份,鑫瑞 12 号按照本基金《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,并已按照法规规定向中国证监会进行了报告。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内,基金管理人根据《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》及基金管理人网站进行了如下信息披露:

1、2014 年 4 月 19 日披露了《国金通用沪深 300 指数分级证券投资基金 2014 年第 1 季度报告》;

2、2014 年 5 月 27 日披露了《国金通用基金管理有限公司关于增加北京钱景财富投资管理有限公司为基金销售机构并参加相关费率优惠活动的公告》;

3、2014 年 6 月 27 日披露了《国金通用基金管理有限公司关于增加中信建投期货有限公司为基金销售机构并参加相关费率优惠活动的公告》;

4、本报告期内,基金管理人按照《证券投资基金信息披露管理办法》的规定每个开放日公布基金份额净值和基金份额累计净值。

§9 备查文件目录

9.1 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。

9.2 存放地点

北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 层。

9.3 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
2014 年 7 月 19 日

国金通用鑫利分级债券型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2014 年 7 月 19 日

§1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于 2014 年 7 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国金通用鑫利分级债	
交易代码	000453	
基金运作方式	契约型	
基金合同生效日	2014年 1 月 21 日	
报告期末基金份额总额	433,085,966.73 份	
投资目标	本基金主要投资于债券等证券品种,在合理控制信用风险的基础上,通过积极主动的管理,力求基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金不做积极主动的大类资产配置,在充分分析债券市场环境及市场流动性的基础上,确定组合的久期及利率期限结构,进行组合资产的类属配置和个券选择,并根据相关影响因素的变化情况,对投资组合进行动态调整。	
业绩比较基准	中国债券总指数	
风险收益特征	从基金资产整体运作来看,本基金为债券型基金,属于低风险基金产品,其预期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。	
基金管理人	国金通用基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	国金通用鑫利分级 A	国金通用鑫利分级 B
下属两级基金的交易代码	000454	000455
报告期末下属两级基金的份额总额	303,154,186.56 份	129,931,780.17 份
下属两级基金的风险收益特征	鑫利分级 A 为低预期风险、收益相对稳定的基金份额。	鑫利分级 B 为中高预期风险、收益相对较高的基金份额。

§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(2014 年 4 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)
1.本期已实现收益	5,959,096.54
2.本期利润	13,049,043.96
3.加权平均基金份额本期利润	0.0301
4.期末基金资产净值	447,538,666.87
5.期末基金份额净值	1.033

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

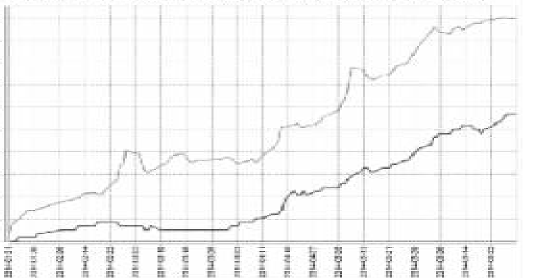
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.99%	0.08%	3.51%	0.11%	-0.52%	-0.03%

注:本基金的业绩比较基准为:中国债券总指数

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



注:本基金基金合同生效日为 2014 年 1 月 21 日,至本报告期期末,本基金运作时间未满一年。

3.3 其他指标

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		
徐艳芳	基金经理	2014年 1 月 21 日	-	5	徐艳芳女士,中国青年政治学院学士、清华大学硕士,历任香港皓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;截止至本报告公告之日,徐艳芳女士同时兼任国金通用鑫盈货币基金、国金通用国鑫发起式基金、国金通用金腾通货币基金的基金经理。

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》、《国金通用鑫利分级债券型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《国金通用基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定,通过制度、流程和系统等方式在各业务环节严格控制交易公平执行。

在投资决策内部控制方面,本基金管理人建立了统一的投资研究管理平台和全公司适用的投资对象备选库和交易对象备选库,确保各投资报告期内,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。

在本报告期,本基金管理人管理有 5 只基金产品,分别为 1 只混合型基金、1 只指数基金、2 只货币基金和 1 只债券型基金,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

上半年国内经济增长速度仍处于中长期下台阶过程中,通胀水平较低,多方位的微刺激政策开始发力,货币政策逐步放宽,公开市场净投放,央行定向降准,PSL 等新工具开始出炉。债券市场收益率整体呈下行态势,虽然债市刚性兑付被打破,但信用风险仍处于缓慢释放的过程中,市场的风险偏好有所回升,中低评级债券信用利差在 3 月触顶后有较大幅度下行。

基金成立于 1 月 21 日,已度过建仓期进入正常操作阶段,组合投资券种的期限和结构与资金期限基本匹配,重点配置中短期债券,已配置为主,锁定期间收益,精选个券,重点关注信用相关风险,规避高风险行业和发行主体的相关债券。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金份额净值增长率为 2.99%,业绩比较基准收益率为 3.51%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度经济增速低位企稳,工业增加值触底反弹;固定资产投资增速下行,基建投资支撑加大,地产投资增速快速下滑;政府反腐倡廉影响逐步消退,消费增长企稳,社消同比增速反弹;外贸刺激政策、人民币贬值、美国经济回暖等影响,出口增速回升;经济增长潜在性指标反弹,二季度经济增长平稳;但三季度由于去年基数较高,而地产投资下滑风险大,在政策微刺激下,预计经济增速三季度下行风险仍较大。

在央行定向定点宽松政策下,二季度资金面保持宽松态势,在定向放宽政策不变的环境下,三季度的流动性压力下降。虽然外汇占款走低,人民币偏弱,信用风险仍存,新股发行和地产再融资,以及优先股试点,信托大量到期、信用债到期续滚,资金需求大增,但宽松货币政策以及对非标的监控可对冲,三季度流动性保持平稳。

由于内需不旺,通胀仍将维持低位,CPI 稳中有升、PPI 基数效应下弱反弹;货币政策延续偏宽松态势;财政政策继续保持积极,改革相关措施会进一步出炉。

在基本面和资金面支撑下,三季度债券市场预计延续慢牛走势,无风险利率和信用利差仍有下行空间。

§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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	863,330,818.53	94.60
	其中:债券	863,330,818.53	94.60
	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	31,704,913.79	3.47
7	其他资产	17,562,348.68	1.92
8	合计	912,598,081.00	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	21,848,552.60	4.88
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,035,000.00	2.24
	其中:政策性金融债	10,035,000.00	2.24
4	企业债券	404,435,465.93	90.37
5	企业短期融资券	368,623,400.00	82.37
6	中期票据	50,268,000.00	11.23
7	可转债	8,120,400.00	1.81
8	其他	-	-
9	合计	863,330,818.53	192.91

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	041459014	14广汇能源 CP001	400,000	40,464,000.00	9.04
2	041460015	14永泰能源 CP001	360,000	36,302,400.00	8.11
3	122921	10郴州债	350,000	36,295,000.00	8.11
4	122033	09富力债	360,000	36,201,600.00	8.09
5	041453015	14宏图 CP001	300,000	30,213,000.00	6.75

5.6 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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未参与国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本期基金投资组合前十名证券的发行主体中,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、处罚的情况。

5.11.2

本基金本报告期末未投资股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	64,508.78
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	17,497,839.90
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,562,348.68

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	4,318,800.00	0.97
2	110020	南山转债	3,801,600.00	0.85

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	国金通用鑫利分级 A	国金通用鑫利分级 B
报告期期初基金份额总额	303,154,186.56	129,931,780.17
报告期期间基金总申购份额	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	303,154,186.56	129,931,780.17

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内,基金管理人根据《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》及基金管理人网站进行了如下信息披露:

1、2014 年 4 月 5 日、4 月 12 日、4 月 19 日、4 月 26 日、5 月 5 日、5 月 10 日、5 月 17 日、5 月 24 日、5 月 31 日、6 月 7 日、6 月 14 日、6 月 21 日、6 月 28 日披露了《国金通用鑫利分级债券型证券投资基金封闭期周净值公告》;

2、2014 年 4 月 19 日披露了《国金通用鑫利分级债券型证券投资基金 2014 年第 1 季度报告》;

3、2014 年 4 月 25 日披露了《国金通用基金管理有限公司关于增加北京恒天明泽基金销售有限公司和北京钱景财富投资管理有限公司为基金销售机构并参加相关费率优惠活动的公告》;

4、2014 年 5 月 7 日披露了《国金通用基金管理有限公司关于增加中期时代基金销售(北京)有限公司和中国国际期货有限公司为基金销售机构并参加相关费率优惠活动的公告》;

5、2014 年 6 月 27 日披露了《国金通用基金管理有限公司关于增加中信建投期货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》。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;
2、国金通用鑫利分级债券型证券投资基金基金合同;
3、国金通用鑫利分级债券型证券投资基金托管协议;
4、国金通用鑫利分级债券型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。

9.2 存放地点

北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 层。

9.3 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
2014 年 7 月 19 日

国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014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
报告送出日期:2014 年 7 月 19 日

§1 重要提示

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

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2014 年 7 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国金通用国鑫发起
交易代码	762001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年 8 月 28 日
报告期末基金份额总额	55,389,427.11 份
投资目标	本基金通过合理的资产配置和积极的证券选择,追求在严格控制风险的前提下实现资本的长期稳健回报。
投资策略	本基金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,本基金会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	本基金的业绩比较基准为:60%×沪深 300 指数收益率+40%×上证国债指数收益率。
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金,属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。
基金管理人	国金通用基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司

注:本基金为发起式基金。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014 年 4 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)
1.本期已实现收益	-1,281,924.61
2.本期利润	-560,936.00
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0108
4.期末基金资产净值	54,147,160.21
5.期末基金份额净值	0.9776

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

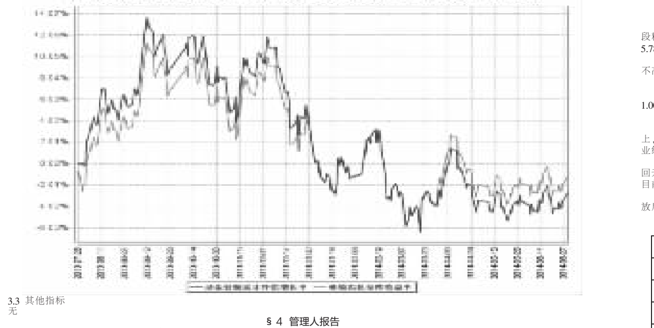
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.29%	0.82%	1.00%	0.52%	-2.29%	0.30%

注:本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%

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



3.3 其他指标

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		
徐艳芳	基金经理	2013年 2 月 27 日	-	5	徐艳芳女士, 中国青年政治学院学士、清华大学硕士,历任香港皓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;截止至本报告公告之日,徐艳芳女士同时兼任国金通用鑫盈货币基金、国金通用鑫利分级债基金、国金通用金腾通货币基金的基金经理。
齐达铮	基金经理	2013年 8 月 10 日	-	7	齐达铮先生, 北京师范大学文学学士、经济学学士。历任有色金属技术经济研究院分析员、国金证券股份有限公司交易员、云南国际信托有限公司资产管理总部交易员、分析员等职,2012 年 3 月加入国金通用基金管理有限公司, 担任行业分析员、基金经理助理等职,2013 年 8 月 10 日起任本基金基金经理。
滕祖光	基金经理	2014年 4 月 11 日	-	8年	滕祖光先生, 东北财经大学管理学学士。历任中国工商银行深圳分行国际业务职员、中大期货经纪有限公司北京营业部期货交易员、和讯信息科技有限公司高级编辑、国投信托有限公司证券交易员等职;2009 年 11 月加入国金通用基金管理有限公司(筹备组),任高级交易员;2014 年 4 月 11 日起担任本基金基金经理, 滕祖光先生同时兼任国金通用鑫盈货币基金的基金经理。

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《国金通用基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定,通过制度、流程和系统等方式在各业务环节严格控制交易公平执行。

在投资决策内部控制方面,本基金管理人建立了统一的投资研究管理平台和全公司适用的投资对象备选库和交易对象备选库,确保各投资组合在获取研究信息、投资建议及实施投资决策方面享有平等的机会。健全投资授权制度,明确各投资决策主体的职责和权限划分,投资组合经理在授权范围内自主决策。建立投资组合投资信息的管理及保密制度,通过岗位设置、制度约束、技术手段相结合的方式,对持仓和交易等重大非公开投资信息采取保密措施。

在交易执行控制方面,本基金管理人实行集中交易制度,基金交易部运用交易系统中设置的公平交易功能并按照时间优先、价格优先的原则严格执行所有指令。对于一级市场申购等场外交易,按照公平交易原则建立和完善了相关分配机制。

在本报告期,本基金管理人管理有 5 只基金产品,分别为 1 只混合型基金、1 只指数基金、2 只货币基金和 1 只债券型基金,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

2014 年 2 季度,定向降准等微刺激政策不断出台,宏观经济数据下行风险得以有效对冲,汇丰、中采 PMI 企稳并出现反弹迹象。央行通过多种手段释放流动性, 资金面实质宽松。A 股市场呈现先抑后扬的走势, 创业板为首的小市值股票经过 4、5 两月回调后持续反弹, 创业板指数单季度涨幅 5.78%,从低点反弹幅度则接近 10%。主板、沪深 300 小幅反弹,单季度涨幅均未超过 1%。

本基金根据二季度投资策略展开操作,基于对市场谨慎判断,利用蓝筹股采取防御策略,有效避免了市场风险,但对 6 月成长股反弹行情参与度不高,导致净值落后。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金单位份额净值 0.9776 元,累计单位净值 1.0776 元。本报告期基金单位份额净值增长率-1.29%,同期业绩比较基准增长率 1.00%。

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 季度微刺激政策出台后进入观察期,短期继续出台刺激性政策的概率降低,7、8 两月宏观经济的运行情况将为 9 月政策取舍提供参考。流动性上,预计央行将延续上半年的偏宽松政策。除宏观数据外,中报业绩将成为 3 季度影响证券市场运行的主要因素之一。从业绩预告看,中小板、创业板业绩增速好于 1 季度 ,但预期差仍维持高位。

从投资时钟角度看,目前处于债券牛市,之后才是权益市场的牛市。从必要条件看,非标资产的有效风险暴露将降低企业融资成本从而促进利润回升。根据上半年信托业协会数据统计,非标资产融资规模在 9 号文、127 号文后,融资规模增速显著下降,但非标利率水平下降有限,导致场外资金目前并未大量进入权益市场。

展望 3 季度,在政策托底背景下,预计市场延续上半年窄幅波动特征,成长股、权重股继续区间波动,前者的波动概率更大,中报业绩证伪风险释放后产生交易性机会。

§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	35,920,485.00	64.36
	其中:股票	35,920,485.00	64.36
2	固定收益投资	13,871,536.30	24.85
	其中:债券	13,871,536.30	24.85
	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	1,425,979.66	2.55
7	其他资产	4,595,721.41	8.23
8	合计	55,813,722.37	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	3,783,163.52	6.99
B	采矿业	-	-
C	制造业	30,398,013.88	56.14
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	6,100.00	0.01
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	1,733,207.60	3.20
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	35,920,485.00	66.34

注:以上行业分类以 2014 年 6 月 30 日的中国证监会行业分类标准为依据。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002584	西陇化工	183,247	2,849,490.85	5.26
2	600081	东风科技	189,545	2,632,780.05	4.86
3	002005	德豪润达	310,400	2,598,048.00	4.80
4	600073	上海梅林	356,600	2,592,482.00	4.79
5	002557	洽洽食品	150,803	2,500,313.74	4.62
6	002330	得利斯	428,800	2,439,872.00	4.51
7	600673	东阳光科	192,528	2,358,468.00	4.36
8	600261	阳光照明	238,200	2,353,416.00	4.35
9	000816	江淮动力	510,067	2,203,489.44	4.07
10	002299	圣农发展	189,500	2,196,305.00	4.06

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	2,985,750.00	5.51
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	804,870.00	1.49
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	10,080,916.30	18.62
8	其他	-	-
9	合计	13,871,536.30	25.62

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019314	13国债 14	25,000	2,500,750.00	4.62
2	110015	石化转债	20,000	2,159,400.00	3.99
3	113002	工行转债	20,000	2,108,000.00	3.89
4	113005	平安转债	15,000	1,602,300.00	2.96
5	128005	齐翔转债	15,000	1,595,550.00	2.95

5.6 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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

报告期,本基金未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

报告期,本基金未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未参与国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本期基金投资组合前十名证券的发行主体中,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、处罚的情况。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	102,378.86
2	应收证券清算款	4,210,245.29
3	应收股利	-
4	应收利息	168,116.94
5	应收申购款	114,980.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,595,721.41

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	2,159,400.00	3.99
2	113002	工行转债	2,108,000.00	3.89
3	113005	平安转债	1,602,300.00	2.96
4	113001	中行转债	1,017,900.00	1.88
5	110020	南山转债	950,400.00	1.76
6	110016	川投转债	645,650.00	1.19
7	128002	东华转债	1,716.30	0.00

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限情况

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	51,545,611.30
报告期期间基金总申购份额	9,187,223.99
减:报告期期间基金总赎回份额	5,343,408.18
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	55,389,427.11

注:1、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;

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(以下简称"千石资本")持有本基金的份额为 5,250,549.60 份,千石资本按照本基金《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,并已按照法规规定向中国证监会进行了报告。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 报告期末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	0.00	0.00	0.00	0.00	-
基金管理人高级管理人员	1,539,117.00	2.78	1,400,342.78	2.53	3年
基金经理等人员	521,805.50	9.42	500,080.64	9.03	3年
基金管理人股东	8,501,132.50	15.35	8,501,132.50	15.35	3年
其他	600,084.67	1.08	600,084.67	1.08	3年
合计	11,162,139.67	20.15	11,001,640.59	19.86	3年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内,基金管理人根据《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》及基金管理人网站进行了如下信息披露:

1、2014 年 4 月 4 日披露了《国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金参加中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告》;

2、2014 年 4 月 11 日披露了《国金通用基金管理有限公司关于增加深圳市新兰德证券投资咨询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》;

3、2014 年 4 月 12 日披露了《国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书(更新)》;

4、2014 年 4 月 12 日披露了《国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书(更新)摘要》;

5、2014 年 4 月 12 日披露了《关于国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金增聘基金经理的公告》;

6、2014 年 4 月 19 日披露了《国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金 2014 年第 1 季度报告》;

7、2014 年 4 月 25 日披露了《国金通用基金管理有限公司关于增加北京恒天明泽基金销售有限公司和北京钱景财富投资管理有限公司为基金销售机构并参加相关费率优惠活动的公告》;

8、2014 年 5 月 7 日披露了《国金通用基金管理有限公司关于增加中期时代基金销售(北京)有限公司和中国国际期货有限公司为基金销售机构并参加相关费率优惠活动的公告》;

9、2014 年 5 月 8 日披露了《国金通用基金管理有限公司关于旗下基金持有的"栗之联"股票估值调整的公告》;

10、2014 年 6 月 27 日披露了《国金通用基金管理有限公司关于增加中信建投期货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》;

11、本报告期内,基金管理人按照《证券投资基金信息披露管理办法》的规定每个开放日公布基金份额净值和基金份额累计净值。

§10 备查文件目录

10.1 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。

10.2 存放地点

北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 层。

10.3 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
2014 年 7 月 19 日