# 长盛转型升级主题灵活配置混合型证券投资基金

## 2015 第四季度 报告

2015年12月31日

**基金管理人:长盛基金管理有限公司**
**基金托管人:中国银行股份有限公司**
**报告送出日期:2016年1月20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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月19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2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 长盛转型升级混合 |
| 基金主代码 | 001197 |
| 交易代码 | 001197 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015年4月21日 |
| 报告期末基金份额总额 | 5,452,479,723.98份 |
| 投资目标 | 本基金的投资目标在于把握中国经济转型升级过程中所蕴含的投资机会,在严格控制投资风险的基础上,力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。 |
| 投资策略 | (1)分析宏观经济指标、微观经济指标、市场指标、政策等因素,动态调整基金资产在各类别资产间的分配比例,控制市场风险,提高配置效率。(2)发挥基金管理人研究团队和投资团队"自下而上"的主动选股能力,选择转型升级主题概念的、具有竞争优势且估值具有吸引力的股票,组建并动态调整转型升级主题优选股票库。 |
| 业绩比较基准 | 50%×沪深300指数收益率+50%×中证综合债指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。 |
| 基金管理人 | 长盛基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 |

§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(2015年10月1日-2015年12月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -158,596,910.79 |
| 2.本期利润 | 584,151,560.09 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1007 |
| 4.期末基金资产净值 | 4,879,737,613.81 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.895 |

注:1、所述基金业绩指标不包括基金份额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。

2、所列数据截止到2015年12月31日。

3、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。

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 | 12.02% | 1.42% | 9.46% | 0.83% | 2.56% | 0.59% |

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:1、长盛转型升级主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效日2015年4月21日,截至本报告期末本基金自合同生效未满一年。

2、按照本基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。建仓期结束时,本基金的各项资产配置比例符合本基金合同有关约定。截至报告日,本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

§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 | | |
| 刘旭明 | 本基金基金经理,长盛生态环境主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛养老健康产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛回益成长回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理。 | 2015年4月21日 | - | 13年 | 男,1977年5月出生,中国国籍。清华大学管理学硕士。曾任中信证券研究部首席分析师、国信证券经济研究所首席分析师。2013年7月加入长盛基金管理有限公司,现任研究部总监,现任长盛生态环境主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛养老健康产业灵活配置混合型证券投资基金(本基金)基金经理,长盛回益成长回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理。 |

注:1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期;

2、"证券从业年限"中"证券从业"的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定,在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节,公平对待旗下所有投资组合,包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等。具体如下:

研究支持,公司旗下所有投资组合共享公司研究部门研究成果,所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权限。

投资授权与决策,公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制,各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内,独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理遵守投资信息隔离墙制度。

交易执行,公司实行集中交易制度,所有投资组合的投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部依照《公司公平交易细则》的规定,场内交易,强制开启恒生交易系统公平交易程序;场外交易,严格遵守相关工作流程,保证交易执行的公平性。

投资管理行为的监控与分析评估,公司风险管理部、监察稽核部,依照《公司公平交易细则》的规定,持续、动态监督公司投资管理全过程,并进行分析评估,及时向公司管理层报告发现问题,保障公司旗下所有投资组合均被公平对待。

公司对过去4个季度的同向交易行为进行数量分析,计算溢价率、贡献率、占优比等指标,使用双边90%置信水平对1日、3日、5日的交易片段进行T检验,未发现违反公平交易及利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易。

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

四季度流动性宽松以及"资产荒"的逻辑再次主导市场,市场预期充裕的流动性暂时没有合适的资产可投,并且经过前期下跌后,股市仍不乏结构性机会,进入四季度市场开始逐步反弹,以新能源汽车、虚拟现实等主题投资机会逐步带动市场上扬,期间券商股飙动也极大鼓舞了市场情绪,当反弹进入前期3500-3600点的成交密集区后,市场开始止步不前,并且美联储加息日期临近,市场开始盘整,12月份在保险资金举牌影响,低估值蓝筹股表现活跃。四季度上证指数上涨15.93%,创业板指数上涨30.32%,市场风格较前期更加均衡,计算机、房地产、电子、家用电器等行业涨幅居前,在线教育、充电桩、虚拟现实等主题依然表现较好。

9月下旬判断市场调整结束后,果断进行加仓成长股。结合规模较大特点,期间波段操作大盘蓝筹股票。在市场进入前期密集成交期的震荡阶段,逐渐获利了结涨幅较大个股,调整仓位至中性仓位,配置也较为均衡。自上而下配置行业主题结合长期成长空间和短期催化剂。自下而上精选个股,减少持仓股票数量,深入挖掘内在价值。同时加强前瞻性布局新的板块,获取更多超额收益。4季度本基金业绩基本和市场同步。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日,长盛转型升级混合份额净值为0.895元,本报告期份额净值增长率为12.02%,同期业绩比较基准增长率为9.46%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警说明。

§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 | 3,426,235,406.38 | 69.57 |
| | 其中:股票 | 3,426,235,406.38 | 69.57 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 1,496,068,170.98 | 30.38 |
| 8 | 其他资产 | 2,764,738.36 | 0.06 |
| 9 | 合计 | 4,925,068,315.72 | 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 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 2,155,384,584.81 | 44.17 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 311,682,749.35 | 6.39 |
| E | 建筑业 | 10,151,232.00 | 0.21 |
| F | 批发和零售业 | 222,304.44 | 0.00 |
| 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 | 241,041,002.86 | 4.94 |
| J | 金融业 | 376,657,764.29 | 7.72 |
| 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 | 286,729,128.63 | 5.88 |
| 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 | 44,366,640.00 | 0.91 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 3,426,235,406.38 | 70.21 |

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 | 002085 | 万丰奥威 | 10,249,932 | 329,842,811.76 | 6.76 |
| 2 | 300070 | 碧水源 | 5,538,519 | 286,729,128.63 | 5.88 |
| 3 | 002236 | 大华股份 | 7,759,154 | 286,312,782.60 | 5.87 |
| 4 | 601126 | 四方股份 | 18,449,334 | 245,007,155.52 | 5.02 |
| 5 | 000049 | 德赛电池 | 4,259,274 | 241,841,577.72 | 4.96 |
| 6 | 600406 | 国电南瑞 | 14,135,186 | 235,774,902.48 | 4.83 |
| 7 | 000400 | 许继电气 | 9,100,145 | 176,815,817.35 | 3.62 |
| 8 | 600617 | 国新能源 | 10,144,682 | 155,517,975.06 | 3.19 |
| 9 | 002309 | 中利科技 | 6,759,312 | 126,939,879.36 | 2.60 |
| 10 | 002304 | 洋河股份 | 1,724,302 | 118,183,659.08 | 2.42 |

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。

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

注: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序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。

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

注: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交易情况

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期,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

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.11.2

基金投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 2,365,998.57 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 283,453.32 |
| 5 | 应收申购款 | 115,286.47 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,764,738.36 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本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

由于四舍五入的原因,分项之和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

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 6,149,543,732.24 |
| 报告期间基金总申购份额 | 15,472,471.68 |
| 减:报告期间基金总赎回份额 | 712,536,479.94 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) | - |
| 报告期末基金份额总额 | 5,452,479,723.98 |

§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

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 11,847,156.40 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 11,847,156.40 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 0.22 |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;

2、《长盛转型升级主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《长盛转型升级主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

4、《长盛转型升级主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;

5、法律意见书;

6、基金管理人业务资格批件、营业执照;

7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

8.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公地址和/或基金托管人的住所。

8.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公地址和/或基金托管人的住所和/或基金管理人互联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。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话:400-888-2666,010-62350088。

网址:http://www.csfunds.com.cn。

**长盛基金管理有限公司**
2016年1月20日

# 国金众赢货币市场证券投资基金

## 2015 第四季度 报告

2015年12月31日

**基金管理人:国金基金管理有限公司**
**基金托管人:招商银行股份有限公司**
**报告送出日期:2016年1月20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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月19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2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 国金众赢货币 |
| 场内简称 | - |
| 交易代码 | 001234 |
| 前端交易代码 | - |
| 后端交易代码 | - |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015年6月25日 |
| 报告期末基金份额总额 | 7,153,087,986.81份 |
| 投资目标 | 在综合考虑基金资产收益性、安全性和流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,力争为投资者创造稳定的收益。 |
| 投资策略 | 本基金在确保资产安全性和流动性的基础上,对短期货币市场利率的走势进行预测和判断,采取积极主动的投资策略,综合利用定性分析和定量分析方法,力争获取超越比较基准的投资回报。 |
| 业绩比较基准 | 人民币活期存款利率(税后) |
| 风险收益特征 | 本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种,其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。 |
| 基金管理人 | 国金基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 |

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(2015年10月1日-2015年12月31日) |
|---|---|
| 1. 本期已实现收益 | 80,369,450.03 |
| 2.本期利润 | 80,369,450.03 |
| 3.期末基金资产净值 | 7,153,087,986.81 |

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和本期利润的金额相等。

2、本基金收益分配为按日结转份额。

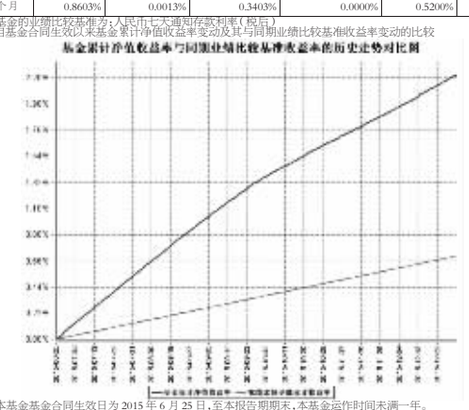
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差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 | 0.8603% | 0.0013% | 0.3403% | 0.0000% | 0.5200% | 0.0013% |

注:本基金的业绩比较基准为:人民币七天通知存款利率(税后)

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




注:1、本基金基金合同生效日为2015年6月25日,至本报告期期末,本基金运作时间未满一年。

§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 | 2015年6月25日 | - | 7 | 徐艳芳女士,清华大学硕士。2005年10月至2012年6月历任盈天财经公关公司财经咨询、英大泰和财产保险股份有限公司投资经理。2012年6月加盟国金基金管理有限公司,任投资研究部固定收益基金经理。2013年2月起增聘为国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理;2013年12月起增聘为国金鑫盈货币市场证券投资基金基金经理;2014年1月起任国金鑫利分级债券型证券投资基金基金经理;2014年2月起任国金金腾通货币市场证券投资基金基金经理;2015年6月起任国金众赢货币市场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遵规守信情况的说明

由于基金管理人对于基金投资于不具备基金托管资格银行的协议存款不得超过基金资产净值的5%的规定在建仓期内是否适用的理解有误,导致本基金在建仓期内存放于深圳前海微众银行股份有限公司的协议存款超过了基金资产净值的5%,公司根据监管部门要求已经于2015年10月9日将上述比例调整在5%以内,公司于2015年12月8日收到了中国证券监督管理委员会北京监管局下发的《关于对国金基金管理有限公司采取责令改正行政监管措施的决定》(行政监管措施决定书[2015]68号)。公司根据监管部门要求及时纠正了理解错误,并调整了协议存款比例达到法规规定,未造成基金资产和投资者利益损失。

除上述以外,本基金本报告期内未发生其他违规行为,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》、《国金众赢货币市场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。

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9只基金产品,分别为4只混合型基金、2只指数基金和3只货币基金,通过交易系统中的公平交易程序,对于不同投资组合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 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

2015年4季度,本基金严格遵守基金合同,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,本基金主要进行回购投资进行现金管理。

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-0.1%,同期业绩比较基准收益率为1.15%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

4季度宏观经济呈现趋稳迹象,但由于外需持续疲软以及政策效应弱化,宏观经济趋稳的基础并不扎实,宏观经济总体状况依旧疲软。经济主要指标仍旧未见明显好转,投资增速仍然趋缓,消费增速平稳,出口仍旧困难。随着未来去产能、去杠杆、去库存的逐步落实,宏观经济整体很难有明显回升。微观层面,资金面持续宽松的预期没有变化,但人民币贬值、注册制推出等因素给证券市场带来很大的不确定性,市场全面上行的动力不足,但周期性行业仍存结构性机会。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,自2015年11月16日起至2015年12月31日止,本基金已连续三十四个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。

§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 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 10,000,125.00 | 38.95 |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 15,667,322.79 | 61.02 |
| 8 | 其他资产 | 7,465.33 | 0.03 |
| 9 | 合计 | 25,674,913.12 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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序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序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。

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

注: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

注:本基金本报告期末股指期货投资。

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

注: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

本基金本参与国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内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,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.11.2

基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 3,167.03 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 4,298.30 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 7,465.33 |

5.11.4 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在流通受限情况的说明

注:本基金本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 | 15,092,413,070.81 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 22,061,996,004.48 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 30,001,321,088.48 |
| 报告期期末基金份额总额 | 7,153,087,986.81 |

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,基金管理人持有本基金的份额为68,000,000.00份,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22,000,000.00份,基金管理人和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交易明细

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期 | 交易份额(份) | 交易金额(元) | 适用费率 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 申购 | 2015年12月30日 | 68,000,000.00 | 68,000,000.00 | - |
| 合计 | | | 68,000,000.00 | 68,000,000.00 | |

§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、2015年10月20日披露了《关于开通国金基金直销中心柜台作为国金众赢货币市场基金直销通道的公告》;

2、2015年10月27日披露了《国金众赢货币市场证券投资基金2015年第3季度报告》;

3、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每万份收益和7日年化收益率。

§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、国金众赢货币市场证券投资基金基金合同;

3、国金众赢货币市场证券投资基金托管协议;

4、国金众赢货币市场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

**国金基金管理有限公司**
2016年1月20日

# 国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

## 2015 第四季度 报告

2015年12月31日

**基金管理人:国金基金管理有限公司**
**基金托管人:平安银行股份有限公司**
**报告送出日期:2016年1月20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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月19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2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 国金鑫新灵活配置(LOF) |
| 场内简称 | - |
| 交易代码 | 501000 |
| 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 | 2015年7月3日 |
| 报告期末基金份额总额 | 25,319,826.19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 | 一年期银行定期存款利率(税后)+3% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金,其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。 |
| 基金管理人 | 国金基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 平安银行股份有限公司 |

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(2015年10月1日-2015年12月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -37,116.00 |
| 2.本期利润 | -37,116.00 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0011 |
| 4.期末基金资产净值 | 25,360,160.01 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.002 |

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。

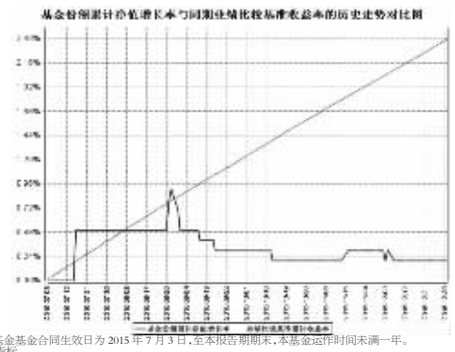
3.2 基金净值表现

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 | -0.10% | 0.03% | 1.15% | 0.01% | -1.25% | 0.02% |

注:本基金的业绩比较基准为:一年期银行定期存款利率(税后)+3%

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:1、本基金基金合同生效日为2015年7月3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 | 2015年7月3日 | - | 7 | 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、指数投资部副总经理,自2014年11月起任指数投资事业部总经理。2013年7月起任国金沪深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月起任国金鑫运灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2015年7月起任国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金(LOF)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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信