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:2016年3月28日

国金沪深300指数分级证券投资基金

2015年度报告摘要

§1 重要提示

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2016年3月25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已经审计,安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2015年1月1日起至2015年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	34,187,556.82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
下属分级基金的场内简称	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	6,942,590.00份	6,942,590.00份	20,302,376.82份

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受益。
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和建基金的投资组合,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	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。
下属分级基金的风险收益特征	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。 从本基金所分离的两类基金份额来看,国金沪深300B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。

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	徐扬瑜	张建春
	联系电话	010-88005601	010-63639180
	电子邮箱	xuyuyiyu@gfund.com	zhangjianchun@cebbank.com
客户服务电话		4000-2000-18	95595
传真		010-88005666	010-63639132

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.gfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2015年	2014年	2013年7月26日(基金合同生效日)-2013年12月31日
本期已实现收益	35,621,165.37	3,287,906.90	14,937,106.39
本期利润	22,753,145.27	6,249,956.76	22,797,308.21
加权平均基金份额本期利润	0.2034	0.1538	0.1004
本期基金份额净值增长率	4.07%	44.17%	5.50%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	0.3091	0.1932	0.0550
期末基金资产净值	34,029,107.82	65,118,706.61	171,399,573.63
期末基金份额净值	0.9954	1.5210	1.0550

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(已实现部分扣抵未实现部分)。

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。

4.自2015年3月27日起,本公司对旗下证券投资基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)的估值方法进行调整,采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

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

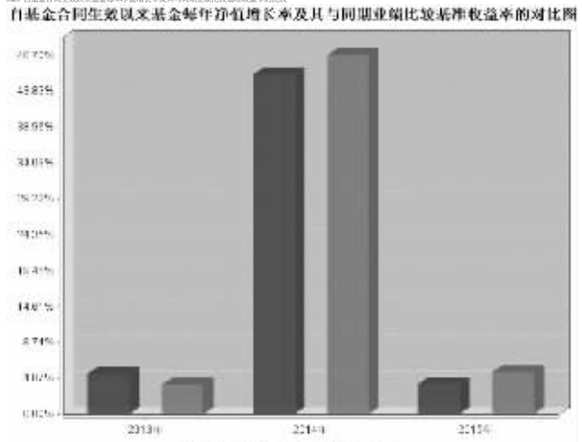
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	18.61%	1.70%	15.65%	1.59%	2.96%	0.11%
过去六个月	-17.78%	2.73%	-15.64%	2.54%	-2.14%	0.19%
过去一年	4.07%	2.55%	5.70%	2.36%	-1.63%	0.19%
自基金合同生效起至今	60.37%	1.84%	63.39%	1.74%	-3.02%	0.10%

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:图示日期为2013年7月26日至2015年12月31日。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金合同生效日为2013年7月26日,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015	0.0000	0.00	-	0.00	
2014	0.0000	0.00	-	0.00	
2013	-	-	-	-	
合计	0.0000	-	-	-	

注:根据本基金基金合同的约定,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 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(原名称为"国金通用基金管理有限公司")经中国证券监督管理委员会(证监许可[2011]661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。2015年7月,公司名称由"国金通用基金管理有限公司"变更为"国金基金管理有限公司"。公司股东为国金证券股份有限公司,苏州工业园区禾润投资控股集团有限公司,广东冠豪华新能源股份有限公司,通金投资股份有限公司,通金投资股份有限公司,国金证券股份有限公司共同管理9只开放式基金——国金创鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金,国金沪深300指数分级证券投资基金,国金鑫盈货币市场证券投资基金,国金鑫安保本混合型证券投资基金,国金上证50指数分级证券投资基金,国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金,国金公募货币市场证券投资基金,国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金(LOF)。

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	-	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月起任国金基金旗下国金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月起任国金基金近远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 公平交易的制度执行情况

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《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。

投资决策环节规范制度方面,本基金管理人建立了统一的投资研究管理平台和公司通用的投资对象备选库和交易对象备选库,确保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,通过投资权限、流程和信息隔离等方式,实现投资决策的独立性。

在交易执行控制方面,本基金管理人实行集中交易制度,基金经理以指令的方式向交易部门下达交易指令,交易部门根据指令内容,在规定时间内完成交易执行。交易部门根据交易指令内容,在规定时间内完成交易执行。交易部门根据交易指令内容,在规定时间内完成交易执行。交易部门根据交易