# 国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

## 2016 第一季度 报告

2016年3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4月22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4月21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2016年1月1日起至3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 | 国金鑫新 |
| 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 | 10,544,087.36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（2016年1月1日 - 2016年3月31日） |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 134,050.71 |
| 2.本期利润 | 134,050.71 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0070 |
| 4.期末基金资产净值 | 10,624,176.64 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.008 |

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。

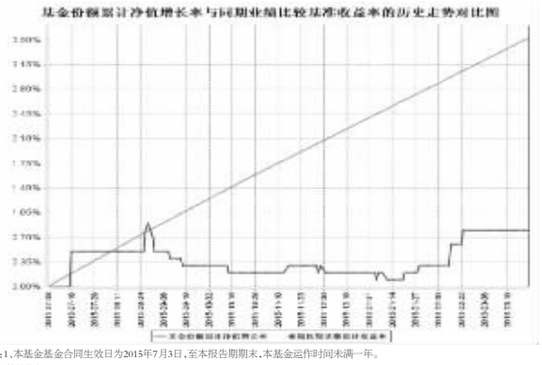
3.2 基金净值表现

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 | 0.60% | 0.05% | 1.11% | 0.02% | -0.51% | 0.03% |

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月起任国金鑫远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》、《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8只基金产品，分别为3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，报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，国内经济增速有低位企稳迹象，投资增速保持平稳，房地产销售价量齐升，地产投资增速触底反弹，同时大宗商品价格开始回暖，物价中枢有所抬升，通缩压力减缓，虽然外围压力随着美联储鸽派言论有所减缓，但资金成本边际上行，市场信用风险事件迅速攀升，债市基本面和资金面支撑中长期仍在，但短期有所弱化，本基金充分考虑资金的流动性和安全性考虑，适度降低信用工具的投资比例，同时保持短久期策略，提升组合资产的流动性。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内本基金份额净值收益率为0.8151%，同期业绩比较基准收益率为0.3366%。

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，本基金无连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者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 | 9,500,000.00 | 87.99 |
| | 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 | 1,293,684.19 | 11.98 |
| 8 | 其他资产 | 2,746.20 | 0.03 |
| 9 | 合计 | 10,796,430.39 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通股票投资。

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。

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

本基金未参与国债期货投资。

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 | 1,069.48 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,050.28 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 626.44 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,746.20 |

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

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 | 25,319,826.19 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 39,886,313.40 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 54,662,052.23 |
| 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 | 10,544,087.36 |

注：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。

§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

注：本报告期，基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：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、2016年1月4日披露了《国金基金管理有限公司关于国金基金2015年12月31日旗下基金净值公告》；

2、2016年1月6日披露了《国金基金管理有限公司关于2016年1月4日指数熔断后旗下基金调整开放时间的补充公告》；

3、2016年1月6日披露了《国金基金管理有限公司关于旗下上交所场内股票类基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告》；

4、2016年1月8日披露了《国金基金管理有限公司关于2016年1月7日指数熔断后旗下基金调整开放时间的公告》；

5、2016年1月20日披露了《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2015年第4季度报告》；

6、2016年2月17日披露了《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）招募说明书更新》、《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）招募说明书更新摘要》；

7、2016年2月26日披露了《国金基金管理有限公司关于直销系统、订单系统升级的公告》；

8、2016年3月9日披露了《国金基金管理有限公司关于电子直销业务增加通联支付第三方支付业务的公告》；

9、2016年3月28日披露了《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2015年度报告》、《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2015年度报告摘要》；

10、2016年3月30日披露了《国金基金管理有限公司关于参加新兰德费率优惠的公告》；

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。

§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、国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同；

3、国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）托管协议；

4、国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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4月22日

# 宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金

## 2016 第一季度 报告

2016年3月31日

**基金管理人：宝盈基金管理有限公司**
**基金托管人：中国银行股份有限公司**
**报告送出日期：2016年4月22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4月21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2016年1月20日（合同生效日）起至3月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 宝盈国家安全沪港深股票 |
| 基金主代码 | 001877 |
| 交易代码 | 001877 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016年1月20日 |
| 报告期末基金份额总额 | 255,870,086.47份 |
| 投资目标 | 本基金主要投资于国家安全战略相关行业的上市公司证券，在严格控制投资风险的条件下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金的投资策略具体由大类资产配置策略、股票投资策略、固定收益类资产投资策略和金融衍生品投资策略四部分组成。<br>（一）大类资产配置策略<br>本基金将在基金合同约定的投资范围内，结合对宏观经济形势与资本市场环境的深入剖析，自上而下地实施积极的大类资产配置策略，并在本合同约定的投资比例范围内制定并适时调整内地和香港（港股通标的股票）两地股票配置比例。<br>（二）股票投资策略<br>本基金定义的国家安全战略主题所涉及的上市公司主要分布在以下领域：（1）国防安全相关的军工及其上、下游领域，包括航海、航空、航天、兵宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金基金合同 42 器、核工业等；（2）能源安全相关的常规能源、新能源、环境保护及其上、下游领域，包括石油开采、采掘服务、石油化工、有色金属、电力、燃气、新能源设备、环保 工程及服务等；（3）信息安全相关的电子信息技术及其上、下游领域，包括通讯设备、计算机、电子元器件等。本基金着重分析宏观经济周期和经济发展阶段中不同的驱动因素，有效结合国家政策导向，分析各子板块成长空间、盈利周期、竞争格局和行业估值水平，通过对各指标的深入研究，动态调整股票资产在各细分子板块间的配置。本基金在行业配置的基础上，通过定性分析与定量分析相结合的方法，精选 出国家安全战略主题的优质上市公司进行投资。<br>（三）固定收益类资产投资策略<br>在进行固定收益类资产投资时，本基金将会考量利率预期策略、信用债券投资策略、套利交易策略、可转换债券投资策略、资产支持证券投资和中小企业私募债券投资策略，选择合适时机投资于低估的债券品种，通过积极主动管理，获得超额收益。<br>（四）金融衍生品投资策略<br>本基金的金融衍生品投资策略包括权证投资策略和股指期货投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率x65%+恒生综合指数收益率x15%+中债综合指数收益 率x20%。 |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型 基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。<br>本基金除了投资于 A 股市场，还可以在法律法规规定的范围内投资香港联合交易所上市的股票，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面汇率风险、香港股票市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。 |
| 基金管理人 | 宝盈基金管理有限公司 |
| 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（2016年1月20日 - 2016年3月31日） |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 5,751,400.42 |
| 2.本期利润 | 5,906,707.98 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0217 |
| 4.期末基金资产净值 | 261,693,457.53 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.023 |

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。

4、本基金合同生效日为2016年1月20日，本报告期为2016年1月20日至2016年3月31日，基金合同生效日起至披露时点不满一个季度。

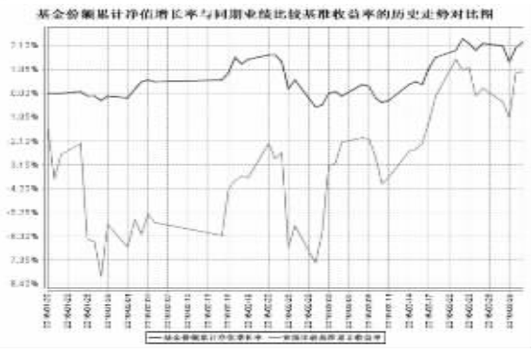
3.2 基金净值表现

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 | 2.30% | 0.41% | 0.96% | 1.47% | 1.34% | -1.06% |

注：本基金合同生效日为2016年1月20日，本报告期自2016年1月20日起至2016年3月31日。

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、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投资组合比例符合基金合同的约定。

2、本基金合同生效日为2016年1月20日，本报告期为2016年1月20日至2016年3月31日，基金合同生效日起至披露时点不满一个季度。

§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 | | |
| 张小仁 | 本基金基金经理、宝盈鸿利收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、宝盈核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理、宝盈先进制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理 | 2016年1月20日 | - | 9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。 |

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法》、《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，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，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 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，国内经济增速有低位企稳迹象，投资增速保持平稳，房地产销售价量齐升，地产投资增速触底反弹，同时大宗商品价格开始回暖，物价中枢有所抬升，通缩压力减缓，虽然外围压力随着美联储鸽派言论有所减缓，但资金成本边际上行，市场信用风险事件迅速攀升，债市基本面和资金面支撑中长期仍在，但短期有所弱化，本基金充分考虑资金的流动性和安全性考虑，适度降低信用工具的投资比例，同时保持短久期策略，提升组合资产的流动性。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内本基金份额净值收益率为-15.12%，同期业绩比较基准收益率为-17.53%，一方面由于去年四季度的大幅反弹，获利资金较多；另一方面，人民币汇率新年后持续贬值，出逃了部分避险资金；外加"熔断机制"的实行，加剧了市场的恐慌情绪。春节后，随着人民币汇率的企稳，美元加息预期的减弱，再加经济企稳的迹象出现，市场进入了震荡企稳的阶段。本基金于1月20日成立，在法定建仓期未结束前，本着绝对收益的思路来管理，目前仓位仍然较低。

4.5 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2.30%，同期业绩比较基准收益率是0.96%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者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 | 26,610,957.35 | 5.80 |
| | 其中：股票 | 26,610,957.35 | 5.80 |
| 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 | 200,000,000.00 | 43.62 |
| | 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 | 231,567,093.48 | 50.51 |
| 8 | 其他资产 | 287,304.25 | 0.06 |
| 9 | 合计 | 458,465,355.08 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 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 | 5,370,000.00 | 2.05 |
| C | 制造业 | 12,137,722.87 | 4.64 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 36,234.48 | 0.01 |
| F | 批发和零售业 | 3,423,000.00 | 1.31 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 5,644,000.00 | 2.16 |
| 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 | | 26,610,957.35 | 10.17 |

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

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

| 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 | 002364 | 中恒电气 | 500,000 | 12,005,000.00 | 4.59 |
| 2 | 000099 | 中信海直 | 400,000 | 5,644,000.00 | 2.16 |
| 3 | 002155 | 湖南黄金 | 600,000 | 5,370,000.00 | 2.05 |
| 4 | 600386 | 北巴传媒 | 210,000 | 3,423,000.00 | 1.31 |
| 5 | 002792 | 通宇通讯 | 1,260 | 55,389.60 | 0.02 |
| 6 | 002791 | 坚朗五金 | 1,121 | 42,138.39 | 0.02 |
| 7 | 300506 | 名家汇 | 1,819 | 36,234.48 | 0.01 |
| 8 | 300474 | 景嘉微 | 1,792 | 35,194.88 | 0.01 |

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序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投资。

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

本基金本报告期末股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。若未来法律法规或监管部门有新规定的，本基金可相应调整和更新相关投资策略。

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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 30,506.99 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 49,153.64 |
| 5 | 应收申购款 | 207,643.62 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 287,304.25 |

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

报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

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

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日（2016年1月20日）基金份额总额 | 291,448,737.30 |
| 报告期初基金份额总额 | - |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 27,541,810.60 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 63,120,461.43 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 255,870,086.47 |

注：本基金于本报告期间成立，基金合同生效日为2016年1月20日。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内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

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会批准宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金设立的文件。

《宝盈国家安全战略沪港深股票型证券投资基金基金合同》。

《宝盈国家安全战略沪港深股票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。

9.2 存放地点

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。

基金管理人办公地址：广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦10层

基金托管人住所：北京市西城区复兴门内大街1号

9.3 查阅方式

上述备查文件文本存放在基金管理人办公场所和基金托管人住所，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**
2016年4月22日

# 国金众赢货币市场证券投资基金

## 2016 第一季度 报告

2016年3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4月22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4月21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2016年1月1日起至3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 | 8,452,732,300.00份 |
| 投资目标 | 在综合考虑基金资产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（2016年1月1日 - 2016年3月31日） |
|---|---|
| 1. 本期已实现收益 | 66,606,940.21 |
| 2.本期利润 | 66,606,940.21 |
| 3.期末基金资产净值 | 8,452,732,300.00 |

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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，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。

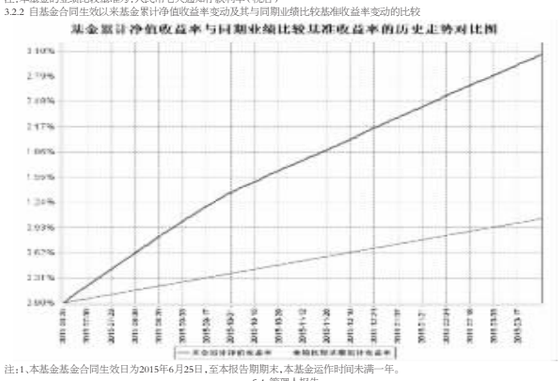
3.2 基金净值表现

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 | 0.8151% | 0.0017% | 0.3366% | 0.0000% | 0.4785% | 0.0017% |

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月历任哈天财经公关公司财经咨询、美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

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》、《国金众赢货币