富国创业板指数分级证券投资基金

2013 第四季度 报告

2013年12月31日

基金管理人:富国基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2014年01月22日

§1 重要提示

富国基金管理有限公司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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月20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。

富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、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2013年10月1日起至2013年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富国创业板指数分级(场内简称:富国创业)		
基金主代码	161022		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2013年09月12日		
报告期末基金份额总额	699,623,612.15		
投资目标	本基金采用指数化投资策略,紧密跟踪创业板指数。在正常市场情况下,力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。		
投资策略	本基金主要采用完全复制法进行投资,依托富国量化投资平台,利用长期稳定的风险模型和交易成本模型,按照成份股在创业板指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合,以拟合、跟踪创业板指数的收益表现,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。		
业绩比较基准	95%×创业板指数收益率 +5%×银行人民币活期存款利率(税后)		
风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征。		
基金管理人	富国基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
下属三级基金的基金简称	创业板A	创业板B	富国创业板指数分级(场内简称:富国创业)
下属三级基金的交易代码	150152	150153	161022
报告期末下属三级基金的份额总额(单位:份)	255,194,830.00	255,194,831.00	189,233,951.15
下属三级基金的风险收益特征	富国创业板A份额具有低风险、收益相对稳定的特征。	富国创业板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,具有较高风险、较高预期收益的特征。

§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(2013年10月01日-2013年12月31日)
1.本期已实现收益	-30,936,972.01
2.本期利润	-51,747,275.89
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0735
4.期末基金资产净值	677,194,778.36
5.期末基金份额净值	0.968

注:上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(例如,开放式基金的申购赎回费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本期已实现收益是基金本期利息收入、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。

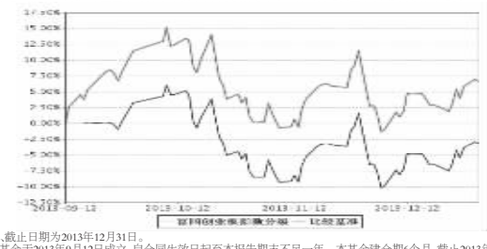
3.2 基金净值表现

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	-6.20%	1.88%	-4.35%	1.94%	-1.85%	-0.06%

注:过去三个月指2013年10月1日—2013年12月31日

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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.截止日期为2013年12月31日。

2.本基金于2013年9月12日成立,自合同生效日起至本报告期末不足一年。本基金建仓期6个月,截止2013年12月31日本基金仍处于建仓期。

3.3 其他指标

其他指标	报告期末(2013年12月31日)
创业板A与创业板B基金份额配比	1:1
期末创业板A份额参考净值	1.019
期末创业板A份额累计参考净值	1.019
期末创业板B份额参考净值	0.917
期末创业板B份额累计参考净值	0.917
2013年富国创业板A的预计年收益率	6.5%

§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		
王保合	兼任量化投资副总监、上证综指交易型开放式指数证券投资基金基金经理、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理	2013-09-12	-	8年	博士,曾任富国基金管理有限公司研究员;富国沪深300增强证券投资基金基金经理助理;2011年3月起任上证综指交易型开放式指数证券投资基金、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,2013年9月起任富国创业板指数分级证券投资基金基金经理;兼任量化投资副总监;具有基金从业资格,中国国籍。
章楷元	本基金基金经理	2013-12-05	-	6	硕士,自2008年7月至2011年5月在建信基金管理有限责任公司任研究员助理、初级研究员、研究员,自2011年5月至今在富国基金管理有限公司任基金经理助理,自2013年12月起任富国创业板指数分级证券投资基金基金经理。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期,富国基金管理有限公司作为富国创业板指数分级证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券投资基金运作管理办法》、《富国创业板指数分级证券投资基金基金合同》及其它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,以尽可能减少和分散投资风险,确保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长为目标,管理和运用基金资产,无损害基金持有人利益的行为,基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据相关法规要求,结合实际情况,制定了内部的《公平交易管理办法》,对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节,实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、共等交易机会,并保持各组合的独立投资决策权。

事前控制主要包括:1.一级市场,通过标准化的办公流程、对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制;2.二级市场,通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理,对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。

事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制,银行间市场交易价格的公允性评估等。1.将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为,非经特别控制流程审核同意,不得进行;对于同日同向交易,通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2.同一基金经理管理的不同组合,对同一投资标的采用相同投资策略的,必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令,确保公平对待其所管理的组合。

事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估,以及不同时间窗口下(1日、3日、5日)的季度公平性交易分析评估等。1.通过公平性交易的事后分析评估系统,对分及公平性交易的投资行为进行分析评估,分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品,并重点分析同类组合(股票型、混合型、债券型)间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为,若发现异常交易行为,监察稽核部相关人员将及时采取措施并向管理人报送相关监管机构的监管报告。

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面,报告期内本组合与其他投资组合之间,因组合流动性管理或投资策略调整需要,出现2次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5%的情况。

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

回顾2013年四季度,整体经济增长稳中趋弱,在经历了三季度的显著反弹后,部分经济指标在四季度显示出经济增长放缓的态势。随着十八届三中全会的召开,未来中国经济改革的坚定性得到了进一步地确认。投资者普遍担心经济改革初期会对经济增长造成一定负面影响。IPO重新开闸的消息也对市场情绪造成冲击,开闸之后的资金分流和未来可能的估值中枢下移都将给市场带来负面影响。创业板指数由于整体估值较高,所受影响较大,四季度整体下跌4.64%。

在投资管理上,本基金采取完全复制的被动式指数基金管理策略,采用量化和人工管理相结合的方法,处理基金日常运作中的大额申购和赎回等事件。本基金在报告期内遇到多次大额申购赎回,在一定程度上增加了本基金的交易成本,我们仍然较好地将跟踪误差控制在合理水平之内。

展望2014年,中国经济改革将在2014加速推进,产业结构调整、财税体制改革、对外经济开放、国企改革、新兴城镇化和金融改革六个领域将成为改革的重点方向。随着改革的深入,投资者需要密切关注地方政府融资平台和影子银行监管等等事件性风险。预计2014年整体将呈现先抑后扬走势,改革业绩的逐渐兑现将使得投资者对于经济的信心有系统性的回升。创业板企业在2014年尽管将面临着估值较高的压力,但创业板指数仍是分享中国战略型新兴产业长期成长的理想标的。

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-6.20%,同期业绩比较基准收益率为-4.35%。

§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	599,399,246.47	81.15
	其中:股票	599,399,246.47	81.15
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	82,438,419.23	11.16
6	其他资产	56,798,511.50	7.69
7	合计	738,636,177.20	100.00

5.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.3 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	-	-
B	采矿业	8,395,920.75	1.24
C	制造业	321,316,818.71	47.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	13,620,323.00	2.01
F	批发和零售业	2,737,368.00	0.40
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	118,714,451.72	17.53
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	24,298,645.00	3.59
M	科学研究和技术服务业	13,874,801.62	2.05
N	水利、环境和公共设施管理业	37,434,352.75	5.53
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	6,476,075.00	0.96
R	文化、体育和娱乐业	52,530,489.92	7.76
S	综合	-	-
	合计	599,399,246.47	88.51

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.4.1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	300027	华谊兄弟	999,282	27,800,025.24	4.11
2	300070	碧水源	629,575	25,806,279.25	3.81
3	300058	蓝色光标	392,275	20,319,845.00	3.00
4	300104	乐视网	488,745	19,940,796.00	2.94
5	300024	机器人	363,597	17,707,173.90	2.61
6	300124	汇川技术	236,963	13,859,965.87	2.05
7	300146	汤臣倍健	185,822	13,544,565.58	2.00
8	300017	网宿科技	149,518	12,664,174.60	1.87
9	300002	神州泰岳	414,112	12,220,445.12	1.80
10	300133	华策影视	380,879	12,150,040.10	1.79

5.4.2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

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.5 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资产。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券资产。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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:本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据基金合同的约定,不允许投资股指期货。

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

本基金根据基金合同的约定,不允许投资国债期货。

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申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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、处罚的情形。

本期,本基金持有的华策影视于2013年11月8日公告其重大资产重组相关方因涉嫌内幕交易被中国证监会立案调查,导致其本次重大资产重组被暂停,并可能存在被终止的风险。

华策影视为本基金跟踪标的指数的样本股,基金管理人将密切跟踪相关进展,遵循价值投资的理念进行投资决策。

本基金持有的其余九名证券的发行主体本期未出现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、处罚的情形。

5.11.2 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在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	228,443.73
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,754.10
5	应收申购款	56,562,313.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	56,798,511.50

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

5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注: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。

因四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	创业板A	创业板B	富国创业板指数分级(场内简称:富国创业)
报告期期初基金份额总额	16,666,407.00	16,666,408.00	73,732,864.42
报告期期间基金总申购份额	-	-	1,039,841,006.02
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-	447,283,073.29
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	238,528,423.00	238,528,423.00	-477,056,846.00
报告期期末基金份额总额	255,194,830.00	255,194,831.00	189,233,951.15

注:拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期本基金的管理人未运用固有资金申赎及买卖本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

基金托管人2013年12月5日发布任免通知,聘任黄秀莲为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1.中国证监会批准设立富国创业板指数分级证券投资基金的文件

2.富国创业板指数分级证券投资基金基金合同

3.富国创业板指数分级证券投资基金托管协议

4.中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件

5.富国创业板指数分级证券投资基金财务报表及报表附注

6.报告期内在指定报刊上披露的各项公告

9.2 存放地点

上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层

9.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。

咨询电话:95105686,4008880688(全国统一,免长途话费)

公司网址:http://www.fullgoal.com.cn

富国基金管理有限公司
2014年01月22日

国金通用沪深300指数分级证券投资基金

2013 第四季度 报告

2013年12月31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1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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1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2013年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国金沪深300指数分级(场内简称: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	162,458,257.46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。从本基金所分类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	国金沪深300指数分级A(场内简称:国金300A)	国金沪深300指数分级B(场内简称:国金300B)	国金沪深300指数分级(场内简称: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	18,969,453.00份	18,969,453.00份	124,519,351.46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(2013年10月1日 - 2013年12月31日)
1.本期已实现收益	9,258,742.20
2.本期利润	-5,142,040.89
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0287
4.期末基金资产净值	171,399,573.63
5.期末基金份额净值	1.055

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。

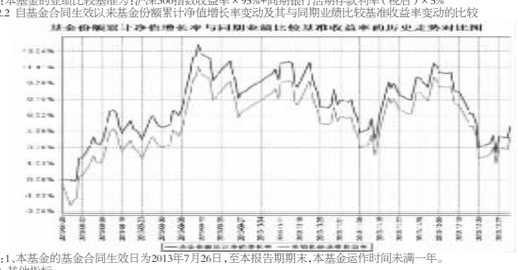
3.2 基金净值表现

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	-3.48%	1.08%	-2.77%	1.07%	-0.71%	0.01%

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:1.本基金的基金合同生效日为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,博士,毕业于中国科学院数学与系统科学研究院,管理科学与工程专业。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。

注:基金经理的任职日期为基金管理人聘任基金经理并对外公告之日,本基金的首任基金经理的任职日期为本基金成立之日。

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会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三只基金产品,分别为混合型基金、指数基金和货币基金,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

2013年4季度上证综指涨幅-2.70%,沪深300涨幅-3.28%,中小板涨幅-4.86%,创业板涨幅-4.64%;从市场风格指数看,大盘股、小盘股均出现下跌,IPO重启对中小板、创业板投资情绪一度产生较大冲击。从行业指数看(申万分类),家用电器(18%)、机械设备(7%)、农林牧渔(7%)领涨,有色金属(-11%)、房地产(-9%)、商业贸易(-9%)领跌。

在流动性持续偏紧的市场环境下,大盘蓝筹股估值缺乏弹性,市场缺乏系统性机会。本基金于报告期继续坚持从大众消费品和必须投资品两个角度出发,重点发掘食品饮料、医药、汽车、轻工及TMT、环保等行业的投资机会。截至四季度末,组合持仓以食品饮料、医药、TMT行业为主,军工、交运行业为辅。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年12月31日,本基金单位份额净值0.9588元,累计单位净值1.0588元。本报告期基金单位份额净值增长率-4.25%,同期业绩比较基准增长率-1.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014年,市场流动性预计持续偏紧,投资标的供给随IPO重启明显增加,符合经济结构调整方向的新兴产业估值大多处于高位,市场环境复杂。对银行非标资产的约束性管理趋严,长期有利于控制银行资产风险敞口的扩大,但短期内或将继续推升实际利率水平,导致企业融资成本抬高,进而降低工业企业利润增速。

在信贷资产风险局部暴露,流动性加剧紧张背景下,货币政策若出现调整,市场有望出现短暂的系统性机会。但整体看,2014年市场或仍将呈现结构性行情。

经过IPO冲击洗礼后,以TMT行业为代表的新兴行业中能够继续保持业绩增长的投资标的或将得到估值溢价,为投资者带来良好回报;军工有望产生持续性的主题投资机会。

§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	162,791,760.91	94.63
	其中:股票	162,791,760.91	94.63
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	9,059,405.37	5.27
6	其他资产	184,163.10	0.11
7	合计	172,035,329.38	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	1,184,894.54	0.69
B	采矿业	9,888,850.62	5.77
C	制造业	59,324,338.61	34.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,027,232.22	2.93
E	建筑业	5,567,476.36	3.25
F	批发和零售业	4,991,621.77	2.91
G	交通运输、仓储和邮政业	4,435,168.09	2.59
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,606,941.61	2.69
J	金融业	55,311,595.54	32.27
K	房地产业	7,451,335.77	4.35
L	租赁和商务服务业	1,129,579.28	0.66
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,510,625.33	0.88
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	808,804.46	0.47
S	综合	1,553,296.71	0.91
	合计	162,791,760.91	94.98

注:以上行业分类以2013年12月31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

注:本基金本报告期末未持有积极投资部分股票。

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	149,811	6,251,613.03	3.65
2	600036	招商银行	516,660	5,626,427.40	3.28
3	600016	民生银行	707,057	5,458,480.04	3.18
4	601166	兴业银行	357,819	3,628,284.66	2.12
5	600000	浦发银行	350,300	3,303,329.00	1.93
6	600837	海通证券	253,267	2,866,982.44	1.67
7	600030	中信证券	215,586	2,748,721.50	1.60
8	000651	格力电器	75,314	2,459,755.24	1.44
9	000002	万 科A	302,924	2,432,479.72	1.42
10	601288	农业银行	812,897	2,015,984.56	1.18

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名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名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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

报告期,本基金未投资国债期货。

5.9.2 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。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金未参与国债期货投资。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

报告期,本基金投资前十名股票中未有超出基金合同规定备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	180,690.55
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,085.85
5	应收申购款	1,386.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	184,163.10

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.10.5.1 报告期末指数投资前十名股票中在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。

5.10.5.2 报告期末积极投资前五名股票中在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。

5.10.6 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	国金沪深300指数分级A	国金沪深300指数分级B	国金沪深300指数分级
报告期期初基金份额总额	21,030,357.00	21,030,357.00	204,410,293.42
报告期期间基金总申购份额	-	-	2,504,533.33
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-	86,517,283.29
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-2,060,904.00	-2,060,904.00	4,121,808.00
报告期期末基金份额总额	18,969,453.00	18,969,453.00	124,519,351.46

注: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。

§7 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,公司根据《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》、《证券日报》及管理人网站进行了如下信息披露:

1.2013年10月23日披露了《国金通用沪深300指数分级证券投资基金2013年第3季度报告》;

2.2013年12月21日披露了《国金通用基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金单笔最低申购金额、赎回份额、追加申购金额及单个交易账户最低持有份额限额的公告》;

3.2013年12月26日披露了《国金通用沪深300指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的提示性公告》;

4.2013年12月27日披露了《国金沪深300A份额定期份额折算后次日前收益价调整的提示公告》;

5.2013年12月27日披露了《国金通用沪深300指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告》;

6.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