国金通用鑫安保本混合型证券投资基金

2014 年度 报告摘要

2014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
送出日期:2015年3月30日

§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2015年3月27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2014年8月27日(基金合同生效日)起至2014年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	国金通用鑫安保本
场内简称	–
基金主代码	000749
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	2014年8月27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
报告期末基金份额总额	1,356,492,567.57份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	–
上市日期	–

注:无

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在保证客户本金的基础上,力争为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金通过固定比例投资组合保险(CPPI,Constant Proportion Portfolio Insurance)策略和时间不变性投资组合保险(TIPP,Time Invariant Portfolio Protection)策略,在保本周期中,对资产配置严格按照公司开发的保本模型进行优化动态调整,确保投资者的投资本金的安全性。同时,本基金通过积极稳健的收益资产投资策略,竭力为基金资产获取更高的增值回报。
业绩比较基准	一年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金为保本混合型基金,属于证券投资基金中的中低风险品种,其预期风险和预期收益低于股票型基金和非保本的混合型基金,高于货币市场基金和债券型基金。

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		国金通用基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	徐炜瑜	张建春
	联系电话	010-88005601	010-63639180
	电子邮箱	xuweiyu@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	2014年8月27日(基金合同生效日)–2014年12月31日	2013年	2012年
本期已实现收益	–17,579,365.54	–	–
本期利润	–17,008,862.56	–	–
加权平均基金份额本期利润	–0.0119	–	–
本期基金份额净值增长率	–1.20%	–	–
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额利润	–0.0122	–	–
期末基金资产净值	1,340,256,635.15	–	–
期末基金份额净值	0.988	–	–

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(已实现部分相抵未实现部分)。

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.本基金合同自2014年8月27日起生效,至2014年12月31日未满一年。

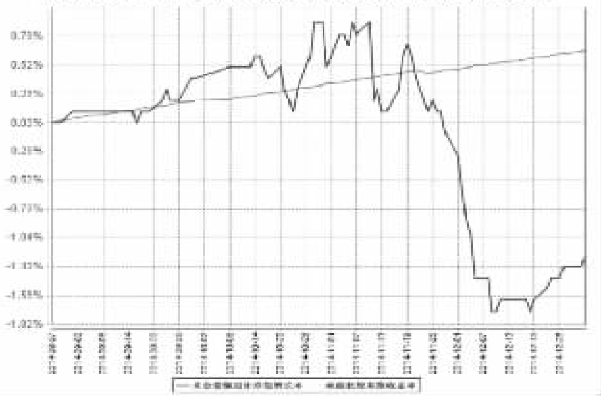
3.2 基金净值表现

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	–1.59%	0.18%	0.73%	0.01%	–2.32%	0.17%
自基金合同生效起至今	–1.20%	0.16%	1.02%	0.00%	–2.22%	0.16%

注:本基金的业绩比较基准为:一年期定期存款利率(税后)

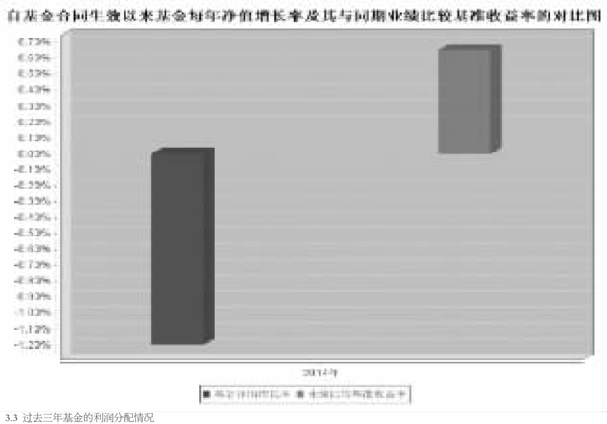
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、图示日期为2014年8月27日至2014年12月31日。

2、本基金基金合同生效日为2014年8月27日,基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间未满一年。

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对比



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
合计	–	–	–	–	

注:本基金自2014年8月27日(基金合同生效日)起至2014年12月31日止未进行利润分配。

§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]1661号)批准,于2011年11月2日月成立,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。公司股东为国金证券股份有限公司、苏州工业园区兆润控股集团有限公司、广东宝丽华新能源股份有限公司、中国通用技术(集团)控股有限责任公司,四家企业共同出资2.8亿元人民币,出资比例分别为49%、19.5% 、19.5%和12%。截至2014年12月31日,国金通用基金管理有限公司共管理6只开放式基金——国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金、国金通用沪深300指数分级证券投资基金、国金通用鑫盈货币市场证券投资基金、国金通用鑫利分级债券型证券投资基金、国金通用金腾通货币市场证券投资基金、国金通用鑫安保本混合型证券投资基金。

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	本基金基金经理	2014年8月26日	–	6	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、产品与金融工程部总经理、指数投资部副总经理等职,自2014年11月起任指数投资事业部总经理。2014年8月27日起至今担任国金通用鑫安保本混合型证券投资基金基金经理。截至本公告之日,宫雪女士同时担任国金通用沪深300指数分级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》、《证券投资基金运作管理办法》、《国金通用鑫安保本混合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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及其他相关法律法规,制定了《国金通用基金管理有限公司公平交易管理办法》,在投资管理活动中公平对待不同投资组合,严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。该公平交易管理办法规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行(集中竞价和非集中竞价交易)、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

第一,明确公平交易的原则:(1)信息获取公平原则,不同投资组合经理可公平获得研究成果;(2)交易机会公平原则,不同投资组合经理可获得公平交易执行的机会。

第二,对开放式基金和特定客户资产管理计划等不同类型业务,公司分别设立独立的投资部门;研究团队对所有的投资业务同时提供研究支持;设立独立的基金交易部,实行集中交易制度,将投资管理职能和交易执行职能相隔离;设立独立的风险管理部,对研究、投资、交易业务的公平交易进行监控、分析、预警、报告等。

第三,通过岗位设置、制度约束、流程规范、技术手段相结合的方式,实现公平交易的控制,具体如下:

(1)总经理、督察长、风险控制委员会负责指导建立公平交易制度,并对公平交易的执行情况进行审核。(2)产品开发:风险分析师根据相关法律法规、公司规章制度以及产品合同的风险控制指标,在投资交易系统中完成风控参数设置,确保做好公平交易的事前控制。(3)研究与投资:投资人员负责在各自的职责及权限范围内从事相应的投资决策行为,其中,投资组合经理需对有可能涉及非公平交易的行为作出合理解释。研究人员负责以客观的研究方法开展研究工作,并根据研究结果建立及维护全公司适用的投资对象备选库和交易对手备选库。研究结果通过策略会、行业及个股报告会、投研平台、邮件系统等共享机制统一开放给所有的投资组合经理,以确保各投资组合享有公平的信息获取机会。(4)交易执行:交易人员负责建立并执行公平的集中交易制度和交易分配制度,风险管理部利用投资交易系统等对交易执行进行实时监控,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。(5)事后分析:风险管理部利用公平交易系统对不同投资组合之间的同向、反向交易及交易时机和价差进行事后分析。(6)报告备案:风险管理部根据实时监控及事后分析的结果撰写定期报告,并由投资组合经理、督察长、总经理签署后,妥善保存分析报告备查。(7)信息披露环节:信息披露部门在各投资组合的定期报告中,至少披露公司整体公平交易制度执行情况、公平交易执行情况及异常交易行为专项说明等事项。(8)反馈完善:根据事后分析报告及信息披露结果,公平交易各相关部门对相关环节予以不断完善,以确保公平交易的执行日臻完善。(9)监督检查:监察稽核部根据法规规定及公司公平交易制度规定,监督、检查、评价公司公平交易制度执行情况,并提出改进建议。会计师事务所在公司年度内部控制评价报告中对公司公平交易制度的执行情况做出专项评价。

4.3.2 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6只基金产品,分别为2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。

4.3.3 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 管理人对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

报告期,本基金严格遵守基金合同,在保本周期中,对资产配置严格按照公司开发的保本模型进行优化动态调整,确保投资者的投资本金的安全性。同时,本基金通过积极稳健的收益资产投资策略,竭力为基金资产获取更高的增值回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期,本基金份额净值增长率为–1.20%,同期业绩比较基准收益率为1.02%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015年货币环境将持续宽松,利率下行不可避免,这将逐步实现社会融资成本的降低,这将有力促进未来微观企业的盈利回升,以及整体经济的良性循环。从整体来看,市场进入回升通道。上半年,降息、降准等货币政策有望逐步落实,这将为整个经济提供充足的流动性,潜在的债务风险仍然存在,但财政政策的释放、以及自贸区等开放政策的实施,对化解债务风险提供了一定缓冲,有助于经济结构的稳步转型。

经济结构的调整仍将逐步向消费导向型经济转型,回升的趋势也在逐渐确认。行业层面来看,经济结构转型意味着不同行业将逐步实现实质性变化,顺应改革方向的金融、计算机、医药、高端消费、互联网、文化传媒、环保等行业都存在较大的增长空间。此外,中国的对外资本输出、技术输出将推动输出型需求行业如运输设备、基础设施建设等行业的增长值得关注。

证券市场层面来看,2015市场呈现上升态势是大概率事件,行业间也会呈现较大的差异,主要驱动将来自微观盈利的回升。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,本基金管理人从合法、合规、保障基金持有人利益出发,由督察长领导独立于各业务部门的监察稽核部对基金投资运作、公司经营管理及员工行为的合法、合规性等进行了监察稽核,通过实时监控、定期检查、专项稽核、日常不定期抽查等方式,及时发现情况、提出整改意见、督促有关业务部门整改并跟踪改进落实情况,并按照相关要求定期制作监察稽核报告报公司管理层、董事会以及监管部门。

本报告期内本基金管理人内部监察稽核的重点包括:

(1)进一步完善制度建设。本基金管理人根据公司实际业务情况不断细化制度流程,及时拟定了相关管理制度,并对原有制度体系进行了持续的更新和完善,截至报告出具日,本基金管理人共制订规章制度110个,涵盖公司主要业务范围。

(2)强化合规教育和培训。本基金管理人及时传达与基金相关的法律法规,将相关规定不断贯彻到相关制度及具体执行过程中,同时以组织公司内部培训、聘请外部律师提供法律专业培训等多种形式,提高全体员工的合规守法意识。

(3)有计划地开展监察稽核工作。本报告期内,本基金管理人根据年度监察稽核工作计划、通过日常监察与专项稽核相结合的方式,开展各项监察稽核工作,包括对基金销售、宣传材料、合同、反洗钱工作、基金投资运作、交易(包括公平交易)等方面进行稽核,对于稽核中发现的问题会通过专项稽核报告的形式,及时将潜在风险通报部门负责人、督察长及公司总经理,督促改进并跟踪改进效果。通过日常监察与专项稽核的方式,保证了内部监察稽核的全面性、实时性,强化内部控制流程,提高了业务部门及人员的风险意识水平,从而较好地预防风险。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会相关规定及基金合同关于估值的约定,严格执行内部估值控制程序,对基金所持有的投资品种进行估值。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构,由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规,具备较强专业胜任能力的基金经理、数量研究员、风险管理人员、监察稽核人员及基金清算人员组成。运营支持部根据估值委员会的估值意见进行相关具体的估值调整或处理,并负责与托管行进行估值结果的核对。涉及模型定价的,由数量研究员或风险控制人员向运营支持部提供模型定价的结果,运营支持部业务人员复核后使用。基金经理作为估值委员会的成员之一,在基金估值定价过程中,充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议,参与估值方案提议的制定,但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。本基金管理人参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

公司与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》,并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金相关法律法规和基金合同,结合本基金实际运作情况,本报告期内,本基金未进行利润分配,不存在应分配而未分配的情况。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无

4.10报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2014年度,中国光大银行股份有限公司在国金通用鑫安保本混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定,依法安全托管了基金的全部资产,对国金通用鑫安保本混合型证券投资基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督,对发现的问题及时提出了意见和建议。按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告,没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为,诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2014年度,中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定,对基金管理人国金通用基金管理有限公司的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督,未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规的要求;各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人国金通用基金管理有限公司编制的 "国金通用鑫安保本混合型证券投资基金2014年年度报告"进行了复核,报告中相关财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容是真实、准确和完整的。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2015)审字第61004823_A06号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	国金通用鑫安保本混合型证券投资基金全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的国金通用鑫安保本混合型证券投资基金财务报表,包括2014年12月31日的资产负债表,2014年8月27日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人国金通用基金管理有限公司的责任。这种责任包括:(1)按照企业会计准则的规定编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。 我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。	
审计意见段	我们认为,上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了国金通用鑫安保本混合型证券投资基金2014年12月31日的财务状况以及2014年8月27日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	汤 骏	王珊珊
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层	
审计报告日期	2015年3月26日	

§7 年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体:国金通用鑫安保本混合型证券投资基金
报告截止日:2014年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资 产:			
银行存款		2,311,879.91	–
结算备付金		7,281,302.37	–
存出保证金		91,302.84	–
交易性金融资产		1,367,065,025.62	–
其中:股票投资		12,406,762.06	–
基金投资		–	–
债券投资		1,354,658,263.56	–
资产支持证券投资		–	–
贵金属投资		–	–
衍生金融资产		–	–
买入返售金融资产		40,000,380.00	–
应收证券清算款		–	–
应收利息		32,629,599.33	–
应收股利		–	–
应收申购款		300.00	–
递延所得税资产		–	–
其他资产		–	–
资产总计		1,449,379,790.07	–
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
负 债:			
短期借款		–	–
交易性金融负债		–	–
衍生金融负债		–	–
卖出回购金融资产款		103,209,365.18	–
应付证券清算款		–	–
应付赎回款		2,575,012.65	–
应付管理人报酬		1,737,174.63	–
应付托管费		231,623.28	–
应付销售服务费		694,869.86	–
应付交易费用		419,112.86	–
应交税费		–	–
应付利息		86,002.74	–
应付利润		–	–
递延所得税负债		–	–
其他负债		169,993.72	–
负债合计		109,123,154.92	–
所有者权益:			
实收基金		1,356,492,567.57	–
未分配利润		–16,235,932.42	–
所有者权益合计		1,340,256,635.15	–
负债和所有者权益总计		1,449,379,790.07	–

注:1.报告截止日2014年12月31日,基金份额净值人民币0.988元,基金份额总额1,356,492,567.57份。

2.本期财务报表的实际编制期间系2014年8月27日(基金合同生效日)至2014年12月31日止。

7.2 利润表

会计主体:国金通用鑫安保本混合型证券投资基金
本报告期:2014年8月27日(基金合同生效日)至2014年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2014年8月27日(基金合同生效日)至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
一、收入		–3,967,146.15	–
1.利息收入		21,270,972.66	–
其中:存款利息收入		5,866,781.54	–
债券利息收入		7,836,069.71	–
资产支持证券利息收入		–	–
买入返售金融资产收入		7,568,121.41	–
其他利息收入		–	–
2.投资收益(损失以"–"填列)		–27,098,432.55	–
其中:股票投资收益		22,198,764.91	–
基金投资收益		–	–
债券投资收益		464,106.06	–
资产支持证券投资收益		–	–
贵金属投资收益		–	–
衍生工具收益		–49,823,820.00	–
股利收益		62,516.48	–
3.公允价值变动收益(损失以"–"号填列)		570,502.98	–
4.汇兑收益(损失以"–"号填列)		–	–
5.其他收入(损失以"–"号填列)		1,289,810.76	–
减:二、费用		13,041,716.41	–
1.管理人报酬		7,387,377.28	–
2.托管费		984,983.65	–
3.销售服务费		2,954,950.90	–
4.交易费用		872,503.21	–
5.利息支出		677,279.92	–
其中:卖出回购金融资产支出		677,279.92	–
6.其他费用		164,621.45	–
三、利润总额(亏损总额以"–"号填列)		–17,008,862.56	–
减:所得税费用		–	–
四、净利润(净亏损以"–"号填列)		–17,008,862.56	–

注:本基金合同自2014年8月27日起生效,至2014年12月31日未满一年。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:国金通用鑫安保本混合型证券投资基金
本报告期:2014年8月27日(基金合同生效日)至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年8月27日(基金合同生效日)至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,442,871,559.51	–	1,442,871,559.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	–	–17,008,862.56	–17,008,862.56
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"–"号填列)	–86,378,991.94	772,930.14	–85,606,061.80
其中:1.基金申购款	371,045.44	–2,839.39	368,206.05
2.基金赎回款	–86,750,037.38	775,769.53	–85,974,267.85
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"–"号填列)	–	–	–
五、期末所有者权益(基金净值)	1,356,492,567.57	–16,235,932.42	1,340,256,635.15
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	–	–	–
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	–	–	–
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"–"号填列)	–	–	–
其中:1.基金申购款	–	–	–
2.基金赎回款	–	–	–
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"–"号填列)	–	–	–
五、期末所有者权益(基金净值)	–	–	–

注:本基金合同自2014年8月27日起生效,至2014年12月31日未满一年。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

尹庆军　　聂武鹏　　于晓莲
基金管理人负责人　　主管会计工作负责人　　会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国金通用鑫安保本混合型证券投资基金(以下简称"本基金"),系经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2014]716号文《关于核准国金通用鑫安保本混合型证券投资基金募集的批复》的核准,由国金通用基金管理有限公司于2014年7月31日至2014年8月22日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具(2014)验字第61004823_A03号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2014年8月27日正式生效,本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金设立时,首次募集(不含认购费)的有效净认购金额为人民币1,442,585,619.80元,折合1,442,585,619.80份基金份额;募集资金在募集期间产生的利息为人民币285,939.71元,折合285,939.71份基金份额;以上收到的实收基金共计人民币1,442,871,559.51元,折合1,442,871,559.51份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构均为国金通用基金管理有限公司,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

本基金的投资范围为:国内依法公开发行的各类具有良好流动性的金融工具,包括现金、银行存款(包括活期存款、定期存款和协议存款等)、债券(包括国债、金融债、公司债、企业债、可转换债券、中小企业私募债、央行票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、股指期货、权证,以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金根据投资策略对安全资产(包括现金、银行存款、债券、资产支持证券、债券回购等)及风险资产(股票、股指期货、权证等)两类资产的投资比例进行动态调整。其中,股票、股指期货、权证等风险资产占基金资产净值的比例不高于60%;现金、银行存款、债券、资产支持证券、债券回购等安全资产占基金资产净值的比例不低于40%,其中现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:一年期银行定期存款税后收益率。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下统称"企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

采用若干修订后/新会计准则

2014年1至3月,财政部制定了《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》和《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》;修订了《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》和《企业会计准则第33号——合并财务报表》;上述7项会计准则均自2014年7月1日起施行。2014年6月,财政部修订了《企业会计准则第37号——金融工具列报》,在2014年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本财务报表无重大影响。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2014年12月31日的财务状况以及2014年8月27日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则及应用指南、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

会计政策变更的说明可参见7.4.2会计报表的编制基础。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

1.印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的3‰调整为1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税[2005] 103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

2.营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004] 78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2005] 103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008] 1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

3.个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2002] 128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入、储蓄存款利息收入,由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012] 85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自2013年1月1日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2005] 103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008] 132号文《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
上海国金通用财富资产管理有限公司	基金管理人的子公司
国金通用基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国通用技术(集团)控股有限责任公司	基金管理人股东
国金证券股份有限公司	基金管理人股东、基金代销机构
广东宝丽华新能源股份有限公司	基金管理人股东
北京千石创富资本管理有限公司	基金管理人的子公司
苏州工业园区兆润控股集团有限公司	基金管理人股东
中国光大银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金于2014年8月27日(基金合同生效日)成立,无上年度可比期间的关联方数据,仅揭示2014年相关数据。

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年8月27日(基金合同生效日)至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国金证券	125,203,944.53	22.33%	–	–

债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年8月27日(基金合同生效日)至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例

注:本基金于2014年8月27日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年8月27日(基金合同生效日)至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国金证券	12,440,900,000.00	63.46%	–	–

7.4.8.1.2 权证交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年8月27日(基金合同生效日)至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例

注:本基金于2014年8月27日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年8月27日(基金合同生效日)至2014年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国金证券	88,945.32	22.33%	88,945.32	22.33%
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年8月27日(基金合同生效日)至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,387,377.28	–
其中:支付销售机构的客户维护费	2,550,410.42	–

注:1.本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费计算方法如下:

H=E×1.50%/当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值

保本周期内,本基金的担保费用从基金管理人的管理费收入中列支。

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

过渡期及到期期间(除保本周期到期日外)不收取管理费。

2.客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用,该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支,不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年8月27日(基金合同生效日)至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	984,983.65	–

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.20%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.20%/当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

过渡期及到期期间(除保本周期到期日外)不收取托管费。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期 2014年8月27日(基金合同生效日)至2014年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
中国光大银行	1,905,347.54
国金通用基金管理有限公司	71,074.26
国金证券	318,426.51
合计	2,294,848.31
获得销售服务费各关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

注:本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的0.60%年费率计提。销售服务费的计算方法如下:

H=E×0.60%÷当年天数
H为每日应计提的基金销售服务费
E为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构,由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2014年8月27日(基金合同生效日)至2014年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出

注:本基金于2014年8月27日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2014年8月27日(基金合同生效日)至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
基金合同生效日(2014年8月27日)持有的基金份额	–	–
期初持有的基金份额	–	–
期间申购/买入总份额	–	–
期间因拆分变动份额	–	–
减:期间赎回/卖出总份额	–	–
期末持有的基金份额	–	–
期末持有的基金份额占基金总份额比例	–	–

注:本基金的管理人于2014年8月27日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

关联方名称	本期末 2014年12月31日		上年度末 2013年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例

注:本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未持有本基金份额。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年8月27日(基金合同生效日)至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行	2,311,879.91	135,095.33	–	–

注:本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位:人民币元

本期 2014年8月27日(基金合同生效日)至2014年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:份)	总金额
上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:份)	总金额

注:本基金于2014年8月27日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无

7.4.9 期末(2014年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.10.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
7.4.10.1.2 受限证券类别:债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
110030	格力转债	2014年12月30日	2015年1月13日	新债未上市	100.00	100.00	7,120	712,000.00	712,000.00	–
7.4.10.1.3 受限证券类别:权证										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:份)	期末成本总额	期末估值总额	备注

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600754	锦江股份	2014年11月10日	重大不确定事项	25.11	2015年1月19日	27.00	129,704	2,697,334.67	3,256,867.44	–
002675	东诚药业	2014年10月10日	重大不确定事项	24.18	–	–	103,309	2,341,093.96	2,498,011.62	–
000009	中国宝安	2014年12月29日	重大事项未公告	12.95	2015年1月7日	13.88	1,100	14,124.00	14,245.00	–

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2014年12月31日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币103,209,365.18元,是以如下债券作为质押的:

金额单位:人民币元

股票代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
041462004	14东方CP001	2015年1月5日	100.97	290,000	29,281,300.00
140437	14农发37	2015年1月29日	99.99	500,000	49,995,000.00
140437	14农发37	2015年3月19日	99.99	100,000	9,999,000.00
1282245	12亨通MTN1	2015年2月16日	99.93	200,000	19,986,000.00
合计				1,090,000	109,261,300.00

–

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1公允价值

结算备付金、买入返售金融资产、应收利息、卖出回购金融资产款、应付赎回款等,因其剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

(1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为人民币8,118,901.56元,属于第二层级的余额为人民币1,358,946,124.06元,属于第三层级余额为人民币零元。

(2) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确认金融工具公允价值层次之间转移的时点。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具,在第一层次和第二层次之间无重大转移。

本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具未发生转入或转出第三层次公允价值的情况。

7.4.14.2承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.3其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.14.4财务报表的批准

本财务报表已于2015年3月26日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	12,406,762.06	0.86
	其中:股票	12,406,762.06	0.86
2	固定收益投资	1,354,658,263.56	93.46
	其中:债券	1,354,658,263.56	93.46
	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	40,000,380.00	2.76
	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	9,593,182.28	0.66
7	其他各项资产	32,721,202.17	2.26
8	合计	1,449,379,790.07	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	9,074,689.62	0.68
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	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	3,256,867.44	0.24
I	信息传输、软件和信息技术服务业	–	–
J	金融业	60,960.00	0.00
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	14,245.00	0.00
	合计	12,406,762.06	0.93

8.3 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

金额单位:人民币元

代码	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601299	中国北车	481,400	3,417,940.00	0.26
2	600754	锦江股份	129,704	3,256,867.44	0.24
3	601766	中国南车	495,100	3,158,738.00	0.24
4	002675	东诚药业	103,309	2,498,011.62	0.19
5	002736	国信证券	6,000	60,960.00	0.00
6	000009	中国宝安	1,100	14,245.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	002662	京威股份	3,743,105.77	0.28
2	002666	德联集团	3,734,490.00	0.28
3	601880	大 连 港	3,539,590.91	0.26
4	002398	建研集团	3,438,203.03	0.26
5	002540	亚太科技	3,357,904.32	0.25
6	600978	宜华木业	3,305,127.00	0.25
7	300095	华伍股份	3,300,623.22	0.25
8	002631	德尔家居	3,185,679.65	0.24
9	600820	隧道股份	3,172,377.00	0.24
10	600017	日 照 港	3,159,348.00	0.24
11	600717	天 津 港	3,123,109.00	0.23
12	000635	英 力 特	3,104,745.00	0.23
13	002031	巨轮股份	3,075,272.00	0.23
14	300284	苏 交 科	3,072,252.00	0.23
15	600742	一汽富维	3,023,728.16	0.23
16	300082	奥克股份	2,952,176.03	0.22
17	000905	厦门港务	2,937,031.01	0.22
18	002025	航天电器	2,892,993.52	0.22
19	600658	电 子 城	2,857,821.27	0.21
20	600422	昆明制药	2,849,889.26	0.21

注:上述买入金额为买入成交金额(成交单价乘以成交数量),不包括相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	002031	巨轮股份	5,358,049.20	0.40
2	000685	中山公用	4,508,393.40	0.34
3	601390	中国中铁	4,492,898.00	0.34
4	601880	大 连 港	4,441,804.00	0.33
5	600717	天 津 港	4,354,993.00	0.32
6	002662	京威股份	4,298,684.00	0.32
7	002540	亚太科技	4,175,839.92	0.31
8	000905	厦门港务	3,884,781.51	0.29
9	002398	建研集团	3,876,076.95	0.29
10	002666	德联集团	3,748,431.00	0.28
11	600017	日 照 港	3,735,248.00	0.28
12	000666	经纬纺机	3,700,095.61	0.28
13	600820	隧道股份	3,628,153.00	0.27
14	002631	德尔家居	3,474,515.14	0.26
15	600350	山东高速	3,382,829.00	0.25
16	000425	徐工机械	3,351,294.15	0.25
17	600004	白云机场	3,314,258.10	0.25
18	300095	华伍股份	3,248,235.75	0.24
19	600252	中恒集团	3,231,117.68	0.24
20	600271	航天信息	3,205,600.73	0.24

注:上述卖出金额为卖出成交金额(成交单价乘以成交数量),不包括相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	274,428,249.46
卖出股票收入(成交)总额	286,349,345.84

注:上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额(成交单价乘以成交数量),不包括相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	59,994,000.00	4.48
	其中:政策性金融债	59,994,000.00	4.48
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	967,682,000.00	72.20
6	中期票据	324,789,000.00	24.23
7	可转债	2,193,263.56	0.16
8	其他	–	–
9	合计	1,354,658,263.56	101.07

8.6 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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	041453019	14恒逸CP002	1,000,000	101,100,000.00	7.54
2	041460117	14广汇集团CP002	1,000,000	100,340,000.00	7.49
3	041459073	14广汇能源CP002	1,000,000	99,540,000.00	7.43
4	1282040	12荣盛MTN1	850,000	85,748,000.00	6.40
5	041460098	14汉当科CP001	800,000	79,728,000.00	5.95

8.7 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

金额单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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

金额单位:人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)

注:本基金本报告期末未持有权证。

8.10报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1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持有股指期货。

8.10.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货的投资应符合基金合同规定的保本策略和投资目标。本基金在风险可控的前提下,投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约,进行风险资产的市值管理,改善组合的风险收益特征。

8.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1本期国债期货投资政策

报告期,本基金未投资国债期货。

8.11.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明
公允价值变动总额合计(元)					–
国债期货投资本期收益(元)					–
国债期货投资本期公允价值变动(元)					–

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3本期国债期货投资评价

本基金未参与国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

报告期,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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	91,302.84
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	32,629,599.33
5	应收申购款	300.00
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	32,721,202.17

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600754	锦江股份	3,256,867.44	0.24	临时停牌
2	002675	东诚药业	2,498,011.62	0.19	临时停牌
3	000009	中国宝安	14,245.00	0.00	临时停牌

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
16,044	84,548.28	49,756,524.00	3.67%	1,306,736,043.57	96.33%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	552,726.29	0.0408%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2014年8月27日)基金份额总额	1,442,871,559.51
本报告期期初基金份额总额	–
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	371,045.44
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	86,750,037.38
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)	–
本报告期期末基金份额总额	1,356,492,567.57

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。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2014年7月16日,张丽女士新任基金管理人督察长、毛伟先生离任基金管理人督察长职务;2014年12月18日,李修辞先生离任基金管理人副总经理职务。除上述人事调整以外,本报告期内基金管理人无其他重大人事变动。

本报告期内,基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内,无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期,本基金在保本周期中,对资产配置严格按照公司开发的保本模型进行优化动态调整,确保投资者的投资本金的安全性。同时,本基金通过积极稳健的收益资产投资策略,竭力为基金资产获取更高的增值回报,未发生投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为50,000元人民币。截至本报告期末,该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	212,849,824.89	37.96%	151,208.55	37.96%	–
申银万国	1	–	–	–	–	–
国金证券	1	125,203,944.53	22.33%	88,945.32	22.33%	–
东方证券	1	–	–	–	–	–
方正证券	1	155,785,924.14	27.78%	110,661.83	27.78%	–
银河证券	1	–	–	–	–	–
华创证券	1	66,902,921.74	11.93%	47,528.03	11.93%	–

注:1.本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基字[2007]48号)的有关规定要求,本基金管理人在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后,向多家券商租用了基金专用交易席位。

(1) 基金专用交易席位的选择标准如下:

① 经营行为规范,在近一年内未出现重大违规行为;

② 财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定;

③ 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施满足基金进行证券交易需要;

④ 具有较强的研究能力,能及时、全面地提供高质量的宏观、策略、行业、上市公司、证券市场研究、固定收益研究、数量研究等报告及信息资讯服务;

⑤交易佣金收取标准合理。

(2)基金专用交易席位的选择程序如下:

① 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构;

② 本基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

2.本基金合同于2014年8月27日正式生效,本期新增东方证券、方正证券、国金证券、华创证券、申银万国、银河证券、中信证券及中信证券(山东)各一个交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券	–	–	4,097,200,000.00	20.90%	–	–
申银万国	–	–	–	–	–	–
国金证券	–	–	12,440,900,000.00	63.46%	–	–
东方证券	–	–	–	–	–	–
方正证券	1,926,888.10	100.00%	3,065,000,000.00	15.64%	–	–
银河证券	–	–	–	–	–	–
华创证券	–	–	–	–	–	–

§12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

国金通用基金管理有限公司
2015年3月30日