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

国金鑫安保本混合型证券投资基金

2015 年度 报告摘要

2015年12月31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	1,681,481,167.04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,对资产配置严格按限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	2015年	2014年8月27日(基金合同生效日)~2014年12月31日	2013年
本期已实现收益	107,112,934.39	−17,579,365.54	–
本期利润	118,542,064.82	−17,008,862.56	–
加权平均基金份额本期利润	0.0905	−0.0119	–
本期基金份额净值增长率	8.95%	−1.20%	–
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	0.0678	−0.0122	–
期末基金资产净值	1,705,950,037.97	1,340,256,635.15	–
期末基金份额净值	1.015	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.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(估值处理板块为有规定约除外)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。

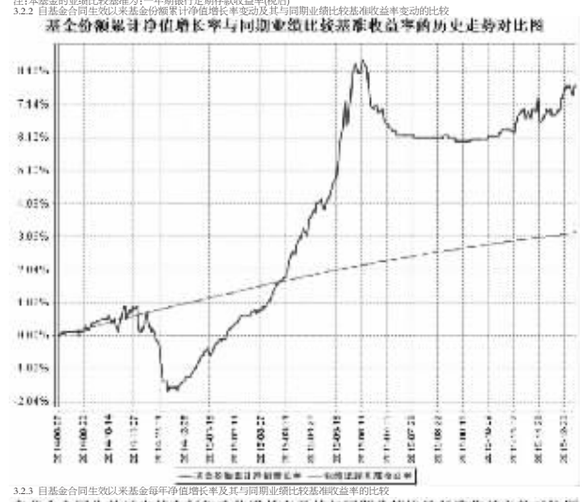
3.2 基金净值表现

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

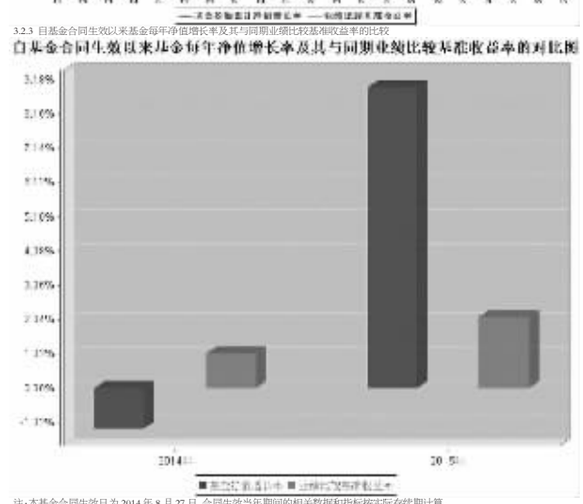
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.50%	0.15%	0.39%	0.01%	1.11%	0.14%
过去六个月	0.60%	0.11%	0.87%	0.00%	−0.27%	0.11%
过去一年	8.95%	0.15%	2.12%	0.01%	6.83%	0.14%
自基金合同生效起至今	7.64%	0.16%	3.17%	0.01%	4.47%	0.15%

注:本基金的业绩比较基准为:一年期银行定期存款收益率(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



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2014年8月27日,合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注:本基金于本报告期内及上年度可比期间2014年8月27日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间均未进行利润分配。

§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、苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司、广东宝丽华新能源股份有限公司、浦金投资控股有限公司,股权比例分别为49%、19.5%、19.5%和12%。截至2015年12月31日,国金基金管理有限公司共管理9只开放式基金——国金国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、国金金鹏通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、国金鑫益灵活配置混合型证券投资基金、国金众赢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	2014年8月27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月起任国金鑫发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。
彭俊斌	基金经理	2015年5月5日	–	4	彭俊斌先生,清华大学博士。2008年5月至2011年4月在北京控制工程研究所任副主任工艺师;2011年5月至2012年6月在民生证券股份有限公司任电子行业分析师;2012年7月加入国金基金管理有限公司,任投资研究部高级分析师;2014年11月起任国金基金管理有限公司权益投资事业部副总经理兼基金经理助理。2015年4月起任国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理;2015年5月起任国金鑫安保本混合型证券投资基金基金经理。
滕祖光	基金经理	2015年8月18日	–	9	滕祖光先生,中央财经大学硕士。2003年至2009年先后历任中国工商银行深圳分行国际业务员、中大期货经纪有限公司期货交易员、和讯信息科技有限公司高级编辑、国投瑞银基金有限公司证券交易员。2009年11月加入国金基金管理有限公司,任高级交易员。2014年4月起被增聘为国金鑫盈货币市场证券投资基金基金经理、国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。2015年8月起被增聘为国金鑫安保本混合型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

本基金管理人在报告期内严格遵守《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。本基金无违规情况。

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《国金基金管理有限公司公平交易管理办法》、《投资管理部运动中心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。该公平交易管理方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,同时包括投资、研究分析、投资决策、交易执行(集中竞价及非集中竞价交易)、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;设立独立的合规风控部,对研究、投资、交易业务的公平交易进行监控、分析、纠错、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,并根据研究结果建议及维护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,合规风控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:合规风控部利用公平交易系统对不同投资组合之间的顾后行为交易及交易机会、交易结果等进行事后分析,(6)报告备案:合规风控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,至少按照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,公司交易各相关部门对相关环节予以不断完善,以确保公平交易的有效实施。(9)监督检查:合规风控部监督稽核人员根据实际情况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高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,并通过投资决策委员会、投资组合经理权责清晰的投资决策流程,实现投资组合投资信息的管理及决策制度,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信息实行授信信息采取保密措施。

在交易执行控制方面,本基金管理人实行集中交易制度,基金交易部监用公司系统中设置的公平交易功能模块,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,按照公司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九只基金产品,其中四只混合型基金、两只指数基金、三只债基,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控制制度,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,对资产配置严格按限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

本报告期,本基金份额净值增长率为8.95%,同期业绩比较基准收益率为2.12%。

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年经济形势总体下行,下半年"稳增长"政策加码,但受汇率以及全球经济疲弱的影响,经济整体仍处于下滑中,在4季度略有趋稳迹象。但由于消费持续疲软以及政策刺激效应的弱化,经济趋稳的基础不牢固,宏观经济形势不乐观。经济主要指标仍旧未见明显好转,投资增速仍然趋缓,消费增速亦不见明显增长,出口仍旧围堵。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,人民币持续贬值的基础不存在,市场在经历了大跌后投资者情绪也在逐步回升,虽然全市场很难出现较大趋势性机会,但个别行业仍存结构性机会。

4.6 管理人内部有关本基金监察稽核工作情况

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合规风控部对基金投资运作、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,及时发现稽核问题并提出整改意见,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,及时制定了相关管理制度,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109项,涵盖公司主要业务范围。

(2)强化合规教育和培训。本基金管理人及其特约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,同时以组织公司巡培训、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宣传意识。

(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、合规、反洗钱工作、基金投资运作、交易(包括公平交易)等方面进行检查,对于检查中发现的问题,通过监察稽核报告的形式,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,强化了内部控制流程,提高了业务部门及人员的风险识水平,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管理人员设定专门的估值模型定价的结果,经投资决策委员会人员复核后,报公司总经理,督促改进跟踪改进效果。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,强化了内部控制流程,提高了业务部门及人员的风险识水平,从而较好地预防风险。

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

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 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

2015年度,中国光大银行股份有限公司在国金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》、《公开募集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

2015年度,中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《公开募集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基金管理有限公司编制的"国金鑫安保本混合型证券投资基金2015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(2016)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鑫安保本混合型证券投资基金财务报表,包括2015年12月31日的资产负债表和2015年度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,公允反映了国金鑫安保本混合型证券投资基金2015年12月31日的财务状况以及2015年度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	2016年3月25日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:国金鑫安保本混合型证券投资基金

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资 产:			
银行存款		45,716,828.51	2,311,879.91
结算备付金		2,158,213.81	7,281,302.37
存出保证金		268,042.88	91,302.84
交易性金融资产		1,193,448,447.06	1,367,065,025.62
其中:股票投资		201,847,508.71	12,406,762.06
基金投资		–	–
债券投资		991,600,938.35	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		447,951,221.50	40,000,380.00
应收证券清算款		382,064.29	–
应收利息		21,159,925.51	32,629,599.33
应收股利		–	–
应收申购款		4,071.04	300.00
递延所得税资产		–	–
其他资产		–	–
资产总计		1,711,088,814.60	1,449,379,790.07
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014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		555,351.98	2,575,012.65
应付管理人报酬		2,169,455.69	1,737,174.63
应付托管费		289,260.77	231,623.28
应付销售服务费		867,782.28	694,869.86
应付交易费用		818,789.00	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		438,136.91	169,993.72
负债合计		5,138,776.63	109,123,154.92
所有者权益:			
实收基金		1,585,560,959.43	1,356,492,567.57
未分配利润		120,389,078.54	−16,235,932.42
所有者权益合计		1,705,950,037.97	1,340,256,635.15
负债和所有者权益总计		1,711,088,814.60	1,449,379,790.07

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值人民币1.015元,基金份额总额1,681,481,167.04份。

7.2 利润表

会计主体:国金鑫安保本混合型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年8月27日(基金合同生效日)至2014年12月31日
一、收入		158,057,835.71	−3,967,146.15
1.利息收入		54,788,007.58	21,270,972.66
其中:存款利息收入		3,225,618.22	5,866,781.54
债券利息收入		39,500,786.19	7,836,069.71
资产支持证券利息收入		–	–
买入返售金融资产收入		12,029,995.42	7,568,121.41
其他利息收入		31,607.75	–
2.投资收益(损失以"-"填列)		88,826,030.15	−27,098,432.55
其中:股票投资收益		82,785,317.25	22,198,764.91
基金投资收益		–	–
债券投资收益		5,371,291.03	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		133,500.00	−49,823,820.00
股利收益		535,921.87	62,516.48
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		11,429,130.43	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)		3,014,667.55	1,289,810.76
减:二、费用		39,515,770.89	13,041,716.41
1.管理人报酬	7.4.8.2.1	19,520,524.99	7,387,377.28
2.托管费	7.4.8.2.2	2,602,736.68	984,983.65
3.销售服务费	7.4.8.2.3	8,041,531.90	2,954,950.90
4.交易费用		2,134,820.34	872,503.21
5.利息支出		6,771,528.63	677,279.92
其中:卖出回购金融资产支出		6,771,528.63	677,279.92
6.其他费用		444,628.35	164,621.45
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		118,542,064.82	−17,008,862.56
减:所得税费用		–	–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		118,542,064.82	−17,008,862.56

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:国金鑫安保本混合型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015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)	1,356,492,567.57	−16,235,932.42	1,340,256,635.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	–	118,542,064.82	118,542,064.82
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)	229,068,391.86	18,082,946.14	247,151,338.00
其中:1.基金申购款	1,467,442,457.33	87,876,449.96	1,555,318,907.29
2.基金赎回款	−1,238,374,065.47	−69,793,503.82	−1,308,167,569.29
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)	1,585,560,959.43	120,389,078.54	1,705,950,037.97

项目	上年度可比期间 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

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 斌武鹏 于晓辉

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 基本情况

国金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)验证并出具了(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)购买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《会计科目设置及财务报表》》、《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>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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2015年12月31日的财务状况以及2015年度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》和其他相关规定所规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

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24号《关于发布<中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准>的通知》的规定,自2015年3月24日起,交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

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(2014年度:无)。

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2016年3月25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	201,847,508.71	11.80
	其中:股票	201,847,508.71	11.80
2	固定收益投资	991,600,938.35	57.95
	其中:债券	991,600,938.35	57.95
	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	447,951,221.50	26.18
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	407,951,041.50	23.84
6	银行存款和结算备付金合计	47,875,042.32	2.80
7	其他各项资产	21,814,103.72	1.27
8	合计	1,711,088,814.60	100.00

8.2 期初权益分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	125,750,230.71	7.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,901,431.00	0.35
E	建筑业	764,359.95	0.04
F	批发和零售业	4,195,518.49	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业