

# 国金通用鑫安保本混合型证券投资基金 2015 年半年度报告

2015 年 6 月 30 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

送出日期：2015 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 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。本半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 8 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未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 2015 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                       | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示 .....                                | 2         |
| 1.2 目录 .....                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b> .....                          | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况 .....                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明 .....                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 .....                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式 .....                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料 .....                              | 6         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                 | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 .....                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现 .....                              | 7         |
| 3.3 其他指标 .....                                | 8         |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                         | <b>8</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 .....                        | 8         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....              | 9         |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....                 | 10        |
| 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 .....             | 11        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....             | 11        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....                | 11        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....                 | 12        |
| 4.8 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 .....       | 12        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                         | <b>12</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....                  | 12        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 ..... | 12        |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....      | 12        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....               | <b>13</b> |
| 6.1 资产负债表 .....                               | 13        |
| 6.2 利润表 .....                                 | 14        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....                      | 15        |
| 6.4 报表附注 .....                                | 16        |
| <b>§7 投资组合报告</b> .....                        | <b>39</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况 .....                          | 39        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....                      | 39        |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....       | 40        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                     | 43        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                    | 45        |
| 7.6 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 .....      | 45        |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....   | 45        |
| 7.8 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 .....   | 45        |
| 7.9 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 .....      | 46        |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....               | 46        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....               | 46        |

|   |           |
|---|-----------|
| 7.12 投资组合报告附注 .....                     | 46        |
| <b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>               | <b>47</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....             | 47        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....          | 48        |
| 8.3 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 ..... | 48        |
| <b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>               | <b>48</b> |
| <b>§10 重大事件揭示 .....</b>                 | <b>48</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                  | 48        |
| 10.2 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 .....  | 48        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....       | 49        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                    | 49        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....             | 49        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....     | 49        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....            | 49        |
| 10.8 其他重大事件 .....                       | 50        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>         | <b>52</b> |
| <b>§12 备查文件目录 .....</b>                 | <b>52</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                       | 52        |
| 12.2 存放地点 .....                         | 52        |
| 12.3 查阅方式 .....                         | 52        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|              |                    |
|--------------|--------------------|
| 基金名称         | 国金通用鑫安保本混合型证券投资基金  |
| 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   | 1,157,989,759.93 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                  |
| 注册地址   |      | 北京市怀柔区府前街三号楼 3-6                | 北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心 |
| 办公地址   |      | 北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 层 | 北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心        |
| 邮政编码   |      | 100089                          | 100033                        |
| 法定代表人  |      | 尹庆军                             | 唐双宁                           |

## 2.4 信息披露方式

|                      |                         |
|----------------------|-------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称       | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》。 |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.gfund.com           |
| 基金半年度报告备置地点          | 基金管理人和基金托管人的办公场所        |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称           | 办公地址                            |
|--------|--------------|---------------------------------|
| 注册登记机构 | 国金通用基金管理有限公司 | 北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 层 |
| 基金保证人  | 瀚华担保股份有限公司   | 北京市朝阳区东三环中路 1 号环球金融中心东塔 13F     |

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 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 | 报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日) |
|---------------|---------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 100,987,375.28                        |
| 本期利润          | 103,588,861.26                        |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0820                                |
| 本期加权平均净值利润率   | 7.98%                                 |
| 本期基金份额净值增长率   | 8.30%                                 |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2015 年 6 月 30 日)                 |
| 期末可供分配利润      | 80,831,658.39                         |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0698                                |

|                     |                         |
|---------------------|-------------------------|
| 期末基金资产净值            | 1,239,282,841.83        |
| 期末基金份额净值            | 1.070                   |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b> | <b>报告期末(2015年6月30日)</b> |
| 基金份额累计净值增长率         | 7.00%                   |

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。

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。

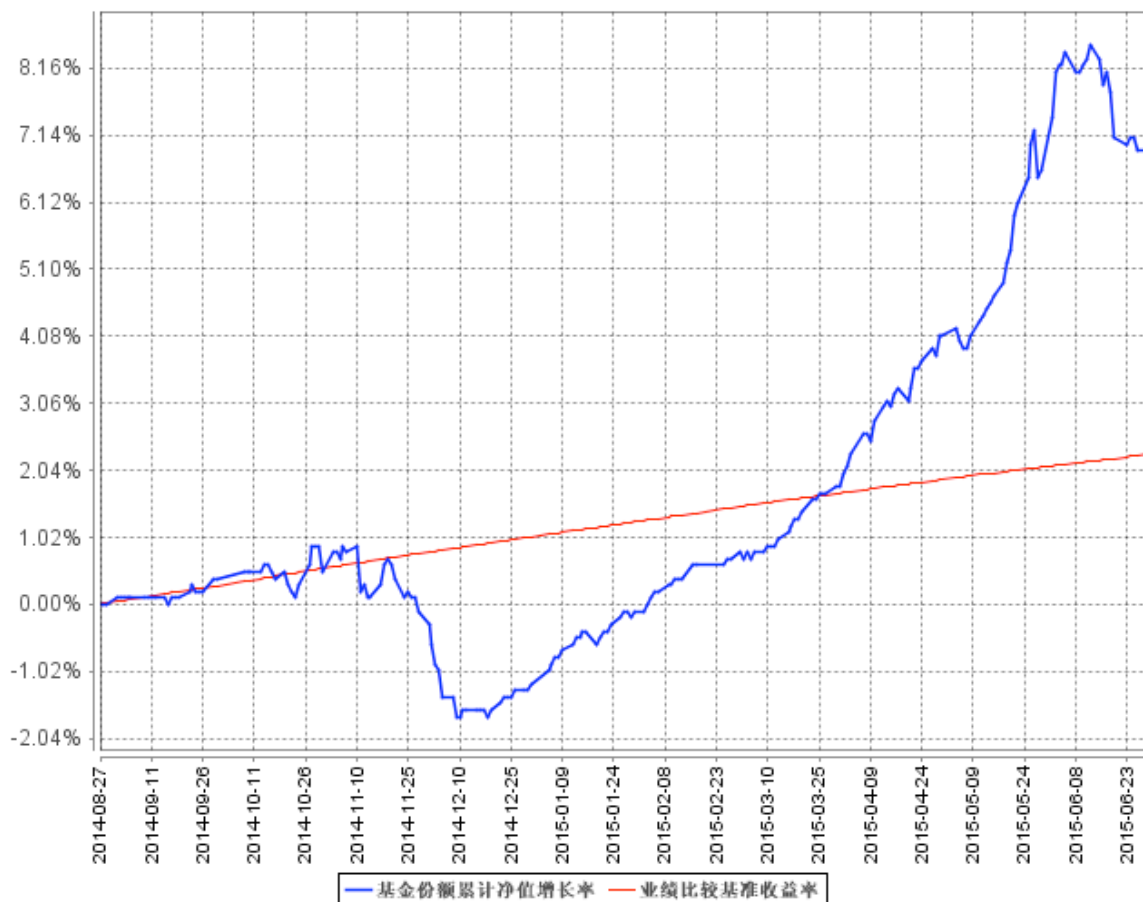
## 3.2 基金净值表现

### 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   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去一个月      | 0.38%    | 0.31%       | 0.19%      | 0.01%         | 0.19% | 0.30% |
| 过去三个月      | 5.11%    | 0.24%       | 0.58%      | 0.01%         | 4.53% | 0.23% |
| 过去六个月      | 8.30%    | 0.18%       | 1.24%      | 0.01%         | 7.06% | 0.17% |
| 自基金合同生效起至今 | 7.00%    | 0.18%       | 2.29%      | 0.01%         | 4.71% | 0.17% |

### 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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、图示日期为 2014 年 8 月 27 日至 2015 年 6 月 30 日。

2、本基金基金合同生效日为 2014 年 8 月 27 日。

### 3.3 其他指标

注：无

## § 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、涌金投资控股有限公司，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 2015 年 06 月 30 日，国金基金管理有限公司共管理 8 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、国金通用金腾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、国金通用上证 50 指数分级证券投资基金、国金通用鑫运灵活配置混合型证券投资基金、国金通用众赢货币市场证券投资基金。

#### 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<br>理（助理）期限 |          | 证券从<br>业年限 | 说明   |
|-----|----------|---------------------|----------|------------|--|
|     |          | 任职日期                | 离任<br>日期 |            |  |
| 宫雪  | 基金<br>经理 | 2014 年 8 月<br>27 日  | -        | 6          | 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 月至今在国金通用基金管理有限公司，历任产品经理、行业分析师、产品与金融工程部副总经理、基金经理。2013 年 7 月起任国金通用沪深 300 指数分级证券投资基金基金经理；2014 年 8 月起任国金通用鑫安保本混合型证券投资基金基金经理；2015 年 5 月起任国金通用上证 50 指数分级证券投资基金基金经理；2015 年 6 月起任国金通用鑫运灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |
| 彭俊斌 | 基金<br>经理 | 2015 年 4 月<br>17 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 月加入国金通用基金管理有限公司，任投资研究部高级分析师；2014 年 11 月起任国金通用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 月起任国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金、2015 年 5 月起任国金通用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,报告期内严格执行公司相关制度,严格控制旗下非指数型投资组合参与交易所公开竞价同日反向交易,未发现存在异常交易行为。

## 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配置策略，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 8.30%，同期业绩比较基准收益率为 1.24%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2 季度投资增速下降趋势有所放缓，消费增速出现企稳，出口的降幅也在收窄，三大需求初步改善显示经济正逐步逼近周期底部，企稳迹象初显。虽然货币持续宽松，但由于对场外配资杠杆的严格监管，导致证券市场短期出现了较大幅度的调整，A 股的估值也大幅回落，市场整体波动率大幅提升。但货币环境持续宽松，财政支持也在加大，企业的融资成本已较之前有了较为显著的降低，随着改革的逐步推进和落地，有助于市场整体的回升。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，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。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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 年上半年，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》、《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

2015 年上半年，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》、《公开募集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 托管人对本半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“国金通用鑫安保本混合型证券投资基金 2015 年半年度报告”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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 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：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2015 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2014 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 102,122,612.61                 | 2,311,879.91                     |
| 结算备付金           |            | 2,475,384.96                   | 7,281,302.37                     |
| 存出保证金           |            | 233,279.34                     | 91,302.84                        |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 402,988,332.20                 | 1,367,065,025.62                 |
| 其中：股票投资         |            | 44,085,484.90                  | 12,406,762.06                    |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 358,902,847.30                 | 1,354,658,263.56                 |
| 资产支持证券投资        |            | -                              | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | 740,001,735.00                 | 40,000,380.00                    |
| 应收证券清算款         |            | -                              | -                                |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 7,459,782.06                   | 32,629,599.33                    |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | 10,050.00                      | 300.00                           |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 1,255,291,176.17               | 1,449,379,790.07                 |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2015 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2014 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>     |            |                                |                                  |
| 短期借款            |            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                              | -                                |
| 衍生金融负债          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                              | 103,209,365.18                   |
| 应付证券清算款         |            | 8,897,125.31                   | -                                |
| 应付赎回款           |            | 3,647,307.49                   | 2,575,012.65                     |
| 应付管理人报酬         |            | 1,555,387.04                   | 1,737,174.63                     |
| 应付托管费           |            | 207,384.94                     | 231,623.28                       |
| 应付销售服务费         |            | 622,154.81                     | 694,869.86                       |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 758,323.59                     | 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          | 6.4.7.8  | 320,651.16       | 169,993.72       |
| 负债合计          |          | 16,008,334.34    | 109,123,154.92   |
| <b>所有者权益：</b> |          |                  |                  |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 1,157,989,759.93 | 1,356,492,567.57 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 81,293,081.90    | -16,235,932.42   |
| 所有者权益合计       |          | 1,239,282,841.83 | 1,340,256,635.15 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 1,255,291,176.17 | 1,449,379,790.07 |

注：1. 报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.070 元，基金份额总额 1,157,989,759.93 份。

2. 上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。

## 6.2 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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                   | 附注号        | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至<br>2015 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2014 年 1 月 1 日至<br>2014 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|--|---|
| <b>一、收入</b>           |            | 125,198,117.06                           | -   |
| 1.利息收入                |            | 32,632,790.03                            | -   |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11   | 556,359.64                               | -   |
| 债券利息收入                |            | 25,768,841.45                            | -   |
| 资产支持证券利息收入            |            | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入            |            | 6,307,588.94                             | -   |
| 其他利息收入                |            | -  | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |            | 88,115,480.00                            | -   |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12   | 83,193,895.45                            | -   |
| 基金投资收益                |            | -  | -   |
| 债券投资收益                | 6.4.7.13   | 4,348,093.14                             | -   |
| 资产支持证券投资收益            | 6.4.7.13.1 | -  | -   |
| 贵金属投资收益               | 6.4.7.14   | -  | -   |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.15   | 133,500.00                               | -   |
| 股利收益                  | 6.4.7.16   | 439,991.41                               | -   |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17   | 2,601,485.98                             | -   |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -  | -   |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.18   | 1,848,361.05                             | -   |
| <b>减：二、费用</b>         |            | 21,609,255.80                            | -   |

|                            |            |                |   |
|----------------------------|------------|----------------|---|
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 9,669,375.42   | - |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 1,289,250.03   | - |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 3,867,750.19   | - |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.19   | 1,138,437.38   | - |
| 5. 利息支出                    |            | 5,416,181.80   | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 5,416,181.80   | - |
| 6. 其他费用                    | 6.4.7.20   | 228,260.98     | - |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 103,588,861.26 | - |
| 减：所得税费用                    |            | -              | - |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 103,588,861.26 | - |

### 6.3 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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 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（本期利润）               | -  | 103,588,861.26 | 103,588,861.26   |
| 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）      | -198,502,807.64                            | -6,059,846.94  | -204,562,654.58  |
| 其中：1.基金申购款                             | 4,794,664.71                               | 111,874.97     | 4,906,539.68     |
| 2.基金赎回款                                | -203,297,472.35                            | -6,171,721.91  | -209,469,194.26  |
| 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）                        | 1,157,989,759.93                           | 81,293,081.90  | 1,239,282,841.83 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日 |                |                  |





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）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。

#### 6.4.2 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。

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。

### 6.4.3 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 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

本基金本报告期无其他重要的会计政策。

#### 6.4.4.1 会计年度

-

#### 6.4.4.2 记账本位币

-

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

-

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

-

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

-

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

-

#### 6.4.4.7 实收基金

-

#### 6.4.4.8 损益平准金

-

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

-

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

-

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

-

#### 6.4.4.12 分部报告

-

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

-

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 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 27 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。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的会计差错更正。

### 6.4.6 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《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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2015 年 6 月 30 日 |
|----|------------------------|
|----|------------------------|

|                |                |
|----------------|----------------|
| 活期存款           | 102,122,612.61 |
| 定期存款           | -              |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | -              |
| 其他存款           | -              |
| 合计：            | 102,122,612.61 |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2015 年 6 月 30 日 |                |                |
|---------------|------------------------|----------------|----------------|
|               | 成本                     | 公允价值           | 公允价值变动         |
| 股票            | 42,320,432.00          | 44,085,484.90  | 1,765,052.90   |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                      | -              | -              |
| 债券            | 交易所市场                  | 1,604,000.00   | 1,822,847.30   |
|               | 银行间市场                  | 355,891,911.24 | 357,080,000.00 |
|               | 合计                     | 357,495,911.24 | 358,902,847.30 |
| 资产支持证券        | -                      | -              | -              |
| 基金            | -                      | -              | -              |
| 其他            | -                      | -              | -              |
| 合计            | 399,816,343.24         | 402,988,332.20 | 3,171,988.96   |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2015 年 6 月 30 日 |           |
|------------|------------------------|-----------|
|            | 账面余额                   | 其中：买断式逆回购 |
| 买入返售证券_银行间 | 490,001,735.00         | -         |
| 买入返售证券     | 250,000,000.00         | -         |
| 合计         | 740,001,735.00         | -         |

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2015年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息   | 33,988.90         |
| 应收定期存款利息   | -                 |
| 应收其他存款利息   | -                 |
| 应收结算备付金利息  | 1,113.90          |
| 应收债券利息     | 7,051,895.17      |
| 应收买入返售证券利息 | 372,679.09        |
| 应收申购款利息    | -                 |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                 |
| 其他         | 105.00            |
| 合计         | 7,459,782.06      |

**6.4.7.6 其他资产**

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2015年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 728,971.96        |
| 银行间市场应付交易费用 | 29,351.63         |
| 合计          | 758,323.59        |

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2015年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | 83,829.81         |
| 预提费用        | 230,770.62        |
| 指数使用费       | 6,050.73          |
| 合计          | 320,651.16        |

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |                  |
|---------------|---------------------------------------|------------------|
|               | 基金份额 (份)                              | 账面金额             |
| 上年度末          | 1,356,492,567.57                      | 1,356,492,567.57 |
| 本期申购          | 4,794,664.71                          | 4,794,664.71     |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -203,297,472.35                       | -203,297,472.35  |
| - 基金拆分/份额折算前  | -                                     | -                |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | -                                     | -                |
| 本期申购          | -                                     | -                |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -                                     | -                |
| 本期末           | 1,157,989,759.93                      | 1,157,989,759.93 |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分         | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 上年度末           | -16,598,254.99 | 362,322.57    | -16,235,932.42 |
| 本期利润           | 100,987,375.28 | 2,601,485.98  | 103,588,861.26 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -3,557,461.90  | -2,502,385.04 | -6,059,846.94  |
| 其中：基金申购款       | 58,945.87      | 52,929.10     | 111,874.97     |
| 基金赎回款          | -3,616,407.77  | -2,555,314.14 | -6,171,721.91  |
| 本期已分配利润        | -              | -             | -              |
| 本期末            | 80,831,658.39  | 461,423.51    | 81,293,081.90  |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
|           | 活期存款利息收入                              |
| 定期存款利息收入  | -                                     |
| 其他存款利息收入  | -                                     |
| 结算备付金利息收入 | 26,462.52                             |
| 其他        | 1,634.09                              |
| 合计        | 556,359.64                            |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期                              |
|------------|---------------------------------|
|            | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
| 卖出股票成交总额   | 447,581,173.61                  |
| 减：卖出股票成本总额 | 364,387,278.16                  |
| 买卖股票差价收入   | 83,193,895.45                   |

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                            | 本期                   |
|-------------------------------|----------------------|
|                               | 2015年1月1日至2015年6月30日 |
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 4,348,093.14         |
| 债券投资收益——赎回差价收入                | -                    |
| 债券投资收益——申购差价收入                | -                    |
| 合计                            | 4,348,093.14         |

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期                   |
|------------------------|----------------------|
|                        | 2015年1月1日至2015年6月30日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 1,422,263,579.42     |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,372,787,757.59     |
| 减：应收利息总额               | 45,127,728.69        |
| 买卖债券差价收入               | 4,348,093.14         |

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券赎回差价收入。

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券申购差价收入。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。



**6.4.7.14 贵金属投资收益****6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

单位：人民币元

| 项目       | 本期收益金额<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |
|----------|--------------------------------|
| 股指期货投资收益 | 133,500.00                     |

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 439,991.41                 |
| 基金投资产生的股利收益 | -                          |
| 合计          | 439,991.41                 |

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |
|------|----------------------------|
|------|----------------------------|

|            |              |
|------------|--------------|
| 1. 交易性金融资产 | 2,601,485.98 |
| ——股票投资     | -364,040.63  |
| ——债券投资     | 2,965,526.61 |
| ——资产支持证券投资 | -            |
| ——贵金属投资    | -            |
| ——其他       | -            |
| 2. 衍生工具    | -            |
| ——权证投资     | -            |
| 3. 其他      | -            |
| 合计         | 2,601,485.98 |

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期                   |
|---------|----------------------|
|         | 2015年1月1日至2015年6月30日 |
| 基金赎回费收入 | 1,848,361.05         |
| 合计      | 1,848,361.05         |

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购费补差和赎回费两部分构成，其中不低于赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期                   |
|-----------|----------------------|
|           | 2015年1月1日至2015年6月30日 |
| 交易所市场交易费用 | 1,128,636.73         |
| 银行间市场交易费用 | 8,837.50             |
| 股指期货费用    | 963.15               |
| 合计        | 1,138,437.38         |

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期                   |
|-----------|----------------------|
|           | 2015年1月1日至2015年6月30日 |
| 审计费用      | 39,671.58            |
| 信息披露费     | 148,765.71           |
| 中债债券账户维护费 | 9,000.00             |
| 银行费用      | 10,719.29            |
| 指数使用费     | 8,104.40             |

|          |            |
|----------|------------|
| 上清所帐户维护费 | 12,000.00  |
| 合计       | 228,260.98 |

#### 6.4.7.21 分部报告

无

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称        | 与本基金的关系               |
|--------------|-----------------------|
| 国金基金管理有限公司   | 基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构 |
| 国金证券股份有限公司   | 基金管理人股东、基金代销机构        |
| 中国光大银行股份有限公司 | 基金托管人、基金代销机构          |

注：关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |                      | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |                      |
|-------|----------------------------|----------------------|---------------------------------|----------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期股票<br>成交总额的<br>比例 | 成交金额                            | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例 |
| 国金证券  | 244,739,778.38             | 29.79%               | -                               | -                    |

注：本基金基金合同自 2014 年 8 月 27 日起生效，无上年度可比期间数据。

## 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |                      | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |                      |
|-------|----------------------------|----------------------|---------------------------------|----------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期债券<br>成交总额的<br>比例 | 成交金额                            | 占当期债券<br>成交总额的比<br>例 |
| 国金证券  | 8,504,788.10               | 76.18%               | -                               | -                    |

注：1. 本基金基金合同自 2014 年 8 月 27 日起生效，无上年度可比期间数据。

## 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |                            | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |                            |
|-------|----------------------------|----------------------------|---------------------------------|----------------------------|
|       | 回购成交金额                     | 占当期债券<br>回购<br>成交总额的<br>比例 | 回购成交金额                          | 占当期债券<br>回购<br>成交总额的比<br>例 |
| 国金证券  | 3,530,000,000.00           | 85.27%                     | -                               | -                          |

注：1. 本基金基金合同自 2014 年 8 月 27 日起生效，无上年度可比期间数据。

### 6.4.10.1.2 权证交易

注：1. 本基金本报告期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

2. 本基金基金合同自 2014 年 8 月 27 日起生效，无上年度可比期间数据。

### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民

币元

| 关联方名称 | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月30日      |                |            |                  |
|-------|---------------------------------|----------------|------------|------------------|
|       | 当期<br>佣金                        | 占当期佣金<br>总量的比例 | 期末应付佣金余额   | 占期末应付佣<br>金总额的比例 |
| 国金证券  | 173,860.97                      | 29.28%         | 262,806.29 | 36.05%           |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |                |            |                  |
|       | 当期<br>佣金                        | 占当期佣金<br>总量的比例 | 期末应付佣金余额   | 占期末应付佣<br>金总额的比例 |

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务

务。

3. 本基金基金合同自 2014 年 8 月 27 日起生效，无上年度可比期间数据。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月<br>30 日 | 上年度可比期间<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日 |
|-----------------|--|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 9,669,375.42                             | -  |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 3,324,826.73                             | -  |

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：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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

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。

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。

3. 本基金基金合同自 2014 年 8 月 27 日起生效，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,289,250.03                          | -  |

注：1. 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：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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。

2. 本基金基金合同自 2014 年 8 月 27 日起生效，无上年度可比期间数据。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费<br>各关联方名称 | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日      |
|-------------------|--|
|                   | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |
| 中国光大银行            | 2,633,990.79                               |
| 国金通用基金管理有限公司      | 97,988.64                                  |
| 国金证券              | 415,842.56                                 |
| 合计                | 3,147,821.99                               |
| 获得销售服务费<br>各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日 |
|                   | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |

注：1. 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：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

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

2. 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。

3. 本基金基金合同自 2014 年 8 月 27 日起生效，无上年度可比期间数据。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：1. 本基金本报告期未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（回购）交易。

2. 本基金基金合同自 2014 年 8 月 27 日起生效，无上年度可比期间数据。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：1. 本基金本报告期未发生管理人运用固有资金投资本基金的情况。

2. 本基金基金合同自 2014 年 8 月 27 日起生效，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.4.2 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

注：1. 本基金除管理人之外的其他关联方于报告期末未持有份额。

2. 本基金基金合同自 2014 年 8 月 27 日起生效，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.5 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<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |            | 上年度可比期间<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 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 | 102,122,612.61                        | 528,263.03 | -  | -      |

注：1. 本基金的活期银行存款和部分定期银行存款由基金托管人中国光大银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

2. 本基金基金合同自 2014 年 8 月 27 日起生效，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本会计期间未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 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

| 6.4.12.1.1 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<br>(单位：股) | 期末成本总额     | 期末估值总额     | 备注 |
| 300487               | 蓝晓科技 | 2015 年 6 月 24 日 | 2015 年 7 月 2 日 | 新股流通受限 | 14.83 | 14.83  | 10,700       | 158,681.00 | 158,681.00 | -  |
| 300488               | 恒锋工具 | 2015 年 6 月 25 日 | 2015 年 7 月 1 日 | 新股流通受限 | 20.11 | 20.11  | 6,734        | 135,420.74 | 135,420.74 | -  |
| 300480               | 光力科技 | 2015 年 6 月 25 日 | 2015 年 7 月 2 日 | 新股流通受限 | 7.28  | 7.28   | 7,263        | 52,874.64  | 52,874.64  | -  |

6.4.12.2 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 |
|--------|------|------------|--------|--------|------------|--------|---------|--------------|--------------|----|
| 002398 | 建研集团 | 2015年6月8日  | 筹划重大事项 | 28.49  | 2015年7月1日  | 25.64  | 229,207 | 5,151,395.09 | 6,530,107.43 | -  |
| 600872 | 中炬高新 | 2015年5月4日  | 重大资产重组 | 21.73  | -          | -      | 56,100  | 795,171.04   | 1,212,882.00 | -  |
| 000786 | 北新建材 | 2015年4月10日 | 重大资产重组 | 18.58  | -          | -      | 61,000  | 896,244.92   | 1,133,380.00 | -  |
| 002242 | 九阳股份 | 2015年6月15日 | 筹划重大事项 | 19.45  | 2015年7月7日  | 17.51  | 55,230  | 1,029,432.60 | 1,074,223.50 | -  |
| 300047 | 天源迪科 | 2015年6月3日  | 筹划重大事项 | 35.88  | 2015年7月30日 | 32.29  | 28,800  | 700,775.52   | 1,033,344.00 | -  |
| 002226 | 江南化工 | 2015年6月8日  | 筹划重大事项 | 13.18  | -          | -      | 67,600  | 770,462.22   | 890,968.00   | -  |
| 002191 | 劲嘉股份 | 2015年6月18日 | 筹划重大事项 | 19.22  | -          | -      | 45,200  | 559,748.38   | 868,744.00   | -  |
| 300113 | 顺网科技 | 2015年5月5日  | 筹划重大事项 | 57.70  | 2015年8月6日  | 51.93  | 10,600  | 451,904.00   | 611,620.00   | -  |
| 300195 | 长荣股份 | 2015年6月23日 | 筹划重大事项 | 31.96  | 2015年8月24日 | 28.76  | 14,700  | 588,917.34   | 469,812.00   | -  |
| 002238 | 天威视讯 | 2015年6月29日 | 筹划重大事项 | 23.76  | -          | -      | 18,770  | 423,677.22   | 445,975.20   | -  |
| 000708 | 大冶特钢 | 2015年5月13日 | 重大资产重组 | 13.92  | -          | -      | 21,200  | 256,305.44   | 295,104.00   | -  |



### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人的风险管理政策是通过事前充分到位的防范、事中实时有效的过程控制、事后完备可追踪的检查和反馈，将风险管理贯穿于投研运作的整个流程，从而使基金投资风险可测、可控、可承担，有效防范和化解投研业务的市场风险、信用风险、流动性风险及操作风险。

本基金管理人建立了董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险管理组织体系，合规风控部风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

董事会负责公司整体风险的预防和控制，审核、监督公司风险控制制度的有效执行。董事会下设风险管理委员会，并制定《风险管理委员会议事规则》，规范其组成人员、职责、议事规则等事宜。

督察长负责公司及其投资组合运作的监察稽核工作，向董事会汇报。

总经理负责公司日常经营管理中的风险控制工作。总经理下设风险控制委员会，负责对公司经营及投资组合运作中的风险进行识别、评估和防控，负责对投资组合风险评估报告中提出的重大问题进行讨论和决定应对措施。公司制定《风险控制委员会议事规则》，规范其组成人员、职责、议事规则等事宜。

本基金管理人推行全员风险管理理念，公司各部门是风险管理的一线部门，公司各部门负责人是其部门风险管理的第一责任人，根据公司制度规定的各项作业流程和规范，加强对风险的控制。

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制，基金经理是本基金风险管理的第一责任人。

合规风控部监察稽核团队负责对风险控制制度的建立和落实情况进行监督，在职权范围内独

立履行检查、评价、报告、建议职能；合规风控部风险管理团队独立于投资研究体系，负责落实具体的风险管理政策，对投资进行事前、事中及事后的风险管理。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2015 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2014 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | 65,785,000.00          | 967,682,000.00           |
| A-1 以下 | -                      | -                        |
| 未评级    | 150,882,000.00         | -                        |
| 合计     | 216,667,000.00         | 967,682,000.00           |

注：表中所列示的债券投资为短期融资券及超短期融资券，其中超短期融资券无信用评级。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比

例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的生息资产主要为银行存款等。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2015年<br>6月30<br>日 | 1个月以内          | 1-3个月          | 3个月-1年         | 1-5年         | 5<br>年<br>以<br>上 | 不计息           | 合计               |
|---------------------------|----------------|----------------|----------------|--------------|------------------|---------------|------------------|
| 资产                        |                |                |                |              |                  |               |                  |
| 银行存款                      | 102,122,612.61 | -              | -              | -            | -                | -             | 102,122,612.61   |
| 结算备付金                     | 2,475,384.96   | -              | -              | -            | -                | -             | 2,475,384.96     |
| 交易性金融资产                   | 15,030,000.00  | 110,953,000.00 | 231,798,847.30 | 1,121,000.00 | -                | 44,085,484.90 | 402,988,332.20   |
| 买入返售金融资产                  | 740,000,000.00 | -              | -              | -            | -                | -             | 740,000,000.00   |
| 应收利息                      | -              | -              | -              | -            | -                | 7,459,782.06  | 7,459,782.06     |
| 应收申购款                     | -              | -              | -              | -            | -                | 10,050.00     | 10,050.00        |
| 其他资产                      | -              | -              | -              | -            | -                | 235,014.34    | 235,014.34       |
| 资产总计                      | 859,627,997.57 | 110,953,000.00 | 231,798,847.30 | 1,121,000.00 | -                | 51,790,331.30 | 1,255,291,176.17 |

|                     |                |                |                |                |      |                |                  |
|---------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|------|----------------|------------------|
| 计                   |                |                |                |                |      |                |                  |
| 负债                  |                |                |                |                |      |                |                  |
| 应付证券清算款             | -              | -              | -              | -              | -    | 8,897,125.31   | 8,897,125.31     |
| 应付赎回款               | -              | -              | -              | -              | -    | 3,647,307.49   | 3,647,307.49     |
| 应付管理人报酬             | -              | -              | -              | -              | -    | 1,555,387.04   | 1,555,387.04     |
| 应付托管费               | -              | -              | -              | -              | -    | 207,384.94     | 207,384.94       |
| 应付销售服务费             | -              | -              | -              | -              | -    | 622,154.81     | 622,154.81       |
| 应付交易费用              | -              | -              | -              | -              | -    | 758,323.59     | 758,323.59       |
| 其他负债                | -              | -              | -              | -              | -    | 320,651.16     | 320,651.16       |
| 负债总计                | -              | -              | -              | -              | -    | 16,008,334.34  | 16,008,334.34    |
| 利率敏感度缺口             | 859,627,997.57 | 110,953,000.00 | 231,798,847.30 | 1,121,000.00   | -    | -35,781,996.96 | 1,239,282,841.83 |
| 上年度末<br>2014年12月31日 | 1个月以内          | 1-3个月          | 3个月-1年         | 1-5年           | 5年以上 | 不计息            | 合计               |
| 资产                  |                |                |                |                |      |                |                  |
| 银行存款                | 2,311,879.91   | -              | -              | -              | -    | -              | 2,311,879.91     |
| 结算备付金               | 7,281,302.37   | -              | -              | -              | -    | -              | 7,281,302.37     |
| 交易性金融资产             | -              | 348,760,000.00 | 846,467,263.56 | 159,431,000.00 | -    | -12,406,762.06 | 1,367,065,025.62 |
| 买入返售金融资产            | 40,000,000.00  | -              | -              | -              | -    | -              | 40,000,000.00    |
| 应收利息                | -              | -              | -              | -              | -    | 32,629,599.33  | 32,629,599.33    |
| 应收申购款               | -              | -              | -              | -              | -    | 300.00         | 300.00           |

|           |                |                |                |                |                |                  |
|-----------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|------------------|
| 其他资产      | -              | -              | -              | -              | 91,682.84      | 91,682.84        |
| 资产总计      | 49,593,182.28  | 348,760,000.00 | 346,467,263.56 | 159,431,000.00 | -45,128,344.23 | 1,449,379,790.07 |
| 负债        |                |                |                |                |                |                  |
| 卖出回购金融资产款 | 103,209,365.18 | -              | -              | -              | -              | 103,209,365.18   |
| 应付赎回款     | -              | -              | -              | -              | 2,575,012.65   | 2,575,012.65     |
| 应付管理人报酬   | -              | -              | -              | -              | 1,737,174.63   | 1,737,174.63     |
| 应付托管费     | -              | -              | -              | -              | 231,623.28     | 231,623.28       |
| 应付销售服务费   | -              | -              | -              | -              | 694,869.86     | 694,869.86       |
| 应付交易费用    | -              | -              | -              | -              | 419,112.86     | 419,112.86       |
| 应付利息      | -              | -              | -              | -              | 86,002.74      | 86,002.74        |
| 其他负债      | -              | -              | -              | -              | 169,993.72     | 169,993.72       |
| 负债总计      | 103,209,365.18 | -              | -              | -              | 5,913,789.74   | 109,123,154.92   |
| 利率敏感度缺口   | -53,616,182.90 | 348,760,000.00 | 346,467,263.56 | 159,431,000.00 | -39,214,554.49 | 1,340,256,635.15 |

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|         |                                  |                             |                        |
|---------|----------------------------------|-----------------------------|------------------------|
| 假设      | 该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；         |                             |                        |
|         | 假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变； |                             |                        |
|         | 此项影响并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。  |                             |                        |
| 分析      | 相关风险变量的变动                        | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                        |
|         |                                  | 本期末（2015 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2014 年 12 月 31 日） |
|         | +25 个基点                          | -298,495.45                 | -1,948,402.89          |
| -25 个基点 | 299,549.63                       | 1,956,530.66                |                        |

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2015年6月30日 |               | 上年度末<br>2014年12月31日 |               |
|---------------|-------------------|---------------|---------------------|---------------|
|               | 公允价值              | 占基金资产净值比例 (%) | 公允价值                | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 44,085,484.90     | 3.56          | 12,406,762.06       | 0.93          |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                 | -             | -                   | -             |
| 交易性金融资产—债券投资  | 358,902,847.30    | 28.96         | 1,354,658,263.56    | 101.07        |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | -                 | -             | -                   | -             |
| 衍生金融资产—权证投资   | -                 | -             | -                   | -             |
| 其他            | -                 | -             | -                   | -             |
| 合计            | 402,988,332.20    | 32.52         | 1,367,065,025.62    | 102.00        |

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：除市场利率和外汇汇率以外的其他市场价格因素的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

|                              |                   |                  |                    |
|------------------------------|-------------------|------------------|--------------------|
| 本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。 |                   |                  |                    |
| 假设                           | 1. 置信区间 -         |                  |                    |
|                              | 2. 观察期 -          |                  |                    |
| 分析                           | 风险价值<br>(单位：人民币元) | 本期末 (2015年6月30日) | 上年度末 (2014年12月31日) |

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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              | 44,085,484.90    | 3.51          |
|    | 其中：股票             | 44,085,484.90    | 3.51          |
| 2  | 固定收益投资            | 358,902,847.30   | 28.59         |
|    | 其中：债券             | 358,902,847.30   | 28.59         |
|    | 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          | 740,001,735.00   | 58.95         |
|    | 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      | 104,597,997.57   | 8.33          |
| 7  | 其他各项资产            | 7,703,111.40     | 0.61          |
| 8  | 合计                | 1,255,291,176.17 | 100.00        |

### 7.2 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（元）       | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -             | -             |
| B  | 采矿业              | 154,938.00    | 0.01          |
| C  | 制造业              | 20,712,452.88 | 1.67          |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 638,638.00    | 0.05          |
| E  | 建筑业              | 958,310.92    | 0.08          |
| F  | 批发和零售业           | 730,365.00    | 0.06          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 1,657,965.67  | 0.13          |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务   | 2,623,295.20  | 0.21          |

|   | 业             |               |      |
|---|---------------|---------------|------|
| J | 金融业           | 5,558,002.00  | 0.45 |
| K | 房地产业          | -             | -    |
| L | 租赁和商务服务业      | 1,576,740.00  | 0.13 |
| M | 科学研究和技术服务业    | 6,530,107.43  | 0.53 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 219,672.00    | 0.02 |
| 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     | 2,629,654.80  | 0.21 |
| S | 综合            | 95,343.00     | 0.01 |
|   | 合计            | 44,085,484.90 | 3.56 |

注：以上行业分类以 2015 年 6 月 30 日的证监会行业分类标准为依据。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 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  | 002398 | 建研集团   | 229,207 | 6,530,107.43 | 0.53         |
| 2  | 600000 | 浦发银行   | 300,000 | 5,088,000.00 | 0.41         |
| 3  | 002415 | 海康威视   | 53,325  | 2,388,960.00 | 0.19         |
| 4  | 002056 | 横店东磁   | 63,300  | 1,980,024.00 | 0.16         |
| 5  | 600872 | 中炬高新   | 56,100  | 1,212,882.00 | 0.10         |
| 6  | 300485 | 赛升药业   | 17,372  | 1,164,097.72 | 0.09         |
| 7  | 000786 | 北新建材   | 61,000  | 1,133,380.00 | 0.09         |
| 8  | 002242 | 九阳股份   | 55,230  | 1,074,223.50 | 0.09         |
| 9  | 300047 | 天源迪科   | 28,800  | 1,033,344.00 | 0.08         |
| 10 | 002226 | 江南化工   | 67,600  | 890,968.00   | 0.07         |
| 11 | 002191 | 劲嘉股份   | 45,200  | 868,744.00   | 0.07         |
| 12 | 601238 | 广汽集团   | 54,800  | 838,440.00   | 0.07         |
| 13 | 601888 | 中国国旅   | 12,500  | 828,750.00   | 0.07         |
| 14 | 601801 | XD 皖新传 | 25,500  | 743,835.00   | 0.06         |
| 15 | 000729 | 燕京啤酒   | 64,200  | 667,680.00   | 0.05         |
| 16 | 600270 | 外运发展   | 22,600  | 659,016.00   | 0.05         |
| 17 | 002181 | 粤传媒    | 43,700  | 642,390.00   | 0.05         |
| 18 | 600642 | 申能股份   | 63,800  | 638,638.00   | 0.05         |
| 19 | 300113 | 顺网科技   | 10,600  | 611,620.00   | 0.05         |



|    |        |      |        |            |      |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 20 | 002775 | 文科园林 | 19,306 | 517,786.92 | 0.04 |
| 21 | 600757 | 长江传媒 | 36,052 | 501,122.80 | 0.04 |
| 22 | 600386 | 北巴传媒 | 29,800 | 484,548.00 | 0.04 |
| 23 | 300195 | 长荣股份 | 14,700 | 469,812.00 | 0.04 |
| 24 | 601098 | 中南传媒 | 20,500 | 469,655.00 | 0.04 |
| 25 | 600551 | 时代出版 | 21,400 | 464,594.00 | 0.04 |
| 26 | 600373 | 中文传媒 | 18,800 | 450,448.00 | 0.04 |
| 27 | 002238 | 天威视讯 | 18,770 | 445,975.20 | 0.04 |
| 28 | 601929 | 吉视传媒 | 28,800 | 435,456.00 | 0.04 |
| 29 | 002773 | 康弘药业 | 17,338 | 411,430.74 | 0.03 |
| 30 | 002770 | N 科迪 | 40,555 | 399,872.30 | 0.03 |
| 31 | 000708 | 大冶特钢 | 21,200 | 295,104.00 | 0.02 |
| 32 | 300486 | N 东杰 | 16,092 | 207,104.04 | 0.02 |
| 33 | 601211 | 国泰君安 | 6,000  | 206,040.00 | 0.02 |
| 34 | 300479 | 神思电子 | 4,000  | 181,120.00 | 0.01 |
| 35 | 600284 | 浦东建设 | 10,700 | 174,517.00 | 0.01 |
| 36 | 600664 | 哈药股份 | 13,800 | 166,152.00 | 0.01 |
| 37 | 601668 | 中国建筑 | 19,300 | 160,383.00 | 0.01 |
| 38 | 300487 | 蓝晓科技 | 10,700 | 158,681.00 | 0.01 |
| 39 | 600583 | 海油工程 | 9,300  | 154,938.00 | 0.01 |
| 40 | 600269 | 赣粤高速 | 22,100 | 150,280.00 | 0.01 |
| 41 | 300481 | N 惠成 | 11,296 | 148,542.40 | 0.01 |
| 42 | 601006 | 大秦铁路 | 10,300 | 144,612.00 | 0.01 |
| 43 | 300079 | 数码视讯 | 5,200  | 144,508.00 | 0.01 |
| 44 | 600426 | 华鲁恒升 | 7,490  | 139,014.40 | 0.01 |
| 45 | 002099 | 海翔药业 | 5,300  | 137,906.00 | 0.01 |
| 46 | 002449 | 国星光电 | 6,247  | 137,434.00 | 0.01 |
| 47 | 002144 | 宏达高科 | 3,600  | 136,440.00 | 0.01 |
| 48 | 300488 | 恒锋工具 | 6,734  | 135,420.74 | 0.01 |
| 49 | 601398 | 工商银行 | 25,400 | 134,112.00 | 0.01 |
| 50 | 002543 | 万和电气 | 5,400  | 133,812.00 | 0.01 |
| 51 | 002233 | 塔牌集团 | 7,700  | 132,902.00 | 0.01 |
| 52 | 600059 | 古越龙山 | 8,600  | 131,752.00 | 0.01 |
| 53 | 601333 | 广深铁路 | 15,800 | 129,876.00 | 0.01 |
| 54 | 601288 | 农业银行 | 35,000 | 129,850.00 | 0.01 |
| 55 | 002585 | 双星新材 | 7,600  | 127,680.00 | 0.01 |
| 56 | 002533 | 金杯电工 | 9,700  | 126,003.00 | 0.01 |
| 57 | 000830 | 鲁西化工 | 12,500 | 124,500.00 | 0.01 |
| 58 | 002561 | 徐家汇  | 7,500  | 123,750.00 | 0.01 |

|    |        |      |        |            |      |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 59 | 000423 | 东阿阿胶 | 2,270  | 123,715.00 | 0.01 |
| 60 | 002032 | 苏泊尔  | 5,000  | 123,050.00 | 0.01 |
| 61 | 600723 | 首商股份 | 9,900  | 122,067.00 | 0.01 |
| 62 | 600104 | 上汽集团 | 5,400  | 122,040.00 | 0.01 |
| 63 | 600125 | 铁龙物流 | 7,769  | 119,875.67 | 0.01 |
| 64 | 600252 | 中恒集团 | 5,200  | 119,600.00 | 0.01 |
| 65 | 300137 | 先河环保 | 5,200  | 118,976.00 | 0.01 |
| 66 | 002294 | 信立泰  | 4,100  | 117,260.00 | 0.01 |
| 67 | 002661 | 克明面业 | 2,300  | 116,495.00 | 0.01 |
| 68 | 600518 | 康美药业 | 6,500  | 115,245.00 | 0.01 |
| 69 | 002597 | 金禾实业 | 9,400  | 114,962.00 | 0.01 |
| 70 | 600004 | 白云机场 | 6,800  | 114,920.00 | 0.01 |
| 71 | 002478 | 常宝股份 | 7,000  | 114,730.00 | 0.01 |
| 72 | 600350 | 山东高速 | 13,400 | 114,704.00 | 0.01 |
| 73 | 000089 | 深圳机场 | 10,100 | 113,928.00 | 0.01 |
| 74 | 600292 | 中电远达 | 3,700  | 112,998.00 | 0.01 |
| 75 | 601677 | 明泰铝业 | 6,900  | 112,953.00 | 0.01 |
| 76 | 600660 | 福耀玻璃 | 7,900  | 112,812.00 | 0.01 |
| 77 | 601678 | 滨化股份 | 12,550 | 112,573.50 | 0.01 |
| 78 | 601339 | 百隆东方 | 11,600 | 112,520.00 | 0.01 |
| 79 | 603366 | 日出东方 | 7,600  | 111,720.00 | 0.01 |
| 80 | 600033 | 福建高速 | 18,900 | 110,754.00 | 0.01 |
| 81 | 600062 | 华润双鹤 | 4,200  | 109,368.00 | 0.01 |
| 82 | 002028 | 思源电气 | 5,900  | 108,560.00 | 0.01 |
| 83 | 000919 | 金陵药业 | 5,565  | 108,406.20 | 0.01 |
| 84 | 600177 | 雅戈尔  | 5,900  | 107,734.00 | 0.01 |
| 85 | 300160 | 秀强股份 | 4,700  | 107,630.00 | 0.01 |
| 86 | 002033 | 丽江旅游 | 6,900  | 106,674.00 | 0.01 |
| 87 | 002433 | 太安堂  | 6,600  | 106,656.00 | 0.01 |
| 88 | 002372 | 伟星新材 | 5,990  | 106,442.30 | 0.01 |
| 89 | 000823 | 超声电子 | 7,900  | 106,334.00 | 0.01 |
| 90 | 600143 | 金发科技 | 8,900  | 106,088.00 | 0.01 |
| 91 | 002054 | 德美化工 | 9,300  | 105,834.00 | 0.01 |
| 92 | 601117 | 中国化学 | 10,800 | 105,624.00 | 0.01 |
| 93 | 600138 | 中青旅  | 5,000  | 105,600.00 | 0.01 |
| 94 | 601222 | 林洋电子 | 3,000  | 105,270.00 | 0.01 |
| 95 | 600563 | 法拉电子 | 3,400  | 105,230.00 | 0.01 |
| 96 | 600522 | 中天科技 | 4,600  | 104,558.00 | 0.01 |
| 97 | 000726 | 鲁泰 A | 7,500  | 104,250.00 | 0.01 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 98  | 000623 | 吉林敖东 | 3,100  | 104,160.00 | 0.01 |
| 99  | 600195 | 中牧股份 | 3,700  | 103,970.00 | 0.01 |
| 100 | 600761 | 安徽合力 | 6,200  | 103,726.00 | 0.01 |
| 101 | 601179 | 中国西电 | 10,100 | 103,525.00 | 0.01 |
| 102 | 002088 | 鲁阳股份 | 6,179  | 103,127.51 | 0.01 |
| 103 | 600529 | 山东药玻 | 6,100  | 101,931.00 | 0.01 |
| 104 | 002483 | 润邦股份 | 5,800  | 101,500.00 | 0.01 |
| 105 | 002394 | 联发股份 | 6,408  | 99,195.84  | 0.01 |
| 106 | 300183 | 东软载波 | 3,400  | 96,900.00  | 0.01 |
| 107 | 603001 | 奥康国际 | 3,100  | 96,782.00  | 0.01 |
| 108 | 600805 | 悦达投资 | 6,100  | 95,343.00  | 0.01 |
| 109 | 300082 | 奥克股份 | 9,717  | 93,769.05  | 0.01 |
| 110 | 601766 | 中国南车 | 4,350  | 79,866.00  | 0.01 |
| 111 | 300480 | 光力科技 | 7,263  | 52,874.64  | 0.00 |
| 112 | 002674 | 兴业科技 | 2,800  | 50,904.00  | 0.00 |
| 113 | 300482 | N 万孚 | 500    | 11,520.00  | 0.00 |

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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      | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1  | 601318 | 中国平安 | 19,405,299.00 | 1.45            |
| 2  | 600000 | 浦发银行 | 11,488,300.00 | 0.86            |
| 3  | 600703 | 三安光电 | 10,302,409.00 | 0.77            |
| 4  | 002415 | 海康威视 | 8,301,154.95  | 0.62            |
| 5  | 601800 | 中国交建 | 7,769,774.00  | 0.58            |
| 6  | 000060 | 中金岭南 | 7,739,972.00  | 0.58            |
| 7  | 300070 | 碧水源  | 7,136,684.74  | 0.53            |
| 8  | 603766 | 隆鑫通用 | 6,991,878.93  | 0.52            |
| 9  | 000876 | 新希望  | 6,946,046.08  | 0.52            |
| 10 | 002344 | 海宁皮城 | 5,869,117.00  | 0.44            |
| 11 | 601600 | 中国铝业 | 5,848,128.00  | 0.44            |
| 12 | 002398 | 建研集团 | 5,842,153.47  | 0.44            |
| 13 | 002038 | 双鹭药业 | 5,778,652.00  | 0.43            |
| 14 | 000709 | 河北钢铁 | 5,408,554.00  | 0.40            |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 15 | 601766 | 中国南车 | 5,357,002.00 | 0.40 |
| 16 | 002488 | 金固股份 | 5,337,364.00 | 0.40 |
| 17 | 002324 | 普利特  | 5,086,842.00 | 0.38 |
| 18 | 000400 | 许继电气 | 4,777,535.05 | 0.36 |
| 19 | 600999 | 招商证券 | 4,647,366.00 | 0.35 |
| 20 | 002202 | 金风科技 | 4,388,346.55 | 0.33 |

注：“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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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      | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1  | 601318 | 中国平安 | 19,406,745.14 | 1.45            |
| 2  | 603678 | 火炬电子 | 13,650,568.00 | 1.02            |
| 3  | 601766 | 中国南车 | 10,939,846.77 | 0.82            |
| 4  | 600703 | 三安光电 | 10,259,108.54 | 0.77            |
| 5  | 000060 | 中金岭南 | 9,212,964.70  | 0.69            |
| 6  | 300070 | 碧水源  | 7,727,529.43  | 0.58            |
| 7  | 601800 | 中国交建 | 7,588,100.00  | 0.57            |
| 8  | 000876 | 新希望  | 7,401,865.92  | 0.55            |
| 9  | 002675 | 东诚药业 | 6,645,129.55  | 0.50            |
| 10 | 002415 | 海康威视 | 6,258,931.69  | 0.47            |
| 11 | 600000 | 浦发银行 | 6,250,970.00  | 0.47            |
| 12 | 002038 | 双鹭药业 | 6,178,205.81  | 0.46            |
| 13 | 002324 | 普利特  | 6,052,827.00  | 0.45            |
| 14 | 601299 | 中国北车 | 6,030,219.00  | 0.45            |
| 15 | 603766 | 隆鑫通用 | 5,977,760.10  | 0.45            |
| 16 | 002488 | 金固股份 | 5,714,206.00  | 0.43            |
| 17 | 601600 | 中国铝业 | 5,375,311.00  | 0.40            |
| 18 | 000709 | 河北钢铁 | 5,279,352.00  | 0.39            |
| 19 | 600699 | 均胜电子 | 5,265,437.00  | 0.39            |
| 20 | 000400 | 许继电气 | 5,050,429.68  | 0.38            |

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 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 | 396,430,041.63 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 447,581,173.61 |

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 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      | 60,198,000.00  | 4.86         |
|    | 其中：政策性金融债 | 60,198,000.00  | 4.86         |
| 4  | 企业债券      | 0.00           | 0.00         |
| 5  | 企业短期融资券   | 216,667,000.00 | 17.48        |
| 6  | 中期票据      | 80,215,000.00  | 6.47         |
| 7  | 可转债       | 1,822,847.30   | 0.15         |
| 8  | 其他        | -              | -            |
| 9  | 合计        | 358,902,847.30 | 28.96        |

### 7.6 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  | 011570004 | 15 赣高速 SCP004 | 1,200,000 | 120,588,000.00 | 9.73         |
| 2  | 120239    | 12 国开 39      | 600,000   | 60,198,000.00  | 4.86         |
| 3  | 041460077 | 14 润华 CP001   | 500,000   | 50,755,000.00  | 4.10         |
| 4  | 1382143   | 13 尧柏 MTN1    | 500,000   | 50,110,000.00  | 4.04         |
| 5  | 011518001 | 15 铁物资 SCP001 | 300,000   | 30,294,000.00  | 2.44         |

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

### 7.8 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。

## 7.9 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

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末持有股指期货。

### 7.10.2 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。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

报告期，本基金未投资国债期货。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期间未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

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。

### 7.12.2

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。

### 7.12.3 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   | 233,279.34 |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |

|   |       |              |
|---|-------|--------------|
| 3 | 应收股利  | -            |
| 4 | 应收利息  | 7,459,782.06 |
| 5 | 应收申购款 | 10,050.00    |
| 6 | 其他应收款 | -            |
| 7 | 待摊费用  | -            |
| 8 | 其他    | -            |
| 9 | 合计    | 7,703,111.40 |

### 7.12.4 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债。

### 7.12.5 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  | 002398 | 建研集团 | 6,530,107.43 | 0.53          | 筹划重大事项   |
| 2  | 600872 | 中炬高新 | 1,212,882.00 | 0.10          | 重大资产重组   |
| 3  | 000786 | 北新建材 | 1,133,380.00 | 0.09          | 重大资产重组   |
| 4  | 002242 | 九阳股份 | 1,074,223.50 | 0.09          | 筹划重大事项   |
| 5  | 300047 | 天源迪科 | 1,033,344.00 | 0.08          | 筹划重大事项   |
| 6  | 002226 | 江南化工 | 890,968.00   | 0.07          | 筹划重大事项   |

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额             | 占总份<br>额比例 |
| 13,353       | 86,721.32     | 46,756,024.00 | 4.04%      | 1,111,233,735.93 | 95.96%     |

**8.2 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 | 436,500.91 | 0.0400%  |

**8.3 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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金 | 0~10              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 0                 |

**§ 9 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              | 1,356,492,567.57 |
| 本报告期基金总申购份额               | 4,794,664.71     |
| 减：本报告期基金总赎回份额             | 203,297,472.35   |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）  | -                |
| 本报告期末基金份额总额               | 1,157,989,759.93 |

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。

**§ 10 重大事件揭示****10.1 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。

**10.2 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**

经国金通用基金管理有限公司第一届董事会审议并通过，并向中国证券投资基金业协会完成备案，基金管理人于2015年4月16日增聘吴富佳先生担任公司副总经理；2015年5月5日，本基金增聘彭俊斌先生担任基金经理。

除了上述情况以外，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。



### 10.3 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。

### 10.4 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。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务至今，本报告期内会计师事务所未发生改变。

### 10.6 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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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 |    |
| 东方证券   | 1      | 13,504,589.75  | 1.64%        | 9,593.69   | 1.62%      | -  |
| 方正证券   | 1      | 136,389,516.49 | 16.60%       | 96,891.20  | 16.32%     | -  |
| 国金证券   | 1      | 244,739,778.38 | 29.79%       | 173,860.97 | 29.28%     | -  |
| 华创证券   | 1      | 214,531,241.52 | 26.12%       | 152,403.42 | 25.66%     | -  |
| 申万宏源   | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 银河证券   | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 中信证券   | 1      | 51,536,826.28  | 6.27%        | 46,918.77  | 7.90%      | -  |
| 中信证券山东 | 1      | 160,734,822.36 | 19.57%       | 114,186.36 | 19.23%     | -  |

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. 本基金本报告期无交易单元变更。

### 10.7.2 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 |
| 东方证券   | -            | -            | -                | -              | -    | -            |
| 方正证券   | 983,148.10   | 8.81%        | 310,000,000.00   | 7.49%          | -    | -            |
| 国金证券   | 8,504,788.10 | 76.18%       | 3,530,000,000.00 | 85.27%         | -    | -            |
| 华创证券   | -            | -            | -                | -              | -    | -            |
| 申万宏源   | -            | -            | -                | -              | -    | -            |
| 银河证券   | -            | -            | -                | -              | -    | -            |
| 中信证券   | -            | -            | 300,000,000.00   | 7.25%          | -    | -            |
| 中信证券山东 | 1,675,713.30 | 15.01%       | -                | -              | -    | -            |

### 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项   | 法定披露方式           | 法定披露日期    |
|----|--|------------------|-----------|
| 1  | 国金通用基金管理有限公司关于旗下基金的基金资产净值、基金份额净值及基金份额累计净值的公告 | 指定信息披露媒体及基金管理人网站 | 2015年1月5日 |

|    |   |                  |                 |
|----|---|------------------|-----------------|
| 2  | 国金通用鑫安保本混合型证券投资基金 2014 年第 4 季度报告                    | 指定信息披露媒体及基金管理人网站 | 2015 年 1 月 22 日 |
| 3  | 国金通用基金管理有限公司关于在齐鲁证券有限公司开通定期定额投资业务的公告                | 指定信息披露媒体及基金管理人网站 | 2015 年 3 月 23 日 |
| 4  | 国金通用基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告                | 指定信息披露媒体及基金管理人网站 | 2015 年 3 月 28 日 |
| 5  | 国金通用鑫安保本混合型证券投资基金 2014 年年度报告                        | 基金管理人网站          | 2015 年 3 月 30 日 |
| 6  | 国金通用鑫安保本混合型证券投资基金 2014 年年度报告摘要                      | 指定信息披露媒体及基金管理人网站 | 2015 年 3 月 30 日 |
| 7  | 国金通用基金管理有限公司关于增加上海利得基金销售有限公司为旗下基金销售机构并参加相关费率优惠活动的公告 | 指定信息披露媒体及基金管理人网站 | 2015 年 3 月 30 日 |
| 8  | 国金通用鑫安保本混合型证券投资基金招募说明书（更新）                          | 基金管理人网站          | 2015 年 4 月 13 日 |
| 9  | 国金通用鑫安保本混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要                        | 指定信息披露媒体及基金管理人网站 | 2015 年 4 月 13 日 |
| 10 | 国金通用基金管理有限公司高级管理人员变更公告                              | 指定信息披露媒体及基金管理人网站 | 2015 年 4 月 18 日 |
| 11 | 国金通用鑫安保本混合型证券投资基金 2015 年第 1 季度报告                    | 指定信息披露媒体及基金管理人网站 | 2015 年 4 月 20 日 |
| 12 | 国金通用鑫安保本混合型证券投资基金增聘基金经理公告                           | 指定信息披露媒体及基金管理人网站 | 2015 年 5 月 7 日  |

注：经国金通用基金管理有限公司（以下简称“公司”）股东会审议通过，根据 2015 年 6 月 8 日中国证券监督管理委员会印发的《关于核准国金通用基金管理有限公司变更股权的批复》（证监许可〔2015〕1153 号），公司原股东之一中国通用技术（集团）控股有限责任公司将所持有的国金通用基金管理有限公司 12% 的股权转让给涌金投资控股有限公司。变更后的股权结构为：国金证

券股份有限公司持股比例 49%、苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司持股比例 19.5%、广东宝丽华新能源股份有限公司持股比例 19.5%、涌金投资控股有限公司持股比例 12%。同时公司名称变更为“国金基金管理有限公司”。

上述公司股权和公司名称变更事项，已按有关规定在北京市工商行政管理局办理完毕相关变更登记手续，并于 2015 年 7 月 23 日领取了变更后的营业执照。

具体请参见公司于 2015 年 7 月 24 日发布在中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站的相关公告。

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

|   |
|---|
| 无 |
|---|

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、国金通用鑫安保本混合型证券投资基金基金合同；
- 3、国金通用鑫安保本混合型证券投资基金托管协议；
- 4、国金通用鑫安保本混合型证券投资基金招募说明书；
- 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。

### 12.2 存放地点

本基金基金管理人的办公场所。

### 12.3 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](http://www.gfund.com)

国金基金管理有限公司  
2015 年 8 月 28 日