

国金鑫安保本混合型证券投资基金

2015 年度报告摘要

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

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、监事会对本基金所报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。本公司报告已充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基金合同的规定，于2016年3月25日复审了本报告书的财务报告、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，保证报告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信、勤勉尽责的原则管理本基金，但不保证基金一定盈利。

基金托管人：中国光大银行股份有限公司根据基金合同的规定，于2016年3月25日复审了本报告书的财务报告、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，保证报告内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本基金报告期自2015年1月1日起至2015年12月31日止。

§ 2 基金简介

基金基本情况	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
基金成立日	2014年10月14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
报告期末基金资产总额	1,681,401,107.04
基金合同存续期间	不长期
基金销售机构的代销网点	-
上市日期	-

注：无

2.2 基金产品说明

投资目标 本基金在保证本金的基础上，力争为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。

投资范围 本基金通过在货币市场类资产中的投资，实现资本保值增值。

投资策略 本基金将通过分析宏观经济、经济政策和资金面的变化，把握利率变化趋势，以确定投资品种的配置比例，同时根据宏观经济形势变化，适时调整投资组合的配置比例，以达到风险与收益的最佳平衡。

业绩比较基准 一年定期存款利率（税后）+0.1%

风险特征说明 本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的中低风险品种，风险收益水平低于股票型基金，高于货币市场基金和货币型基金。

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

姓名 张建峰

信函披露负责人 联系电话 010-62639190

电子邮件 xuweiyi@fund.com zhengjiaoban@ebank.com

客户服务电话 4000-2000-18

传真 95566

网站 010-62639066

010-62639132

2.4 信息披露方式

载明基金产品信息的管理人互联网网址 www.gfund.com

基金份额净值发布地点 基金管理人和基金托管人的住所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及期间分布情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

期初数据和指标	2015年	2014年
本期已实现收益	107,112,034.39	-17,679,306.64
本期利润	118,542,064.02	-17,000,025.66
加权平均基金份额本期利润	0.0900	-0.0119
期末基金份额净值	1.00%	-0.12%

2015年末

2014年末

3.2 自基金合同生效以来基金的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 份额占比 (%) 份额占比 (%) 收益率标准差 (%) ① - ② -

过去三个月 1.00% 0.15% 0.30% 0.01% 1.11% 0.14%

过去六个月 0.00% 0.11% 0.07% 0.00% -0.27% 0.11%

过去一年 0.00% 0.10% 2.12% 0.01% 0.63% 0.14%

成立以来 7.65% 0.10% 3.17% 0.01% 4.47% 0.16%

注：本基金的业绩比较基准为“一年期银行定期存款利率(税后) + 0.1%”。

注：本期利润为本基金本期实现的收益加上投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.3 所有者权益变动包括持有人认购或交易本基金的各项费用，计入费用后实际可支配的金额。

4. 管理人对报告期内本基金运作遵守法律法规情况的说明

4.1 管理人对本基金运作的内部控制制度的说明

4.1.1 管理人对基金管理制度的说明

4.1.2 管理人对基金投资决策制度的说明

4.1.3 管理人对基金研究制度的说明

4.1.4 管理人对基金估值制度的说明

4.1.5 管理人对基金绩效评价制度的说明

4.1.6 管理人对基金风险管理制度的说明

4.1.7 管理人对基金流动性风险管理的说明

4.1.8 管理人对基金投资禁止行为的说明

4.1.9 管理人对基金投资限制行为的说明

4.1.10 管理人对基金投资关联交易的说明

4.1.11 管理人对基金投资金融衍生品的说明

4.1.12 管理人对基金投资境外市场的说明

4.1.13 管理人对基金投资中小企业私募债的说明

4.1.14 管理人对基金投资资产支持证券的说明

4.1.15 管理人对基金投资国债期货的说明

4.1.16 管理人对基金投资期权的说明

4.1.17 管理人对基金投资股指期货的说明

4.1.18 管理人对基金投资商品期货的说明

4.1.19 管理人对基金投资商品期权的说明

4.1.20 管理人对基金投资商品互换的说明

4.1.21 管理人对基金融资融券的说明

4.1.22 管理人对基金参与转融通业务的说明

4.1.23 管理人对基金参与新发基金的说明

4.1.24 管理人对基金参与股票期权交易的说明

4.1.25 管理人对基金参与国债期货交易的说明

4.1.26 管理人对基金参与商品期货交易的说明

4.1.27 管理人对基金参与商品期权交易的说明

4.1.28 管理人对基金参与商品互换交易的说明

4.1.29 管理人对基金参与远期交易的说明

4.1.30 管理人对基金参与掉期交易的说明

4.1.31 管理人对基金参与期权组合交易的说明

4.1.32 管理人对基金参与互认互通基金的说明

4.1.33 管理人对基金参与内地香港基金互认的说明

4.1.34 管理人对基金参与沪港通的说明

4.1.35 管理人对基金参与深港通的说明

4.1.36 管理人对基金参与债券通的说明

4.1.37 管理人对基金参与沪伦通的说明

4.1.38 管理人对基金参与基金互认的说明

4.1.39 管理人对基金参与QDII的说明

4.1.40 管理人对基金参与沪港基金互认的说明

4.1.41 管理人对基金参与深港基金互认的说明

4.1.42 管理人对基金参与债券通的说明

4.1.43 管理人对基金参与沪伦通的说明

4.1.44 管理人对基金参与基金互认的说明

4.1.45 管理人对基金参与QDII的说明

4.1.46 管理人对基金参与沪港基金互认的说明

4.1.47 管理人对基金参与深港基金互认的说明

4.1.48 管理人对基金参与债券通的说明

4.1.49 管理人对基金参与沪伦通的说明

4.1.50 管理人对基金参与基金互认的说明

4.1.51 管理人对基金参与QDII的说明

4.1.52 管理人对基金参与沪港基金互认的说明

4.1.53 管理人对基金参与深港基金互认的说明

4.1.54 管理人对基金参与债券通的说明

4.1.55 管理人对基金参与沪伦通的说明

4.1.56 管理人对基金参与基金互认的说明

4.1.57 管理人对基金参与QDII的说明

4.1.58 管理人对基金参与沪港基金互认的说明

4.1.59 管理人对基金参与深港基金互认的说明

4.1.60 管理人对基金参与债券通的说明

4.1.61 管理人对基金参与沪伦通的说明

4.1.62 管理人对基金参与基金互认的说明

4.1.63 管理人对基金参与QDII的说明

4.1.64 管理人对基金参与沪港基金互认的说明

4.1.65 管理人对基金参与深港基金互认的说明

4.1.66 管理人对基金参与债券通的说明

4.1.67 管理人对基金参与沪伦通的说明

4.1.68 管理人对基金参与基金互认的说明

4.1.69 管理人对基金参与QDII的说明

4.1.70 管理人对基金参与沪港基金互认的说明

4.1.71 管理人对基金参与深港基金互认的说明

4.1.72 管理人对基金参与债券通的说明

4.1.73 管理人对基金参与沪伦通的说明

4.1.74 管理人对基金参与基金互认的说明

4.1.75 管理人对基金参与QDII的说明

4.1.76 管理人对基金参与沪港基金互认的说明

4.1.77 管理人对基金参与深港基金互认的说明

4.1.78 管理人对基金参与债券通的说明

4.1.79 管理人对基金参与沪伦通的说明

4.1.80 管理人对基金参与基金互认的说明

4.1