国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金

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

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	国金国鑫发起
场内简称	-
基金主代码	762001
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	2012年8月28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	560,480,654.75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	本基金通过合理的资产配置和积极的证券选择,追求在严格控制风险的前提下实现资本的长期稳健回报。
投资策略	本基金将根据对宏观经济周期和市场运行阶段的判断来确定投资组合中各大类资产的权重。在权益类资产投资方面,本基金将综合运用定量分析和定性分析手段,精选出具有内在价值和成长潜力的股票来构建股票投资组合。在固定收益类资产投资方面,本基金会深入研究分析宏观经济和利率趋势,选择流动性好,到期收益率与信用质量相对较高的债券品种进行投资。
业绩比较基准	金融机构人民币三年期定期存款基准利率(税后)
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金,属于中高预期收益和较高风险水平的投资品种。

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	2013年
本期已实现收益	32,643,106.94	15,222,639.60	6,398,217.55
本期利润	27,081,073.75	25,707,281.77	3,260,162.20
加权平均基金份额本期利润	0.0596	0.5132	0.0498
本期基金份额净值增长率	60.16%	57.12%	2.89%
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	0.6218	0.1457	-0.0412
期末基金资产净值	936,458,409.40	84,118,762.15	69,846,199.59
期末基金份额净值	1.6708	1.2969	0.9588

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(债券品种标准另有规定的除外)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

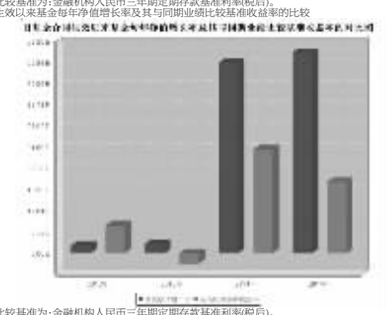
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.81%	0.10%	0.72%	0.01%	0.09%	0.09%
过去六个月	0.29%	0.11%	1.54%	0.01%	-1.25%	0.10%
过去一年	60.16%	1.31%	21.49%	0.23%	38.67%	0.48%
过去三年	158.93%	1.21%	54.48%	0.20%	104.45%	0.41%
自基金合同生效起至今	168.22%	1.16%	67.39%	0.81%	97.83%	0.35%

注:本基金的业绩比较基准为:金融机构人民币三年期定期存款基准利率(税后)。

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

注:本基金的业绩比较基准为:金融机构人民币三年期定期存款基准利率(税后)。

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:本基金的业绩比较基准为:金融机构人民币三年期定期存款基准利率(税后)。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015	3.30	192,645,958.02	2,670,586.03	195,316,544.05	-
2014	2.00	6,411,121.07	1,435,796.52	7,846,917.59	-
2013	1.00	4,394,416.68	1,355,978.17	5,750,394.85	-
合计	6.30	203,451,495.77	5,462,360.72	208,913,856.49	-

§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16亿元人民币增加至28亿元人民币。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、国金金鑫普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、国金证券50指数分级证券投资基金、国金鑫运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		
滕祖光	基金经理	2014年4月11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、国投信托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;2013年2月起聘聘为国金鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理;2013年12月起聘聘为国金鑫盈货币市场证券投资基金基金经理;2014年1月起任国金鑫利分级债券型证券投资基金基金经理;2014年2月起任国金金鑫普货币市场证券投资基金基金经理;2015年6月起任国金众赢货币市场证券投资基金基金经理。
徐艳芳	基金经理	2013年2月26日	-	7	徐艳芳女士,清华大学硕士。2006年10月至2012年6月历任纳天财经公关公司财经咨询、英大泰和财产保险股份有限公司投资经理。2012年6月加盟国金基金管理有限公司,任投资研究部固定收益基金经理。2013年2月起聘聘为国金鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理;2013年12月起聘聘为国金鑫盈货币市场证券投资基金基金经理;2014年1月起任国金鑫利分级债券型证券投资基金基金经理;2014年2月起任国金金鑫普货币市场证券投资基金基金经理;2015年6月起任国金众赢货币市场证券投资基金基金经理。
彭俊斌	基金经理	2015年4月17日	-	4	彭俊斌先生,清华大学博士。2008年9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。

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》、《国金国鑫灵活配置混合型发起式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,严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及其他相关法律法规,制定了《国金基金管理有限公司公平交易管理办法》,在投资管理活动中公平对待不同投资组合,严禁直接或者通过与其它管理活动中的公平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,同时包括投权、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、预警、报告等。

第三,通过岗位设置、制度约束、流程规范、技术手段相结合的方式,实现公平交易的控制,具体如下:(1)总经理、督察长、风险控制委员会负责指导建立公平交易的决策、流程规范,技术手段相结合的方式,实现公平交易的权利、责任分配;(2)研究与投资:投资人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,并提供研究结果建立及维护全公司适用的投资对象备选库和交易对手备选库。研究结果通过策略会、行业及个股报告会、投研平台、邮件系统等共享机制统一开放给所有的投资组合经理,以确保各投资组合享有公平的信息获取机会。(4)交易执行:交易人员负责建立并执行公平的集中交易制度和交易分配制度,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同向、反向交易及交易时机和价差进行事后分析。(6)报告备案: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,要备保存分析报告备查。(7)信息披露部门在各投资组合的定期报告中,至少披露公司整体公平交易制度执行情况,公平交易执行情况及异常交易行为专项说明等事项。(8)反馈完善:根据事后分析报告及信息披露结果,公平交易相关部门对相关环节予以不断完善,以确保公平交易制度执行且臻完善。(9)监督检查:合规风控部监察稽核人员根据法规规定及公司公平交易制度规定,监督、检查、评价公司公平交易制度执行情况,并提出改进建议。会计师事务所在公司年度内部控制评价报告中对公司公平交易制度的执行情况做出专项评价。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《国金基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定,通过制度、流程和系统等方式在各业务环节严格控制交易公平执行。

在投资决策内部控制方面,本基金管理人建立了统一的投资研究管理平台和全公司适用的投资对象备选库和交易对象备选库,确保各投资组合在获取研究信息、投资建议及实施投资决策方面享有平等的机会。健全投资授权制度,明确各投资决策主体的职责和权限划分,投资组合经理在授权范围内自主决策。建立投资组合投资信息的管理及保密制度,通过岗位设置、制度约束、技术手段相结合的方式,对持仓和交易等重大非公平交易信息采取保密措施。

在交易执行控制方面,本基金管理人实行集中交易制度,基金交易部运用交易系统中设置的公平交易功能并按照时间优先、价格优先的原则严格执行所有指令。对于一级市场申购等场外交易,按照公平交易原则建立和完善了相关分配机制。在本报告期内,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、三只货币基金,不存在非公平交易情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了对异常交易的控制制度,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

2015年宏观经济持续下行,4个季度分别为7.0%、7.0%、6.9%和6.8%,全年GDP增长6.9%。全球经济整体低迷令出口形势继续恶化,全年进出口同比下降7%,其中出口下降1.8%,进口下降12.4%。全年固定资产投资增速也下台阶,降至10%,其中基础设施投资同比增长17.8%,房地产投资增速由10.5%下滑至1%,制造业投资增速由7.3%降至6%。传统"三驾马车"中,只有消费整体平稳,社消零售同比增速一直维持在10%以上。

2015年物价整体走弱,CPI低位徘徊,全年在0.8%-2%之间小幅波动,PPI加速下滑,自8月起逼近-6%的低位。

2015年货币政策整体较为宽松,降息降准不断,2015年央行进行了5次降息,3次全面降准,2次定向降准,利率也持续下行,且上半年宽松力度大于下半年。

2015年资本市场出现较大波动,上半年在杠杆放应下,指数不断攀升,下半年在市值在去杆杠的影响下不断下跌;

国金国鑫灵活配置发起式基金秉承价值投资理念,全年组合配置以低估值价值股为基础,根据市场情况灵活参与成长股的交易性机会,全年业绩回报60%,为投资者获取了较好的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日,本基金份额净值1.6708元,累计单位净值2.3008元。本报告期份额净值增长率为60.16%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016年风险点较多,经济面临供给侧结构调整带来的去产能、去库存影响,未来呈L型;流动性受制于美国加息以及人民币贬值压力,国内货币政策的空间有限;风险偏好在经历过股灾之后要迅速恢复难度较大,受注册制推进影响,供给加大,创业板整体面临更大压力。预计16年市场整体将呈V型。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,本基金管理人认合法、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,及时发现违规、提出整改意见,督促有关业务部门整改并跟踪改进落实情况,并按照相关要求定期制作监察稽核报告报公司管理层,董事会以及监管部门。

本报告期内本基金管理人内部监察稽核的重点包括:

(1)进一步完善制度建设。本基金管理人根据公司实际业务情况不断细化制度流程,及时拟定了相关管理制度,并对原有制度体系进行了持续的更新和完善,截至报告出具日,本基金管理人共制订规章制度109项,涵盖公司主要业务范围。

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

(3)有计划地开展监察稽核工作。本报告期内,本基金管理人根据年度监察稽核工作计划,通过日常监察与专项稽核相结合的方式,开展各项监察稽核工作,包括对基金销售、宣传材料、合同、反洗钱工作、基金投资运作、交易(包括公平交易)等方面进行检查,对于检查中发现的问题会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,强化内部控制流程,提高了业务部门及人员的风险意识水平,从而较好地预防风险。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证券业协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人员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》,并依照其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金相关法律法规和基金合同,结合本基金实际运作情况,本报告期内,本基金每10份基金份额分红3.3元。

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国鑫灵活配置混合型发起式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,对国金国鑫灵活配置混合型发起式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"国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金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_A01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	国金国鑫灵活配置混合型发起式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国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金财务报表,包括2015年12月31日的资产负债表,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	编制和公允反映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,我们取得的审计证据是充分、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,公允反映了国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金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:国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金

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		305,199,275.38	11,984,960.19
结算备付金		815,310.90	391,249.68
存出保证金		348,340.70	93,076.17
交易性金融资产		259,063,628.01	82,460,384.94
其中:股票投资		91,868,965.21	63,656,878.66
基金投资		-	-
债券投资		167,194,672.80	18,803,506.28
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		370,001,355.00	-
应收证券清算款		958,352.60	-
应收利息		3,504,603.17	183,760.24
应收股利		-	-
应收申购款		85,040.95	113,764.65
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		939,975,906.71	95,227,195.87
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		-	4,000,000.00
应付证券清算款		-	5,047,067.01
应付赎回款		660,954.11	728,761.99
应付管理人报酬		1,197,560.96	74,045.47
应付托管费		199,593.50	12,340.90
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		1,142,974.06	985,400.65
应交税费		15.00	15.00
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		316,399.68	260,802.70
负债合计		3,517,497.31	11,108,433.72
所有者权益:			
实收基金		560,480,654.75	64,912,868.61
未分配利润		375,977,754.65	19,205,893.54
所有者权益合计		936,458,409.40	84,118,762.15
负债和所有者权益总计		939,975,906.71	95,227,195.87

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值为人民币1.6708元,基金份额总额为560,480,654.75份。

7.2 利润表

会计主体:国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

资 产	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1月1日至2014年12月31日
一、收入		42,753,633.30	28,421,037.43
1.利息收入		21,896,238.50	403,956.41
其中:存款利息收入		4,542,930.37	42,473.16
债券利息收入		11,880,868.13	298,394.82
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,450,128.62	62,688.43
其他利息收入		22,311.38	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		21,806,353.92	17,472,469.19
其中:股票投资收益		24,675,538.27	15,505,312.07
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-3,086,682.18	1,611,336.60
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		217,497.83	355,820.52
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-5,562,033.19	10,484,642.17
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		4,613,074.07	60,369.66
减:二、费用		15,672,559.55	2,713,755.66
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	11,073,500.85	782,155.88
2. 托管费	7.4.8.2.2	1,845,583.61	130,359.38
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		2,167,083.16	1,367,582.27
5. 利息支出		343,090.05	42,758.13
其中:卖出回购金融资产支出		343,090.05	42,758.13
6. 其他费用		243,301.88	390,900.00
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		27,081,073.75	25,707,281.77
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		27,081,073.75	25,707,281.77

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金

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)	64,912,868.61	19,205,893.54	84,118,762.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	27,081,073.75	27,081,073.75
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)	495,567,786.14	525,007,331.41	1,020,575,117.55
其中:1.基金申购款	2,471,938,244.68	1,658,904,101.50	4,130,842,346.18
2.基金赎回款	-1,976,370,458.54	-1,133,896,770.09	-3,110,267,228.63
四、本期末所有者权益(基金净值)	-	-195,316,544.05	-195,316,544.05
五、期末所有者权益(基金净值)	560,480,654.75	375,977,754.65	936,458,409.40

项目	上年度可比期间 2014年1月1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)	72,844,349.98	-2,998,150.39	69,846,199.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	25,707,281.77	25,707,281.77
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)	-7,931,481.37	4,343,679.75	-3,587,801.62
其中:1.基金申购款	50,004,744.77	8,084,454.98	58,089,199.75
2.基金赎回款	-57,936,226.14	-3,740,775.23	-61,677,001.37
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)	-	-7,846,917.59	-7,846,917.59
五、期末所有者权益(基金净值)	64,912,868.61	19,205,893.54	84,118,762.15

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:

尹庆宏 聂武鹏 于晓莲

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金本体简介

国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金(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[2012]953号文的核准,由国金基金管理有限公司于2012年8月13日至2012年8月24日向社会公开募集,基金合同于2012年8月28日生效,首次募集规模为178,532,819.63份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。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具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(含中小板股票、创业板股票)、以及经中国证监会核准上市的股票)、权证、股指期货、债券(含中小企业私募债、中期票据)、可转换债券(含分离交易可转债、可交换债券)、资产支持证券、银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金股票投资占基金资产的比例为0%-95%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:金融机构人民币三年期定期存款基准利率(税后)

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(以下合称"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>估值业务及分配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-年度报告财年年度报告》及其他中国证监会及中国证券投资基金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》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.5 会计政策变更以及差错更正的说明

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。

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

关联方名称	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	91,868,965.21	9.77
	其中:股票	91,868,965.21	9.77
2	固定收益投资	167,194,672.80	17.79
	其中:债券	167,194,672.80	17.79
	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	370,001,355.00	39.36
	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	306,014,586.28	32.56
7	其他各项资产	4,896,337.42	0.52
8	合计	939,975,906.71	100.00

8.2 期末按行业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