国金鑫盈货币市场证券投资基金

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:兴业银行股份有限公司
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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中的财务资料已经审计,安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2015年1月1日起至2015年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	国金鑫盈货币
场内简称	–
基金主代码	000439
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	2013年12月16日
基金管理人	国金基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	161,627,862.40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	在综合考虑基金资产收益性、安全性和流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,力争为投资者创造稳定的收益。
投资策略	本基金在分析各类资产的信用风险、流动性风险及其经风险调整后的收益率水平或盈利能力的基础上,通过比较或合理预期不同的各类资产的风险与收益率变化,确定并动态地调整优化配置的资产类别和配置比例。
业绩比较基准	人民币七天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种,其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。

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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	徐炜瑜	张志永
	联系电话	010-88005601	021-62677777-212004
	电子邮箱	xuweiyu@gfund.com	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		4000-2000-18	95561
传真		010-88005666	021-62159217

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12月16日(基金合同生效日)-2013年12月31日
本期已实现收益	8,224,417.82	4,310,890.45	613,196.58
本期利润	8,224,417.82	4,310,890.45	613,196.58
本期净值收益率	3.6206%	4.6900%	0.1645%
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	–	–	–
期末基金资产净值	161,627,862.40	111,125,490.71	68,196,802.33
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000

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,由于货币基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润金额相等。

2、本基金收益分配为按日结转份额。经协商基金托管人同意,并报中国证监会备案,本基金收益分配自基金合同生效日至2015年6月9日按月结转,自2015年6月10日起按日结转。

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。

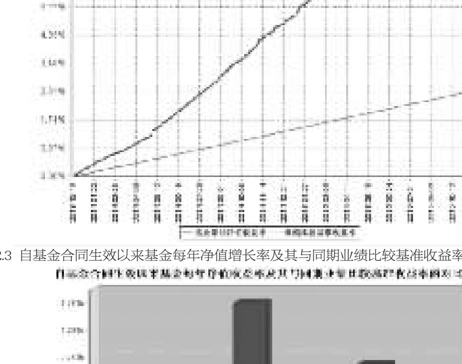
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

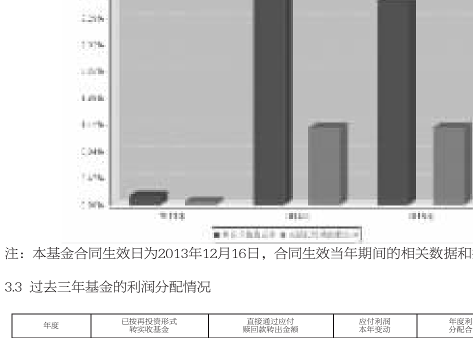
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.7212%	0.0052%	0.3450%	0.0000%	0.3762%	0.0052%
过去六个月	1.4633%	0.0058%	0.6900%	0.0000%	0.7733%	0.0058%
过去一年	3.6206%	0.0109%	1.3688%	0.0000%	2.2518%	0.0109%
自基金合同生效起至今	8.6588%	0.0117%	2.7975%	0.0000%	5.8613%	0.0117%

注:本基金的业绩比较基准为:人民币七天通知存款利率(税后)

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金合同生效日为2013年12月16日,合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2015	8,517,668.90	0.00	-293,251.08	8,224,417.82	
2014	4,106,043.73	0.00	204,846.72	4,310,890.45	
2013	512,426.23	0.00	100,770.35	613,196.58	
合计	13,136,138.86	0.00	12,365.99	13,148,504.85	

§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]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。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、涌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、国金金腾通货币市场证券投资基金、国金鑫安保本混合型证券投资基金、国金上证50指数分级证券投资基金、国金鑫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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
徐艳芳	基金经理	2013年12月16日	–	7	徐艳芳女士,清华大学硕士。2005年10月至2012年6月历任皓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月起增聘为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12月起增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月起任国金金腾通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。
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月起被增聘为国金鑫盈货币市场证券投资基金基金经理、国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理;2015年8月起被增聘为国金鑫安保本混合型证券投资基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在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》、《国金鑫盈货币市场证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及其他相关法律法规,制定了《国金基金管理有限公司公平交易管理办法》,在投资管理活动中公平对待不同投资组合,严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。该公平交易管理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,同时包括授权、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制度,并对公平交易的执行情况进行审核。(2)产品开发:风险分析师根据相关法律法规、公司规章制度以及产品合同的风险控制指标,在投资交易系统中完成风控参数设置,确保做好公平交易的事前控制。(3)研究与投资:投资人员负责在各自的职责及权限范围内从事相应的投资决策行为,其中,投资组合经理需对有可能涉及非公平交易的行为作出合理解释。研究人员负责以客观的研究方法开展研究工作,并根据研究结果建立及维护全公司适用的投资对象备选库和交易对手备选库。研究结果通过策略会、行业及个股报告会、投研平台、邮件系统等共享机制统一开放给所有的投资组合经理,以确保各投资组合享有公平的信息获取机会。(4)交易执行:交易人员负责建立并执行公平的集中交易制度和交易分配制度,合规风控部利用公平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,妥善保存分析报告备查。(7)信息披露环节:信息披露部门在各投资组合的定期报告中,至少披露公司整体公平交易制度执行情况、公平交易执行情况及异常交易行为等专项说明等事项。(8)反馈完善:根据事后分析报告及信息披露结果,公平交易各相关部门对相关环节予以不断完善,以确保公平交易的执行日臻完善。(9)监督检查: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开投资信息采取保密措施。

在交易执行控制方面,本基金管理人实行集中交易制度,基金交易部运用交易系统中设置的公平交易功能并按照时间优先、价格优先的原则严格执行所有指令。对于一级市场申购等场外交易,按照公平交易原则建立和完善了相关分配机制。在本报告期,本基金管理人管理有九只基金产品,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年国内宏观经济延续下行走势,全年GDP同比增速6.90%,长期以来支持我国经济高速增长的投资需求出现了大幅度下滑,居民消费对GDP的贡献有所增加,但社会消费品零售总额的同比增速也出现下滑。工业增加值在四季度后两月有所回升,但在企业利润下降和投资机会欠缺的市场背景下,制造业投资增速的反弹难以持续。在经济增长的新常态下,经济增速出现换挡,增长的质量成为本届政府规划的新目标。年末中央经济工作会议提出了"供给侧结构性改革"的经济增长总体解决方案,再次经济增长的质量提到了新的高度。

全球经济复苏存在不确定性,外需增长同样不乐观,稳增长只能期待国内消费和基建投资。从景气度方面看,财新PMI在服务业的带动下在低位企稳回升,但仍处50以下。物价方面,12月CPI同比1.6%,PPI同比-5.9%,连续第46个月下滑。全年CPI上涨1.4%,创2009年CPI负增长以来的6年新低。

在报告期内,本基金依旧保持稳健的操作风格,在充分考虑安全性和流动性的基础上,对于组合持仓的信用风险进行了评估,调整了信用债的仓位和低评级债券的比重,由于市场收益率整体下移,组合的期间业绩回报有所下降。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内本基金份额净值收益率为3.6206%,同期业绩比较基准收益率为1.3688%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在经历了近两年的牛市后,债券收益率已下行至比较低的区间,10年期国债收益率在2015年末一度下探至2.70%,利率债的未来下行空间已经相对有限,春节期间外围股票市场下跌,全球风险偏好下降,10年期美国国债收益率下行接近10bps,而节后中国市场的利率债收益率却出现了小幅上行的走势。资金面,流动性总量上是宽松的,但央行边际投放上是谨慎的。原因是多方面的,主要是汇率影响,去年811汇改以来人民币的汇率波动明显走扩,释放过多的流动性会增大人民币贬值的压力,所以目前央行在公开市场上的短期操作调节市场流动性。从大类资产配置的角度,目前股市处于熊市格局,资金更偏好于债市,但外汇占款趋势性下行,所以说流动性边际上没有改善。展望2016年债券市场,今年以来收益率下行的因素主要是资金风险偏好的转变,未来债券市场继续走牛存在不确定性。信用债方面,违约和兑付风险在逐步增加,在经济下行的背景下,控制个券信用风险是投资的主线。

未来本基金将在保证流动性的前提下,维持短期债券为主的组合资产配置状况,适当降低组合久期,严格控制投资组合中个券的信用风险,力争为广大投资者创造超越市场平均水平的稳定收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,本基金管理人从合法、合规、保障基金持有人利益出发,由督察长领导独立于各业务部门的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,及时发现情况、提出整改意见、督促有关业务部门整改并跟踪改进落实情况,并按照相关要求定期制作监察稽核报告报公司管理层、董事会以及监管部门。

本报告期内本基金管理人内部监察稽核的重点包括:

(1)进一步完善制度建设。本基金管理人根据公司实际业务情况不断细化制度流程,及时拟定了相关管理制度,并对原有制度体系进行了持续的更新和完善,截至报告出具日,本基金管理人共制订规章制度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》、中国证监会相关规定及基金合同关于估值的约定,严格执行内部估值控制程序,对基金所持有的投资品种进行估值。

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配方式为红利再投资,免收再投资的费用;本基金根据每日基金收益情况,以每万份基金已实现收益为基准,为投资人每日计算当日收益并分配,并每月进行支付。

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

本托管人根据《国金鑫盈货币市场证券投资基金基金合同》与《国金鑫盈货币市场证券投资基金托管协议》,自2013年12月16日起托管国金鑫盈货币市场证券投资基金全部资产。

报告期内,本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,诚信、尽责地履行了基金托管人义务,不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内,本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查,未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为;基金管理人在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、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,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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_A03号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	国金鑫盈货币市场证券投资基金全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的国金鑫盈货币市场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	编制和公允列报财务报表是基金管理人国金基金管理有限公司的责任。这种责任包括:(1)按照企业会计准则的规定编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。	
审计意见段	我们认为,上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了国金鑫盈货币市场证券投资基金2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	汤 骏	王珊珊
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层	
审计报告日期	2016年3月25日	

§7 年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体:国金鑫盈货币市场证券投资基金

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		28,615,701.56	26,078,306.39
结算备付金		–	208,000.00
存出保证金		–	–
交易性金融资产		109,989,650.23	64,579,013.54
其中:股票投资		–	–
基金投资		–	–
债券投资		109,989,650.23	64,579,013.54
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		21,000,265.50	17,000,145.50
应收证券清算款		–	–
应收利息		2,108,551.25	2,772,560.06
应收股利		–	–
应收申购款		392,455.00	1,148,137.40
递延所得税资产		–	–
其他资产		–	–
资产总计		162,106,623.54	111,786,162.89
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		–	–
应付证券清算款		–	–
应付赎回款		–	–
应付管理人报酬		85,851.65	38,822.46
应付托管费		26,015.65	11,764.36
应付销售服务费		65,039.13	29,411.02
应付交易费用		10,167.48	11,504.93
应交税费		–	–
应付利息		–	–
应付利润		12,365.99	305,617.07
递延所得税负债		–	–
其他负债		279,321.24	263,552.35
负债合计		478,761.14	660,672.18
所有者权益:			
实收基金		161,627,862.40	111,125,490.71
未分配利润		–	–
所有者权益合计		161,627,862.40	111,125,490.71
负债和所有者权益总计		162,106,623.54	111,786,162.89

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值为人民币1.0000元,基金份额总额为161,627,862.40份。

7.2 利润表

会计主体:国金鑫盈货币市场证券投资基金

本报告期: 2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入		10,265,659.12	5,358,693.95
1.利息收入		9,188,380.59	3,756,897.81
其中:存款利息收入		1,777,703.24	1,519,043.13
债券利息收入		4,230,456.11	1,747,539.54
资产支持证券利息收入		–	–
买入返售金融资产收入		3,180,221.24	490,315.14
其他利息收入		–	–
2.投资收益(损失以"-"填列)		1,057,278.53	1,581,672.14
其中:股票投资收益		–	–
基金投资收益		–	–
债券投资收益		1,057,278.53	1,581,672.14
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		–	–
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		–	–
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		–	–
5.其他收入(损失以"-"号填列)		20,000.00	20,124.00
减:二、费用		2,041,241.30	1,047,803.50
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	829,867.44	296,044.01
2. 托管费	7.4.8.2.2	251,475.16	89,710.33
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	628,687.43	224,275.72
4. 交易费用		–	–
5. 利息支出		89,718.03	33,227.97
其中:卖出回购金融资产支出		89,718.03	33,227.97
6. 其他费用		241,493.24	404,545.47
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		8,224,417.82	4,310,890.45
减:所得税费用		–	–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		8,224,417.82	4,310,890.45

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:国金鑫盈货币市场证券投资基金

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)	111,125,490.71	–	111,125,490.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	–	8,224,417.82	8,224,417.82
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	50,502,371.69	–	50,502,371.69
其中:1.基金申购款	1,227,200,741.51	–	1,227,200,741.51
2.基金赎回款	-1,176,698,369.82	–	-1,176,698,369.82
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)	–	-8,224,417.82	-8,224,417.82
五、期末所有者权益(基金净值)	161,627,862.40	–	161,627,862.40

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)	68,196,802.33	–	68,196,802.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	–	4,310,890.45	4,310,890.45
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)	42,928,688.38	–	42,928,688.38
其中:1.基金申购款	691,886,607.55	–	691,886,607.55
2.基金赎回款	-648,957,919.17	–	-648,957,919.17
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)	–	-4,310,890.45	-4,310,890.45
五、期末所有者权益(基金净值)	111,125,490.71	–	111,125,490.71

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

______尹庆军______ ______聂武鹏______ ____于晓莲____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国金鑫盈货币市场证券投资基金(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[2013]1442号文的核准,由国金基金管理有限公司于2013年11月28日至2013年12月11日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具(2013)验字第61004823_A26号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2013年12月16日正式生效,本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金设立时,首次募集(不含认购费)的有效净认购金额为为人民币545,227,344.41元,折合545,227,344.41份基金份额;有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币20,693.49元,折合20,693.49份基金份额;以上收到的实收基金共计人民币545,248,037.90元,折合545,248,037.90份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构均为国金基金管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具,包括现金,通知存款,短期融资券,一年以内(含一年)的银行定期存款和大额存单,剩余期限(或回售期限)在397天以内(含397天)的债券、剩余期限在397天以内(含397天)的中期票据、剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券,期限在一年以内(含一年)的债券回购,期限在一年以内(含一年)的中央银行票据,以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金的业绩比较基准为:人民币七天通知存款利率(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编报规则》第5号《货币市场基金信息披露特别规定》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1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[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。

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

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
上海国金通用财富资产管理有限公司	基金管理人的子公司
国金基金管理有限公司	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
广东宝丽华新能源股份有限公司	基金管理人股东
北京千石创富资本管理有限公司	基金管理人的子公司
苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司	基金管理人股东
涌金投资控股有限公司	基金管理人股东
兴业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 债券交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注:本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 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
当期发生的基金应支付的管理费	829,867.44	296,044.01
其中:支付销售机构的客户维护费	65,732.68	49,150.84

注:1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.33%年费率计提。管理费计算方法如下:

H=E×0.33%/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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的托管费	251,475.16	89,710.33

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.10%/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。

7.4.8.2.3 销售服务费

金额单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费
国金基金管理有限公司	534,846.89
兴业银行股份有限公司	17,438.62
国金证券	6,887.99
合计	559,173.50

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费
国金基金管理有限公司	128,702.14
兴业银行股份有限公司	43,619.53
国金证券	4,179.95
合计	176,501.62

注:本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。销售服务费的计算方法如下:H=E×0.25%÷当年天数

H为每日应计提的基金销售服务费

E为前一日的基金资产净值

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

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日 债券交易金额 基金买入	基金卖出	基金逆回购 交易金额	利息收入	基金正回购 交易金额	利息支出
兴业银行股份有限公司	10,027,474.64	–	–	–	–	–

银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日 债券交易金额 基金买入	基金卖出	基金逆回购 交易金额	利息收入	基金正回购 交易金额	利息支出

注:本基金于上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 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
基金合同生效日(2013年12月16日)持有的基金份额	–	–
期初持有的基金份额	–	–
期间申购/买入总份额	99,117,000.00	–
期间因拆分变动份额	1,369,435.06	–
减:期间赎回/卖出总份额	92,000,000.00	–
期末持有的基金份额	8,486,435.06	–
期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.2506%	–

注:基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

关联方名称	本期末 2015年12月31日 持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	上年度末 2014年12月31日 持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
上海国金通用财富资产管理有限公司	324,997.78	0.2011%	30,114,946.92	27.0999%
北京千石创富资本管理有限公司	28,985,744.90	17.9336%	14,041,137.78	12.6354%

注:除基金管理人之外的其他关联方持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日 期末余额	当期利息收入
兴业银行-活期存款	615,701.56	101,633.08	6,078,306.39	147,077.96
兴业银行-定期存款	–	563,623.63	20,000,000.00	268,511.11
合计	615,701.56	665,256.71	26,078,306.39	415,589.07

注:本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管,按银行同业利率或约定利率计算。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金于本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无

7.4.9 期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

注:本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

注:本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1公允价值

银行存款、买入返售金融资产、应收利息、应收申购款、应付利润等,因其剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

(1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为人民币109,989,650.23元,无属于第一层次及第三层次的余额(2014年12月31日:第二层次人民币64,579,013.54元,无属于第一层次及第三层次的余额)。

(2) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金本报告期持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,在第一层次和第二层次之间无重大转移(2014年度:第一层次和第二层次之间无重大转移)。

本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具未发生转入或转出第三层次公允价值的情况(2014年度:无)。

7.4.14.2承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.3其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.14.4财务报表的批准

本财务报表已于2016年3月25日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	109,989,650.23	67.85
	其中:债券	109,989,650.23	67.85
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	21,000,265.50	12.95
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
3	银行存款和结算备付金合计	28,615,701.56	17.65
4	其他各项资产	2,501,006.25	1.54
5	合计	162,106,623.54	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额		1.85
	其中:买断式回购融资		–
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	0.00	0.00
	其中:买断式回购融资	–	–

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例(%)	原因	调整期
1	2015年5月19日	25.76	巨额赎回	1个交易日
2	2015年8月19日	25.12	巨额赎回	3个交易日
3	2015年8月20日	26.30	巨额赎回	2个交易日
4	2015年8月21日	31.56	巨额赎回	1个交易日

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	99
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	135
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	9

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

注:报告期内本基金无投资组合平均剩余期限超过180天的情况。

8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	52.34	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
2	30天(含)—60天	–	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
3	60天(含)—90天	6.19	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
4	90天(含)—180天	9.29	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
5	180天(含)—397天(含)	30.92	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
	合计	98.75	–

8.4 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	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	9,999,476.52	6.19
	其中:政策性金融债	9,999,476.52	6.19
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	80,017,391.87	49.51
6	中期票据	–	–
7	同业存单	19,972,781.84	12.36
8	其他	–	–
9	合计	109,989,650.23	68.05
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	–	–

8.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	041562022	15皖北CP001	100,000	10,021,671.00	6.20
2	041562008	15法尔胜CP001	100,000	10,012,305.82	6.19
3	041569029	15皖淮南CP001	100,000	10,000,096.25	6.19
4	011599157	15潞安SCP002	100,000	10,000,011.72	6.19
5	041559052	15神火CP002	100,000	9,997,257.62	6.19
6	041564076	15皖山鹰CP002	100,000	9,996,522.61	6.18
7	041560092	15两面针CP001	100,000	9,996,417.89	6.18
8	041559062	15华友钴业CP002	100,000	9,993,108.96	6.18
9	111593124	15江苏江南农村商业银行CD079	100,000	9,986,499.94	6.18
10	111593126	15成都银行CD046	100,000	9,986,281.90	6.18

8.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	35
报告期内偏离度的最高值	0.4175%
报告期内偏离度的最低值	0.0168%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1713%

注:本报告期内,本基金面临巨额赎回,直接使得本基金的偏离度被提升到0.25%以上。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 投资组合报告附注

8.8.1

本基金估值采用"摊余成本法",即估值对象以买入成本列示,按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在剩余存续期内平均摊销,每日计提损益。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。

为了避免采用"摊余成本法"计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离,从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果,基金管理人于每一估值日,采用估值技术,对基金持有的估值对象进行重新评估,即"影子定价"。当"摊余成本法"计算的基金资产净值与"影子定价"确定的基金资产净值偏离达到或超过0.25%时,基金管理人应根据风险控制的需要调整组合,其中,对于偏离程度达到或超过0.5%的情形,基金管理人应与基金托管人协商一致后,参考成交价、市场利率等信息对投资组合进行价值重估,使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

8.8.2

本报告日前一年内,本基金投资前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查、公开谴责、处罚。

8.8.4 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	–
2	应收证券清算款	–
3	应收利息	2,108,551.25
4	应收申购款	392,455.00
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	2,501,006.25

8.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构 机构投资者 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
16,465	9,816.45	123,052,728.13	76.13%	38,575,134.27	23.87%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	24,358.15	0.0151%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2013年12月16日)基金份额总额	545,248,037.90
本报告期期初基金份额总额	111,125,490.71
本报告期基金总申购份额	1,227,200,741.51
减:本报告期基金总赎回份额	1,176,698,369.82
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	–
本报告期期末基金份额总额	161,627,862.40

注:1、总申购份额含红利再投资、转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

2、本报告期末,基金管理人持有本基金的份额为8,486,435.06份,基金管理人的子公司北京千石创富资本管理有限公司(以下简称"千石资本")、上海国金通用财富资产管理有限公司(以下简称"国金财富")持有本基金的份额分别为28,985,744.90、324,997.78份,基金管理人旗下的国金通用-鑫丰量化对冲15号资产管理计划、国金通用-国金鑫丰量化对冲尊享1号资产管理计划持有本基金的份额各为17,139,459.77份,前述持有人均按照本基金《基金合同》及《招募说明书》规定的申购规则及申购费率办理申购业务,基金管理人、千石资本及国金财富已按照法规规定向中国证监会进行了报告。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2015年4月16日,吴富佳先生新任基金管理人副总经理职务。除上述人事调整以外,本报告期内基金管理人无其他重大人事变动。本报告期内,基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内,无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本基金在报告期内投资策略无重大改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

由于基金管理人对于基金投资于不具备基金托管资格银行的协议存款不得超过基金资产净值的5%的规定在建仓期内是否适用的理解有误,导致国金众赢货币市场证券投资基金在建仓期内存放于深圳前海微众银行股份有限公司的协议存款超过了基金资产净值的5%。公司根据监管部门要求已经于2015年10月9日将上述比例调整在5%以内,公司于2015年12月8日收到了中国证券监督管理委员会北京监管局下发的《关于对国金基金管理有限公司采取责令改正行政监管措施的决定》(行政监管措施决定书[2015]68号)。公司根据监管部门要求及时纠正了理解错误,并调整了协议存款比例达到法规规定,未造成基金资产和投资者利益损失。此外,本报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
华创证券	1	–	–	–	–	–

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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
华创证券	–	–	79,000,000.00	100.00%	–	–

11.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

项目	发生日期	偏离度	法定披露报刊	法定披露日期

注:本基金本报告期内不存在偏离度绝对值超过0.5%的情况。

§12 影响投资者决策的其他重要信息

无

国金基金管理有限公司

2016年3月28日