国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

【2016】第一季度报告

基金管理人:国金基金管理有限公司
基金托管人:平安银行股份有限公司
报告送出日期:2016年4月22日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年4月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国金鑫新灵活配置(LOF)
场内简称	国金鑫新
交易代码	501000
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2015年7月3日
报告期末基金份额总额	10,544,087.36份
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	一年期银行定期存款利率(税后)+3%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。
基金管理人	国金基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司

注:无。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

基金简称	报告期(2016年1月1日 - 2016年3月31日)
1.本期已实现收益	134,050.71
2.本期利润	134,050.71
3.加权平均基金份额本期利润	0.0070
4.期末基金资产净值	10,624,176.64
5.期末基金份额净值	1.008

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(不含公允价值变动损益)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损益。

2、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。

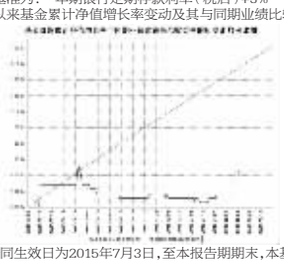
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	0.60%	0.05%	1.11%	0.02%	-0.51%	0.03%

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)+3%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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:1、本基金基金合同生效日为2015年7月3日,至本报告期期末,本基金运作时间未满一年。

3.3 其他指标

注:无

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
宫雪	基金经理	2015年7月3日	-	7	宫雪女士,中国科学院博士。2008年7月至2011年12月在博时基金管理有限公司股票投资部,任产业分析师;2012年2月至今在国金基金管理有限公司,历任产品经理、行业分析师、产品与金融工程部副总经理、指数投资部副总经理,自2014年11月起任指数投资事业部总经理。2013年7月起任国金沪深300指数分级证券投资基金基金经理;2014年8月起任国金鑫安保本混合型证券投资基金基金经理;2015年5月起任国金上证50指数分级证券投资基金基金经理;2015年6月起任国金鑫裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2015年7月起任国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理。

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》、《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金(LOF)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 公平交易专项说明

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》,《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,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,报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 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,本基金主要进行回购投资进行现金管理。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期,本基金份额净值增长率为0.60%,同期业绩比较基准收益率为1.11%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,自2016年1月4日起至2016年2月2日止,本基金已连续二十二个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形;自2016年2月16日起至2016年3月31日止,本基金已连续三十三个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	9,500,000.00	87.99
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,293,684.19	11.98
8	其他资产	2,746.20	0.03
9	合计	10,796,430.39	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有沪港通股票投资。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券投资。

5.5 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债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券投资。

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

报告期,本基金未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

报告期,本基金未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未参与国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体,没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。

5.11.2

基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,069.48
2	应收证券清算款	1,050.28
3	应收股利	-
4	应收利息	626.44
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,746.20

5.11.4 报告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换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	25,319,826.19
报告期期间基金总申购份额	39,886,313.40
减:报告期期间基金总赎回份额	54,662,052.23
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	10,544,087.36

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本报告期,基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内,基金管理人根据《证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站进行了如下信息披露:

1、2016年1月4日披露了《国金基金管理有限公司关于国金基金2015年12月31日旗下基金净值公告》;

2、2016年1月6日披露了《国金基金管理有限公司关于2016年1月4日指数熔断后旗下基金调整开放时间的补充公告》;

3、2016年1月6日披露了《国金基金管理有限公司关于旗下上交所场内股票类基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告》;

4、2016年1月8日披露了《国金基金管理有限公司关于2016年1月7日指数熔断后旗下基金调整开放时间的公告》;

5、2016年1月20日披露了《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金(LOF)2015年第4季度报告》;

6、2016年2月17日披露了《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金(LOF)招募说明书更新》、《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金(LOF)招募说明书更新摘要》;

7、2016年2月26日披露了《国金基金管理有限公司关于直销系统、订单系统升级的公告》;

8、2016年3月9日披露了《国金基金管理有限公司关于电子直销业务增加通联支付第三方支付业务的公告》;

9、2016年3月28日披露了《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金(LOF)2015年度报告》、《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金(LOF)2015年度报告摘要》;

10、2016年3月30日披露了《国金基金管理有限公司关于参加新兰德费率优惠的公告》;

11、本报告期内,基金管理人按照《证券投资基金信息披露管理办法》的规定每个开放日公布基金份额净值和基金份额累计净值。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;

2、国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同;

3、国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金(LOF)托管协议;

4、国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金(LOF)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。

9.2 存放地点

北京市海淀区西三环北路87号国际财经中心D座14层。

9.3 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

国金基金管理有限公司
2016年4月22日

国金众赢货币市场证券投资基金

【2016】第一季度报告

基金管理人:国金基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2016年4月22日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年4月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国金众赢货币
场内简称	-
交易代码	001234
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	2015年6月25日
报告期末基金份额总额	8,452,732,300.00份
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	本基金在确保资产安全性和流动性的基础上,对短期货币市场利率的走势进行预测和判断,采取积极主动的投资策略,综合利用定性分析和定量分析方法,力争获取超越比较基准的投资回报。
业绩比较基准	人民币活期存款利率(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。
基金管理人	国金基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

注:无。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年1月1日 - 2016年3月31日)
1. 本期已实现收益	66,606,940.21
2. 本期利润	66,606,940.21
3. 期末基金资产净值	8,452,732,300.00

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,由于货币市场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的金额相等。

2、本基金收益分配为按日结转份额。

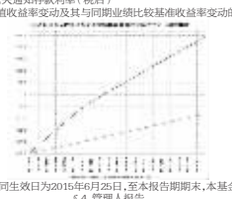
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值收益率①	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	0.8151%	0.0017%	0.3366%	0.0000%	0.4785%	0.0017%

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



注:1、本基金基金合同生效日为2015年6月25日,至本报告期期末,本基金运作时间未满一年。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐艳芳	基金经理	2015年6月25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。

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 公平交易专项说明

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》,《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。

4.3.2 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,报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,国内经济增速有低位企稳迹象,投资增速保持平稳,房地产销售价量齐升,地产投资增速触底反弹,同时大宗商品价格开始回暖,物价中枢有所抬升,通缩压力减缓,虽然外围压力随着美联储鸽派言论有所减缓,但资金成本边际上行,市场信用风险事件迭速攀升。债市基本面和资金面支撑中长期仍在,但短期有所弱化,本基金充分考虑资金的流动性和安全性考虑,适度降低信用工具的投资比例,同时保持短久期策略,提升组合资产的流动性。

4.5 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0.8151%,同期业绩比较基准收益率为0.3366%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	4,892,771,146.39	57.86
	其中:债券	4,892,771,146.39	57.86
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	2,690,426,915.44	31.82
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	100,566,110.66	1.19
3	银行存款和结算备付金合计	822,483,459.28	9.73
4	其他资产	50,355,152.28	0.60
5	合计	8,456,036,673.39	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	3.33
	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	-	-
	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

注:在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	62
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	103
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	53

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。

5.3.2 报告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	49.37	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	6.61	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	24.95	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	12.25	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	6.27	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		99.44	-

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	360,210,486.72	4.26
	其中:政策性金融债	360,210,486.72	4.26
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,775,660,385.19	21.01
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,756,900,274.48	32.62
8	其他	-	-
9	合计	4,892,771,146.39	57.88
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111621015	16渤海银行CD015	5,000,000	497,192,232.20	5.88
2	111619052	16恒丰银行CD052	3,900,000	387,329,711.40	4.58
3	111691304	16北京农商银行CD007	2,500,000	248,703,856.26	2.94
4	111691360	16苏州银行CD028	2,300,000	229,856,410.58	2.72
5	150311	15进出11	2,000,000	200,123,217.40	2.37
6	111691303	16重庆农村商行CD016	2,000,000	199,896,579.30	2.36
7	111690836	16厦门农商行CD002	2,000,000	199,166,499.19	2.36
8	111691486	16中原银行CD004	2,000,000	198,886,233.69	2.35
9	111691581	16洛阳银行CD013	2,000,000	198,848,486.62	2.35
10	041566018	15淮南矿业CP003	1,500,000	149,964,265.73	1.77

5.6 "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	0
报告期内偏离度的最高值	0.1248%
报告期内偏离度的最低值	0.0439%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0891%

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

本基金估值采用"摊余成本法",固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。

5.8.2

报告期内本基金未持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券。

5.8.3 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。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	50,354,364.66
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	787.62
7	其他	-
8	合计	50,355,152.28

5.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	7,153,087,986.81
报告期期间基金总申购份额	25,746,984,537.80
报告期期间基金总赎回份额	24,447,340,224.61
报告期期末基金份额总额	8,452,732,300.00

注:1、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。

2、本报告期末,基金管理人持有本基金的份额为45,052,057.03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")持有本基金的份额为41,872,862.57份,基金管理人和千石资本按照本基金《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,并已按照法规规定向中国证监会进行了报告。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2016年1月7日	6,000,000.00	6,000,000.00	0.00%
2	申购	2016年1月14日	13,000,000.00	13,000,000.00	0.00%
3	赎回	2016年2月1日	20,000,000.00	20,004,569.50	0.00%
4	赎回	2016年2月19日	5,000,000.00	5,000,422.57	0.00%
5	赎回	2016年2月29日	50,000,000.00	50,012,757.60	0.00%
6	赎回	2016年3月2日	12,378,095.45	12,379,206.02	0.00%
7	申购	2016年3月9日	20,000,000.00	2,000,000.00	0.00%
8	申购	2016年3月25日	25,000,000.00	25,000,000.00	0.00%
合计			151,378,095.45	133,396,955.69	

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内,基金管理人根据《证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站进行了如下信息披露:

1、2016年1月4日披露了《国金基金管理有限公司关于国金基金2015年12月31日旗下基金净值公告》;

2、2016年1月16日披露了《国金基金管理有限公司关于国金众赢货币市场证券投资基金限制大额申购业务的公告》;

2、2016年1月20日披露了《国金众赢货币市场证券投资基金2015年第4季度报告》;

3、2016年2月6日披露了《国金众赢货币市场证券投资基金招募说明书更新》、《国金众赢货币市场证券投资基金招募说明书更新摘要》;

4、2016年2月26日披露了《国金基金管理有限公司关于直销系统、订单系统升级的公告》;

5、2016年3月9日披露了《国金基金管理有限公司关于电子直销业务增加通联支付第三方支付业务的公告》;

6、2016年3月28日披露了《国金众赢货币市场证券投资基金2015年度报告》、《国金众赢货币市场证券投资基金2015年度报告摘要》;

7、本报告期内,基金管理人按照《证券投资基金信息披露管理办法》的规定每个开放日公布基金每万份收益和7日年化收益率。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;

2、国金众赢货币市场证券投资基金基金合同;

3、国金众赢货币市场证券投资基金托管协议;

4、国金众赢货币市场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。

9.2 存放地点

北京市海淀区西三环北路87号国际财经中心D座14层。

9.3 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

国金基金管理有限公司
2016年4月22日

国金鑫盈货币市场证券投资基金

【2016】第一季度报告

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
报告送出日期:2016年4月22日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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4月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国金鑫盈货币
场内简称	-
交易代码	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
报告期末基金份额总额	164,311,104.63份
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先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。
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

注:无。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年1月1日 - 2016年3月31日)
1. 本期已实现收益	1,309,369.50
2. 本期利润	1,309,369.50
3. 期末基金资产净值	164,311,104.63

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,由于货币市场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的金额相等。

2、本基金收益分配为按日结转份额。

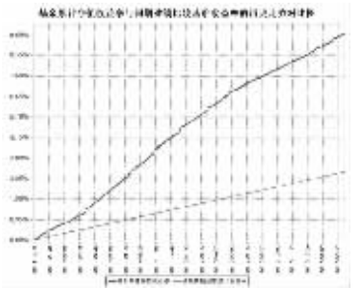
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值收益率①	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	0.7911%	0.0116%	0.3413%	0.0000%	0.4498%	0.0116%

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



注:图示日期为2013年12月16日至2016年3月31日。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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