国金鑫盈货币市场证券投资基金 2017年年度报告摘要

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:2018年3月27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2018年3月26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2017年1月1日起至2017年12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§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	98,764,583.15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,通过标概主动的投资管理,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。

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	杨海燕	张志永
	联系电话	010-88005970	021-62677777-212004
	电子邮箱	yanghaiyan@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办公场所

§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	2017年	2016年	2015年
本期已实现收益	7,355,685.63	6,582,258.53	8,224,417.82
本期利润	7,355,685.63	6,582,258.53	8,224,417.82
本期净值收益率	3.4532%	2.7782%	3.6206%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	2016年末	2015年末
期末可供分配基金份额利润	–	–	–
期末基金资产净值	98,764,583.15	327,342,468.78	161,627,862.40
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.本基金收益分配方按日结转份额。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	0.8348%	0.0029%	0.3450%	0.0000%	0.4898%	0.0029%
过去六个月	1.7080%	0.0022%	0.6900%	0.0000%	1.0180%	0.0022%
过去一年	3.4532%	0.0023%	1.3688%	0.0000%	2.0844%	0.0023%
过去三年	10.1809%	0.0083%	4.1100%	0.0000%	6.0709%	0.0083%
自基金合同生效起至今	15.5481%	0.0096%	5.5388%	0.0000%	10.0093%	0.0096%

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:本基金基金合同生效日为 2013 年 12 月 16 日,图示日期为 2013 年 12 月 16 日至 2017 年 12 月31 日。

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
2017	7,293,681.04	84,123.22	-22,118.63	7,355,685.63	–
2016	6,236,674.02	0.00	59,950.83	6,296,624.85	–
2015	8,517,668.90	0.00	-293,251.08	8,224,417.82	–
合计	22,048,023.96	84,123.22	-255,418.88	21,876,728.30	–

§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、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2017年12月31日,国金基金管理有限公司共管理11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)、国金及第七天理财债券型证券投资基金、国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金、国金民丰回报6个月定期开放混合型证券投资基金。

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	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘辉	本基金基金经理,国金金腾通货币基金经理	2016年8月29日	–	6	刘辉先生,对外经济贸易大学硕士。2011年9月至2013年8月在中债资信评估有限责任公司任评级分析师。2013年8月加入国金基金管理有限公司,历任投资研究部固定收益分析师、基金交易部债券交易员、上海资管事业部投资经理、上海资管事业部基金经理;自2017年3月起任投资管理部基金经理。

注:(1)任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期,首任基金经理的任职日期按基金合同生效日填写;(2)证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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,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,公平对待旗下所有投资组合。在投资决策内部控制方面,各投资组合按投资管理制度和流程独立决策,并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;在交易执行控制方面,通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进,确保公平交易原则的实现;在行为监控和分析评估方面,通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控,确保做好公平交易的监控和分析。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内,未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内,本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易,未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

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

回顾2017年,经济基本面总体保持稳健,经济韧性超预期,GDP增速从2016年的6.7%回升至6.9%,主要是地产和基建投资仍坚挺,同时出口大幅回升。通胀方面,受食品价格拖累,全年CPI同比增速保持在1.6%的低位,较上年有所回落;受供给侧改革以及国际油价上涨影响,工业品价格结束通缩,PPI回升到6.3%的高位。

政策方面,2017年金融监管全面加强,全国金融工作会议为金融监管、防风险定调,2017年11月17日中国人民银行发布《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见(征求意见稿)》,银监会加强了影子银行监管。在去杠杆、防风险的政策基调下,货币政策总体偏紧,资金面呈现紧平衡态势,并且随着美联储加息,中国人民银行相应提升了公开市场操作利率。

在基本面超预期、金融监管升级、货币政策略紧的背景下,债券市场收益率大幅上行,10年期国债收益率从2017年初3.0%左右上行至年末的3.9%左右的高位。

报告期内,本基金依旧保持稳健的操作风格,始终把流动性风险放在第一位,根据中国人民银行态度和资金面的变化,灵活调整债券仓位和久期,在控制风险的同时,为投资人提供了合理回报。

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3.4532%,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

展望2018年,国内经济增速将较2017年有所回落:基建投资方面,政府融资趋严、预算赤字降低将拖累基建投资增速,房地产投资也面临融资受限以及销售放缓压力制约,出口方面,受前期基数较高、人民币汇率升值、贸易战等因素影响,预计出口增速将放缓。通胀方面,2018年食品拖累将逐步减弱,叠加PPI逐步向CPI非食品价格的传导,以及国际油价的上涨,预计CPI中枢将有所回升,但仍将保持在温和范围内。国内基建、地产投资需求趋弱,将使得上游原材料价格环比涨幅趋缓,叠加2017年较高的基数,2018年PPI将逐步回落。政策方面,2018年金融监管预计将进一步加强,资管新规以及银行理财等监管政策将逐步落地,但经过前期消化,预计不会对市场造成更大冲击。货币政策方面,随着国内收益率和融资成本逐步上行,以及金融去杠杆逐步见到成效,预计货币政策可能会随着基本面的走弱而有所放松。综合而言,预计2018年债市收益率将呈现震荡下行的格局。

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152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)等方面进行稽核,对于稽核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,估值委员会由公司督察长、投资总监、运营总监、清算业务负责人、研究部门负责人、风控业务负责人、合规业务负责人组成,可根据需要邀请产品托管行代表、公司独立董事、会计师事务所代表等外部人员参加。公司运营总监为公司基金估值委员会主席。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,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,并每日进行支付。

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(2018)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
审计意见	我们审计了国金鑫盈货币市场证券投资基金的财务报表,包括2017年12月31日的资产负债表,2017年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。 我们认为,后附的国金鑫盈货币市场证券投资基金的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2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	–
强调事项	–
其他事项	–
其他信息	–
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、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导致的重大错报。 在编制财务报表时,管理层负责评估国金鑫盈货币市场证券投资基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督国金鑫盈货币市场证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作: (1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2)了解与审计相关的内部控制,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。 (3)评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4)对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对国金鑫盈货币市场证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致国金鑫盈货币市场证券投资基金不能持续经营。 (5)评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露),并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
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)
注册会计师的姓名	徐艳 贺耀
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17层01-12室
审计报告日期	2018年3月26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:2017年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
资 产:			
银行存款		50,400,619.51	6,925,990.66
结算备付金		–	886,363.67
存出保证金		–	–
交易性金融资产		9,972,114.49	99,761,952.66
其中:股票投资		–	–
基金投资		–	–
债券投资		9,972,114.49	99,761,952.66
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		38,712,498.07	219,496,535.94
应收证券清算款		–	–
应收利息		330,550.56	800,826.73
应收股利		–	–
应收申购款		27,302.00	72,080.68
递延所得税资产		–	–
其他资产		–	–
资产总计		99,443,084.63	327,943,750.34
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016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		–	24,699.80
应付管理人报酬		24,947.64	80,337.62
应付托管费		7,559.89	24,344.75
应付销售服务费		18,899.72	60,861.83
应付交易费用		5,194.77	10,198.67
应交税费		–	–
应付利息		–	–
应付利润		50,198.19	72,316.82
递延所得税负债		–	–
其他负债		571,701.27	328,522.07
负债合计		678,501.48	601,281.56
所有者权益:			
实收基金		98,764,583.15	327,342,468.78
未分配利润		–	–
所有者权益合计		98,764,583.15	327,342,468.78
负债和所有者权益总计		99,443,084.63	327,943,750.34

注:报告截止日2017年12月31日,国金鑫盈货币基金份额净值1.0000元,基金份额总额98764583.15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:2017年1月1日至2017年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
一、收入		9,280,975.70	8,623,998.98
1.利息收入		9,278,717.63	8,368,915.97
其中:存款利息收入		1,370,973.51	1,428,590.79
债券利息收入		5,117,234.37	3,784,063.06
资产支持证券利息收入		–	–
买入返售金融资产收入		2,790,509.75	3,156,262.12
其他利息收入		–	–
2.投资收益(损失以"-"填列)		-42,741.93	255,083.01
其中:股票投资收益		–	–
基金投资收益		–	–
债券投资收益		-42,741.93	255,083.01
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)		45,000.00	–
减:二、费用		1,925,290.07	2,041,740.45
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	713,236.16	854,668.47
2. 托管费	7.4.8.2.2	216,132.21	258,990.23
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	540,330.30	647,476.21
4. 交易费用		–	–
5. 利息支出		27,276.90	35,324.80
其中:卖出回购金融资产支出		27,276.90	35,324.80
6. 其他费用		428,314.50	245,280.74
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		7,355,685.63	6,582,258.53
减:所得税费用		–	–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		7,355,685.63	6,582,258.53

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:2017年1月1日至2017年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017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)	327,342,468.78	–	327,342,468.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	–	7,355,685.63	7,355,685.63
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)	-228,577,885.63	–	-228,577,885.63
其中:1.基金申购款	432,685,813.56	–	432,685,813.56
2.基金赎回款	-661,263,699.19	–	-661,263,699.19
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)	–	-7,355,685.63	-7,355,685.63
五、期末所有者权益(基金净值)	98,764,583.15	–	98,764,583.15
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016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)	161,627,862.40	–	161,627,862.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	–	6,582,258.53	6,582,258.53
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)	165,714,606.38	–	165,714,606.38
其中:1.基金申购款	3,303,583,203.98	–	3,303,583,203.98
2.基金赎回款	-3,137,868,597.60	–	-3,137,868,597.60
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)	–	-6,582,258.53	-6,582,258.53
五、期末所有者权益(基金净值)	327,342,468.78	–	327,342,468.78

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(原名称为"国金通用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。2015年9月23日,本基金名称由"国金通用鑫盈货币市场证券投资基金"变更为"国金鑫盈货币市场证券投资基金"。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2017年12月31日的财务状况以及2017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

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.增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定,经国务院批准,自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点,金融业纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税;国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税;存款利息收入不征收增值税;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定,金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定,金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定,资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人;

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,自2018年1月1日起,资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为(以下简称"资管产品运营业务"),暂适用简易计税方法,按照