国金金腾通货币市场证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31日

基金管理人:国金基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月20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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月19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2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国金金腾通	
场内简称	-	
交易代码	000540	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年2月17日	
报告期末基金份额总额	14,018,949,737.45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	中国民生银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	国金金腾通货币A	国金金腾通货币C
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	000540	001621
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	13,427,757,754.90份	591,191,982.55份

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(2015年10月1日 - 2015年12月31日)	
	国金金腾通货币A	国金金腾通货币C
1. 本期已实现收益	113,506,367.11	2,870,169.13
2.本期利润	113,506,367.11	2,870,169.13
3.期末基金资产净值	13,427,757,754.90	591,191,982.55

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

国金金腾通货币A

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	0.8519%	0.0065%	0.0882%	0.0000%	0.7637%	0.0065%

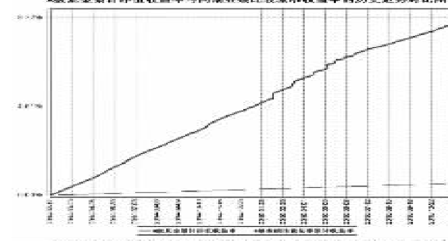
注:本基金的业绩比较基准为:人民币活期存款利率(税后)

国金金腾通货币C

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	0.6685%	0.0065%	0.0882%	0.0000%	0.5803%	0.0065%

注:本基金的业绩比较基准为:人民币活期存款利率(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



§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	2014年2月17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》、《国金金腾通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》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9只基金产品,分别为4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,报告期内严格执行公司相关制度,严格控制旗下非指数型投资组合参与交易所公开竞价同日反向交易,未发现存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

第三产业对经济拉动持续发力,经济增长动力从投资转向消费;消费稳中有升,餐饮表现出色,限额企业零售好转;投资增速下行压力明显,基建仍在托底;出口增速整体偏弱,对经济增长贡献动能不强;财政支出增速偏高,财政收支缺口压力增大;收入增速不及支出,财政收支恶化;内需不足,CPI多月"1"时代。

美国加息,人民币贬值,资金流出压力持续增大,外汇占款缩减;央行各种花样宽松,降息、降准、定向量宽;资金面维持宽松,资金利率低位;基本面强力支撑、资金面强力拉动下,无风险利率创新低,信用利差被挤压至低位,债市"资产荒"蔓延,信用风险扩大。本基金在充分考虑安全性和流动性的基础上,保持稳健的操作风格,适时调整组合资产的配置,维持适中的债券仓位占比,防范市场和流动性风险,同时自下而上精选短期信用债以防范个券的信用风险,为投资者提供稳健的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金的金腾通货币A份额净值收益率为0.8519%,同期业绩比较基准收益率为0.0882%;本基金的金腾通货币C份额净值收益率为0.6685%,同期业绩比较基准收益率为0.0882%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

前瞻性指标偏弱,经济增长动能不强;稳增长政策下大中型企业表现优于中小企业;2016年稳增长压力仍然较大,若地产投资无法好转,经济下行压力难缓。CPI仍在低位,实体经济增速下行,内需不足,消费难旺,预计CPI仍维持低位;PPI负值延续,美元走强,人民币贬值,大宗继续受压制,油价下跌,国内经济去产能,需求不足,通缩延续。货币政策放松空间有限,受制于美国加息和中美利差缩窄。

人民币贬值压力下,外汇占款流出速度可能偏高,央行能否对冲以及对冲时点存不确定性;债市收益率经过上年四季度大涨后下行空间收窄,汇率事件、信用事件、权益市场超预期波动等黑天鹅事件可能抬升市场的流动性风险。

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	10,218,823,592.01	71.24
	其中:债券	10,218,823,592.01	71.24
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	3,119,167,330.41	21.75
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	831,157,578.41	5.79
3	银行存款和结算备付金合计	905,690,035.47	6.31
4	其他资产	100,396,420.14	0.70
5	合计	14,344,077,378.03	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		1.63
	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	319,999,400.00	2.28
	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

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	92
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	104
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	46

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	33.98	2.28
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	3.56	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.35	-
3	60天(含)-90天	27.51	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	24.43	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	12.11	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	101.60	2.28

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	959,304,929.32	6.84
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	4,545,612,917.43	32.42
6	中期票据	-	-
7	同业存单	4,713,905,745.26	33.63
8	其他	-	-
9	合计	10,218,823,592.01	72.89
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	49,518,587.48	0.35

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	150413	15农发13	5,000,000	499,683,987.12	3.56
2	111593303	15绍兴银行CD066	4,000,000	393,547,694.42	2.81
3	011537013	15中建材SCP013	3,000,000	299,698,560.99	2.14
4	111593413	15瑞丰银行CD013	3,000,000	299,287,074.42	2.13
5	111593328	15浙江泰隆商行CD017	3,000,000	297,705,342.29	2.12
6	111593407	15富滇银行CD026	3,000,000	297,665,208.72	2.12
7	111592832	15绍兴银行CD064	3,000,000	295,576,839.87	2.11
8	011501001	15中石油SCP001	2,000,000	199,957,444.02	1.43
9	111593382	15长安银行CD024	2,000,000	199,587,850.27	1.42
10	111593444	15长安银行CD027	2,000,000	199,504,063.10	1.42
10	111593430	15浙江泰隆商行CD019	2,000,000	199,504,063.10	1.42

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	-
报告期内偏离度的最高值	0.2370%
报告期内偏离度的最低值	0.1194%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1731%

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",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。

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	100,388,920.14
4	应收申购款	-
5	其他应收款	7,500.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	100,396,420.14

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

项目	国金金腾通货币A	国金金腾通货币C
报告期期初基金份额总额	14,271,628,200.47	2,715,716.91
报告期期间基金总申购份额	98,048,973,844.19	4,134,831,116.12
减:报告期期间基金总赎回份额	98,892,844,289.76	3,546,354,850.48
报告期期末基金份额总额	13,427,757,754.90	591,191,982.55

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,基金管理人的子公司上海国金通用财富资产管理有限公司(以下简称"国金财富")持有本基金的金腾通货币A份额为70,568,582.69份,基金管理人的关联方国金道富投资服务有限公司、国金创新投资有限公司持有本基金的金腾通货币A份额分别为13,315,175.62份、1,510,121.10份,基金管理人子公司北京千石创富资本管理有限公司旗下的资管计划千石资本国圣1号资产管理计划、千石资本-兴云回运动1号资产管理计划持有本基金的金腾通A份额分别为74,785,953.64份、1,548.16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,国金财富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情况

7.1 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》及基金管理人网站披露如下信息:

1、2015年10月27日披露了《国金金腾通货币市场证券投资基金2015年第3季度报告》;

2、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、国金金腾通货币市场证券投资基金基金合同;
3、国金金腾通货币市场证券投资基金托管协议;
4、国金金腾通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1月20日

国金鑫安保本混合型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31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
报告送出日期:2016年1月20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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月19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2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国金鑫安保本
场内简称	-
交易代码	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
基金合同生效日	2014年8月27日
报告期末基金份额总额	1,681,481,167.04份
投资目标	本基金在保证客户本金的基础上,力争为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金通过固定比例投资组合保险(CPPI,Constant Proportion Portfolio Insurance)策略和时间不变性投资组合保险(TIPP,Time Invariant Portfolio Protection)策略,在保本周期中,对资产配置严格按照公司开发的保本模型进行优化动态调整,确保投资者的投资本金的安全性。同时,本基金通过积极稳健的收益资产投资策略,竭力为基金资产获取更高的增值回报。 本基金的投资策略主要由五部分组成:资产配置策略、债券投资策略、股票投资策略、股指期货投资策略、权证投资策略。
业绩比较基准	一年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金为保本混合型基金,属于证券投资基金中的中低风险品种,其预期风险和预期收益低于股票型基金和非保本的混合型基金,高于货币市场基金和债券型基金。
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
基金保证人	瀚华担保股份有限公司

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(2015年10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	13,289,483.26
2.本期利润	24,222,184.06
3.加权平均基金份额本期利润	0.0143
4.期末基金资产净值	1,705,950,037.97
5.期末基金份额净值	1.015

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、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。

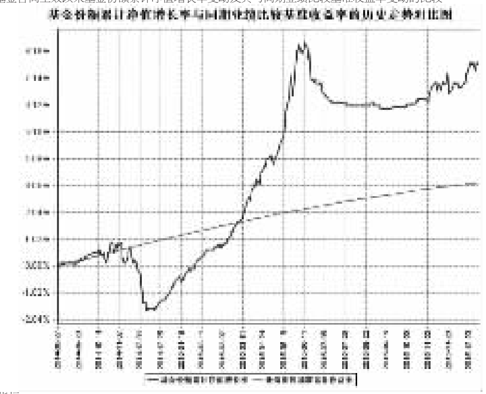
3.2 基金净值表现

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	1.50%	0.15%	0.39%	0.01%	1.11%	0.14%

注:本基金的业绩比较基准为:一年期定期存款收益率(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



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	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
宫雪	基金经理	2014年8月27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月起任国金鑫运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。
彭俊斌	基金经理	2015年5月5日	-	4	彭俊斌先生,清华大学博士。2008年5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。
滕祖光	基金经理	2015年8月18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》、《国金鑫安保本混合型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》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9只基金产品,分别为4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,报告期内严格执行公司相关制度,严格控制旗下非指数型投资组合参与交易所公开竞价同日反向交易,未发现存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年4季度,本基金严格遵守基金合同,在保本周期中,对资产配置严格按照公司开发的保本模型进行优化动态调整,确保投资者的投资本金的安全性。同时,本基金通过积极稳健的收益资产投资策略,竭力为基金资产获取更高的增值回报。

4.4.2 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1.50%,同期业绩比较基准收益率为0.39%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

4季度宏观经济呈现趋稳迹象。但由于外需持续疲软以及政策效应弱化,宏观经济趋稳的基础并不扎实,宏观经济总体状况依旧疲软,经济主要指标仍旧未见明显好转,投资增速仍然趋缓,消费增速平稳,出口仍旧困难。随着未来去产能、去杠杆、去库存的逐步落实,宏观经济整体很难有明显回升。微观层面,资金面持续宽松的预期没有变化,但人民币贬值、注册制推出等因素给证券市场带来很大的不确定性,市场全面上行的动力不足,但局部性行业仍存结构性机会。

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	权益投资	201,847,508.71	11.80
	其中:股票	201,847,508.71	11.80
2	固定收益投资	991,600,938.35	57.95
	其中:债券	991,600,938.35	57.95
	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	447,951,221.50	26.18
	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	47,875,042.32	2.80
7	其他资产	21,814,103.72	1.27
8	合计	1,711,088,814.60	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	125,750,230.71	7.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,901,431.00	0.35
E	建筑业	764,359.95	0.04
F	批发和零售业	4,195,518.49	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	13,744,346.00	0.81
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,820,459.86	0.93
J	金融业	14,578,770.00	0.85
K	房地产业	8,067,723.63	0.47
L	租赁和商务服务业	4,132,267.00	0.24
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	3,541,380.00	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	5,351,022.07	0.31
S	综合	-	-
	合计	201,847,508.71	11.83

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002142	宁波银行	400,000	6,204,000.00	0.36
2	600485	信威集团	200,000	5,350,000.00	0.31
3	601009	南京银行	300,000	5,310,000.00	0.31
4	002032	苏泊尔	187,544	5,217,474.08	0.31
5	300124	汇川技术	99,924	4,716,412.80	0.28
6	601021	春秋航空	75,000	4,575,000.00	0.27
7	600660	福耀玻璃	300,000	4,557,000.00	0.27
8	600048	保利地产	400,000	4,256,000.00	0.25
9	002484	江海股份	150,000	3,885,000.00	0.23
10	002146	荣盛发展	399,971	3,811,723.63	0.22

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	公允价值(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	84,823,500.00	4.97
	其中:政策性金融债	84,823,500.00	4.97
4	企业债券	122,535,438.35	7.18
5	企业短期融资券	481,359,000.00	28.22
6	中期票据	302,883,000.00	17.75
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	991,600,938.35	58.13

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1182146	11凯迪MTN1	1,000,000	101,550,000.00	5.95
2	011599833	15机床SCP003	1,000,000	99,990,000.00	5.86
3	011582002	15太钢SCP002	900,000	90,270,000.00	5.29
4	011599418	15瑞水泥SCP002	700,000	70,469,000.00	4.13
5	011599765	15美邦SCP001	600,000	59,994,000.00	3.52

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持有股指期货。

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	268,042.88
2	应收证券清算款	382,064.29
3	应收股利	-
4	应收利息	21,159,925.51
5	应收申购款	4,071.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,814,103.72

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	1,703,829,375.70
报告期期间基金总申购份额	1,153,624.30
减:报告期期间基金总赎回份额	23,501,832.96
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	1,681,481,167.04

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,基金管理人的子公司上海国金通用财富资产管理有限公司(以下简称"国金财富")持有本基金的份额为6,092,850.6份,国金财富按照本基金《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、2015年10月21日披露了《国金基金管理有限公司关于增加中国国际金融股份有限公司为旗下基金销售机构的公告》;
2、2015年10月27日披露了《国金基金管理有限公司关于增加积木基金为旗下基金销售机构的公告》;
3、2015年10月27日披露了《国金鑫安保本混合型证券投资基金2015年第3季度报告》;
4、2015年11月2日披露了《国金基金管理有限公司关于增加嘉实财富管理有限公司为旗下基金销售机构的公告》;
5、2015年11月5日披露了《国金基金管理有限公司关于旗下基金所持"北京银行"股票估值调整的公告》;
6、2015年11月13日披露了《国金基金管理有限公司关于增加珠海盈米财富管理有限公司为旗下基金销售机构的公告》;
7、2015年11月23日披露了《国金基金管理有限公司关于参加利得基金和积木基金费率优惠的公告》;
8、2015年11月25日披露了《国金基金管理有限公司关于增加中信期货有限公司为旗下基金销售机构的公告》;
9、2015年12月17日披露了《国金基金管理有限公司关于增加上海陆金所资产管理有限公司为旗下基金销售机构的公告》;
10、2015年12月22日披露了《国金基金管理有限公司关于参加众禄金融费率优惠的公告》;
11、2015年12月31日披露了《国金基金管理有限公司关于指数熔断机制实施后旗下基金调整开放时间的公告》;
12、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。

§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、国金鑫安保本混合型证券投资基金基金合同;
3、国金鑫安保本混合型证券投资基金托管协议;
4、国金鑫安保本混合型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1月20日

国金鑫盈货币市场证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31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
报告送出日期:2016年1月20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1月19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2015年10月1日起至12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	161,627,862.40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(2015年10月1日 - 2015年12月31日)
1. 本期已实现收益	2,561,054.40
2.本期利润	2,561,054.40
3.期末基金资产净值	161,627,862.40

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。

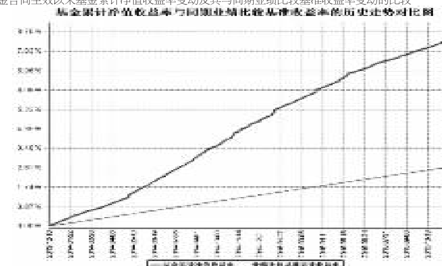
3.2 基金净值表现

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	0.7212%	0.0052%	0.3450%	0.0000%	0.3762%	0.0052%

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



§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 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》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9只基金产品,分别为4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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

房地产投资和制造业下滑的影响,四季度前两月固定资产投资完成额累计同比下行至10.20%,工业增加值在11月份回升至6.20%,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。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。

在新股申购的几次短期扰动后,市场流动性在年底没有出现太大波动,资金面依然保持相对宽松,但短期资金成本也没有随着无风险利率下行。

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0.7212%,同期业绩比较基准收益率为0.3450%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

四季度的债券市场保持相对平稳牛市格局,"资产荒"仍在继续,利率品和高等级的信用债受到市场的追捧,收益率下行,信用违约事件不断发生,致使中低资质的信用品收益率下行受限,信用风险利差扩大。预计债券市场牛市格局将延续,但收益率下行空间相对有限。信用债方面,随着信用违约事件的增加,对于低评级的信用品依然要保持谨慎。目前信用品的收益水平已经很难满足市场需求,股票市场回暖仍可能引发资金回流。

央行在12月份未进行降准,市场预期落空,关于宽松货币政策的判断要有所调整,虽然调降存款准备金率有很大的操作空间,但央行在实际操作中仍然比较谨慎,另外,目前央行对于市场短期流动性问题,会通过MLF和SLF进行调节,宽松的货币政策是适当的,而不是不停的放水。但四季度以来人民币再次出现大幅度贬值,央行外汇储备和金融机构外汇占款下降,央行外汇储备减少1838亿美元,未来人民币贬值压力仍将存在,为了对冲资本外流的风险,央行仍有可能在春节前下调一次存款准备金率。

综合来看,四季度的债券市场走势相对平稳,牛市格局的基本面因素没有出现改变,但随着无风险收益率的不断下行,市场需求不断被释放,空间已经相对有限。

未来本基金将在保证流动性的前提下,维持债券、存款和回购为主的组合资产配置状况,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 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	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	其他资产	2,501,006.25	1.54
5	合计	162,106,623.54	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		1.77
	其中:买断式回购融资		0.00
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	99
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	104
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	69

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	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	-

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	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	-	-

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	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皖淮海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

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	1
报告期内偏离度的最高值	0.2503%
报告期内偏离度的最低值	0.1101%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1608%

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。

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",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。在有关法律法规允许交易所短期债券可以采用摊余成本法估值前,本基金暂不投资于交易所短期债券。

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	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

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	440,364,028.40
报告期期间基金总申购份额	87,251,082.32
减:报告期期间基金总赎回份额	365,987,248.32
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、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。

§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	2015年10月15日	5,000,000.00	5,000,000.00	0.00%
2	申购	5015年10月19日	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00%
3	申购	2015年11月4日	5,000,000.00	5,000,000.00	0.00%
4	赎回	2015年12月16日	10,000,000.00	10,000,696.86	0.00%
5	赎回	2015年12月28日	69,000,000.00	69,023,516.56	0.00%
合计			99,000,000.00	99,024,213.42	

§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、2015年10月21日披露了《国金基金管理有限公司关于增加中国国际金融股份有限公司为旗下基金销售机构的公告》;
2、2015年10月27日披露了《国金鑫盈货币市场证券投资基金2015年第3季度报告》、《国金基金管理有限公司关于增加积木基金为旗下基金销售机构的公告》;
3、2015年11月2日披露了《国金基金管理有限公司关于增加嘉实财富管理有限公司为旗下基金销售机构的公告》;
4、2015年11月5日披露了《国金基金管理有限公司关于旗下基金所持"北京银行"股票估值调整的公告》;
5、2015年11月13日披露了《国金基金管理有限公司关于增加珠海盈米财富管理有限公司为旗下基金销售机构的公告》;
6、2015年11月23日披露了《国金基金管理有限公司关于参加利得基金和积木基金费率优惠的公告》;
7、2015年11月25日披露了《国金基金管理有限公司关于增加中信期货有限公司为旗下基金销售机构的公告》;
8、2015年12月17日披露了《国金基金管理有限公司关于增加上海陆金所资产管理有限公司为旗下基金销售机构的公告》;
9、2015年12月22日披露了《国金基金管理有限公司关于参加众禄金融费率优惠的公告》;
10、2015年12月29日披露了《国金鑫盈货币市场证券投资基金2016年元旦假期暂停大额申购、大额定期定额投资业务的公告》;
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、国金鑫盈货币市场证券投资基金基金合同;
3、国金鑫盈货币市场证券投资基金托管协议;
4、国金鑫盈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1月20日