

国金鑫盈货币市场证券投资基金 2016 年年度报告

2016 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

送出日期：2017 年 3 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

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 2017 年 3 月 27 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 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 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.....	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
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.....	14
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	19
§8 投资组合报告	40
8.1 期末基金资产组合情况.....	40
8.2 债券回购融资情况.....	41
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	41
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	42
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
8.6 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.....	42
8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	43

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	43
8.9 投资组合报告附注	43
§9 基金份额持有人信息	44
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	44
9.3 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	45
§10 开放式基金份额变动	45
§11 重大事件揭示	45
11.1 基金份额持有人大会决议	45
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	45
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
11.4 基金投资策略的改变	45
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	46
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	46
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	46
11.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况	47
11.9 其他重大事件	47
§12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录	52
12.2 存放地点	52
12.3 查阅方式	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国金鑫盈货币市场证券投资基金
基金简称	国金鑫盈货币
基金主代码	000439
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	327,342,468.78 份
基金合同存续期	不定期

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。

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
注册地址		北京市怀柔区府前街三号楼 3-6	福州市湖东路 154 号
办公地址		北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 层	上海市江宁路 168 号兴业大厦 20 楼
邮政编码		100089	200041
法定代表人		尹庆军	高建平

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》。
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层
注册登记机构	国金基金管理有限公司	北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 层

§ 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	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	6,582,258.53	8,224,417.82	4,310,890.45
本期利润	6,582,258.53	8,224,417.82	4,310,890.45
本期净值收益率	2.7782%	3.6206%	4.6900%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末基金资产净值	327,342,468.78	161,627,862.40	111,125,490.71
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
累计净值收益率	11.6776%	8.6588%	4.8621%

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

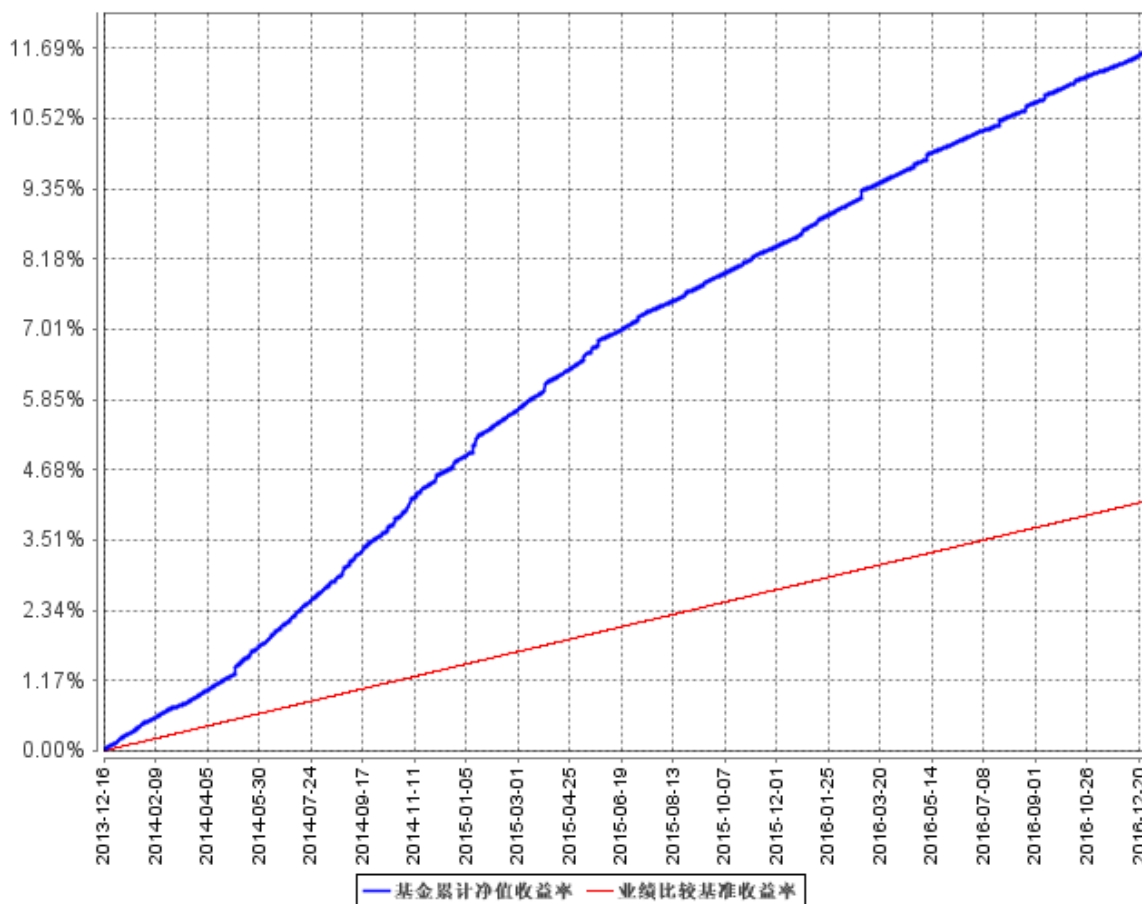
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益率标	①—③	②—④
----	----------	----------	----------	------------	-----	-----

		准差②	率③	准差④		
过去三个月	0.6005%	0.0037%	0.3450%	0.0000%	0.2555%	0.0037%
过去六个月	1.2846%	0.0079%	0.6900%	0.0000%	0.5946%	0.0079%
过去一年	2.7782%	0.0089%	1.3725%	0.0000%	1.4057%	0.0089%
自基金合同生效起至今	11.6776%	0.0110%	4.1700%	0.0000%	7.5076%	0.0110%

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

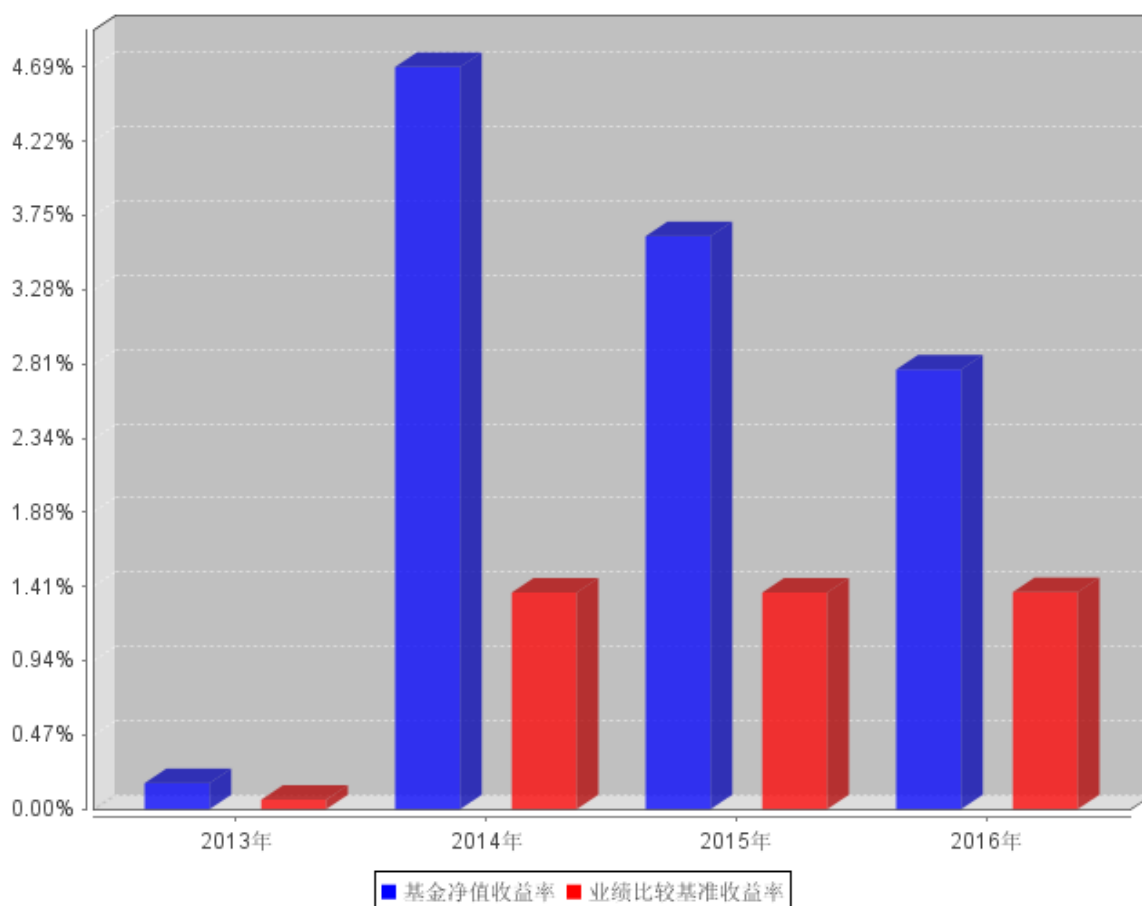
基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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 2016 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

自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



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
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	
2014	4,106,043.73	0.00	204,846.72	4,310,890.45	
合计	18,860,386.65	0.00	-28,453.53	18,831,933.12	

§ 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2016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。

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	2016年8月29日	-	6	刘辉先生，对外经济贸易大学硕士。2011年8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；自2016年8月起任上海资管事业部基金经理。
徐艳芳	本基金基金经理，国金国鑫发起、国金金腾货币、国金众赢货币、国金及第七天理财基金经理，固定收益投资部总经理	2013年12月16日	2016年10月12日	8	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师、英大泰和财产保险股份有限公司投资经理。2012年6月加入国金基金管理有限公司，历任投资研究部基金经理、固定收益投资部基金经理；自2016年4月起任固定收益投资部总经理兼基金经理。

滕祖光	本基金基金经理，国金鑫发起、国金鑫安保本基金基金经理	2014 年 4 月 11 日	2016 年 10 月 12 日	11	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业务员、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，历任基金交易部高级交易员、投资研究部基金经理；自 2014 年 11 月起任固定收益投资部基金经理。
-----	----------------------------	-----------------	------------------	----	--

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合规守信情况的说明

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》和其他有关法律法规的规定，以及《国金鑫盈货币市场证券投资基金基金合同》的约定，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

2016 年国内房地产销售和投资继续回升，政府稳增长政策之下，基建投资也维持较高增速。2016 年车辆购置税优惠政策提振汽车消费，房地产销售回升带动房屋相关消费回升，支撑 16 年消费总体保持平稳增长。在投资和消费平稳增长的带动下，2016 年国内宏观经济呈现企稳迹象，全年 GDP 增速维持在 6.70%。通胀方面，在供给侧改革发力、下游需求企稳的背景下，上游煤炭、钢铁等工业品价格大幅上涨，推动 16 年 PPI 持续回升、全年 PPI 达-1.4%，跌幅较 15 年大幅收窄；CPI 也在猪肉等食品价格的推动下温和回升至 2%。政策方面，在经济企稳的背景下，中央将控泡沫、降杠杆、防风险放在了更加突出的位置，自 8 月中旬开始，央行开启了“锁短放长”的公开市场操作、逐步收紧货币政策。资金面方面，随着央行货币政策逐步收紧，叠加年底季节性因素，11 月以来资金面持续攀升，最终诱发债市在年底出现一轮急速、大幅的调整。

在报告期内，本基金保持稳健的操作风格，始终把流动性管理放在第一位，提前预判各种风险，合理控制久期和债券仓位，为持有人提供了稳健合理的投资收益。

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 2.7782%，同期业绩比较基准收益率为 1.3725%。

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 2017 年，经济增速将前高后低：企业主动补库周期仍将支撑上半年经济增长，下半年地产调控效应显现、地产投资下滑将施压经济增长。2017 年 PPI 环比将继续上涨、但幅度回落，同比将呈现前高后低走势、全年将转正，原油及其他工业品价格和房价的上涨向 CPI 中工业制成品和服务的传导，预计将推动 17 年 CPI 温和回升。政策方面，中央已明确将防风险放在首要位置，央行确立了稳健中性的货币政策基调，上半年央行货币政策将延续收紧态势，下半年经济下行压力加大之时可能会有所松动，相应地，资金面在上半年维持紧平衡态势，下半年可能会有所松动。综合来看，上半年债券收益率保持震荡态势，下半年可能会打开下行空间。

投资策略上，本基金将风险控制放在组合管理的第一位，严格控制组合流动性风险、信用风险和利率风险，根据市场变化、调节组合债券仓位和久期，在风险可控的基础上，继续为持有人创造稳健的收益。

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 117 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，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，并每日进行支付。

4.9 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（2017）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 2016 年 12 月 31 日的资产负债表，2016 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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	
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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	汤 骏	贺 耀
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	2017 年 3 月 27 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：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	6,925,990.66	28,615,701.56
结算备付金		886,363.67	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	99,761,952.66	109,989,650.23
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		99,761,952.66	109,989,650.23
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	219,496,535.94	21,000,265.50
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	800,826.73	2,108,551.25
应收股利		-	-
应收申购款		72,080.68	392,455.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		327,943,750.34	162,106,623.54
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
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		80,337.62	85,851.65
应付托管费		24,344.75	26,015.65
应付销售服务费		60,861.83	65,039.13

应付交易费用	7.4.7.7	10,198.67	10,167.48
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		72,316.82	12,365.99
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	328,522.07	279,321.24
负债合计		601,281.56	478,761.14
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	327,342,468.78	161,627,862.40
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		327,342,468.78	161,627,862.40
负债和所有者权益总计		327,943,750.34	162,106,623.54

注：报告截止日 2016 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 327,342,468.78 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		8,623,998.98	10,265,659.12
1.利息收入		8,368,915.97	9,188,380.59
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,428,590.79	1,777,703.24
债券利息收入		3,784,063.06	4,230,456.11
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,156,262.12	3,180,221.24
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		255,083.01	1,057,278.53
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	255,083.01	1,057,278.53
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	20,000.00

减：二、费用		2,041,740.45	2,041,241.30
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	854,668.47	829,867.44
2. 托管费	7.4.10.2.2	258,990.23	251,475.16
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	647,476.21	628,687.43
4. 交易费用	7.4.7.19	-	-
5. 利息支出		35,324.80	89,718.03
其中：卖出回购金融资产支出		35,324.80	89,718.03
6. 其他费用	7.4.7.20	245,280.74	241,493.24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,582,258.53	8,224,417.82
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,582,258.53	8,224,417.82

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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 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
项目	上年度可比期间 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

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（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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 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。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金的金融资产于初始确认时分类为交易性金融资产及贷款和应收款项。本基金持有的交易性金融资产主要包括债券投资等。

本基金的金融负债于初始确认时归类为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

本基金的金融资产在初始确认时以公允价值计量。本基金对所持有的债券投资以摊余成本法进行后续计量。本会计期间内，本基金持有的债券投资的摊余成本接近其公允价值。

本基金的金融负债于初始确认时以公允价值计量，并以摊余成本进行后续计量。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认，即从本基金账户和资产负债表内予以转销；金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 债券投资

买入银行间同业市场交易的债券于成交日确认为债券投资。债券投资按实际支付的全部价款入账，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本，对于贴息债券，该等利息应作为债券投资成本；卖出银行间同业市场交易的债券于成交日确认债券投资收益。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

(2) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购）以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以使用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有

重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

本基金估值采用摊余成本法，其相当于公允价值。估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内摊销，每日计提收益或损失。

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；

本基金金融工具的估值方法具体如下：

(1) 银行存款

本基金持有的银行存款以本金列示，按银行实际协议利率逐日计提利息；

(2) 债券投资

本基金持有的附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

(3) 回购协议

1) 本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息；

2) 本基金持有的买断式回购以协议成本列示，所产生的利息在实际持有期间内逐日计提。回购期间对涉及的金融资产根据其资产的性质进行相应的估值。回购期满时，若双方都能履约，则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约，则继续持有现金资产；若融券业务到期无法履约，则继续持有债券资产，实际持有的相关资产按其性质进行估值；

(4) 其他

1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

2) 为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标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，采用其他可参考公允价值指标，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当基金资产净值与影子价格产生重大偏离，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，是基金资产净值更能公允地反应基金资产价值；

3) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，

同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。每份基金份额面值为人民币 1.00 元。由于申购、赎回引起的实收基金的变动分别于基金申购确认日、赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的实际利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息收入损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示。另外，根据中国证监会令第 120 号《货币市场基金监督管理办法》的规定，自 2016 年 2 月 1 日起，如果出现因提前支取而导致的利息损失的情形，基金管理人应当使用风险准备金予以弥补，风险准备金不足的，应当使用固有资金予以弥补；

(2) 债券利息收入按实际持有期内逐日计提。附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

(3) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(4) 债券投资收益于卖出债券成交日确认，并按卖出债券成交金额与其成本、应收利息及相关费用的差额入账；

(5) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.9 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.33% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率逐日计提；

(3) 基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率逐日计提；

(4) 卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

- (1) 本基金每份基金份额享有同等分配权；
- (2) 本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；
- (3) “每日分配、按日支付”。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。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理（因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止）；
- (4) 本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益；
- (5) 本基金每日进行收益计算并分配时，每日收益支付方式只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益；若投资人在每日收益支付时，当日净收益为正值，则为投资人增加相应的基金份额，当日净收益为负值，则缩减投资人基金份额。若投资人赎回基金份额时，其对应收益将立即结清；若收益为负值，则从投资人赎回基金款中扣除；
- (6) 当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益；
- (7) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.11 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

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. 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；

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]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，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，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

2. 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。

3. 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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	6,925,990.66	615,701.56
定期存款	-	28,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	-	28,000,000.00
其他存款	-	-
合计：	6,925,990.66	28,615,701.56

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2016 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	99,761,952.66	99,696,000.00	-65,952.66	-0.0201%
	合计	99,761,952.66	99,696,000.00	-65,952.66	-0.0201%
项目		上年度末 2015 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	109,989,650.23	110,350,500.00	360,849.77	0.2233%
	合计	109,989,650.23	110,350,500.00	360,849.77	0.2233%

注：偏离金额=影子定价-摊余成本；偏离度=偏离金额/摊余成本法确认的基金资产净值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产**7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	117,296,535.94	-
买入返售证券_固定平台	102,200,000.00	-
合计	219,496,535.94	-
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	21,000,265.50	-
合计	21,000,265.50	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	2,903.52	4,379.92
应收定期存款利息	-	56,389.00
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	648.38	-
应收债券利息	642,520.72	2,016,369.36
应收买入返售证券利息	154,754.11	31,412.97
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	-
合计	800,826.73	2,108,551.25

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	10,198.67	10,167.48
合计	10,198.67	10,167.48

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	303.05	-
预提审计费用	50,000.00	50,000.00
预提信息披露费	266,000.00	216,000.00
预提账户维护费	9,000.00	9,000.00
银行费用	2,919.02	4,021.24
上清所查询服务费	300.00	300.00
合计	328,522.07	279,321.24

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	161,627,862.40	161,627,862.40
本期申购	3,303,583,203.98	3,303,583,203.98
本期赎回(以“-”号填列)	-3,137,868,597.60	-3,137,868,597.60
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	327,342,468.78	327,342,468.78

注：申购含红利再投、转入份额及金额，赎回含转出份额及金额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

上年度末	-	-	-
本期利润	6,582,258.53	-	6,582,258.53
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-6,582,258.53	-	-6,582,258.53
本期末	-	-	-

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
活期存款利息收入	189,496.75	101,633.08
定期存款利息收入	1,228,449.88	1,675,525.20
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	10,644.16	544.96
其他	-	-
合计	1,428,590.79	1,777,703.24

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金于本年度及上年度可比期间均无股票投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	255,083.01	1,057,278.53
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	255,083.01	1,057,278.53

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	294,912,791.29	313,179,176.78
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	289,884,968.77	303,708,177.42
减：应收利息总额	4,772,739.51	8,413,720.83
买卖债券差价收入	255,083.01	1,057,278.53

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金于本年度及上年度可比期间均无债券赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金于本年度及上年度可比期间均无债券申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金于本年度及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金于本年度及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期末及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

注：基金于本年度及上年度可比期间均无股利收益。

7.4.7.17 公允价值变动收益

注：本基金于本年度及上年度可比期间均无公允价值变动收益。

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12
----	-----------------------	------------------------------

	12 月 31 日	月 31 日
基金赎回费收入	-	-
其他	-	20,000.00
合计	-	20,000.00

7.4.7.19 交易费用

注：本基金于本年度及上年度可比期间均无交易费用。

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	116,000.00	116,000.00
账户维护费	36,000.00	36,000.00
银行费用	41,880.74	38,893.24
上清所查询服务费	1,200.00	400.00
其他	200.00	200.00
合计	245,280.74	241,493.24

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，除 7.4.6.1 营业税、增值税中披露的事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
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
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
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
北京千石创富资本管理有限公司	基金管理人的子公司
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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	854,668.47	829,867.44
其中：支付销售机构的客户维护费	134,024.48	65,732.68

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：

$$H = E \times 0.33\% / \text{当年天数}$$

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	258,990.23	251,475.16

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：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

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。

7.4.10.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费 各关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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	462,518.72
兴业银行股份有限公司	36,838.36
国金证券	2,362.22
国金财富	549.43
合计	502,268.73
获得销售服务费 各关联方名称	上年度可比期间 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

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：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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。

7.4.10.3 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

上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日			
银行间市场交	债券交易金额	基金逆回购	基金正回购

易的 各关联方名称	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
兴业银行	10,027,474.64	-	-	-	-	-

注：本基金于本年度未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015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	8,486,435.06	-
期间申购/买入总份额	60,600,000.00	99,117,000.00
期间因拆分变动份额	1,128,014.88	1,369,435.06
减：期间赎回/卖出总份额	4,218,140.28	92,000,000.00
期末持有的基金份额	65,996,309.66	8,486,435.06
期末持有的基金份额占基金总份额比例	20.1612%	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。

7.4.10.4.2 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		上年度末	
	2016年12月31日		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	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%
北京千石创富资本管理有限公司	-	-	28,985,744.90	17.9336%

注：1、本基金本报告期末除管理人之外的其他关联方未持有本基金份额。

2、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。

7.4.10.5 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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	兴业银行-活期存款	6,925,990.66	189,496.75	615,701.56
兴业银行-定期存款	-	503,666.67	-	563,623.63
合计	6,925,990.66	693,163.42	615,701.56	665,256.71

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。

7.4.10.6 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。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——货币市场基金

金额单位：人民币元

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	本期利润分配合计	备注
6,236,674.02	0.00	59,950.83	6,296,624.85	-

7.4.12 (2016年12月31日) 本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人的风险管理政策是通过事前充分到位的防范、事中实时有效的过程控制、事后完备可追踪的检查和反馈，将风险管理贯穿于投研运作的整个流程，从而使基金投资风险可测、可控、可承担，有效防范和化解投研业务的市场风险、信用风险、流动性风险及操作风险。

本基金管理人建立了董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险管理

组织体系，合规风控部风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

董事会负责公司整体风险的预防和控制，审核、监督公司风险控制制度的有效执行。董事会下设风险管理委员会，并制定《风险管理委员会议事规则》，规范其组成人员、职责、议事规则等事宜。

督察长负责公司及其投资组合运作的监察稽核工作，向董事会汇报。

总经理负责公司日常经营管理中的风险控制工作。总经理下设风险控制委员会，负责对公司经营及投资组合运作中的风险进行识别、评估和防控，负责对投资组合风险评估报告中提出的重大问题进行讨论和决定应对措施。公司制定《风险控制委员会议事规则》，规范其组成人员、职责、议事规则等事宜。

本基金管理人推行全员风险管理理念，公司各部门是风险管理的一线部门，公司各部门负责人是其部门风险管理的第一责任人，根据公司制度规定的各项作业流程和规范，加强对风险的控制。

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制，基金经理是本基金风险管理的第一责任人。

合规风控部监察稽核团队负责对风险控制制度的建立和落实情况进行监督，在职权范围内独立履行检查、评价、报告、建议职能；合规风控部风险管理团队独立于投资研究体系，负责落实具体的风险管理政策，对投资进行事前、事中及事后的风险管理。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、到期未能及时足额兑付本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，并对证券交割方式进行限制，以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末	上年度末
--------	-----	------

	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
A-1	20,024,018.78	70,017,380.15
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	69,597,830.31	29,972,793.56
合计	89,621,849.09	99,990,173.71

注：表中所列示的债券投资为短期融资券、超短期融资券、同业存单及其他按短期信用评级的债券投资，其中超短期融资券和同业存单无信用评级。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级的债券投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，且能够通过出售所持有的债券应对流动性需求。此外本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，除发生巨额赎回情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于交易所及银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年12月 31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	6,925,990.66	0.00	0.00	0.00	0.00	-	6,925,990.66
结算备付金	886,363.67	-	-	-	-	-	886,363.67
交易性金融资产	20,005,188.09	69,616,661.00	10,140,103.57	0.00	0.00	0.00	99,761,952.66
买入返售金融资产	219,496,535.94	0.00	0.00	0.00	0.00	-	219,496,535.94
应收利息	-	-	-	-	-	800,826.73	800,826.73
应收申购款	-	-	-	-	-	72,080.68	72,080.68
资产总计	247,314,078.36	69,616,661.00	10,140,103.57	0.00	0.00	872,907.41	327,943,750.34
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	24,699.80	24,699.80
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	80,337.62	80,337.62
应付托管费	-	-	-	-	-	24,344.75	24,344.75
应付销售服务费	-	-	-	-	-	60,861.83	60,861.83
应付交易费用	-	-	-	-	-	10,198.67	10,198.67
应付利润	-	-	-	-	-	72,316.82	72,316.82
其他负债	-	-	-	-	-	328,522.07	328,522.07
负债总计	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	601,281.56	601,281.56
利率敏感度缺口	247,314,078.36	69,616,661.00	10,140,103.57	0.00	0.00	271,625.85	327,342,468.78
上年度末 2015年12月 31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	28,615,701.56	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	28,615,701.56
交易性金融资产	34,974,251.79	10,012,305.82	65,003,092.62	-	-	-	109,989,650.23
买入返售金融资产	21,000,265.50	-	-	-	-	-	21,000,265.50
应收利息	-	-	-	-	-	2,108,551.25	2,108,551.25

应收申购款	-	-	-	-	-	392,455.00	392,455.00
资产总计	84,590,218.85	10,012,305.82	65,003,092.62	-	-	-2,501,006.25	162,106,623.54
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	85,851.65	85,851.65
应付托管费	-	-	-	-	-	26,015.65	26,015.65
应付销售服务费	-	-	-	-	-	65,039.13	65,039.13
应付交易费用	-	-	-	-	-	10,167.48	10,167.48
应付利润	-	-	-	-	-	12,365.99	12,365.99
其他负债	-	-	-	-	-	279,321.24	279,321.24
负债总计	-	-	-	-	-	478,761.14	478,761.14
利率敏感度缺口	84,590,218.85	10,012,305.82	65,003,092.62	-	-	-2,022,245.11	161,627,862.40

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日、行权日或到期日孰早者进行分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变；		
	此项影响并未考虑管理层为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016年12月31日）	上年度末（2015年12月31日）
	利率+25个基点	-46,729.99	-102,059.35
	利率-25个基点	46,877.82	102,446.58

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金主要投资于固定收益类金融工具，且以摊余成本进行后续计量，因此无重大其他价格风险。

7.4.14 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 99,761,952.66 元，无属于第一层次及第三层次的余额（2015 年 12 月 31 日：第二层次人民币 109,989,650.23 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（2015 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（2015 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 2017 年 3 月 27 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	99,761,952.66	30.42
	其中：债券	99,761,952.66	30.42
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	219,496,535.94	66.93
	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	7,812,354.33	2.38

4	其他各项资产	872,907.41	0.27
5	合计	327,943,750.34	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	0.62	
	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%。

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	25
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	118
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	5

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

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	44.33	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	3.05	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	18.22	-
	其中：剩余存续期超过 397 天	-	-

	天的浮动利率债		
4	90 天(含)—120 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	3.10	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	68.70	-

8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：本报告期未发生投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

8.5 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	10,140,103.57	3.10
	其中：政策性金融债	10,140,103.57	3.10
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	30,023,792.17	9.17
6	中期票据	-	-
7	同业存单	59,598,056.92	18.21
8	其他	-	-
9	合计	99,761,952.66	30.48
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

8.6 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	140220	14 国开 20	100,000	10,140,103.57	3.10
2	041663003	16 首钢 CP001	100,000	10,018,604.08	3.06
3	041653004	16 云南华电 CP001	100,000	10,005,414.70	3.06
4	011698570	16 沪杭甬 SCP002	100,000	9,999,773.39	3.05
5	111617193	16 光大 CD193	100,000	9,970,005.88	3.05
6	111681540	16 攀枝花商	100,000	9,928,281.67	3.03

		行 CD161			
6	111681569	16 邯郸银行 CD228	100,000	9,928,281.67	3.03
7	111681675	16 中原银行 CD182	100,000	9,927,019.87	3.03
8	111681741	16 杭州银行 CD204	100,000	9,923,117.63	3.03
9	111681765	16 厦门国际 银行 CD029	100,000	9,921,350.20	3.03

8.7 “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	15
报告期内偏离度的最高值	0.3683%
报告期内偏离度的最低值	-0.1110%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1221%

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。

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：本基金本报告期内未发生负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：本基金本报告期内未发生正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1

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。

8.9.2

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。

8.9.3 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	800,826.73
4	应收申购款	72,080.68
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	872,907.41

§ 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		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
37,413	8,749.43	247,498,985.70	75.61%	79,843,483.08	24.39%

9.2 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	122,417.11	0.0374%

9.3 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	0

§ 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	161,627,862.40
本报告期基金总申购份额	3,303,583,203.98
减:本报告期基金总赎回份额	3,137,868,597.60
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	327,342,468.78

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。

§ 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

2016年12月13日，吴富佳先生离任基金管理人副总经理。2016年12月28日，索峰先生新任基金管理人副总经理。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

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		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
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》(证监基金字[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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华创证券	-	-	1,765,000,000.00	100.00%	-	-

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

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。

11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国金基金管理有限公司高级管理人员变更公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016 年 12 月 30 日
2	国金基金管理有限公司关于电子直销基金转换费率优惠活动延期的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016 年 12 月 27 日
3	国金基金管理有限公司关于增加盈信基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016 年 12 月 21 日
4	国金基金管理有限公司高级管理人员变更公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016 年 12 月 14 日
5	国金基金管理有限公司关于公司系统维护期间影响微众“活期+”及新浪“金生宝”业务的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016 年 12 月 2 日
6	国金基金管理有限公司关于增加上海中正达广投资管理有限公司为国金基金旗下基金销售机构的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016 年 11 月 24 日
7	国金基金管理有限公司关于增加北京微动利投资管理有限公司为国金基金旗下基金销售机构的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016 年 11 月 15 日
8	国金基金管理有限公司关于增加天津国美基金销售有限公司和北京格上富信投资顾问有限公司为旗下基金销售机构的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016 年 10 月 26 日
9	国金鑫盈货币市场证券投资基金 2016 年第 3 季度报告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016 年 10 月 24 日
10	国金基金管理有限公司关于北京恒天明泽基金销售有限公司费率优惠的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016 年 10 月 24 日
11	关于国金鑫盈货币市场证券投资基金基金经理变更的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016 年 10 月 13 日
12	国金基金管理有限公司关于增加北京唐鼎耀华投资咨询有限公司和乾道金融信息服务（北京）有限公司为旗下基金销售机	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016 年 10 月 13 日

	构的公告		
13	国金鑫盈货币市场证券投资基金 2016 年国庆假期暂停大额申购、大额转换转入、大额定期定额投资业务的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016 年 9 月 28 日
14	国金基金管理有限公司关于增加北京懒猫金融信息服务有限公司为旗下基金销售机构的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016 年 9 月 24 日
15	国金基金管理有限公司关于增加和耕传承基金销售有限公司和诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司为旗下基金销售机构的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016 年 9 月 21 日
16	国金基金管理有限公司关于开通旗下部分基金间的基金转换业务及费率优惠的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016 年 9 月 9 日
17	国金基金管理有限公司关于增加上海长量基金销售投资顾问有限公司为旗下基金销售机构的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016 年 9 月 8 日
18	国金基金管理有限公司关于增加上海万得投资顾问有限公司为旗下基金销售机构的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016 年 9 月 7 日
19	国金基金管理有限公司关于增加北京电盈基金销售有限公司和光大证券股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016 年 9 月 2 日
20	国金基金管理有限公司关于增加一路财富（北京）信息科技有限公司为旗下基金销售机构的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016 年 9 月 2 日
21	国金基金管理有限公司关于增加北京新浪仓石基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016 年 8 月 31 日
22	关于国金鑫盈货币市场证券投资基金基金经理变更公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016 年 8 月 29 日
23	国金鑫盈货币市场证券投资基金 2016 年半年度报告摘要	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016 年 8 月 27 日
24	国金鑫盈货币市场证券投资基金 2016 年半年度报告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016 年 8 月 27 日
25	国金基金管理有限公司关于增加北京汇成基金销售有限公司	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016 年 8 月 23 日

	为旗下基金销售机构的公告		
26	国金基金管理有限公司关于增加奕丰金融和微众银行为旗下基金销售机构的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年8月10日
27	国金鑫盈货币市场证券投资基金招募说明书(更新)	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年7月30日
28	国金鑫盈货币市场证券投资基金招募说明书(更新)摘要	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年7月30日
29	国金基金管理有限公司关于增加中证金牛(北京)投资咨询有限公司为旗下基金销售机构的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年7月26日
30	国金基金管理有限公司关于增加海银基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年7月22日
31	国金鑫盈货币市场证券投资基金2016年第2季度报告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年7月20日
32	国金基金管理有限公司关于增加深圳前海凯恩斯基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年7月19日
33	国金基金管理有限公司关于增加北京晟视天下投资管理有限公司为旗下基金销售机构的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年7月13日
34	国金基金管理有限公司关于旗下基金的基金资产净值、基金份额净值及基金份额累计净值的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年7月1日
35	国金基金管理有限公司关于直销系统、电子交易系统升级的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年6月30日
36	国金基金管理有限公司关于在上海陆金所资产管理有限公司推出定期定额投资业务并参加费率优惠活动的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年6月22日
37	国金基金管理有限公司关于增加平安证券有限责任公司为旗下基金销售机构的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年6月21日
38	国金基金管理有限公司关于增加武汉市伯嘉基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年6月18日
39	国金基金管理有限公司关于参加上海联泰资产管理有限公司	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年6月18日

	费率优惠活动的公告		
40	国金基金管理有限公司关于调整直销电子交易系统开放式基金单笔最低申购金额和追加申购金额的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年6月2日
41	国金基金管理有限公司关于增加泰诚财富基金销售(大连)有限公司为旗下基金销售机构的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年6月2日
42	国金基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金单笔最低申购金额和追加申购金额的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年6月1日
43	国金基金管理有限公司关于增加成都万华源基金销售有限责任公司为旗下基金销售机构的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年5月25日
44	国金基金管理有限公司关于参加中国民生银行股份有限公司费率优惠的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年5月12日
45	国金基金管理有限公司关于关闭淘宝基金理财平台相关服务的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年5月5日
46	国金基金管理有限公司关于关闭支付宝渠道基金支付服务的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年5月5日
47	国金基金管理有限公司关于增加上海凯石财富基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年4月28日
48	国金基金管理有限公司关于国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年4月22日
49	国金基金管理有限公司关于增加深圳市金斧子投资咨询有限公司为旗下基金销售机构的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年4月20日
50	国金基金管理有限公司关于增加微众银行股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年4月20日
51	国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书(更新)	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年4月13日
52	国金国鑫灵活配置混合型发起	指定披露媒体和本基金基金	2016年4月13日

	式证券投资基金招募说明书(更新)摘要	管理人网站	
53	国金基金管理有限公司关于参加新西兰费率优惠的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年3月30日
54	国金基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司个人电子银行申购费率优惠活动的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年3月30日
55	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	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年3月28日
56	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	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年3月9日
57	国金基金管理有限公司关于增加厦门鑫鼎盛和深圳富济财富为旗下基金销售机构的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年3月8日
58	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	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年2月26日
59	国金基金管理有限公司关于旗下基金所持“浦发银行”、“信威集团”股票估值调整的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年2月23日
60	国金基金管理有限公司关于增加上海联泰资产管理有限公司为旗下基金销售机构的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年2月19日
61	国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年1月20日
62	国金基金管理有限公司关于增加浙江金观诚财富管理有限公司和大泰金石投资管理有限公司为旗下基金销售机构的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年1月20日
63	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	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年1月8日
64	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	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年1月6日
65	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	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2016年1月4日

注：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。

§ 12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 存放地点

本基金基金管理人的办公场所：北京海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 87 号 D 座 14 层。

12.3 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
2017 年 3 月 28 日