

国金通用鑫盈货币市场证券投资基金 2015 年半年度报告

2015 年 6 月 30 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：2015 年 8 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。本半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 2015 年 8 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未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 2015 年 6 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 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	12
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 债券回购融资情况	37
7.3 基金投资组合平均剩余期限	37
7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合	38
7.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细	38
7.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	39
7.7 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	39
7.8 投资组合报告附注	39
§8 基金份额持有人信息	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	40

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	40
8.3 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	41
§9 开放式基金份额变动	41
§10 重大事件揭示	41
10.1 基金份额持有人大会决议	41
10.2 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	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	42
10.4 基金投资策略的改变	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	42
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	42
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	43
10.9 其他重大事件	43
§11 影响投资者决策的其他重要信息	44
§12 备查文件目录	45
12.1 备查文件目录	45
12.2 存放地点	45
12.3 查阅方式	45

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国金通用鑫盈货币市场证券投资基金
基金简称	国金通用鑫盈货币
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	177,567,997.83 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

注：无。

2.2 基金产品说明

投资目标	在综合考虑基金资产收益性、安全性和流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为投资者创造稳定的收益。
投资策略	本基金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。
业绩比较基准	人民币七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种，其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。

注：无。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	国金基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	徐炜瑜	张志永
	联系电话	010-88005601	021-62677777-212004
	电子邮箱	xuweiyu@gfund.com	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		4000-2000-18	95561
传真		010-88005666	021-62159217
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》。
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.gfund.com
基金半年度报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	3,800,855.23
本期利润	3,800,855.23
本期净值收益率	2.1262%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末基金资产净值	177,567,997.83
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
累计净值收益率	7.0918%

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。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。

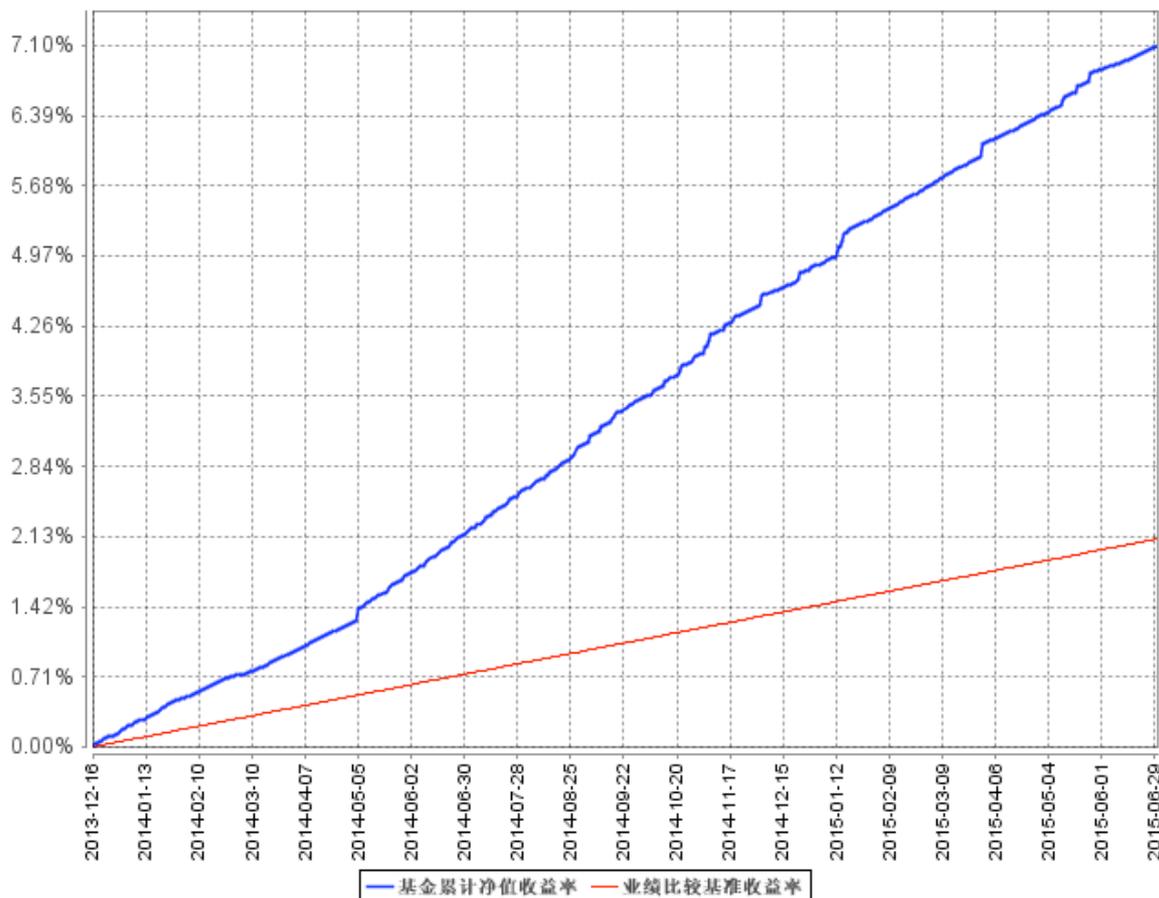
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	0.2246%	0.0010%	0.1125%	0.0000%	0.1121%	0.0010%
过去三个月	0.9255%	0.0110%	0.3413%	0.0000%	0.5842%	0.0110%
过去六个月	2.1262%	0.0141%	0.6788%	0.0000%	1.4474%	0.0141%
过去一年	4.8374%	0.0143%	1.3688%	0.0000%	3.4686%	0.0143%
自基金合同生效起至今	7.0917%	0.0129%	2.1075%	0.0000%	4.9842%	0.0129%

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：1、图示日期为 2013 年 12 月 16 日至 2015 年 6 月 30 日。

2、本基金基金合同生效日为 2013 年 12 月 16 日。

3.3 其他指标

注：无

§ 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。公司股东为国金证券股份有限公司、苏州工业园区兆润控股集团有限公司、广东宝丽华新能源股份有限公司、涌金投资控股有限公司，四家企业共同出资 2.8 亿元人民币，出资比

例分别为 49%、19.5%、19.5%和 12%。截至 2015 年 06 月 30 日，国金基金管理有限公司共管理 8 只开放式基金——国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金、国金通用沪深 300 指数分级证券投资基金、国金通用鑫盈货币市场证券投资基金、国金通用金腾通货币市场证券投资基金、国金通用鑫安保本混合型证券投资基金、国金通用上证 50 指数分级证券投资基金、国金通用鑫运灵活配置混合型证券投资基金、国金通用众赢货币市场证券投资基金。

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		
徐艳芳	基金 经理	2013 年 12 月 16 日	-	6	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 月加盟国金通用基金管理有限公司，任投资研究部固定收益基金经理。2013 年 2 月起增聘为国金通用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 月起增聘为国金通用鑫盈货币市场证券投资基金基金经理；2014 年 1 月起任国金通用鑫利分级债券型证券投资基金基金经理；2014 年 2 月起任国金通用金腾通货币市场证券投资基金基金经理；2015 年 6 月起任国金通用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，东北财经大学管理学学士。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 月加入国金通用基金管理有限公司，任高级交易员。2014 年 4 月起被增聘为国金通用鑫盈货币市场证券投资基金基金经理、国金通用国鑫灵活配置混合型发起式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》、《国金通用鑫赢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 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 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

从月度数据看，二季度以来，社会消费总额同比增速低位趋稳，但固定资产投资同比增速大幅下滑，5月固定资产投资完成额同比跌至11.4%，工业增加值触底后有所反弹。从景气度方面看，中采制造业PMI荣枯分水岭之上微幅回升。上半年，经济增速下台阶，物价指数下行压力明显，二季度以来，虽然通缩压力有所减缓，PPI指数二季度同比增速跌幅趋缓，持续处于零轴下方说明生产端持续低迷。分项指数中，食品价格短期回落，非食品价格企稳回升。

央行继续实施宽松积极的货币政策，6月末重启七天逆回购操作并下调利率水平至2.5%，平抑半年末资金紧张状况，而后又在6月28日周末降息加定向降准，短期货币政策转向的担忧被证伪。由于近期A股市场的超预期下跌，预计央行货币政策三季度出现转折的可能性也不大。

二季度市场资金价格中枢下移，在季度末由于半年末时点因素和新股申购冻结资金影响叠加，市场资金价格出现了短期的上行，但新股申购对资金面的扰动影响显著降低。

在报告期内，本基金依旧保持稳健的操作风格，在充分考虑安全性和流动性的基础上，当提高了组合资产配置中信用品的比重，由于市场资金价格中枢显著下移，组合的期间业绩回报也有所下降。

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2.1262%，同期业绩比较基准收益率为0.6788%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

整体的经济增长状况下行压力依然存在，与一季度相比，制造业数据有所改善，但固定资产投资增速下行较快，拖累经济增长，预计二、三季度GDP同比增速会在政策作用下出现实质性企稳回升到“7”以上。二季度以来，虽然通缩压力有所减缓，但未来CPI指数大幅反弹可能性也不大，三季度同比增速维持在1-2%之间的大概率事件，PPI指数二季度同比增速跌幅趋缓，持续处于零轴下方说明生产端持续低迷。分项指数中，食品价格短期回落，非食品价格企稳回升。综合来看，物价水平在三季度会出现温和反弹，预计下半年CPI指数会抬升至1.5-2.0%，略高于上半年平均水平。

三季度市场资金面不会出现太大波动，央行降低实体经济融资成本的要务没有变化，在金融市场利率维持低位的前提下，资金才会逐步流向实体经济，促成“宽货币”转向“宽信用”得以实现。

综合来看，三季度经济增长逐步寻底，物价水平低位运行，资金面也相对宽松，对于债券市

场不会形成利空，需要关注的是地方债的发行和短期融资工具增加可能带来的供给压力，无风险利率短端的下行空间已经有限，收益率曲线增陡，未来债市将会呈现震荡拉锯的格局。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的约定，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，并每日进行支付，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。自 2015 年 6 月 10 日起，每日分配所得收益参与下一日收益分配（详情可参考基金管理人于 2015 年 6 月 6 日公告文件《关于调整国金通用鑫盈货币市场证券投资基金收益支付方式并相应修订基金合同部分条款的公告》）。

4.8 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

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 托管人对本半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半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国金通用鑫盈货币市场证券投资基金

报告截止日：2015年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,092,456.51	26,078,306.39
结算备付金		-	208,000.00
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	115,193,149.95	64,579,013.54
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-

债券投资		115,193,149.95	64,579,013.54
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	60,000,450.00	17,000,145.50
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	1,561,887.55	2,772,560.06
应收股利		-	-
应收申购款		44,595.32	1,148,137.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		177,892,539.33	111,786,162.89
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		50,115.41	38,822.45
应付托管费		15,186.50	11,764.36
应付销售服务费		37,966.25	29,411.02
应付交易费用	6.4.7.7	12,567.59	11,504.93
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		14,863.18	305,617.07
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	193,842.57	263,552.35
负债合计		324,541.50	660,672.18
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	177,567,997.83	111,125,490.71
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		177,567,997.83	111,125,490.71
负债和所有者权益总计		177,892,539.33	111,786,162.89

注：本报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.0000 元，基金份额总额 177,567,997.83 份。

6.2 利润表

会计主体：国金通用鑫盈货币市场证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		4,599,285.81	1,354,436.84
1.利息收入		3,949,302.57	1,181,049.64
其中：存款利息收入	6.4.7.11	658,607.73	862,357.58
债券利息收入		1,566,301.44	177,017.99
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,724,393.40	141,674.07
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		629,983.24	173,387.20
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	629,983.24	173,387.20
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	20,000.00	-
减：二、费用		798,430.58	366,008.98
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	308,275.82	83,994.75
2. 托管费	6.4.10.2.2	93,417.01	25,452.99
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	233,542.33	63,632.34
4. 交易费用	6.4.7.19	-	-
5. 利息支出		40,249.05	-
其中：卖出回购金融资产支出		40,249.05	-
6. 其他费用	6.4.7.20	122,946.37	192,928.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,800,855.23	988,427.86
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,800,855.23	988,427.86

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国金通用鑫盈货币市场证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 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）	-	3,800,855.23	3,800,855.23
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）	66,442,507.12	-	66,442,507.12
其中：1.基金申购款	739,293,786.66	-	739,293,786.66
2.基金赎回款	-672,851,279.54	-	-672,851,279.54
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）	-	-3,800,855.23	-3,800,855.23
五、期末所有者权益（基金净值）	177,567,997.83	-	177,567,997.83
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	68,196,802.33	-	68,196,802.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	988,427.86	988,427.86
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）	10,067,454.82	-	10,067,454.82
其中：1.基金申购款	242,250,493.01	-	242,250,493.01
2.基金赎回款	-232,183,038.19	-	-232,183,038.19
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）	-	-988,427.86	-988,427.86
五、期末所有者权益（基金净值）	78,264,257.15	-	78,264,257.15

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>尹庆军</u>	<u>聂武鹏</u>	<u>于晓莲</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国金通用鑫盈货币市场证券投资基金(以下简称“本基金”)的募集已获中国证监会许可【2013】1442 号文核准。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验证并出具安永华明(2013)验字第 61004823_A26 号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2013 年 12 月 16 日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。首次募集扣除认购费后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。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天;投资于同一公司发行的短期企业债券及短期融资券的比例,不得超过基金资产净值的 10%;本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的 10%;本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的中期票据,不超过该中期票据的 10%;除发生巨额赎回的情形外,本基金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%;因发生巨额赎回致使本基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20%的,基金管理人应当在 5 个交易日内进行调整;债券回购最长期限为 1 年,债券回购到期后不得展期;本基金买断式回购融入基础债券的剩余期限不得超过 397 天;存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的 30%;存放在不具有基金托管资格的同一商业银行(指具有基金销售资格以及合格境外机构投资者托管人资格的商业银行)的存款,不得超过基金资产净值的 5%;本基金投资于定期存款的比例不得超过基金资产净值的 30%,根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款,不受此限制;本基金持有的剩余期限不超过 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的 20%;本基

金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；本基金应投资于信用级别评级为 AAA 以上（含 AAA）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出。本基金业绩比较基准为：人民币七天通知存款利率（税后）。

6.4.2 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（以下统称“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 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

采用若干修订后/新会计准则

2014 年 1 至 3 月，财政部制定了《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》和《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》；修订了《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》和《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》；上述 7 项会计准则均自 2014 年 7 月 1 日起施行。2014 年 6 月，财政部修订了《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》，在 2014 年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本财务报表无重大影响。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

6.4.4.1 会计年度

-

6.4.4.2 记账本位币

-

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

-

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

-

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

-

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

-

6.4.4.7 实收基金

-

6.4.4.8 损益平准金

-

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

-

6.4.4.10 费用的确认和计量

-

6.4.4.11 基金的收益分配政策

- 1、本基金每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。

6.4.4.12 分部报告

无

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的会计差错更正。

6.4.6 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. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
活期存款	1,092,456.51
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	1,092,456.51

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30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	115,193,149.95	115,509,500.00	316,350.05	0.1782%
	合计	115,193,149.95	115,509,500.00	316,350.05	0.1782%

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 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 2015年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	60,000,450.00	-
合计	60,000,450.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,109.58
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	1,505,210.67
应收买入返售证券利息	54,567.30
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	1,561,887.55

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	12,567.59
合计	12,567.59

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	191,318.80
应付银行汇划手续费	2,523.77
合计	193,842.57

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	111,125,490.71	111,125,490.71
本期申购	739,293,786.66	739,293,786.66
本期赎回(以“-”号填列)	-672,851,279.54	-672,851,279.54
- 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	177,567,997.83	177,567,997.83

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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	3,800,855.23	-	3,800,855.23
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	-3,800,855.23	-	-3,800,855.23
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	610,284.80
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	544.96
其他	-
合计	658,607.73

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本报告期无买卖股票差价收入。

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30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	629,983.24
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	629,983.24

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	164,902,648.80
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	158,624,295.76
减：应收利息总额	5,648,369.80
买卖债券差价收入	629,983.24

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益**6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

注：本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

注：本基金本报告期末不存在公允价值变动收益。

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	-
其他	20,000.00
合计	20,000.00

6.4.7.19 交易费用

注：本基金本报告期末不存在交易费用。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	24,795.19

信息披露费	57,523.61
中债债券账户维护费	9,000.00
银行费用	22,427.57
上清所帐户维护费	9,000.00
其他	200.00
合计	122,946.37

6.4.7.21 分部报告

无

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
兴业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

注：关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

债券交易

注：本基金本报告期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

债券回购交易

注：本基金本报告期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6 月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	308,275.82	83,994.75
其中：支付销售机构的客户维护费	28,310.88	19,874.43

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6 月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	93,417.01	25,452.99

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。

6.4.10.2.3 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
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 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	170,365.58
兴业银行股份有限公司	10,538.66
国金证券	4,159.13
合计	185,063.37
获得销售服务费 各关联方名称	上年度可比期间
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 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	29,428.65
兴业银行股份有限公司	31,634.43
国金证券	279.80
合计	58,342.88

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

-

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2013 年 12 月 16 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	60,515,743.74	-
期间因拆分变动份额	0.00	-
减：期间赎回/卖出总份额	7,000,000.00	-
期末持有的基金份额	53,515,743.74	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	30.1400%	-

注：期间申购份额含红利再投份额。

6.4.10.4.2 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	
	2015 年 6 月 30 日		2014 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
北京千石创富资本管理有限公司	14,416,417.57	8.1200%	-	-
上海国金通用财富资产管理有限公司	68,712,034.87	38.7000%	-	-

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

6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	1,092,456.51	47,777.97	3,526,399.40	72,225.53
兴业银行定期存款	0.00	117,777.79	12,000,000.00	230,732.98

注：本基金的活期银行存款和部分定期银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率或

约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 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
3,336,950.68	754,658.44	-290,753.89	3,800,855.23	-

6.4.12 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本期末未持有认购新发或增发证券。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有银行间市场正回购抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场正回购抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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、拒绝支付到期本息，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。

6.4.13.2.1 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
--------	-----	------

	2015 年 6 月 30 日	2014 年 12 月 31 日
A-1	90,166,130.86	64,579,013.54
A-1 以下	-	-
未评级	10,000,114.16	-
合计	100,166,245.02	64,579,013.54

注：表中所列示的债券投资为短期融资券及超短期融资券，其中超短期融资券无信用评级。

6.4.13.2 按长期信用评级列示的债券投资

注：本期末（2015 年 6 月 30 日）及上年度末（2014 年 12 月 31 日），本基金未持有按长期信用评级的债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时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银行间同业市场交易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%。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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因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。本基金主要投资于银行间市场交易的固定收益品种，以摊余成本计价，并通过“影子定价”机制使按摊余成本确认的基金资产净值能近似反映基金资产的公允价值，因此本基金的运作仍然存在相应的利率风险。本基金的基金管理人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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年6月30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	1,092,456.51	-	-	-	-	-	1,092,456.51
交易性金融资产	15,000,763.73	29,994,966.60	70,197,419.62	-	-	-	115,193,149.95
买入返售金融资产	60,000,450.00	-	-	-	-	-	60,000,450.00
应收利息	-	-	-	-	-	1,561,887.55	1,561,887.55
应收申购款	-	-	-	-	-	44,595.32	44,595.32
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	76,093,670.24	29,994,966.60	70,197,419.62	-	-	1,606,482.87	177,892,539.33
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	50,115.41	50,115.41
应付托管费	-	-	-	-	-	15,186.50	15,186.50
应付销售服务费	-	-	-	-	-	37,966.25	37,966.25
应付交易费用	-	-	-	-	-	12,567.59	12,567.59
应付利润	-	-	-	-	-	14,863.18	14,863.18
其他负债	-	-	-	-	-	193,842.57	193,842.57
负债总计	-	-	-	-	-	324,541.50	324,541.50
利率敏感度缺口	76,093,670.24	29,994,966.60	70,197,419.62	-	-	1,281,941.37	177,567,997.83
上年度末 2014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	26,078,306.39	-	-	-	-	-	26,078,306.39
结算备付金	208,000.00	-	-	-	-	-	208,000.00
交易性金融资产	9,999,503.72	34,317,908.08	20,261,601.74	-	-	-	64,579,013.54

买入返售金融资产	17,000,000.00	-	-	-	-	-	17,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	-2,772,560.06	2,772,560.06
应收申购款	-	-	-	-	-	-1,148,137.40	1,148,137.40
其他资产	-	-	-	-	-	145.50	145.50
资产总计	53,285,810.11	34,317,908.08	20,261,601.74	-	-	-3,920,842.96	111,786,162.89
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	38,822.45	38,822.45
应付托管费	-	-	-	-	-	11,764.36	11,764.36
应付销售服务费	-	-	-	-	-	29,411.02	29,411.02
应付交易费用	-	-	-	-	-	11,504.93	11,504.93
应付利润	-	-	-	-	-	305,617.07	305,617.07
其他负债	-	-	-	-	-	263,552.35	263,552.35
负债总计	-	-	-	-	-	660,672.18	660,672.18
利率敏感度缺口	53,285,810.11	34,317,908.08	20,261,601.74	-	-	-3,260,170.78	111,125,490.71

6.4.13.4.1.2 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减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（2015 年 6 月 30 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	+25 个基点	-101,319.09	-33,299.16
	-25 个基点	101,701.52	33,395.83

注：利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的情况下，利率发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值可参考的公允价值产生的影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，且以摊余成本进行后续计量，因此无重大其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	115,509,500.00	65.05	64,694,000.00	58.22
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	115,509,500.00	65.05	64,694,000.00	58.22

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。			
假设	1. 置信区间 -		
	2. 观察期 -		
分析	风险价值 (单位：人民币元)	本期末 (2015 年 6 月 30 日)	上年度末 (2014 年 12 月 31 日)

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无

§ 7 投资组合报告

7.1 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	115,193,149.95	64.75

	其中：债券	115,193,149.95	64.75
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	60,000,450.00	33.73
	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	1,092,456.51	0.61
4	其他各项资产	1,606,482.87	0.90
5	合计	177,892,539.33	100.00

7.2 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	2.09	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	0.00	0.00
	其中：买断式回购融资	-	-

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

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

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

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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	102
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	119
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	9

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限 (天数)	原因	调整期
----	------	-------------	----	-----

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。

7.3.2 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	42.85	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	11.26	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	5.63	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—180 天	11.33	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天 (含)	28.20	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		99.28	-

7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	45,021,871.53	25.35
	其中：政策性金融债	15,026,904.93	8.46
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	70,171,278.42	39.52
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	115,193,149.95	64.87
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	041471011	14 苏交科	100,000	10,062,215.96	5.67

		CP001			
2	041454072	14 东明石化 CP001	100,000	10,061,005.23	5.67
3	041562008	15 法尔胜 CP001	100,000	10,046,567.09	5.66
4	041563007	15 洛娃科技 CP001	100,000	10,001,326.34	5.63
5	041556010	15 美克 CP002	100,000	10,000,440.12	5.63
6	011599157	15 潞安 SCP002	100,000	10,000,114.16	5.63
7	071545002	15 瑞银 CP002	100,000	9,999,609.52	5.63
8	071536003	15 华安证券 CP003	100,000	9,998,526.03	5.63
9	071547001	15 国联证券 CP001	100,000	9,998,404.44	5.63
10	071543004	15 金元证券 CP004	100,000	9,998,036.13	5.63

7.6 “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	17
报告期内偏离度的最高值	0.4175%
报告期内偏离度的最低值	0.0168%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1528%

7.7 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。

7.8 投资组合报告附注

7.8.1

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。

7.8.2

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

7.8.3 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	1,561,887.55
4	应收申购款	44,595.32
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,606,482.87

7.8.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
15,412	11,521.41	136,644,196.18	76.95%	40,923,801.65	23.05%

8.2 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	476,509.59	0.2700%

有本基金		
------	--	--

8.3 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、基金投资和研发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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013 年 12 月 16 日）基金份额总额	545,248,037.90
本报告期期初基金份额总额	111,125,490.71
本报告期基金总申购份额	739,293,786.66
减：本报告期基金总赎回份额	672,851,279.54
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	177,567,997.83

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 53,515,743.74 份，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 68,712,034.87 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 14,416,417.57 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、国金财富、千石资本已按照法规规定向中国证监会进行了报告。

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

经国金通用基金管理有限公司第一届董事会审议并通过，并向中国证券投资基金业协会完成备案，基金管理人于 2015 年 4 月 16 日增聘吴富佳先生担任公司副总经理。

除了上述情况以外，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务至今，本报告期内会计师事务所未发生改变。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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。

10.7.2 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	-	-	79,000,000.00	100.00%	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况

注：本基金本报告期偏离度绝对值未超过 0.5%。

10.9 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	国金通用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	指定信息披露媒体及基金管理人网站	2015 年 1 月 5 日
2	国金通用鑫盈货币市场证券投资基金 2014 年第 4 季度报告	指定信息披露媒体及基金管理人网站	2015 年 1 月 22 日
3	国金通用鑫盈货币市场证券投资基金招募说明（更新）	基金管理人网站	2015 年 1 月 30 日
4	国金通用鑫盈货币市场证券投资基金招募说明（更新）摘要	指定信息披露媒体及基金管理人网站	2015 年 1 月 30 日
5	国金通用基金管理有限公司关于在齐鲁证券有限公司开通定期定额投资业务的公告	指定信息披露媒体及基金管理人网站	2015 年 3 月 23 日
6	国金通用鑫盈货币市场证券投资基金 2014 年年度报告	基金管理人网站	2015 年 3 月 30 日
7	国金通用鑫盈货币市场证券投资基金 2014 年年度报告（摘要）	指定信息披露媒体及基金管理人网站	2015 年 3 月 30 日
8	国金通用基金管理有限公司关	指定信息披露媒体及基金管	2015 年 3 月 30 日

	于增加上海利得基金销售有限公司为旗下基金销售机构并参加相关费率优惠活动的公告	理人网站	
9	关于旗下部分基金停止办理支付宝网上直销部分业务的公告	指定信息披露媒体及基金管理人网站	2015 年 4 月 1 日
10	国金通用基金管理有限公司高级管理人员变更公告	指定信息披露媒体及基金管理人网站	2015 年 4 月 18 日
11	国金通用鑫盈货币市场证券投资基金 2015 年第 1 季度报告	指定信息披露媒体及基金管理人网站	2015 年 4 月 20 日
12	国金通用鑫盈货币市场证券投资基金 2015 年五一假期暂停大额申购、大额定期定额投资业务的公告	指定信息披露媒体及基金管理人网站	2015 年 4 月 28 日
13	关于调整国金通用鑫盈货币市场证券投资基金收益支付方式并相应修订基金合同部分条款的公告	指定信息披露媒体及基金管理人网站	2015 年 6 月 6 日
14	国金通用鑫盈货币市场证券投资基金 2015 年端午假期暂停大额申购、大额定期定额投资业务的公告	指定信息披露媒体及基金管理人网站	2015 年 6 月 18 日

注：经国金通用基金管理有限公司（以下简称“公司”）股东会审议通过，根据 2015 年 6 月 8 日中国证券监督管理委员会印发的《关于核准国金通用基金管理有限公司变更股权的批复》（证监许可〔2015〕1153 号），公司原股东之一中国通用技术（集团）控股有限责任公司将所持有的国金通用基金管理有限公司 12% 的股权转让给涌金投资控股有限公司。变更后的股权结构为：国金证券股份有限公司持股比例 49%、苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司持股比例 19.5%、广东宝丽华新能源股份有限公司持股比例 19.5%、涌金投资控股有限公司持股比例 12%。同时公司名称变更为“国金基金管理有限公司”。

上述公司股权和公司名称变更事项，已按有关规定在北京市工商行政管理局办理完毕相关变更登记手续，并于 2015 年 7 月 23 日领取了变更后的营业执照。

具体请参见公司于 2015 年 7 月 24 日发布在中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站的相关公告。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 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、国金通用鑫盈货币市场证券投资基金基金合同；
- 3、国金通用鑫盈货币市场证券投资基金托管协议；
- 4、国金通用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
2015 年 8 月 28 日