

# 国金金腾通货币市场证券投资基金 2017 年第 1 季度报告

2017-03-31

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：2017-04-22

目录全部展开 目录全部收拢

重要提示

基金产品概况

基金基本情况

主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标

基金净值表现

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

自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

管理人报告

基金经理（或基金经理小组）简介

管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

公平交易专项说明

公平交易制度的执行情况

异常交易行为的专项说明

报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内基金的业绩表现

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

报告期债券回购融资情况

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%

投资组合平均剩余期限基本情况

期末投资组合平均剩余期限分布比例

期末按债券品种分类的债券投资组合

期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

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

投资组合报告附注

基金计价方法说明

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

受到调查以及处罚情况

期末其他各项资产构成

投资组合报告附注的其他文字描述部分

开放式基金份额变动

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细  
报告期末发起式基金发起资金持有份额情况  
影响投资者决策的其他重要信息  
报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况  
影响投资者决策的其他重要信息  
备查文件目录  
备查文件目录  
存放地点  
查阅方式

#### 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 2017 年 4 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 3 月 31 日止。

#### 基金基本情况

项目

数值

基金简称

国金金腾通

场内简称

基金主代码

000540

基金运作方式

契约型开放式

基金合同生效日

2014-02-17

报告期末基金份额总额

11,210,732,186.34

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 2 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 2 级基金的场内简称

下属 2 级基金的交易代码

000540

001621

报告期末下属 2 级基金的份额总额

9,202,928,643.12

2,007,803,543.22

注：无

主要财务指标

单位：人民币元

项目

主基金(元)

A(元)

2017-01-01 - 2017-03-31

C(元)

2017-01-01 - 2017-03-31

本期已实现收益

104,186,269.28

16,328,770.33

本期利润

104,186,269.28

16,328,770.33

期末基金资产净值

9,202,928,643.12

2,007,803,543.22

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。

基金净值表现

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

-%

-%

-%

-%

-%

-%

-%

-%

-%

-%

-%

-%

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 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

-%

-%

-%

-%

-%

-%

0.9010%

0.0010%

0.0863%

0.0000%

0.8147%

0.0010%

注：本基金的业绩比较基准为：人民币活期存款利率（税后）

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 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

0.7147%

0.0010%

0.0863%

0.0000%

0.6284%

0.0010%

注：本基金的业绩比较基准为：人民币活期存款利率（税后）

自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注：本基金 A 类份额基金合同生效日为 2014 年 2 月 17 日，图示日期为 2014 年 2 月 17 日至 2017 年 3 月 31 日。本基金 C 类份额基金合同生效日为 2015 年 9 月 28 日，图示日期为 2015 年 9 月 28 日至 2017 年 3 月 31 日。

自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较  
A

自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较  
C

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

本基金基金经理，国金国鑫发起、国金众赢货币、国金及第七天理财基金经理，投资管理部总经理

2014-02-17

-

9

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、固定收益投资部总经理兼基金经理；自 2017 年 3 月起任投资管理部总经理兼基金经理。

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。

## 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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《国金金腾通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。

## 公平交易专项说明

### 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。

### 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。

### 报告期内基金的投资策略和运作分析

一季度经济增速平稳，通胀下行，原材料价格维持高位，基本面对债市的支撑不强；美国加息，人民币贬值压力阶段性暂缓，央行继续推动金融去杠杆，MPA 考核趋严，货币政策中性偏紧，债市信用风险事件频发，山东邹平板块金融风险抬升，资金面成本持续高位，债券市场延续调整格局。

在资金面偏紧、债券市场调整风险延续的环境下，组合投资操作偏谨慎，组合安排了充裕的流动性以应对市场的流动性冲击和赎回压力，同时整体维持较低的债券仓位和较短久期，以应对市场调整的风险。在充分考虑资金的流动性和安全性考虑的基础上，择机配置优质的流动性和收益性兼具的现金管理工具，在保持短久期策略的基础上，适度提升组合资产的收益性。

### 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 0.9010%，同期业绩比较基准收益率为 0.0863%；本基金的金腾通货币 C 份额净值收益率为 0.7147%，同期业绩比较基准收益率为 0.0863%。

### 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

#### 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。

#### 投资组合报告

##### 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

5,240,924,646.70

41.67

其中：债券

5,240,924,646.70

41.67

资产支持证券

-

-

2

买入返售金融资产

2,817,543,706.32

22.40

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

4,473,845,850.18

35.57

4

其他各项资产

45,041,678.38

0.36

5

合计

12,577,355,881.58

100.00

报告期债券回购融资情况

序号

项目

金额（元）

占基金资产净值的比例（%）

1

报告期内债券回购融资余额

-

4.35

其中：买断式回购融资

-

0.02

2

报告期末债券回购融资余额

1,359,833,920.24

12.13

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%。

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

75

报告期内投资组合平均剩余期限最高值

98

报告期内投资组合平均剩余期限最低值

58

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

-

-

-

-

-

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

43.19

12.13

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债

-

-

2

30 天(含)—60 天

31.25



-  
其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债  
0.44

-  
3  
60 天(含)—90 天  
11.01

-  
其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债  
-

-  
4  
90 天(含)—180 天  
-

-  
其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债  
-

-  
5  
180 天(含)—397 天（含）  
-

-  
其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债  
-

-  
合计  
111.79

12.13  
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

719,716,282.05

6.42  
其中：政策性金融债

719,716,282.05

6.42

4

企业债券

-

-

5

企业短期融资券

659,636,143.50

5.88

6

中期票据

-

-

7

同业存单

3,861,572,221.15

34.45

8

其他

-

-

9

合计

5,240,924,646.70

46.75

10

剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券

49,730,553.70

0.44

期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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

160414

16 农发 14

4,550,000

454,899,225.54

4.06  
2  
111790721  
17 杭州银行 CD019  
4,000,000  
398,995,141.80  
3.56  
3  
111680645  
16 中德住房储蓄银行 CD016  
3,000,000  
298,520,942.05  
2.66  
4  
041653060  
16 河钢 CP005  
2,500,000  
249,619,098.32  
2.23  
5  
111792978  
17 上饶银行 CD007  
2,000,000  
199,878,439.91  
1.78  
6  
111790358  
17 南充商行 CD008  
2,000,000  
199,665,403.66  
1.78  
7  
111790708  
17 广州银行 CD008  
2,000,000  
199,497,570.88  
1.78  
8  
111791580  
17 中德住房储蓄银行 CD007  
2,000,000  
198,926,960.35  
1.77  
9

111793131

17 富邦华一银行 CD008

1,986,000

196,976,038.74

1.76

10

111680711

16 郑州银行 CD127

2,000,000

195,613,349.56

1.74

“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目

偏离情况

报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数

0

报告期内偏离度的最高值

-0.0321%

报告期内偏离度的最低值

-0.0765%

报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值

0.0514%

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

序号

证券代码

证券名称

数量（份）

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

投资组合报告附注

基金计价方法说明

本基金采用固定份额净值，基金账面份额净值始终保持为人民币 1.00 元。

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，每日计提收益或损失。

本报告期内本基金持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券说明  
序号

发生日期

该类浮动债占基金资产净值的比例

原因

调整期

受到调查以及处罚情况

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

其他资产构成

单位：人民币元

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

45,041,678.38

4

应收申购款

-

5

其他应收款

-

6

待摊费用

-

8

其他

-

9

合计

45,041,678.38

投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

开放式基金份额变动

单位：份

项目

国金金腾通

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

9,779,777,034.38

1,753,366,361.35

报告期期间总申购份额

61,729,420,265.34

14,269,570,257.63

报告期期间基金总赎回份额

62,306,268,656.60

14,015,133,075.76

报告期期末基金份额总额

11,210,732,186.34

9,202,928,643.12

2,007,803,543.22

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，基金管理人的股东涌金投资控股有限公司持有本基金的金腾通货币 A 份额为 215,591.18 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”）持有本基金的金腾通货币 A 份额为 17,635,938.51 份，基金管理人的关联方国金道富投资服务有限公司持有本基金的金腾通货币 A 份额为 40,060,385.79 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 号资产管理计划持有本基金的金腾通 A 份额为 12,687,472.02 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，其中，国金财富已按照法规规定向中国证监会进行了报告。

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

合计

注：本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目

持有份额总数

持有份额占基金总份额比例

发起份额总数

发起份额占基金总份额比例

发起份额承诺持有期限

基金管理人固有资金

-%

-%

基金管理人高级管理人员

-%

-%

基金经理等人员

-%

-%

基金管理人股东

-%

-%

其他

-%

-%

合计

-%

-%

报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别

报告期内持有基金份额变化情况

报告期末持有基金情况

序号

持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间

期初份额

申购份额

赎回份额

持有份额

份额占比

机构

-

-

-

-

-

-

-

-

个人

-

-

-

-

-

-

-

产品特有风险

-

注：本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

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、2017 年 1 月 3 日披露了《国金基金管理有限公司 2016 年 12 月 31 日旗下基金净值公告》；
- 2、2017 年 1 月 21 日披露了《国金金腾货币市场证券投资基金 2016 年第 4 季度报告》；
- 3、2017 年 3 月 28 日披露了《国金金腾货币市场证券投资基金 2016 年年度报告》《国金金腾货币市场证券投资基金 2016 年年度报告摘要》；

4、2017年3月30日披露了《国金金腾货币市场证券投资基金招募说明书（更新）》  
《国金金腾货币市场证券投资基金招募说明书（更新）摘要》。

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。

备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、国金金腾货币市场证券投资基金基金合同；
- 3、国金金腾货币市场证券投资基金托管协议；
- 4、国金金腾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。

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。

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](http://www.gfund.com)