国金众赢货币市场证券投资基金
2019年第1季度报告

2019年3月31日

基金管理人：国金基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2019年4月22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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 4 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年月 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国金众赢货币
场内简称	-
交易代码	001234
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	2015 年 6 月 25 日
报告期末基金份额总额	22,017,481,427.86 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，力争为投资人创造稳定的收益。
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	本基金的业绩比较基准为：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，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	招商银行股份有限公司

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（ 2019 年 1 月 1 日 － 2019 年 3 月 31 日 ）
1．本期已实现收益	171,164,572.09
2．本期利润	171,164,572.09
3．期末基金资产净值	22,017,481,427.86

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。

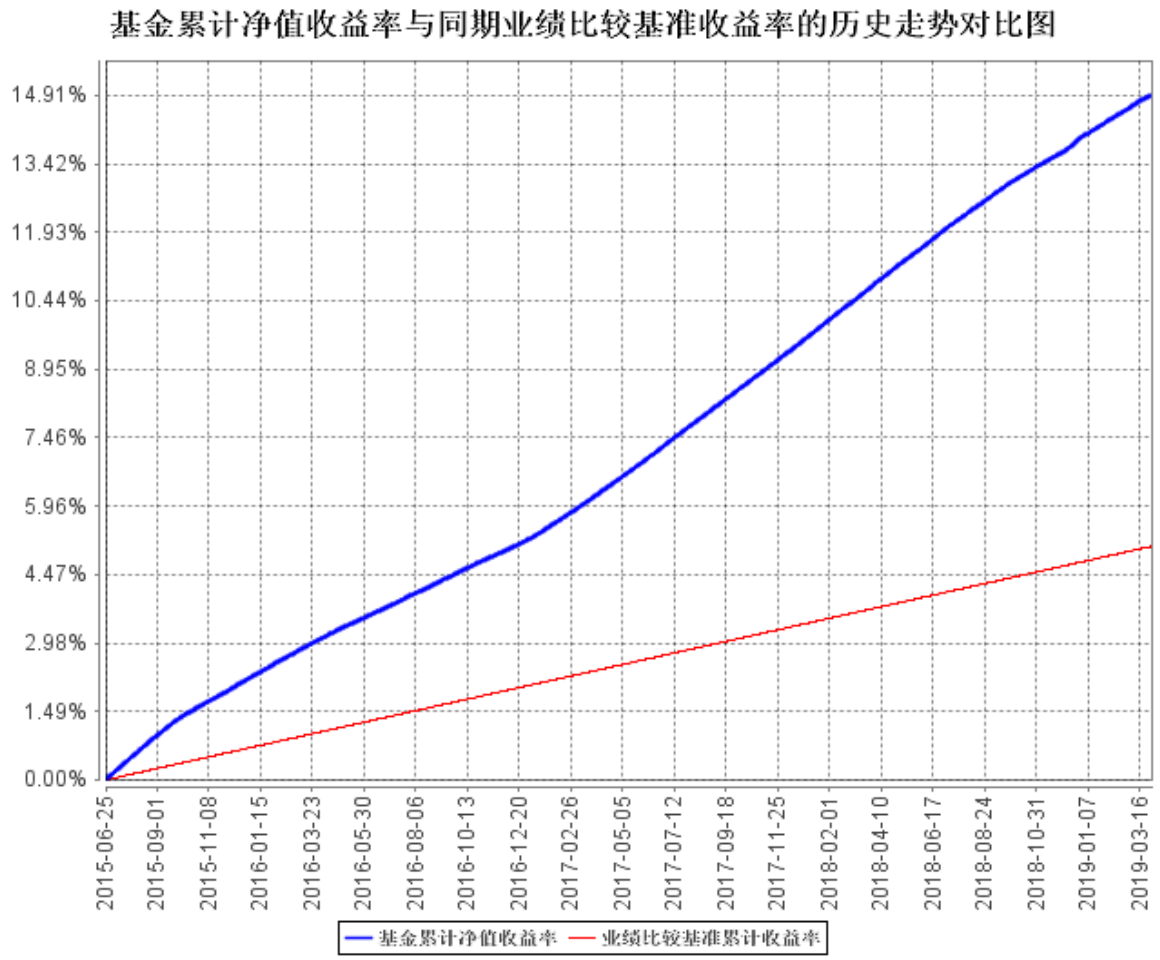
3.2 基金净值表现

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	0.7828%	0.0024%	0.3329%	0.0000%	0.4499%	0.0024%

注：本基金的业绩比较基准为：人民币七天通知存款利率（税后）。

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



注：本基金基金合同生效日为 2015 年 6 月 25 日，图示日期为 2015 年 6 月 25 日至 2019 年 3 月 31 日。

§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	本基金基金经理，国金国鑫发起、国金及第七天理财、国金民丰回报、国金量化添利、国金惠鑫短债基金	2015 年 6 月 25 日	-	11	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；

	经理，固定收益投资部总经理				现任固定收益投资部总经理兼基金经理。
刘辉	本基金基金经理，国金鑫盈货币、国金金腾通货币基金经理	2018 年 1 月 25 日	-	8	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、上海资管事业部基金经理；现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》和其他有关法律法规的规定，以及《国金众赢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 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，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。

4.3.2 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 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期间内，全球经济增速疲软，美国经济已经在去年四季度呈现顶部特征，今年前两月个人消费明显回落，欧元区 PMI 进一步加速下滑。国内经济同样处于底部区间，但经济动能边际改善。固定资产投资增速回升较为明显，主要来自于基建和房地产两方面的支撑。而其他方面，工业增速和消费增速底部企稳，出口增速在外需疲弱的情况下大幅回落。市场对于通胀预期在经历一波下滑后于 3 月再度升温。

货币政策的重点主要是疏通传导机制，支持实体经济。整体流动性维持宽松，资金价格水平处于低位。债市方面经历 2018 年的一波下行后 19 年一季度处于震荡态势，短端继续回落而长端保持平稳，同时信用利差依然维持在高位。

组合在报告期间内维持稳健操作风格，在控制流动性风险和信用风险的基础上，积极进行货币工具的配置，提升组合的收益水平。

4.5 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 0.7828%，同期业绩比较基准收益率为 0.3329%。

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，本基金未出现连续二十个工作日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	17,039,011,629.82	70.74
	其中：债券	16,201,011,629.82	67.26
	资产支持证券	838,000,000.00	3.48

2	买入返售金融资产	2,123,569,625.35	8.82
	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	4,801,740,415.42	19.94
4	其他资产	122,364,218.02	0.51
5	合计	24,086,685,888.61	100.00

5.2 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	1,927,954,149.10	8.86
	其中：买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	2,056,808,941.76	9.34
	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	107
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	112
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	95

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。

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	29.33	9.34
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

2	30 天(含)-60 天	10.84	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	20.71	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-120 天	7.98	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)-397 天（含）	39.98	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		108.84	9.34

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 240 天。

5.5 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	1,182,516,779.09	5.37
	其中：政策性金融债	1,182,516,779.09	5.37
4	企业债券	237,672,931.90	1.08
5	企业短期融资券	2,843,498,750.37	12.91
6	中期票据	859,533,215.31	3.90
7	同业存单	11,077,789,953.15	50.31
8	其他	-	-
9	合计	16,201,011,629.82	73.58
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

5.6 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	111895798	18 贵阳银行 CD076	4,000,000	399,307,342.80	1.81
2	111906094	19 交通银行	4,000,000	397,538,743.61	1.81

		CD094			
3	111990822	19 长沙银行 CD004	4,000,000	396,477,481.25	1.80
4	111886417	18 长沙银行 CD191	3,700,000	363,088,844.64	1.65
5	180407	18 农发 07	3,200,000	320,428,320.90	1.46
6	011802088	18 陕延油 SCP009	3,000,000	300,066,701.72	1.36
7	111994044	19 盛京银行 CD135	3,000,000	298,101,886.52	1.35
8	111882140	18 华融湘江银行 CD129	3,000,000	296,382,947.78	1.35
9	111809367	18 浦发银行 CD367	3,000,000	296,192,320.90	1.35
10	111886861	18 昆仑银行 CD090	3,000,000	294,070,334.62	1.34

5.7 “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	0
报告期内偏离度的最高值	0.1593%
报告期内偏离度的最低值	0.0772%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1254%

注：本基金本报告期内未发生偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

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。

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十名资产支持证券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（份）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	149814	借呗 57A1	2,500,000	250,000,000.00	1.14
2	149920	18 花呗 6A	1,500,000	150,000,000.00	0.68
3	156081	18 建花 3A	1,100,000	110,000,000.00	0.50
4	149984	18 京保 5A	950,000	95,000,000.00	0.43
5	156636	19 裕源 03	800,000	80,000,000.00	0.36

6	156771	19 裕源 04	500,000	50,000,000.00	0.23
7	156953	19 京保 1A	300,000	30,000,000.00	0.14
7	156601	二局 01 优	300,000	30,000,000.00	0.14
8	156680	二局 02 优	230,000	23,000,000.00	0.10
9	156599	19 信易 01	150,000	15,000,000.00	0.07
10	156600	威新 01 优	50,000	5,000,000.00	0.02

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现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、处罚的情形。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	34,056.37
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	120,398,034.60
4	应收申购款	1,932,127.05
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	122,364,218.02

5.9.4 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	20,829,139,755.43
报告期期间基金总申购份额	24,236,029,715.81
报告期期间基金总赎回份额	23,047,688,043.38
报告期期末基金份额总额	22,017,481,427.86

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。

§7 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	2019 年 1 月 10 日	130,000.00	130,000.00	0.00%
2	基金转换入	2019 年 1 月 10 日	634,924.12	634,924.12	0.00%
合计			764,924.12	764,924.12	

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

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。

8.2 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》及基金管理人网站进行了如下信息披露：

1、2019 年 01 月 04 日《关于增加大连网金基金销售有限公司为国金基金旗下基金销售机构的公告》

2、2019 年 01 月 10 日《关于增加阳光人寿保险股份有限公司为国金基金旗下基金销售机构的公告》

3、2019 年 01 月 19 日《国金众赢货币市场证券投资基金 2018 年第 4 季度报告》

4、2019 年 01 月 29 日《国金众赢货币市场证券投资基金 2019 年春节假期暂停大额申购、大额转换转入、大额定期定额投资业务的公告》

5、2019 年 02 月 01 日《国金众赢货币市场证券投资基金招募说明书（更新）》

6、2019 年 02 月 01 日《国金众赢货币市场证券投资基金招募说明书（更新）摘要》

7、2019 年 02 月 23 日《关于暂停大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告》

8、2019 年 03 月 07 日《关于增加民商基金销售(上海)有限公司为国金基金旗下基金销售机

构的公告》

9、2019 年 03 月 20 日《关于增加新兰德为国金众赢货币市场证券投资基金销售机构的公告》

10、2019 年 03 月 30 日《国金众赢货币市场证券投资基金 2018 年年度报告》

11、2019 年 03 月 30 日《国金众赢货币市场证券投资基金 2018 年年度报告摘要》

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。

§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、国金众赢货币市场证券投资基金基金合同；

3、国金众赢货币市场证券投资基金托管协议；

4、国金众赢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

2019 年 4 月 22 日