国金金腾通货币市场证券投资基金

2018年第三季度报告

2018年9月30日

基金管理人:国金基金管理有限公司

基金托管人:中国民生银行股份有限公司

报告送出日期:2018年10月25日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2017 年 10 月 24 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 2018 年 7 月 1 日至 2018 年 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国金金腾通	
场内简称	-	
交易代码	000540	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年2月17日	
报告期末基金份额总额	15,608,710,778.08 份	
投资目标	在综合考虑基金资产收益性、安全性和流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,力争为投资者创造稳定的收益。	
投资策略	本基金在确保资产安全性和流动性的基础上,对短期货币市场利率的走势进行预测和判断,采取积极主动的投资策略,综合利用定性分析和定量分析方法,力争获取超越比较基准的投资回报。	
业绩比较基准	人民币活期存款利率(税后)。	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种,其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。	
基金管理人	国金基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	国金金腾通货币 A	国金金腾通货币 C
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	000540	001621
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	12,262,306,191.18 份	3,346,404,586.90 份

注:无。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018 年 7 月 1 日 — 2018 年 9 月 30 日)	
	国金金腾通货币 A	国金金腾通货币 C
1.本期已实现收益	130,032,515.70	31,582,158.94
2. 本期利润	130,032,515.70	31,582,158.94
3. 期末基金资产净值	12,262,306,191.18	3,346,404,586.90

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2.本基金收益分配为按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国金金腾通货币 A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.9312%	0.0010%	0.0882%	0.0000%	0.8430%	0.0010%

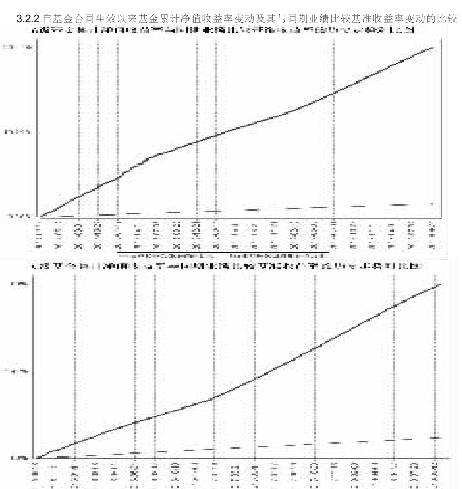
注:本基金的业绩比较基准为:人民币活期存款利率(税后)

国金金腾通货币 C

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.7407%	0.0010%	0.0882%	0.0000%	0.6525%	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)

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 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 2018 年 9 月 30 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 2018 年 9 月 30 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		
刘辉	本基金基金经理,国金鑫盈货币、国金众赢货币基金经理	2017年4月15日	-	7	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;自 2017 年 3 月起任投资管理部基金经理。

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。

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

三季度国内经济总体呈现类滞胀格局;随着去杠杆政策的坚定推进、资管新规的实施、政府隐性债务的严控,社融增速持续下行,企业融资陷入困境,债券违约事件持续发生,基建投资和社会消费持续下滑,国内经济增速小幅下行,而猪肉、蔬菜价格持续上涨,推动国内 CPI 连续回升。三季度中美贸易战愈演愈烈,两轮互征关税先后落地,引发国内出口前景担忧。随着外部环境的变化,7 月底中央政治局会议对政策基调进行了调整,提出加大基建投资补短板力度,央行货币政策也进一步放松,积极支持银行投资低等级信用债和中小企业融资,疏通货币政策传导机制。

在上述经济和政策背景下,债市短端大幅下行,1 年期国开债收益率从 6 月底的 3.7 左右下降至 9 月底的 3.1 左右,长端总体保持震荡,10 年国开债收益率维持在 4.25%左右。

报告期内,本基金依旧保持稳健的操作风格,始终把流动性风险放在第一位,根据资金面的变化,灵活调整债券仓位和久期。报告期内,本基金在控制风险的同时,为投资人提供了合理回报。

4.5 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 0.9312%,同期业绩比较基准收益率为 0.0882%;本基金的金腾通货币 C 份额净值收益率为 0.7407%,同期业绩比较基准收益率为 0.0882%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金无连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	8,386,296,185.51	51.74
	其中:债券	8,386,296,185.51	51.74
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,830,204,265.30	11.29
	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	5,923,421,844.02	36.54
4	其他资产	70,087,496.64	0.43
5	合计	16,210,009,791.47	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	-	1.06
	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	589,988,795.01	3.78
	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	108
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	110
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	77

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注:报告期内本基金无投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	24.10	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)- 60 天	13.11	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)- 90 天	28.37	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)- 120 天	1.92	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)- 397 天(含)	35.89	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	103.40	-

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:本报告期未发生投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

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	49,835,523.16	0.32
2	央行票据	-	-
3	金融债券	729,709,769.38	4.68
	其中:政策性金融债	729,709,769.38	4.68
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	850,431,999.06	5.45
6	中期票据	-	-
7	同业存单	6,756,318,893.91	43.29
8	其他	-	-
9	合计	8,386,296,185.51	53.73
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	111810372	18兴业银行CD372	5,000,000	500,001,216.99	3.20
2	111811104	18平安银行CD104	4,500,000	439,330,812.89	2.81
3	111810361	18兴业银行CD361	3,000,000	300,000,736.72	1.92
4	111810355	18兴业银行CD355	3,000,000	300,000,000.00	1.92
4	111810332	18兴业银行CD332	3,000,000	300,000,000.00	1.92
5	111880958	18盛京银行CD289	3,000,000	299,558,680.83	1.92
6	111810399	18兴业银行CD399	3,000,000	298,725,897.47	1.91
7	111810429	18兴业银行CD429	3,000,000	298,544,400.93	1.91
8	111811077	18平安银行CD077	3,000,000	297,165,941.04	1.90
9	111884721	18上海农商银行CD067	2,500,000	248,671,536.46	1.59
10	011801011	18陕延油SCP005	2,000,000	200,096,049.27	1.28

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	0.1846%
报告期内偏离度的最低值	0.0609%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1046%

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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

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

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

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	70,087,496.64
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	70,087,496.64

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

项目	国金金腾通货币 A	国金金腾通货币 C
报告期期初基金份额总额	9,961,354,051.11	3,000,579,427.07
报告期期间基金总申购份额	43,101,796,990.16	17,396,962,760.12
报告期期间基金总赎回份额	40,800,844,850.09	17,051,137,600.29
报告期期末基金份额总额	12,262,306,191.18	3,346,404,586.90

注:1、总申购份额含红利再投、转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

2、本报告期末,基金管理人的子公司上海国金理益财富基金销售有限公司持有金腾通货币 A 份额为 33,217.70 份,基金管理人的股东涌金投资控股有限公司持有金腾通货币 C 份额为 983,771.64 份,基金管理人旗下资管计划国金基金 - 鑫盛量化多策略 1 号资产管理计划持有金腾通货币 A 份额为 3,892,903.89 份,基金管理人旗下资管计划国金基金贤达汇鑫 8 号资产管理计划持有金腾通货币 A 份额为 6,597,171.03 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金腾通 A 份额为 70,532,810.72 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。

§ 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	2018年7月3日	50,000,000.00	50,000,000.00	0.00%
2	申购	2018年7月5日	5,000,000.00	5,000,000.00	0.00%
3	申购	2018年9月7日	18,000,000.00	18,000,000.00	0.00%
4	赎回	2018年7月6日	-2,000,000.00	-2,000,000.00	0.00%
5	赎回	2018年8月8日	-1,500,000.00	-1,500,000.00	0.00%
6	赎回	2018年8月10日	-1,000,000.00	-1,000,000.00	0.00%
7	赎回	2018年8月20日	-2,000,000.00	-2,000,000.00	0.00%
8	赎回	2018年8月23日	-1,000,000.00	-1,000,000.00	0.00%
9	赎回	2018年9月11日	-5,500,000.00	-5,500,000.00	0.00%
10	赎回	2018年9月18日	-3,000,000.00	-3,000,000.00	0.00%
11	赎回	2018年9月25日	-57,966,563.94	-57,966,563.94	0.00%
合计			-966,563.94	-988,276.13	

§ 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》《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、2018 年 07 月 20 日披露了《国金金腾通货币市场证券投资基金 2018 年第 2 季度报告》;

2、2018 年 08 月 24 日披露了《国金金腾通货币市场证券投资基金 2018 年半年度报告》;

3、2018 年 08 月 24 日披露了《国金金腾通货币市场证券投资基金 2018 年半年度报告摘要》;

4、2018 年 08 月 30 日披露了《国金基金管理有限公司关于旗下基金投资资产支持证券的公告》;

5、2018 年 09 月 28 日披露了《国金金腾通货币市场证券投资基金招募说明书(更新)》;

6、2018 年 09 月 28 日披露了《国金金腾通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。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;

2、国金金腾通货币市场证券投资基金基金合同;

3、国金金腾通货币市场证券投资基金托管协议;

4、国金金腾通货币市场证券投资基金招募说明书;

5、基金管理人业务资格批件、营业执照;

6、基金托管人业务资格批件、营业执照;

7、报告期内披露的各项公告。

9.2 存放地点

北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 层。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的办公场所或基金管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问,可咨询本管理人。

咨询电话:4000-2000-18

公司网址:www.gfund.com

国金基金管理有限公司

2018 年 10 月 25 日

国金上证 50 指数分级证券投资基金

2018年第三季度报告

2018年9月30日

基金管理人:国金基金管理有限公司

基金托管人:中国民生银行股份有限公司

报告送出日期:2018年10月25日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2018 年 10 月 24 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 2018 年 7 月 1 日起至 2018 年 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国金上证 50		
场内简称	国金上证 50		
交易代码	502020		
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5月27日		
报告期末基金份额总额	38,866,085.96 份		
投资目标	采用指数化投资策略,紧密跟踪上证 50 指数,力争获取与标的指数相似的投资收益,并将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35%以内,年跟踪误差控制在 4%以内。		
投资策略	本基金采用指数完全复制方法,按照标的指数成份股及其权重构建基金的投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整,以达到跟踪和复制指数的目的,力争保持基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值不超过 0.35%,年跟踪误差不超过 4%。如遇特殊情况(如市场流动性不足、个别成份股被限制投资、法律法规禁止或限制投资等)致使基金无法购得足够数量的股票时,基金管理人将对投资组合管理进行适当变通和调整,并运用股指期货等金融衍生工具,以实现对跟踪误差的有效控制。		
业绩比较基准	95%× 上证 50 指数收益率+5%× 同期银行活期存款利率(税后)。		
风险收益特征	本基金为股票型基金,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。从本基金三类基金份额来看,国金上证 50 份额具有与标的指数及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征,国金上证 50A 份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征;国金上证 50B 份额具有高预期风险、高预期收益的特征。		
基金管理人	国金基金管理有限公司		
基金托管人	中国民生银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	国金 50A	国金 50B	国金 50
下属分级基金的场内简称	国金 50A	国金 50B	国金 50
下属分级基金的交易代码	502021	502022	502020
报告期末下属分级基金的份额总额	1,756,479.00 份	1,756,479.00 份	35,353,127.96 份
下属分级基金的风险收益特征	国金上证 50A 份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征。	国金上证 50B 份额具有高预期风险、高预期收益的特征。	国金上证 50 份额具有与标的指数及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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(2018 年 7 月 1 日 — 2018 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	-630,294.91
2.本期利润	1,435,131.25
3.加权平均基金份额本期利润	0.0345
4.期末基金资产净值	36,374,479.76
5.期末基金份额净值	0.936

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(不含公允价值变动损益)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损益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

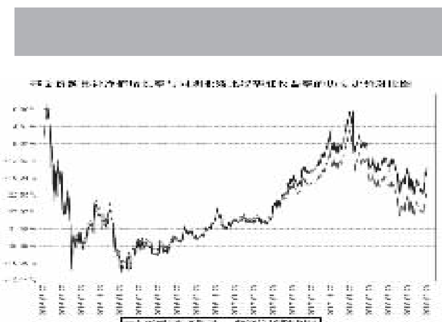
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	4.00%	1.35%	4.89%	1.36%	-0.89%	-0.01%

注:本基金的业绩比较基准为:上证 50 指数收益率× 95%+同期银行活期存款利率(税后)× 5%

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



注:本基金基金合同生效日为 2015 年 5 月 27 日,图示日期为 2015 年 5 月 27 日至 2018 年 9 月 30 日。

3.3 其他指标

注:无

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
宫雪	本基金基金经理,国金 300 指数增强、国金鑫新灵活配置(LOF)、国金鑫瑞灵活基金经理,量化投资事业三部总经理	2015年5月27日	-	10	宫雪女士,中国科学院博士。2008 年 7 月至 2011 年 12 月在博时基金管理有限公司股票投资部,任产业分析师;2012 年 2 月至今在国金基金管理有限公司,历任产品经理、行业分析师、产品与金融工程部副总经理、指数投资部副总经理、指数投资事业部总经理,自 2016 年 4 月起任量化投资事业三部总经理。

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《国金上证 50 指数分级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,本基金严格遵守基金合同,采取完全复制标的指数上证 50 指数的投资策略,同时为控制大额申购对跟踪误差的影响,本基金适当投资股指期货。基金持仓包括上证 50 指数成份股、股指期货及现金等,其中股票持仓不低于 90%,股指期货市值不高于 10%,现金类资产不低于 5%,以日均跟踪偏离度最小(绝对值不超过 0.35%)、年化跟踪误差尽量小(不超过 4%)为管理目标。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金份额净值增长率为 4.00%,同期业绩比较基准收益率为 4.89%;报告期内,基金的日均跟踪偏离度 0.15%,低于合同约定的日均跟踪偏离度为 0.35%,年化跟踪误差为 3.12%,低于合同约定的年化跟踪误差为 4%的水平。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

截止本报告期末,本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。本基金管理人已经按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》向中国证监会报告并提出解决方案。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	34,979,177.37	94.20
	其中:股票	34,979,177.37	94.20
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,056,064.02	5.54
8	其他资产	98,783.40	0.27
9	合计	37,134,024.79	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,389,016.00	3.82
C	制造业	8,329,408.25	22.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,588,022.00	4.37
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	498,318.00	1.37
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	421,184.00	1.16
J	金融业	18,196,933.31	50.03
K	房地产业	935,208.00	2.57
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	31,358,089.56	86.21

注:以上行业分类以 2018 年 9 月 30 日的中国证监会行业分类标准为依据。

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	2,778,815.61	7.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	842,272.20	2.32
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,621,087.81	9.96

注:以上行业分类以 2018 年 9 月 30 日的中国证监会行业分类标准为依据。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投资部分股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	73,300	5,021,050.00	13.80
2	600519	贵州茅台	3,378	2,465,940.00	6.78
3	600036	招商银行	70,300	2,157,507.00	5.93
4	601166	兴业银行	85,300	1,360,535.00	3.74
5	600016	民生银行	191,940	1,216,899.60	3.35
6	601328	交通银行	188,300	1,099,672.00	3.02
7	600887	伊利股份	41,600	1,068,288.00	2.94
8	601288	农业银行	262,200	1,019,958.00	2.80
9	600276	恒瑞医药	15,200	965,200.00	2.65
10	600030	中信证券	53,200	887,908.00	2.44

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	603156	养元饮品	52,804	2,644,952.36	7.27
2	600000	浦发银行	79,310	842,272.20	2.32
3	600485	信威集团	9,175	133,863.25	0.37

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券投资。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券投资。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

报告期,本基金未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

报告期,本基金未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

报告期内,本基金未参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体中,招商银行于 2018 年 5 月 4 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚决定,罚款 6570 万元,没收违法所得 3.024 万元,罚没合计 6573.024 万元。主要违法违规事实:(一)内控管理严重违反审慎经营规则;(二)违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款;(三)同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保;(四)销售同业非保本理财产品时违规承诺保本;(五)违规将票据贴现资金直接转回出票人账户;(六)为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保;(七)未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目;(八)高管人员在未取得任职资格核准前履职;(九)未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务;(十)未严格审查贸易背景真实性开立信用证;(十一)违规签订保本合同销售同业非保本理财产品;(十二)非真实转让信贷资产;(十三)违规向典当行发放贷款;(十四)违规向关系人发放信用贷款。

兴业银行于 2018 年 5 月 4 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚决定,罚款 5870 万元。主要违法违规事实:(一)重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告;(二)非真实转让信贷资产;(三)无授信额度或超授信额度办理同业业务;(四)内控管理严重违反审慎经营规则,多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规;(五)同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保;(六)债券卖出回购业务违规出表;(七)个人理财资金违规投资;(八)提供日期倒签的材料;(九)部分非现场监管统计数据与事实不符;(十)个别董事未经任职资格核准即履职;(十一)变相批量转让个人贷款;(十二)向四证不全的房地产项目提供融资。

除上述情况外,本基金投资的其他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。

5.11.2

本期基金投资组合前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	19,187.90
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	525.22
5	应收申购款	79,070.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	98,783.40

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	603156	养元饮品	2,644,952.36	7.27	非公开发行
2	600485	信威集团	133,863.25	0.37	临时停牌

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

§ 6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	国金 50A	国金 50B	国金 50
报告期期初基金份额总额	1,762,129.00	1,762,129.00	37,294,736.90
报告期期间基金总申购份额	-	-	8,634,542.79
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-	10,587,451.73
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-5,650.00	-5,650.00	11,300.00
报告期期末基金份额总额	1,756,479.00	1,756,479.00	35,353,127.96

注:1.拆分变动份额为本基金三级份额之间配对转换及基金份额折算的变动份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本报告期基金管理人未投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

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》、《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、2018 年 07 月 04 日披露了《国金上证 50 指数分级证券投资基金 B 类份额交易价格波动提示公告》;

2、2018 年 07 月 06 日披露了《国金上证 50 指数分级证券投资基金 B 类份额交易价格波动提示公告》;

3、2018 年 07 月 11 日披露了《国金上证 50 指数分级证券投资基金招募说明书(更新)摘要》;

4、2018 年 07 月 11 日披露了《国金上证 50 指数分级证券投资基金招募说明书(更新)》;

5、2018 年 07 月 14 日披露了《国金上证 50 指数分级证券投资基金 B 类份额交易价格波动提示公告》;

6、2018 年 07 月 17 日披露了《国金上证 50 指数分级证券投资基金 B 类份额交易价格波动提示公告》;

7、2018 年 07 月 20 日披露了《国金上证 50 指数分级证券投资基金 2018 年第 2 季度报告》;

8、2018 年 08 月 07 日披露了《国金基金管理有限公司关于增加东海证券股份有限公司为旗下基金销售机构的公告》;

9、2018 年 08 月 24 日披露了《国金上证 50 指数分级证券投资基金 2018 年半年度报告》;

10、2018 年 08 月 24 日披露了《国金上证 50 指数分级证券投资基金 2018 年半年度报告摘要》;

11、2018 年 08 月 30 日披露了《国金基金管理有限公司关于增加联讯证券股份有限公司为旗下基金销售机构的公告》;

12、2018 年 08 月 30 日披露了《国金基金管理有限公司关于旗下基金投资资产支持证券的公告》;

13、2018 年 09 月 21 日披露了《关于网上交易平台汇付天天盈渠道关闭基金支付服务的公告》;

14、2018 年 09 月 28 日披露了《国金基金关于增加北京君德汇富基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告》。

本报告期内,基金管理人按照《证券投资基金信息披露管理办法》的规定每个开放日公布基金份额净值。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;

2、国金上证 50 指数分级证券投资基金基金合同;

3、国金上证 50 指数分级证券投资基金托管协议;

4、国金上证 50 指数分级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

2018 年 10 月 25 日

国金众赢货币市场证券投资基金

2018年第三季度报告

2018年9月30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:2018年10月25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 2018 年 10 月 24 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 2018 年 7 月 1 日起至 2018 年 9 月 30 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	25,894,211,118.09 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(2018 年 7 月 1 日 — 2018 年 9 月 30 日)
1. 本期已实现收益	255,960,812.97
2. 本期利润	255,960,812.97
3. 期末基金资产净值	25,894,211,118.09

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。

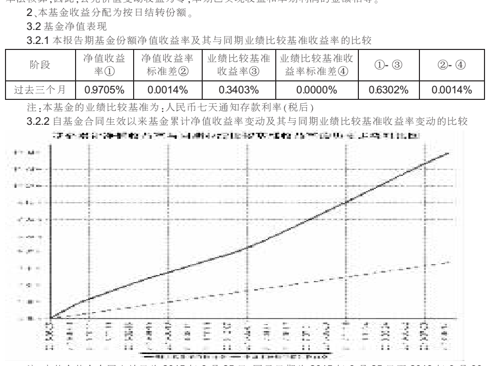
3.2 基金净值表现

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	0.9705%	0.0014%	0.3403%	0.0000%	0.6302%	0.0014%

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 2018 年 9 月 30 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、国金民丰回报基金经理,投资管理部总经理	2015年6月25日	-	10	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。
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	-	7	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;自 2017 年 3 月起任投资管理部基金经理。

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,经济基本面存在明显的下行态势:居民收入上下滑,居民买房贷款挤占购买力,消费增速较上半年再下一个台阶;中美贸易摩擦继续升级,进出口增速双双回落;投资方面,地方政府债务管控强化下基建投资增速继续下滑,严重拖累整体投资增速;通胀则受到夏季自然灾害、以及非洲猪瘟影响,三季度通胀水平抬升。

央行货币政策确认为宽松。7 月进行年内第三次降准,释放的增量资金使得资金面大幅宽松,几度出现 7 日回购利率与同期限公开市场回购利率倒挂的现象。另一方面,通过指导商业银行加大信贷投放力度,以及鼓励银行用 MLF 资金配置信用债的方式,加快疏通货币政策传导机制,来支持实体经济。债券方面,受通胀上升影响以及地方债发行压力影响,长端利率债收益率出现一波明显上行,信用风险事件频发,信用利差维持高位。

组合在报告期内稳健操作,在严格控制流动性风险和信用风险的基础上,适时增加货币工具配置,稳健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 0.9705%,同期业绩比较基准收益率为 0.3403%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金无连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	16,521,051,460.64	62.46
	其中:债券	15,646,051,460.64	59.16
	资产支持证券	875,000,000.00	3.31
2	买入返售金融资产	1,933,660,260.49	7.31
	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	7,878,639,433.35	29.79
4	其他资产	115,486,030.36	0.44
5	合计	26,448,837,184.84	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	-	4.95
	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	539,698,590.44	2.08
	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	112
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	116
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	88

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注:报告期内本基金无投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	20.44	2.08
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)- 60 天	15.44	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)- 90 天	18.55	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)- 120 天	9.12	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)- 397 天(含)	38.15	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	101.70	2.08

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:本报告期未发生投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

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	219,689,922.19	0.85
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,074,656,714.59	4.15
	其中:政策性金融债	1,074,656,714.59	4.15
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,401,856,248.01	5.41
6	中期票据	-	-
7	同业存单	12,949,848,575.85	50.01
8	其他	-	-
9	合计	15,646,051,460.64	60.42
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	111810217	18兴业银行CD217	5,000,000	498,418,116.25	1.92
2	111813084	18浙商银行CD084	5,000,000	498,135,364.76	1.92
3	111892639	18郑州银行CD029	5,000,000	497,468,273.54	1.92
4	111884736	18重庆农村商行CD096	5,000,000	497,342,757.00	1.92
5	111895798	18贵阳银行CD076	4,000,000	390,898,544.04	1.51
6	170413	17农发 13	3,500,000	349,956,650.07	1.35
7	111895471	18广东顺德农商行CD043	3,000,000	299,637,810.63	1.16
8	111895401	18成都银行CD093	3,000,000	299,566,416.00	1.16
9	111881080	18深圳前海微众银行CD019	3,000,000	299,492,768.34	1.16
10	111881989	18成都银行CD198	3,000,000	299,200,881.06	1.16

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	0.2207%
报告期内偏离度的最低值	0.0226%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0963%

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	149920	18花呗 6A	3,500,000	350,000,000.00	1.35
2	149814	德邦借呗 57A1	2,500,000	250,000,000.00	0.97
3	149980	18京保 4A	1,800,000	180,000,000.00	0.70
4	149984	18京保 5A	950,000	95,000,000.00	0.37

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	67,636,339.48
4	应收申购款	47,849,690.88
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	115,486,030.36

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	25,216,754,849.14
报告期期间基金总申购份额	28,314,976,227.45
报告期期间基金总赎回份额	27,637,519,958.50
报告期期末基金份额总额	25,894,211,118.09

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,基金管理人旗下资管计划国金基金 - 新智能 2 号资产管理计划持有本基金份额为 12,012,549.87 份,该持有人已按照本基金《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。

§ 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	赎回	2018年9月25日	-3,249,889.78	-3,251,149.49	-
合计			-3,249,889.78	-3,251,149.49	

§ 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者超过 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》、《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、2018 年 07 月 04 日披露了《国金基金关于增加济安财富(北京)基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告》;

2、2018 年 07 月 20 日披露了《国金众赢货币市场证券投资基金 2018 年第 2 季度报告》;

3、2018 年 07 月 21 日披露了《国金基金管理有限公司关于增加中民财富基金销售(上海)有限公司为旗下基金销售机构的公告》;

4、2018 年 08 月 07 日披露了《国金基金管理有限公司关于增加东海证券股份有限公司为旗下基金销售机构的公告》;

5、2018 年 08 月 07 日披露了《国金基金管理有限公司关于增加上海万得基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告》;

6、2018 年 08 月 09 日披露了《国金众赢货币市场证券投资基金招募说明书(更新)》;

7、2018 年 08 月 09 日披露了《国金众赢货币市场证券投资基金招募说明书(更新)摘要》;

8、2018 年 08 月 16 日披露了《国金基金关于增加华泰期货有限公司为旗下基金销售机构的公告》;

9、2018 年 08 月 24 日披露了《国金众赢货币市场证券投资基金 2018 年半年度报告》;

10、2018 年 08 月 24 日披露了《国金众赢货币市场证券投资基金 2018 年半年度报告摘要》;

11、2018 年 08 月 24 日披露了《国金基金管理有限公司关于增加北京创金启富基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告》;

12、2018 年 08 月 25 日披露了《国金基金关于增加上海国金理益财富基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告》;

13、2018 年 08 月 30 日披露了《国金基金管理有限公司关于旗下基金投资资产支持证券的公告》;

14、2018 年 09 月 03 日披露了《国金基金关于增加深圳众禄基金销售股份有限公司为旗下基金销售机构的公告》;

15、2018 年 09 月 07 日披露了《关于调整国金众赢货币市场证券投资基金机构投资者大额申购、转换转入及定期定额投资业务限制金额的公告》;

16、2018 年 09 月 15 日披露了《国金基金管理有限公司关于基金经理恢复履行职责的公告》;

17、2018 年 09 月 18 日披露了《国金众赢货币市场证券投资基金 2018 年中秋节假期前暂停机构投资者申购、转换转入、定期定额投资业务的公告》;

18、2018 年 09 月 21 日披露了《关于网上交易平台汇付天天盈渠道关闭基金支付服务的公告》;

19、2018 年 09 月 25 日披露了《国金众赢货币市场证券投资基金 2018 年国庆节假期前暂停机构投资者申购、转换转入、定期定额投资业务的公告》。

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

2018 年 10 月 25 日