国金沪深300指数分级证券投资基金

【2015】第三季度报告

基金管理人:国金基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月27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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月26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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国金沪深300		
场内简称	国金300		
交易代码	167601		
前端交易代码	-		
后端交易代码	-		
基金运作方式	上市契约型开放式		
基金合同生效日	2013年7月26日		
报告期末基金份额总额	41,370,215.66份		
投资目标	本基金采用指数化投资策略,紧密跟踪沪深300指数,在严格控制基金的日均跟踪误差偏离度和年跟踪误差的前提下,力争获取与标的指数相似的投资收益。		
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,力争保持日均跟踪偏离度的绝对值不超过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	本基金的业绩比较基准为:95%×沪深300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,属于较高风险、较高预期收益的基金品种,其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。		
基金管理人	国金基金管理有限公司		
基金托管人	中国光大银行股份有限公司		
下属分级基金简称	国金300A	国金300B	国金300
下属分级场内简称	国金300A	国金300B	国金300
下属分级基金交易代码	150140	150141	167601
下属分级基金报告期末基金份额总额	10,367,941.00份	10,367,941.00份	20,634,333.66份
下属分级基金的风险收益特征	国金沪深300指数分级A份额具有低风险、收益相对稳定的特征。	国金沪深300指数分级B份额具有高风险、高预期收益的特征。	本基金为股票型基金,属于较高风险、较高预期收益的基金品种,其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

注:本报告期内,基金管理人的公司名称于2015年7月23日变更为"国金基金管理有限公司",并于2015年7月24日对外公告。根据《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》等法律法规的规定,经托管人同意,并报请中国证监会备案,基金管理人于2015年9月23日起将本基金的基金名称变更为"国金沪深300指数分级证券投资基金",并对基金合同及托管协议相应修订,具体请见基金管理人于2015年9月23日在中国证监会指定媒体和基金管理人网站发布的《国金基金管理有限公司关于变更公司旗下基金名称的公告》。

§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(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-5,633,784.42
2.本期利润	-22,337,131.30
3.加权平均基金份额本期利润	-0.4166
4.期末基金资产净值	34,718,022.98
5.期末基金份额净值	0.8392

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	-30.68%	3.40%	-27.06%	3.18%	-3.62%	0.22%

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300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

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	基金经理	2013年7月26日	-	7	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,自2014年11月起任指数投资事业部总经理。2013年7月起任国金沪深300指数分级证券投资基金基金经理;2014年8月起任国金鑫安保本混合型证券投资基金基金经理;2015年5月起任国金上证50指数分级证券投资基金基金经理;2015年6月起任国金鑫运灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2015年7月起任国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金(LOF)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》、《公开募集证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《国金沪深300指数分级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 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,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9只基金产品,分别为4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投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 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

2015年3季度,本基金严格遵守基金合同,采取完全复制标的指数上证50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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期,本基金份额净值增长率为-24.07%,同期业绩比较基准收益率为-23.99%;报告期内,基金的日均跟踪偏离度0.19%,低于合同约定的日均跟踪偏离度为0.35%,年化跟踪误差为4.01%,略高于合同约定的年化跟踪误差为4%的水平。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

3季度中国经济主要指标未见明显好转,投资增速仍然趋缓,消费增速平稳,出口暂时出现改善迹象,工业增速仍不见回升,结构性通货紧缩严重。但消费市场的结构性变化显现,短期需求端的下行压力有望逐步缓解,但传统投资需求的持续回落不可避免,未来消费市场的稳定和增长将成为经济增长的稳定器。短期外资流出的压力仍然较大。目前货币环境持续宽松,未来进一步有进一步宽松的预期,有助于融资成本的进一步下降,有助于微观层面结构性行业、企业的效益空间回升,这对风险资产收益是正向预期。从证券市场整体来看,市场投资机会逐步显现,尤其有利于收益的长期配置。

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,自2015年8月31日起至2015年9月30日止,本基金已连续二十五个工作日出现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)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	31,792,843.38	89.22
	其中:股票	31,792,843.38	89.22
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	3,162,078.83	8.87
7	其他资产	680,255.31	1.91
8	合计	35,635,177.52	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按证监会行业分类的股票投资组合

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	74,206.20	0.21
B	采矿业	1,261,869.08	3.63
C	制造业	10,384,292.87	29.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,555,181.79	4.48
E	建筑业	1,481,846.69	4.27
F	批发和零售业	879,341.60	2.53
G	交通运输、仓储和邮政业	1,280,368.35	3.69
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,764,448.37	5.08
J	金融业	10,581,910.86	30.48
K	房地产业	1,356,977.01	3.91
L	租赁和商务服务业	308,162.85	0.89
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	253,670.40	0.73
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	41,266.52	0.12
R	文化、体育和娱乐业	496,310.46	1.43
S	综合	72,990.33	0.21
	合计	31,792,843.38	91.57

注:以上行业分类以2015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	-	-
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	-	-
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	-	-

注:本基金本报告期末未持有积极投资部分股票。

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	39,972	1,193,563.92	3.44
2	600036	招商银行	60,882	1,081,873.14	3.12
3	600016	民生银行	109,093	921,835.85	2.66
4	600000	浦发银行	41,339	687,467.57	1.98
5	601166	兴业银行	42,232	614,897.92	1.77
6	600900	长江电力	66,955	557,065.60	1.60
7	000002	万 科A	35,851	456,383.23	1.31
8	601328	交通银行	72,403	440,210.24	1.27
9	601766	中国中车	33,827	438,736.19	1.26
10	600030	中信证券	29,045	394,431.10	1.14

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

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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

序号	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IF1510	IF1510	3	2,812,860.00	-130,140.00	报告期内,本基金运用股指期货是出于追求基金充分投资,减少交易成本,降低跟踪误差的目的,总体风险可控且符合既定的投资政策和投资目标。
公允价值变动总额合计(元)				-130,140.00	
股指期货投资本期收益(元)				-3,109,221.82	
股指期货投资本期公允价值变动(元)				1,553,001.82	

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

报告期,本基金运用股指期货来控制预期大额申购赎回等情况下的流动性风险,有效减少基金组合资产配置与跟踪标的之间的差距,确保投资组合对指数跟踪的效果。

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:本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未参与国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本期基金投资组合前十名证券的发行主体中,海通证券(600837.SH)于2015年1月19日发布公告《海通证券股份有限公司公告》,公司存在为少数融资融券六个月到期并提出逾期仍债务没平仓申请的客户,在维持担保比例处于150%以上的前提下暂缓平仓的行为,存在违规为到期融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施;2015年8月26日海通证券发布公告《海通证券关于收到中国证券监督管理委员会立案调查通知书的公告》,公司于2015年8月24日收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》,因公司涉嫌未按规定审查、了解客户身份等违法违规行为,根据《中华人民共和国证券法》的有关规定,中国证监会决定对公司进行立案调查,2015年9月12日发布公告《海通证券关于收到中国证监会行政处罚事先告知书的公告》,公司于2015年9月10日收到中国证券监督管理委员会行政处罚事先告知书,行政处罚如下:对海通证券责令改正,给予警告,没收违法所得并处罚款,同时对相关工作人员予以警告并处罚款;中信证券(600030.SH)于2015年1月16日发布公告《中信证券股份有限公司公告》,中信证券在为到期融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施。

由于海通证券(600837.SH)和中信证券(600030.SH)是沪深300指数的成份股,故将其纳入本基金的投资组合。

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	679,363.69
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	593.41
5	应收申购款	298.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	680,255.31

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 报告期末积极投资的五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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300A	国金300B	国金300
报告期期初基金份额总额	38,306,431.00	38,306,431.00	13,157,906.11
报告期期间基金总申购份额	-	-	15,397,518.66
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-	63,798,071.11
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-27,938,490.00	-27,938,490.00	55,876,980.00
报告期期末基金份额总额	10,367,941.00	10,367,941.00	20,634,333.66

注:1.拆分变动份额为本基金一级份额之间配对转换及基金份额折算的变动份额。
2.本报告期末,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")、上海国金通用财富资产管理有限公司(以下简称"国金财富")持有本基金的金鹏通货币A份额为50,126,323.33份,基金管理人的关联方国金证券股份有限公司、国金创新投资有限公司持有本基金的金鹏通货币A份额分别为4,029,159.40份、4,939,200.00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泰1号资产管理计划、千石资本-兴云圆运动1号资产管理计划持有本基金的金鹏通A份额分别为59,381,356.34份、9,296,08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,国金财富已按照法规规定向中国证监会进行了报告。

§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

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:

1.2015年7月1日披露了《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》;
2.2015年7月21日披露了《国金通用基金管理有限公司关于旗下基金持有的"长江电力"股票估值调整的公告》;
3.2015年7月24日披露了《国金通用基金管理有限公司关于旗下基金持有的"国投电力"股票估值调整的公告》;
4.2015年7月10日披露了《关于参加激米基金网费率优惠活动的公告》;
5.2015年7月16日披露了《国金通用基金管理有限公司关于旗下基金持有的"华东医药"股票估值调整的公告》;
6.2015年7月21日披露了《国金通用基金管理有限公司关于旗下基金2015年第2季度报告》;
7.2015年7月24日披露了《国金通用基金管理有限公司法定名称变更公告》;
8.2015年8月21日披露了《国金通用基金管理有限公司关于参加可花顺基金费率优惠活动的公告》;
9.2015年8月22日披露了《国金基金管理有限公司更正公告》;
10.2015年8月25日披露了《国金基金管理有限公司关于参加天天基金网费率优惠的公告》;
11.2015年8月26日披露了《国金基金管理有限公司关于旗下基金持有股票估值调整的公告》;
12.2015年8月27日披露了《国金基金管理有限公司关于旗下基金持有股票估值调整的公告》;
13.2015年8月28日披露了《国金通用沪深300指数分级证券投资基金2015年半年度报告》、《国金通用沪深300指数分级证券投资基金2015年半年度报告摘要》;
14.2015年9月16日披露了《国金基金管理有限公司关于旗下基金所持"铜陵有色"股票估值调整的公告》、《国金基金管理有限公司关于增加上海基煜基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告》;
15.2015年9月23日披露了《国金基金管理有限公司关于变更公司旗下基金名称的公告》;
16.2015年9月26日披露了《国金基金管理有限公司关于增加上海汇付金融服务有限公司为旗下基金销售机构的公告》;
17.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和基金份额累计净值。

§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.国金沪深300指数分级证券投资基金基金合同;
3.国金沪深300指数分级证券投资基金托管协议;
4.国金沪深300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
2015年10月27日

国金金腾通货币市场证券投资基金

【2015】第三季度报告

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:2015年10月27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2015年10月26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2015年7月1日起至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	14,274,343,917.38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	14,271,628,200.47份	2,715,716.91份	

注:本报告期内,基金管理人的公司名称于2015年7月23日变更为"国金基金管理有限公司",并于2015年7月24日对外公告。根据《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》等法律法规的规定,经托管人同意、并报请中国证监会备案,基金管理人于2015年9月23日起将本基金的基金名称变更为"国金金腾通货币市场证券投资基金",并对基金合同及托管协议相应修订,具体请见基金管理人于2015年9月23日在中国证监会指定媒体和基金管理人网站发布的《国金基金管理有限公司关于变更公司旗下基金名称的公告》。

§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(2015年7月1日 - 2015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	118,448,635.88	391.96
2.本期利润	118,448,635.88	391.96
3.期末基金资产净值	14,271,628,200.47	2,715,716.91

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	0.8030%	0.0036%	0.0882%	0.0000%	0.7148%	0.0036%

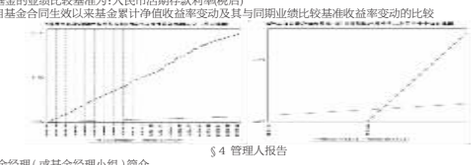
注:本基金的业绩比较基准为:人民币活期存款利率(税后)

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	0.0144%	0.0083%	0.0019%	0.0000%	0.0125%	0.0083%

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



§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	基金经理	2014年2月17日	-	7	徐艳芳女士,清华大学硕士。2005年10月至2012年6月历任瑞天财经公关公司财经咨询、美亚泰和财产保险股份有限公司投资经理。2012年6月加盟国金基金管理有限公司,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月起增聘为国金鑫盈货币市场证券投资基金基金经理;2014年1月起任国金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月起任国金金鑫货币市场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》、《国金金腾通货币市场证券投资基金合同》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。本基金投资组合符合有关法律及基金合同的约定。

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,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9只基金产品,分别为4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投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 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

投资增速下行压力明显,基建托底,随着政府赤字率上调、债务置换降低平台融资成本,基建增速仍在高位;消费平稳好转,餐饮表现出色;出口增速低位回升,美欧日出口改善;前8个月财政支出增速偏高,财政收支缺口压力增大;财政收入增速继续下滑,财政刺激托底力度加强,财政收支恶化;CPI仍在低位,实体经济增速下行,猪肉价格高位回落,食品项CPI回落,非食品CPI项保持稳定。

货币政策持续放松,多层次多结构放水,央行大量放水,对冲资金流出压力;股市大幅调整,打新资金大规模转移流入债券市场,市场资金面极度宽松,但后半季度预期端资金成本已从底部企稳;债券收益率曲线呈平坦化下行,期限利差缩窄。本基金在充分考虑安全性和流动性的基础上,保持稳健的操作风格,通过调整组合资产的配置,维持适中的债券仓位占比,防范市场和流动性风险,同时自下而上精选短期信用债以防范个券的信用风险,为投资者提供稳健的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金的金腾通货币A份额净值收益率为0.8030%,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0.0144%,同期业绩比较基准收益率为0.0019%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

前瞻性指标偏弱,汇率和中采PMI表现差异,稳增长政策下大中型企业表现优于中小企业,但分项指数的新订单动能均较弱,经济增长动能不强;四季度稳增长压力仍然较大,虽有基建托底,但财政收支压力增大,若地产投资无法好转,经济下行压力难缓。需求不足环境下,叠加猪肉价格回落,非食品CPI项保持稳定,预计CPI仍维持低位。

信用债到期续滚、平台债务置换和再融资,资金需求仍高,但预计央行会有相应宽松政策加以对冲,流动性整体平稳,而股市震荡降低资金卧段性风险,债市大涨后整体空间不大,四季度黑天鹅事件以及市场在三季度未快速冲高,均增加了潜在风险。

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	4,998,687,904.09	34.91
	其中:债券	4,998,687,904.09	34.91
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	5,787,978,601.94	40.42
	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	3,415,490,496.65	23.85
4	其他资产	117,941,651.53	0.82
5	合计	14,320,098,654.21	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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		12.83
	其中:买断式回购融资		0.00
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	39,999,820.00	0.28
	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