

国金金腾通货币市场证券投资基金

[2017]第一季度报告

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:2017年4月22日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事和高级管理人员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。

基金托管人的董事、监事和高级管理人员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。

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

基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金财产，但不保证基金一定盈利。

投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金报告中财务资料未经审计。

报告期自2017年1月1日起至2017年3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称 国金金腾通

场内简称 国金金腾通

交易代码 000040

基金运作方式 约定型开放式

基金合同生效日 2014年2月17日

报告期末基金份额总额 11,210,193,193.04份

投资目标 为投资者提供稳定的资产配置和流动性管理，通过积极主动的投资策略，为投资者创造长期稳定的收益。

投资策略 本基金在确保资产安全性及流动性的基础上，对货币市场收益率的走势进行预测判断，采取灵活的期限配置和主动投资策略，综合利用分析和定性分析方法，力争争取超越一般货币基金的回报。

业绩比较基准 人民币银行存款利率(税后)

风险特征 本基金为货币市场基金，属于货币市场基金中的流动性、低风险品种，其预期收益和风险均低于债券基金、混合基金及股票基金。

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

下属分级基金的基金简称 国金金腾通货币A

下属分级基金的基金代码 000040

下属分级基金的启用交易代码 -

下属分级基金的赎回交易代码 -

报告期末本基金的份额总额 9,202,928,643.12份

报告期末本基金的净值 2,007,903,543.22份

§ 3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)

1. 国金金腾通货币A

本期已实现收益 104,196,209.28

2. 本期利润 104,196,209.28

3. 期末基金资产净值 9,202,928,643.12

注:本基金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利润。

2.2 基金收益表现

3.2.1 本基金货币基金份额净值收益与其同期同业存款基准收益率的比较

国金金腾通货币A

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%)

同业存款基准收益率(%)

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%)

同业存款基准收益率(%)

过去三个个月 0.0147% 0.0093% 0.0090% 0.0284% 0.0010%

注:本基金的业绩比较基准为:人民币同业存款基准(税后)

3.2.2 基金合同生效以来基金累计净值增长率与同时期同业存款基准收益率变动的比较

图示了本基金成立以来的净值增长率与同期同业存款基准收益率的比较。

注:本基金的业绩比较基准为:人民币同业存款基准(税后)

3.2.3 本基金货币基金份额净值收益与其同期同业存款基准收益率的比较

国金金腾通货币A

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%)

同业存款基准收益率(%)

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%)

同业存款基准收益率(%)

过去三个个月 0.0147% 0.0093% 0.0090% 0.0284% 0.0010%

注:本基金的业绩比较基准为:人民币同业存款基准(税后)

3.2.4 基金合同生效以来基金累计净值增长率与同时期同业存款基准收益率变动的比较

图示了本基金成立以来的净值增长率与同期同业存款基准收益率的比较。

注:本基金的业绩比较基准为:人民币同业存款基准(税后)

3.2.5 本基金货币基金份额净值收益与其同期同业存款基准收益率的比较

国金金腾通货币A

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%)

同业存款基准收益率(%)

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%)

同业存款基准收益率(%)

过去三个个月 0.0147% 0.0093% 0.0090% 0.0284% 0.0010%

注:本基金的业绩比较基准为:人民币同业存款基准(税后)

3.2.6 本基金货币基金份额净值收益与其同期同业存款基准收益率的比较

国金金腾通货币A

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%)

同业存款基准收益率(%)

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%)

同业存款基准收益率(%)

过去三个个月 0.0147% 0.0093% 0.0090% 0.0284% 0.0010%

注:本基金的业绩比较基准为:人民币同业存款基准(税后)

3.2.7 本基金货币基金份额净值收益与其同期同业存款基准收益率的比较

国金金腾通货币A

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%)

同业存款基准收益率(%)

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%)

同业存款基准收益率(%)

过去三个个月 0.0147% 0.0093% 0.0090% 0.0284% 0.0010%

注:本基金的业绩比较基准为:人民币同业存款基准(税后)

3.2.8 本基金货币基金份额净值收益与其同期同业存款基准收益率的比较

国金金腾通货币A

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%)

同业存款基准收益率(%)

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%)

同业存款基准收益率(%)

过去三个个月 0.0147% 0.0093% 0.0090% 0.0284% 0.0010%

注:本基金的业绩比较基准为:人民币同业存款基准(税后)

3.2.9 本基金货币基金份额净值收益与其同期同业存款基准收益率的比较

国金金腾通货币A

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%)

同业存款基准收益率(%)

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%)

同业存款基准收益率(%)

过去三个个月 0.0147% 0.0093% 0.0090% 0.0284% 0.0010%

注:本基金的业绩比较基准为:人民币同业存款基准(税后)

3.2.10 本基金货币基金份额净值收益与其同期同业存款基准收益率的比较

国金金腾通货币A

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%)

同业存款基准收益率(%)

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%)

同业存款基准收益率(%)

过去三个个月 0.0147% 0.0093% 0.0090% 0.0284% 0.0010%

注:本基金的业绩比较基准为:人民币同业存款基准(税后)

3.2.11 本基金货币基金份额净值收益与其同期同业存款基准收益率的比较

国金金腾通货币A

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%)

同业存款基准收益率(%)

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%)

同业存款基准收益率(%)

过去三个个月 0.0147% 0.0093% 0.0090% 0.0284% 0.0010%

注:本基金的业绩比较基准为:人民币同业存款基准(税后)

3.2.12 本基金货币基金份额净值收益与其同期同业存款基准收益率的比较

国金金腾通货币A

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%)

同业存款基准收益率(%)

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%)

同业存款基准收益率(%)

过去三个个月 0.0147% 0.0093% 0.0090% 0.0284% 0.0010%

注:本基金的业绩比较基准为:人民币同业存款基准(税后)

3.2.13 本基金货币基金份额净值收益与其同期同业存款基准收益率的比较

国金金腾通货币A

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%)

同业存款基准收益率(%)

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%)

同业存款基准收益率(%)

过去三个个月 0.0147% 0.0093% 0.0090% 0.0284% 0.0010%

注:本基金的业绩比较基准为:人民币同业存款基准(税后)

3.2.14 本基金货币基金份额净值收益与其同期同业存款基准收益率的比较

国金金腾通货币A

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%)

同业存款基准收益率(%)

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%)

同业存款基准收益率(%)

过去三个个月 0.0147% 0.0093% 0.0090% 0.0284% 0.0010%

注:本基金的业绩比较基准为:人民币同业存款基准(税后)

3.2.15 本基金货币基金份额净值收益与其同期同业存款基准收益率的比较

国金金腾通货币A

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%)

同业存款基准收益率(%)

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%)

同业存款基准收益率(%)

过去三个个月 0.0147% 0.0093% 0.0090% 0.0284% 0.0010%

注:本基金的业绩比较基准为:人民币同业存款基准(税后)

3.2.16 本基金货币基金份额净值收益与其同期同业存款基准收益率的比较

国金金腾通货币A

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%)

同业存款基准收益率(%)

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%)

同业存款基准收益率(%)

过去三个个月 0.0147% 0.0093% 0.0090% 0.0284% 0.0010%

注:本基金的业绩比较基准为:人民币同业存款基准(税后)

3.2.17 本基金货币基金份额净值收益与其同期同业存款基准收益率的比较

国金金腾通货币A

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%)

同业存款基准收益率(%)

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%)

同业存款基准收益率(%)

过去三个个月 0.0147% 0.0093% 0.0090% 0.0284% 0.0010%

注:本基金的业绩比较基准为:人民币同业存款基准(税后)

3.2.18 本基金货币基金份额净值收益与其同期同业存款基准收益率的比较

国金金腾通货币A

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%)

同业存款基准收益率(%)

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%)

同业存款基准收益率(%)