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
送出日期:2016年3月28日

国金金腾通货币市场证券投资基金

2015 年度 报告摘要

2015年12月31日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2016年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中的财务资料已经审计,安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2015年1月1日起至2015年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	国金金腾通货币	
基金主代码	000540	
场内简称	–	
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	
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	
报告期末基金份额总额	14,018,949,737.45份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	–	
上市日期	–	
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	13,427,757,754.90份	591,191,982.55份

注:无

2.2 基金产品说明

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。	
	国金金腾通货币A	国金金腾通货币C
下属分级基金的风险收益特征	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。	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。

注:无

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国金基金管理有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	徐艳瑜	赵天杰
	联系电话	010-88005601	010-58560666
	电子邮箱	xuweiyu@gfund.com	zhaotianjie@cmbc.com.cn
客户服务电话		4000-2000-18	95568
传真		010-88005666	010-58560798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.gfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015年		2014年2月17日(基金合同生效日)-2014年12月31日		2013年	
	国金金腾通货币A	国金金腾通货币C	国金金腾通货币A	国金金腾通货币C	国金金腾通货币A	国金金腾通货币C
本期已实现收益	409,487,911.81	2,870,561.09	129,184,713.84	–	–	–
本期利润	409,487,911.81	2,870,561.09	129,184,713.84	–	–	–
本期净值收益率	4.5122%	0.6830%	4.5009%	–	–	–
3.1.2 期末数据和指标	2015年末		2014年末		2013年末	
期末基金资产净值	13,427,757,754.90	591,191,982.55	4,964,195,934.53	–	–	–
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	–	–	–
3.1.3 累计期末指标	2015年末		2014年末		2013年末	
累计净值收益率	9.2162%	0.6830%	4.5009%	–	–	–

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.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 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

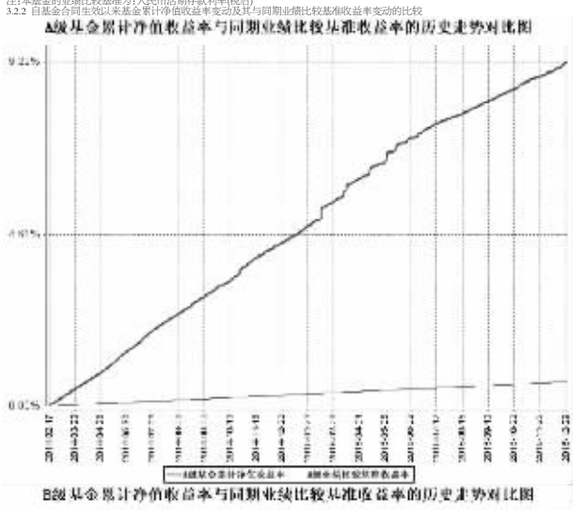
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.8519%	0.0065%	0.0882%	0.0000%	0.7637%	0.0065%
过去六个月	1.6618%	0.0052%	0.1764%	0.0000%	1.4854%	0.0052%
过去一年	4.5122%	0.0192%	0.3500%	0.0000%	4.1622%	0.0192%
自基金合同生效起至今	9.2162%	0.0146%	0.6549%	0.0000%	8.5613%	0.0146%

国金金腾通货币C

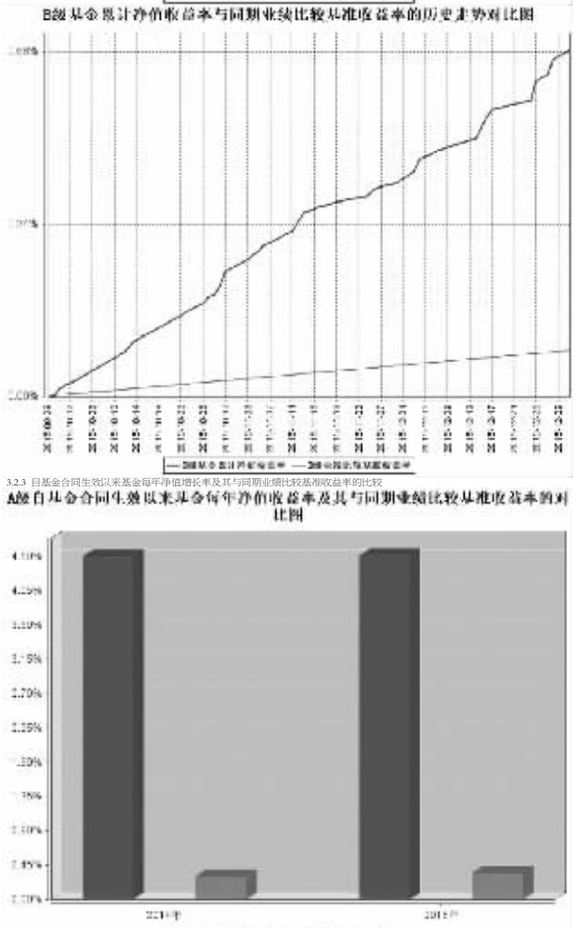
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6685%	0.0065%	0.0882%	0.0000%	0.5803%	0.0065%
过去六个月	0.6830%	0.0065%	0.0911%	0.0000%	0.5919%	0.0065%
自基金合同生效起至今	0.6830%	0.0065%	0.0911%	0.0000%	0.5919%	0.0065%

注:本基金约定按比较基准为: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



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金合同生效日为2014年2月17日,合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

国金金腾通货币A					
年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2015	408,889,427.33	–	598,484.48	409,487,911.81	
2014	128,700,684.24	–	484,029.60	129,184,713.84	
合计	537,590,111.57	–	1,082,514.08	538,672,625.65	
国金金腾通货币C					
年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2015	2,835,997.25	–	34,563.84	2,870,561.09	
合计	2,835,997.25	–	34,563.84	2,870,561.09	

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国金基金管理有限公司(原名称为"国金通用基金管理有限公司")经中国证券监督管理委员会(证监许可[2011]1661号)批准,于2011年11月2日成立,总部设在北京。2012年9月,公司的注册资本由1.6亿元人民币增加至2.8亿元人民币。2015年7月,公司名称由"国金通用基金管理有限公司"变更为"国金基金管理有限公司"。公司股东为国金证券股份有限公司、苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司、广东宝银华新能源股份有限公司、浦金投资控股有限公司、鼎权比例分别为49%、19.5%、19.5%和12%。截至2015年12月31日,国金基金管理有限公司共管理9只开放式基金——国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金、国金沪深300指数分级证券投资基金、国金鑫盈货币市场证券投资基金、国金金腾通货币市场证券投资基金、国金鑫安保本混合型证券投资基金、国金上证50指数分级证券投资基金、国金鑫运灵活配置混合型证券投资基金、国金众赢货币市场证券投资基金、国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金(LOF)。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)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月历任皓天财经公关公司财经咨询、英大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月起任国金众赢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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及其他相关法律法规,制定了《国金基金管理有限公司公平交易管理办法》,在投资管理活动中公平对待不同投资组合,严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。该公平交易管理方法规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,同时包括投权、研究分析、投资决策、交易执行(集中竞价及非集中竞价交易)、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

第一,建立健全公平交易决策流程:(1)信息保证公平原则,不同投资组合经理可公平获得研究报告;(2)交易机会公平原则,不同投资组合经理可获得公平交易执行的机会。

第二,对开放式基金和特定客户资产管理计划等不同类型业务,公司分别设立独立的投资部门;研究团队对所有的投资业务同时提供研究支持;投资决策委员会负责对公平交易制度和流程的监督、检查、评估;风控部门负责对公平交易制度的执行情况进行定期检查,并出具投资合规、监察报告;公平交易小组负责公平交易制度的日常执行、监督、检查、评价公司公平交易制度执行情况,并提出改进建议;公司内部审计部门负责对公平交易制度执行情况的定期审计,在合规基金管理体公平交易制度执行情况、公平交易执行情况及异常交易行为专项说明等事项。(8)投资完毕,根据事后分析报告及信息披露结果,公平交易各相关部门对相关环节予以不断完善,以确保公平交易的执行目锚完善。(9)监督检查:公规风控部监察稽核人员根据法规规定公司公平交易制度规定,监督、检查、评价公司公平交易制度执行情况,并提出改进建议。公司师审计师所在公司年度内部控制审价报告中对公司公平交易制度的执行情况做出专项评价。

4.3.2 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全业务环节严格控制交易公平执行。

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信息实行公平投资信息流控措施。

在交易执行控制方面,本基金管理人实行集中交易制度,基金交易部适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,按规公平交易原则建立和完善了相关分配机制。在本报告期,本基金管理人管理有九只基金产品,其中四只混合型基金、两只指数基金、三只货币基金,不存在非公平交易情况。

4.3.3 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控制制度,报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对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

第二产业对经济社会发展起着基础作用,经济增长动力从投资转向消费;消费稳中有升,餐饮表现出色,限额企业零售好转;投资增速下行压力明显,基建仍在托底;出口增速整体偏弱,对经济增长贡献动能不强;财政支出增速偏高,财政收支缺口压力增大;收入增速不及支出,财政收支恶化;内需不足,CPI多月"零"时代。

美国加息,人民币贬值,资金流出压力持续增大,外汇占款缩减;央行各种花样宽松,降息、降准、定向量宽;资金面维持宽松,资金利率低位;基本面强力支撑,资金面强力托动下,无风险利率的新低,信用利差被挤压至低位,债市"资产荒"毫现,信用风险扩大。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,适时调整组合资产的配置,维持适中的债券仓位占比,防范市场利率波动性风险,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4.5122%,同期业绩比较基准收益率为0.3500%;本基金的金腾通货币C份额净值收益率为0.6830%,同期业绩比较基准收益率为0.0911%。

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,经济增长动能不强;稳增长政策下大中型企业表现优于中小企业;2016年稳增长压力仍然较大,若地产投资无法好转,国内经济下行压力难缓。同时外国层面看,随着美国加息,中美利差缩窄,人民币贬值压力增大,资金仍存在持续流出的风险;为维稳汇率,国内货币政策放松空间有限。债市基本面支撑仍在,债券市场收益率有阶段性机会,但空间受限于中美利差的缩窄和人民币贬值压力;整体乐观偏谨慎,偏中高评级品种。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会相关规定及基金合同关于估值的约定,严格执行内部估值控制程序,对基金所持有的投资品种进行估值。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构,由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、数量研究员、风险管理人员、监察稽核人员及基金清算人员组成。运营支持部根据估值委员会的估值决策机制,对基金所持有的投资品种进行估值。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构,并设立了估值委员会主席,由基金管理人分管投资的公司主管担任,主管投资的公司主管担任的基金经理为投资委员会的成员之一,在基金估值定价过程中,充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议,参与估值方案提议的制定,但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。本基金管理人参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

公司与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》,并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配方式为红利再投资,免收再投资的费用;本基金根据每日基金收益情况,以每万份基金已实现收益为基准,为投资人每日计算当日收益并分配,并每月进行支付。

4.8 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无

4.9 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

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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

中国民生银行根据《国金金腾通货币市场证券投资基金合同》和《国金金腾通货币市场证券投资基金托管协议》,托管国金金腾通货币市场证券投资基金(以下简称"国金金腾通基金")。

本报告期,中国民生银行在国金金腾通基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》,基金合同、托管协议和其他有关规定,依法妥善保管了基金财产,按规定开设基金专用银行账户,独立地同中国证监会履交了本基金运作情况报告,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,按照国家相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定,本托管人对基金管理人——国金基金管理有限公司在国金金腾通货币市场证券投资基金投资运作方面进行了监督,对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真复核,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。本报告期,基金管理人——国金基金管理有限公司严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

由国金金腾通货币市场证券投资基金管理人——国金基金管理有限公司编制,并经本托管人复核审查的本年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2016)审字第61004823_A05号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	国金金腾通货币市场证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的国金金腾通货币市场证券投资基金财务报表,包括2015年12月31日的资产负债表,2015年的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人国金基金管理有限公司的责任。这种责任包括:(1)按照企业会计准则的规定编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。 我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为,上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了国金金腾通货币市场证券投资基金2015年12月31日的财务状况以及2015年的经营成果和净值变动情况。
注册会计师的姓名	汤敏 王珊珊
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层
审计报告日期	2016年3月25日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:国金金腾通货币市场证券投资基金

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资 产:			
银行存款		905,690,035.47	324,163,367.23
结算备付金		–	1,850,000.00
存出保证金		–	–
交易性金融资产		10,218,823,592.01	3,722,384,696.26
其中:股票投资		–	–
基金投资		–	–
债券投资		10,218,823,592.01	3,722,384,696.26
资产支持证券投资		–	–
贵金属投资		–	–
衍生金融资产		–	–
买入返售金融资产		3,119,167,330.41	2,459,690,009.52
应收证券清算款		–	–
应收利息		100,388,920.14	108,675,546.59
应收股利		–	–
应收申购款		–	–
递延所得税资产		–	–
其他资产		7,500.00	7,500.00
资产总计		14,344,077,378.03	6,616,771,119.60
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
负 债:			
短期借款		–	–
交易性金融负债		–	–
衍生金融负债		–	–
卖出回购金融资产款		319,999,400.00	1,649,974,285.02
应付证券清算款		–	–
应付赎回款		–	–
应付管理人报酬		2,248,366.13	953,780.64
应付托管费		562,091.54	238,445.16
应付销售服务费		393,067.08	–
应付交易费用		270,192.02	127,379.26
应交税费		–	–
应付利息		23,645.89	538,265.39
应付利润		1,117,077.92	484,029.60
递延所得税负债		–	–
其他负债		513,800.00	259,000.00
负债合计		325,127,640.58	1,652,575,185.07
所有者权益:			
实收基金		14,018,949,737.45	4,964,195,934.53
未分配利润		–	–
所有者权益合计		14,018,949,737.45	4,964,195,934.53
负债和所有者权益总计		14,344,077,378.03	6,616,771,119.60

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值为人民币1.000元,基金份额总额14,018,949,737.45份,其中A类基金份额为13,427,757,754.90份;C类基金份额为591,191,982.55份。

7.2 利润表

会计主体:国金金腾通货币市场证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年2月17日(基金合同生效日)至2014年12月31日
一、收入		455,331,326.44	140,973,457.14
1.利息收入		413,838,600.28	115,673,758.52
其中:存款利息收入		89,130,776.67	27,058,622.22
债券利息收入		204,396,454.91	63,458,931.13
资产支持证券利息收入		–	–
买入返售金融资产收入		120,304,658.86	25,156,205.17
其他利息收入		6,709.84	–
2.投资收益(损失以"-"填列)		41,038,826.16	25,169,423.98
其中:股票投资收益		–	–
基金投资收益		–	–
债券投资收益		41,038,826.16	25,169,423.98
资产支持证券投资收益		–	–
贵金属投资收益		–	–
衍生工具收益		–	–
股利收益		–	–
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		–	–
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		–	–
5.其他收入(损失以"-"号填列)		453,900.00	130,274.64
减:二、费用		42,972,853.54	11,788,743.30
1.管理人报酬	7.4.8.2.1	22,975,313.75	5,227,488.64
2.托管费	7.4.8.2.2	5,743,828.51	1,306,872.15
3.销售服务费	7.4.8.2.3	875,627.52	–
4.交易费用		–	–
5.利息支出		12,873,484.42	4,821,390.48
其中:卖出回购金融资产支出		12,873,484.42	4,821,390.48
6.其他费用		504,599.34	432,992.03
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		412,358,472.90	129,184,713.84
减:所得税费用		–	–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		412,358,472.90	129,184,713.84

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:国金金腾通货币市场证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	4,964,195,934.53	–	4,964,195,934.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	–	412,358,472.90	412,358,472.90
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	9,054,753,802.92	–	9,054,753,802.92
其中:1.基金申购款	409,091,331,382.99	–	409,091,331,382.99
2.基金赎回款	-400,036,577,580.07	–	-400,036,577,580.07
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	–	-412,358,472.90	-412,358,472.90
五、期末所有者权益(基金净值)	14,018,949,737.45	–	14,018,949,737.45

项目	上年度可比期间 2014年2月17日(基金合同生效日)至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	201,693,057.58	–	201,693,057.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	–	129,184,713.84	129,184,713.84
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	4,762,502,876.95	–	4,762,502,876.95
其中:1.基金申购款	90,275,117,300.22	–	90,275,117,300.22
2.基金赎回款	-85,512,614,423.27	–	-85,512,614,423.27
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	–	-129,184,713.84	-129,184,713.84
五、期末所有者权益(基金净值)	4,964,195,934.53	–	4,964,195,934.53

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

尹庆军 _____ 魏武勤 _____ 于晓莲 _____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国金金腾通货币市场证券投资基金(以下简称"本基金"),系经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2014]128号文的核准,由国金基金管理有限公司于2014年2月10日至2014年2月12日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具(2014)验字第61004823_A02号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2014年2月17日正式生效,本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金设立时,首次募集(不含认购费)的有效净认购金额为人民币201,689,000.00元,折合201,689,000.00份基金份额;募集资金在募集期间产生的利息为人民币4,057.58元,折合4,057.58份基金份额;以上收到的实收基金共计人民币201,693,057.58元,折合201,693,057.58份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构均为国金基金管理有限公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

为满足投资者的理财需求,更好地服务于投资者,根据《国金金腾通货币市场证券投资基金基金合同》的有关约定,本基金于2015年9月28日新设A、C两类基金份额类别,新设A类基金份额代码为000540,新设C类基金份额代码为001621。两类基金份额单位净基金万份净收益和七日年化收益率。金腾通货币基金A类基金份额仅通过本基金的销售机构国金证券股份有限公司(以下简称"国金证券"或"该基金销售机构")线上渠道办理申购、赎回等业务,金腾通货币基金C类基金份额仅通过本基金的销售机构国金证券的线下渠道办理该类份额的申购、赎回等业务。作为金腾通货币基金的独家销售机构,国金证券通过该基金向投资者提供保证金余额理财服务,即为投资者提供账户中的闲置资金提供理财服务。金腾通货币基金A类基金份额和及金腾通货币基金C类基金份额的其余业务规则将按照原有基金运行规则保持不变。

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具,包括现金,通知存款,短期融资券,一年以内(含一年)的银行定期存款和大额存单,剩余期限(或回售期限)在397天以内(含397天)的债券、剩余期限在397天以内(含397天)的中期票据、剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券,期限在一年以内(含一年)的债券回购,期限在一年以内(含一年)的中央银行票据,以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金的业绩比较基准为:人民币活期存款利率(税后)。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下统称"企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第2号(年度报告的内容与格式)》、《证券投资基金信息披露编报规则第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露编报规则第5号《货币市场基金信息披露特别规定》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策及会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则及应用指南、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

1.营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金实去获票、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入、股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

2.个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,对基金取得的股票的股息、红利收入,债券的利息收入,储蓄存款利息收入,由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
上海国金通用财富资产管理有限公司	基金管理人的子公司
国金基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
国金证券股份有限公司	基金管理人股东、基金代销机构
广东宝银华新能源股份有限公司	基金管理人股东
北京千石创富资本管理有限公司	基金管理人的子公司
苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司	基金管理人股东
浦金投资控股有限公司	基金管理人股东
中国民生银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

注:1.关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金于本报告期及上年度可比期间2014年2月17日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间均未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

注:本基金于本报告期及上年度可比期间2014年2月17日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 债券交易

注:本基金于本报告期及上年度可比期间2014年2月17日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

注:本基金于本报告期及上年度可比期间2014年2月17日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

注:本基金于本报告期及上年度可比期间2014年2月17日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注:本基金于本报告期及上年度可比期间2014年2月17日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间均无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7