

国金金腾通货币市场证券投资基金 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 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

送出日期：2023 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

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 2023 年 3 月 28 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 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 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	15
4.10 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	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
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	16
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 净资产（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	23
§8 投资组合报告	53

8.1 期末基金资产组合情况.....	53
8.2 债券回购融资情况.....	54
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	54
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	55
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
8.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	55
8.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离	56
8.8 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明 细.....	56
8.9 投资组合报告附注.....	56
§9 基金份额持有人信息.....	57
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	58
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	58
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产 品情 况.....	58
§10 开放式基金份额变动.....	58
§11 重大事件揭示.....	59
11.1 基金份额持有人大会决议	59
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	59
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
11.4 基金投资策略的改变.....	59
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	59
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	61
11.9 其他重大事件.....	61
§12 影响投资者决策的其他重要信息	64
12.1 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	64
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	64
§13 备查文件目录.....	64
13.1 备查文件目录.....	64
13.2 存放地点.....	64
13.3 查阅方式.....	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国金金腾通货币市场证券投资基金	
基金简称	国金金腾通货币	
基金主代码	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	
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	20,675,738,155.59 份	
基金合同存续期	不定期	
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
下属分级基金的交易代码	000540	001621
报告期末下属分级基金的份额总额	13,823,525,128.48 份	6,852,213,027.11 份

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。

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	张丽	罗菲菲
	联系电话	010-88005632	010-58560666
	电子邮箱	zhangli@gfund.com	tgxxpl@cmbc.com.cn
客户服务电话		4000-2000-18	95568
传真		010-88005666	010-57093382
注册地址		北京市怀柔区府前街三号楼 3-6	北京市西城区复兴门内大街 2 号
办公地址		北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 层	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码		100089	100031
法定代表人		邵海波	高迎欣

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
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办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
注册登记机构	国金基金管理有限公司	北京市海淀区西三环北路87号国际财经中心D座14层

§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	2022 年		2021 年		2020 年	
1 期间数据和指标	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	357,598,377.54	107,932,271.39	381,440,109.97	131,216,764.99	413,771,538.07	109,214,051.29
本期利润	357,598,377.54	107,932,271.39	381,440,109.97	131,216,764.99	413,771,538.07	109,214,051.29
本期净值收益率	2.0796%	1.3166%	2.5249%	1.7592%	2.3983%	1.6332%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
期末基金资产净值	13,823,525,128.48	6,852,213,027.11	12,668,446,600.01	6,999,144,379.37	12,151,915,979.61	5,649,921,930.50
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.	2022 年末		2021 年末		2020 年末	

3 累计期末指标						
累计净值收益率	34.0340%	17.2458%	31.3035%	15.7222%	28.0698%	13.7216%

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	0.4643%	0.0006%	0.0882%	0.0000%	0.3761%	0.0006%
过去六个月	0.9426%	0.0006%	0.1764%	0.0000%	0.7662%	0.0006%
过去一年	2.0796%	0.0008%	0.3500%	0.0000%	1.7296%	0.0008%
过去三年	7.1669%	0.0011%	1.0510%	0.0000%	6.1159%	0.0011%
过去五年	14.5055%	0.0021%	1.7510%	0.0000%	12.7545%	0.0021%
自基金合同生效起至今	34.0340%	0.0073%	3.1068%	0.0000%	30.9272%	0.0073%

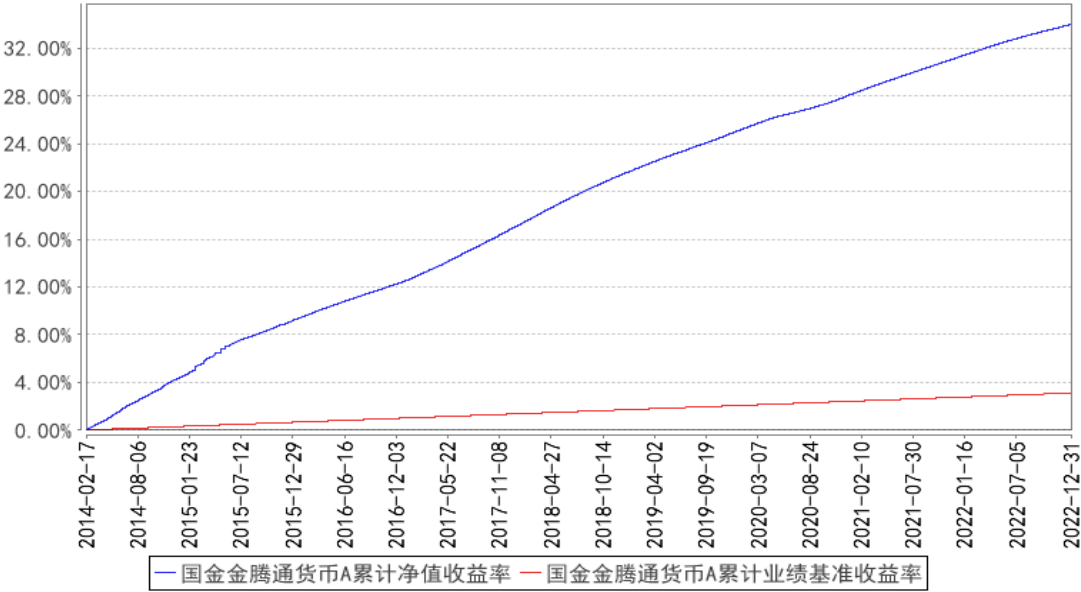
国金金腾货币 C

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	0.2747%	0.0006%	0.0882%	0.0000%	0.1865 %	0.0006 %
过去六个月	0.5612%	0.0006%	0.1764%	0.0000%	0.3848 %	0.0006 %
过去一年	1.3166%	0.0008%	0.3500%	0.0000%	0.9666 %	0.0008 %
过去三年	4.7828%	0.0011%	1.0510%	0.0000%	3.7318 %	0.0011 %
过去五年	10.2926 %	0.0021%	1.7510%	0.0000%	8.5416 %	0.0021 %
自基金合同生效起 至今	17.2458 %	0.0026%	2.5430%	0.0000%	14.702 8%	0.0026 %

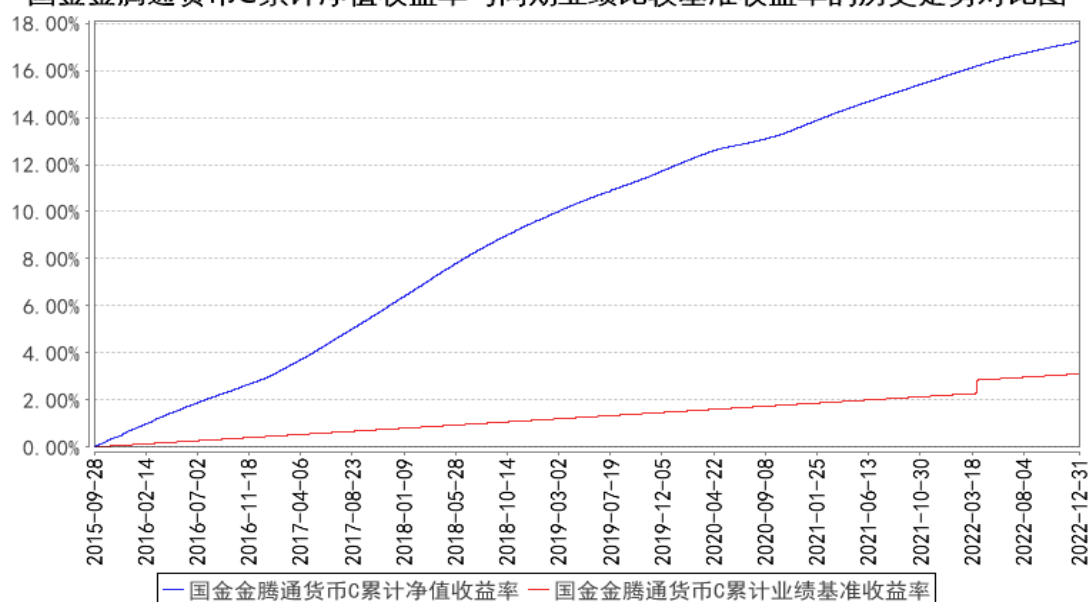
注：本基金的业绩比较基准为：人民币活期存款利率（税后）。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

国金金腾货币A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



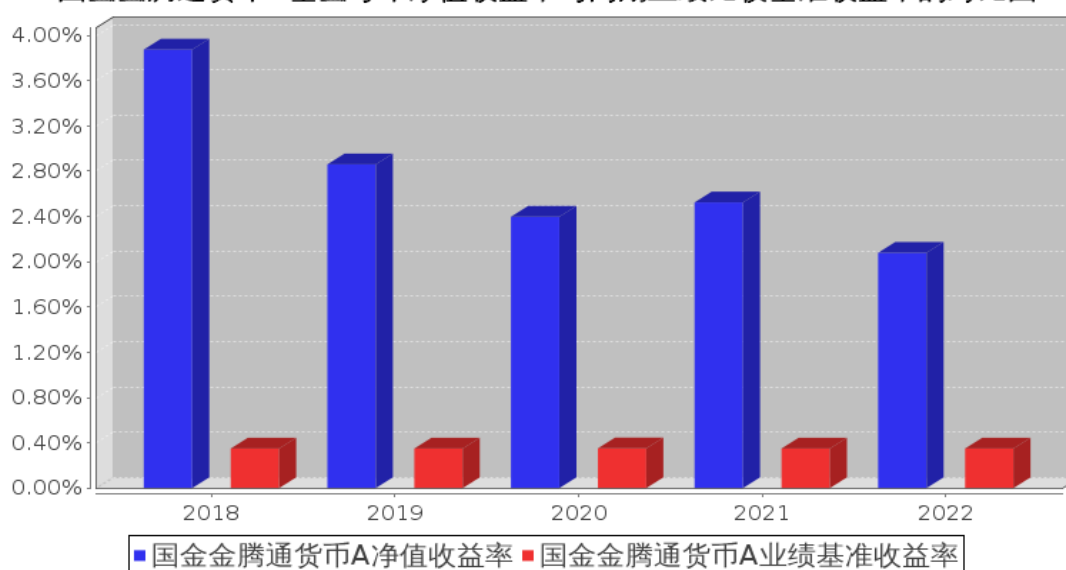
国金金腾货币C累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



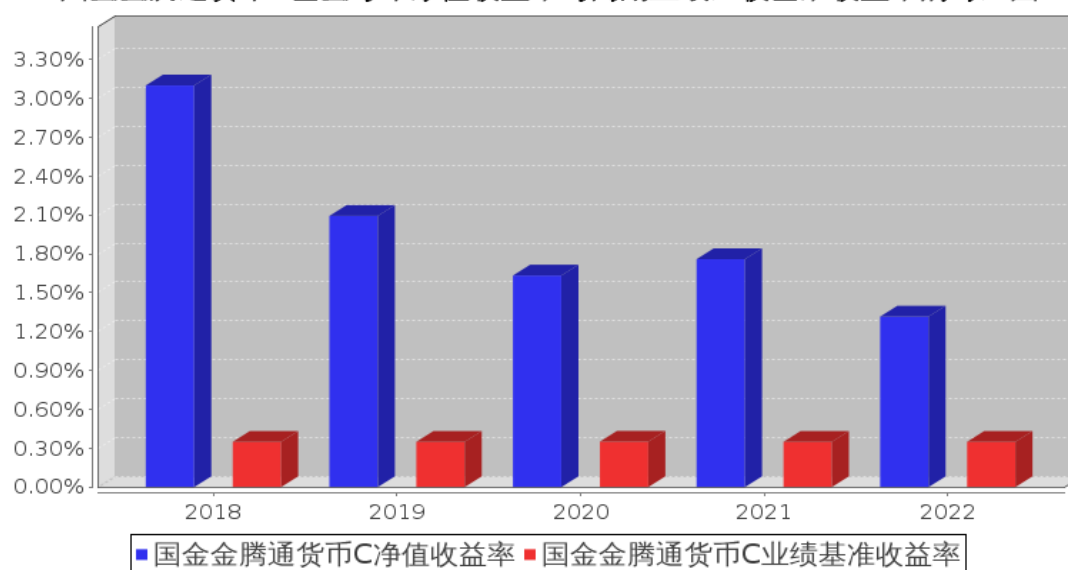
注：本基金 A 类份额基金合同生效日为 2014 年 2 月 17 日，图示日期为 2014 年 2 月 17 日至 2022 年 12 月 31 日。本基金 C 类份额基金合同生效日为 2015 年 9 月 28 日，图示日期为 2015 年 9 月 28 日至 2022 年 12 月 31 日。

3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国金金腾货币A基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



国金金腾通货币C基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金 A 类份额基金合同生效日为 2014 年 2 月 17 日，C 类份额基金合同生效日为 2015 年 9 月 28 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

注：无

3.4 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
2022 年	354,654,721.63	2,317,134.61	626,521.30	357,598,377.54	-
2021 年	378,704,845.22	2,879,525.20	-144,260.45	381,440,109.97	-
2020 年	410,597,957.61	3,249,393.55	-75,813.09	413,771,538.07	-
合计	1,143,957,524.46	8,446,053.36	406,447.76	1,152,810,025.58	-

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
2022 年	106,653,173.51	1,169,729.86	109,368.02	107,932,271.39	-
2021 年	129,654,410.00	1,571,839.12	-9,484.13	131,216,764.99	-
2020 年	107,752,601.62	1,367,345.09	94,104.58	109,214,051.29	-
合计	344,060,185.13	4,108,914.07	193,988.47	348,363,087.67	-

§ 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。公司注册资本为3.6亿元人民币，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、广东宝丽华新能源股份有限公司、涌金投资控股有限公司、苏州元道亨经济信息咨询中心（有限合伙）、苏州元道利经济信息咨询中心（有限合伙）和苏州元道贞经济信息咨询中心（有限合伙），股权比例分别为51%、19.5%、19.5%、5%、1.5%、1.9%、1.6%。截至2022年12月31日，国金基金管理有限公司共管理26只公募基金，具体包括国金金腾通货币市场证券投资基金、国金鑫盈货币市场证券投资基金、国金众赢货币市场证券投资基金、国金及第中短债债券型证券投资基金、国金惠鑫短债债券型证券投资基金、国金惠盈纯债债券型证券投资基金、国金惠安利率债债券型证券投资基金、国金惠远纯债债券型证券投资基金、国金惠享一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、国金惠丰39个月定期开放债券型证券投资基金、国金惠诚债券型证券投资基金、国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金、国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金、国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、国金鑫意医药消费混合型发起式证券投资基金、国金鑫悦经济新动能混合型证券投资基金、国金自主创新混合型证券投资基金、国金ESG持续增长混合型证券投资基金、国金核心资产一年持有期混合型证券投资基金、国金量化精选混合型证券投资基金、国金新兴价值混合型证券投资基金、国金沪深300指数增强证券投资基金、国金上证50指数增强证券投资基金（LOF）、国金量化多因子股票型证券投资基金、国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金。

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		
曾省强	本基金的基金经理	2021年3月26日	-	6年	曾省强先生，北京师范大学硕士。2013年7月至2016年4月在江苏信宁投资管理有限公司担任固定收益部交易员，2016年5月加入国金基金管理有限公司，担任基金交易部交易员。现任国金基金管理有限公司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期填写；（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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：截至本报告期末，不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.1.4 基金经理薪酬机制

截至本报告期末，不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况，故本项不适用。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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，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，同时包括授权、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，明确公平交易的原则：（1）信息获取公平原则，不同投资组合经理可公平获得研究成果；（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，对公募基金和私募资产管理计划等不同类型业务，公司分别设立独立的投资人员；研究团队对所有的投资业务同时提供研究支持；设立独立的基金交易部，实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；设立独立的合规风控部，对研究、投资、交易业务的公平交易进行监控、分析、预警、报告等。

第三，通过岗位设置、制度约束、流程规范、技术手段相结合的方式，实现公平交易的控制，具体如下：（1）总经理、督察长、风险控制委员会负责指导建立公平交易制度，并对公平交易的执行情况进行审核。（2）产品开发：风险分析师根据相关法律法规、公司规章制度以及产品合同的风险控制指标，在投资交易系统中完成风控参数设置，确保做好公平交易的事前控制。（3）研究与投资：投资人员负责在各自的职责及权限范围内从事相应的投资决策行为，其中，投资组合

经理需对有可能涉及非公平交易的行为作出合理解释。研究人员负责以客观的研究方法开展研究工作，并根据研究结果建立及维护全公司适用的投资对象备选库和交易对手备选库。研究结果通过策略会、行业及个股报告会、投研平台、邮件系统等共享机制统一开放给所有的投资组合经理，以确保各投资组合享有公平的信息获取机会。（4）交易执行：交易人员负责建立并执行公平的集中交易制度和交易分配制度，合规风控部利用投资交易系统对交易执行进行实时监控，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（5）事后分析：合规风控部利用公平交易系统对不同投资组合之间的同向、反向交易及交易时机和价差进行事后分析。（6）报告备案：合规风控部根据实时监控及事后分析的结果撰写定期报告，并由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。（7）信息披露环节：信息披露部门在各投资组合的定期报告中，至少披露公司整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）反馈完善：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日臻完善。（9）监督检查：合规风控部监察稽核人员根据法规规定及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。会计师事务所在公司年度内部控制评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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

截至本报告期末，不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况，故本项不适用。

4.3.3 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 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

2022 年全球经济增长放缓，俄乌地缘冲突爆发，美欧等发达经济体通胀居高不下，以美联储为代表的发达国家央行大幅度加息，在海外错综复杂的局面下国内经济增长也面临诸多压力，新冠疫情的反复冲击、地产“断供”等事件使得全年经济增长不及年初目标。市场表现方面，全年债市在“弱现实、强预期”两个主线之间轮流切换，10 月底前收益率整体震荡下行，10 月后在资金利率中枢回归政策利率以及疫情防控政策优化的影响下，叠加理财产品赎回潮的负向反馈，债券市场遭遇了较大的调整，全年整体呈现震荡的格局。

报告期内，本基金依旧力争保持稳健的操作风格，始终把防范流动性风险放在第一位，同时根据央行货币政策和市场资金面的变化，灵活调整债券仓位和久期，力争为持有人创造了与风险相匹配的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期，本基金 A 类份额净值增长率为 2.0796%，同期业绩比较基准收益率为 0.3500%。

本报告期，本基金 C 类份额净值增长率为 1.3166%，同期业绩比较基准收益率为 0.3500%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2023 年，疫情防控政策优化后疫情对经济的影响逐渐削弱，经济修复将是全年的主基调，以消费为主的内需动能恢复是带动全年经济修复的主要力量，但疫情三年对居民资产负债表的损伤将导致地产相关链条继续承压，海外经济的下行也将使得今年出口增速较去年有所下滑，但总体来看，经济将呈现弱复苏的格局。债市策略方面，经济复苏将导致债券市场收益率面临上行的压力，但经济恢复不是一蹴而就，这决定了收益率上行的空间有限，同时“强预期和弱现实”之间的切换也将带来一定的交易性机会，本基金将根据市场变化，灵活调整债券仓位和久期，选择较优资产进行配置。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人从合法、合规、保障基金持有人利益出发，由督察长领导独立于各业务部门的合规风控部对基金投资运作、公司经营管理及员工行为的合法、合规性进行了监察稽核，通过实时监控、定期检查、专项稽核、日常不定期抽查等方式，及时发现情况、提出整改意见、督促有关业务部门整改并跟踪改进落实情况，并按照相关要求定期制作监察稽核报告报公司管理层、董事会以及监管部门。

本报告期内本基金管理人内部监察稽核的重点包括：

(1) 进一步完善制度建设。本基金管理人根据公司实际业务情况不断细化制度流程，及时拟

定了相关管理制度，并对原有制度体系进行了持续的更新和完善，截至报告出具日，本基金管理人共制订规章制度 164 项，涵盖公司主要业务范围。

(2) 强化合规教育和培训。本基金管理人及时传达与基金相关的法律法规，将相关规定不断贯彻到相关制度及具体执行过程中，同时以组织公司内部培训、聘请外部律师提供法律专业培训等多种形式，提高全体员工的合规守法意识。

(3) 有计划地开展监察稽核工作。本报告期内，本基金管理人根据年度监察稽核工作计划、通过日常监察与专项稽核相结合的方式，开展各项监察稽核工作，包括对基金销售、宣传材料、合同、反洗钱工作、基金投资运作、交易（包括公平交易）等方面进行稽核，对于稽核中发现的问题会通过监察稽核报告的形式，及时将潜在风险通报部门负责人、督察长及公司总经理，督促改进并跟踪改进效果。通过日常监察与专项稽核的方式，保证了内部监察稽核的全面性、实时性，强化内部控制流程，提高了业务部门及人员的风险意识水平，从而较好地预防风险。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人按照相关法律法规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，估值委员会由公司督察长、投资总监、运营总监、清算业务负责人、研究部门负责人、风控业务负责人、合规业务负责人组成，可根据需要邀请产品托管行代表、公司独立董事、会计师事务所代表等外部人员参加。公司运营总监为公司基金估值委员会主席。运营支持部根据估值委员会的估值意见进行相关具体的估值调整或处理，并负责与托管行进行估值结果的核对，运营支持部业务人员复核后使用。基金经理作为估值工作小组成员，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，估值政策和估值方案最终由估值委员会决定，基金经理不具有表决权。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。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.8 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，并每日进行支付。

4.9 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

4.10 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，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

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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

本报告期内，按照相关法律法规规定和基金合同、托管协议的有关约定，本托管人对本基金的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、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的约定进行。

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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、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（2023）审字第 61004823_A06 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
审计意见	我们审计了国金金腾通货币市场证券投资基金的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的国金金腾通货币市场证券投资基金的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 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职

	业道德守则，我们独立于国金金腾通货币市场证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	国金金腾通货币市场证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、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导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估国金金腾通货币市场证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督国金金腾通货币市场证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （2）了解与审计相关的内部控制，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。 （3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 （4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，

	根据获取的审计证据，就可能导致对国金金腾通货币市场证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致国金金腾通货币市场证券投资基金不能持续经营。 （5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
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）	
注册会计师的姓名	师宇轩	马剑英
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17层01-12室	
审计报告日期	2023年03月30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：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	6,659,354,600.54	8,529,410,757.63
结算备付金		—	—
存出保证金		—	—
交易性金融资产	7.4.7.2	12,177,899,303.92	10,380,611,233.52
其中：股票投资		—	—
基金投资		—	—
债券投资		12,177,899,303.92	10,380,611,233.52
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—
衍生金融资产	7.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	1,685,859,128.05	1,199,108,139.42
债权投资	7.4.7.5	—	—
其中：债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
其他投资		—	—

其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		166,144,039.29	200.06
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	55,478,841.56
资产总计		20,689,257,071.80	20,164,609,172.19
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	484,999,437.50
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		4,376,090.40	4,137,861.52
应付托管费		1,094,022.61	1,034,465.40
应付销售服务费		5,410,188.48	5,137,757.31
应付投资顾问费		-	-
应交税费		71,718.46	43,480.08
应付利润		2,094,774.01	1,358,884.69
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	472,122.25	306,306.31
负债合计		13,518,916.21	497,018,192.81
净资产:			
实收基金	7.4.7.10	20,675,738,155.59	19,667,590,979.38
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-	-
净资产合计		20,675,738,155.59	19,667,590,979.38
负债和净资产总计		20,689,257,071.80	20,164,609,172.19

注：（1）报告截止日 2022 年 12 月 31 日，国金金腾通货币 A 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 13,823,525,128.48 份；国金金腾通货币 C 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 6,852,213,027.11 份。国金金腾通货币份额总额合计为 20,675,738,155.59 份。

（2）比较数据已根据《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年年度报告资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在 2022 年年度报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年年度报告资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年年度报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余

额，下同。

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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		598,264,321.03	631,229,261.61
1. 利息收入		310,956,735.00	629,446,116.40
其中：存款利息收入	7.4.7.13	210,206,746.77	300,638,887.99
债券利息收入		—	251,950,957.55
资产支持证券利息收入		—	6,298,863.36
买入返售金融资产收入		100,749,988.23	70,557,407.50
证券出借利息收入		—	—
其他利息收入		—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		287,287,284.66	1,782,405.21
其中：股票投资收益	7.4.7.14	—	—
基金投资收益		—	—
债券投资收益	7.4.7.15	287,287,284.66	1,782,405.21
资产支持证券投资	7.4.7.16	—	—
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	—	—
衍生工具收益	7.4.7.18	—	—
股利收益	7.4.7.19	—	—
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		—	—
其他投资收益		—	—
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	—	—
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	20,301.37	740.00
减：二、营业总支出		132,733,672.10	118,572,386.65
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	51,371,389.46	45,889,764.73
2. 托管费	7.4.10.2.2	12,842,847.32	11,472,441.22
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	62,214,846.64	56,761,794.88

4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		5,871,979.40	4,048,041.17
其中：卖出回购金融资产支出		5,871,979.40	4,048,041.17
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		67,035.26	40,604.31
8. 其他费用	7.4.7.23	365,574.02	359,740.34
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		465,530,648.93	512,656,874.96
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		465,530,648.93	512,656,874.96
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		465,530,648.93	512,656,874.96

注：（1）本产品不收取销售服务费，表中所列示的销售服务费为本基金 C 类份额收取的增值服务费项目。

（2）比较数据已根据《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年年度报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年年度报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额，下同。

7.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	19,667,590,979.38	-	-	19,667,590,979.38
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	19,667,590,979.38	-	-	19,667,590,979.38

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,008,147,176.21	-	-	1,008,147,176.21
(一)、综合收益总额	-	-	465,530,648.93	465,530,648.93
(二)、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)	1,008,147,176.21	-	-	1,008,147,176.21
其中：1. 基金申购款	366,013,326,932.33	-	-	366,013,326,932.33
2. 基金赎回款	-365,005,179,756.12	-	-	-365,005,179,756.12
(三)、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)	-	-	-465,530,648.93	-465,530,648.93
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	20,675,738,155.59	-	-	20,675,738,155.59
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	17,801,837,910.11	-	-	17,801,837,910.11
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	17,801,837,910.11	-	-	17,801,837,910.11
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,865,753,069.	-	-	1,865,753,069.2

号填列)	27			7
(一)、综合收益总额	-	-	512,656,874.96	512,656,874.96
(二)、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)	1,865,753,069.27	-	-	1,865,753,069.27
其中: 1. 基金申购款	400,353,528,300.62	-	-	400,353,528,300.62
2. 基金赎回款	-398,487,775,231.35	-	-	-398,487,775,231.35
(三)、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)	-	-	-512,656,874.96	-512,656,874.96
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	19,667,590,979.38	-	-	19,667,590,979.38

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:

邵海波

聂武鹏

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(原名称为“国金通用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向社会公开募集,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。2015 年 9 月 23 日,本基金名称由“国金通用金腾通货币市场证券投资基金”变更为“国金金腾通货币市场证券投资基金”。本基金设立

时，首次募集规模为 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 类基金份额的基金代码为 000540，新设 C 类基金份额代码为 001621。两类基金份额单独公布基金万份净收益和七日年化收益率。

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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集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〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

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 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民

币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产。

（2）金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，在初始确认时以公允价值计量；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的相关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

本基金采用影子定价和偏离度控制确定金融资产的公允价值，即按实际利率法计算金融资产的账面价值，同时为了避免按实际利率法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管

理人于每一估值日，采用其他可参考公允价值指标，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当按实际利率法计算确定的基金资产净值与影子定价确定的基金资产净值产生重大偏离，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

无

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的实际利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示。另外，根据中国证监会令第120号《货币市场基金监督管理办法》的规定，如果出现因提前支取而导致的利息损失的情形，基金管理人应当使用风险准备金予以弥补，风险准备金不足的，应当使用固有资金予以弥补；

(2) 债券投资和资产支持证券投资按实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，在债券投资和资产支持证券投资的实际持有期内逐日计提；处置债券投资和资产支持证券投资的投资收益于成交日确认，并按成交金额与其账面价值的差额入账；

(3) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(4) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的

流入额能够可靠计量时予以确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权；

(2) 本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；

(3) “每日分配、按日结转份额”。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，并每日进行支付。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理（因去尾形成的余额自动合并入下一日收益中进行分配）；

(4) 本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益；

(5) 本基金每日进行收益计算并分配时，每日收益支付方式只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益；若投资人在每日收益支付时，当日净收益为正值，则为投资人增加相应的基金份额，基金管理人将采取必要措施尽量避免基金净收益小于零，若当日净收益为负值，不缩减投资人基金份额，直至累计基金收益为正的工作日，方为投资者增加基金份额；

(6) 当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益；

(7) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分

部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

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

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理。此外，本基金亦已执行财政部于 2022 年发布的《关于印发〈资产管理产品相关会计处理规定〉的通知》（财会[2022]14 号）。新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益、以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

根据新金融工具准则的衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与原准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 8,529,410,757.63 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 31,201,046.51 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准

则列示的账面价值为人民币 8,560,611,804.14 元。

买入返售金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,199,108,139.42 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 1,573,465.11 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，买入返售金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,200,681,604.53 元。

应收申购款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 200.06 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 0.00 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，应收申购款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 200.06 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 55,478,841.56 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 31,201,046.51 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 22,704,329.94 元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币 1,573,465.11 元，转出至应收申购款的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至其他资产的重分类金额为人民币 0.00 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 10,380,611,233.52 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 22,704,329.94 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 10,403,315,563.46 元。

以摊余成本计量的金融负债：

卖出回购金融资产款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 484,999,437.50 元，自应付利息转入的重分类金额为人民币 32,546.11 元。经上述重分类后，卖出回购金融资产款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 485,031,983.61 元。

应付利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 32,546.11 元，转出至卖出回购金融资产款的重分类金额为人民币 32,546.11 元。经上述重分类后，应付利息不再作为财务报表项目单独列报。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

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

7.4.6.1 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，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）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生

的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

7.4.6.2 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）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

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。

7.4.6.3 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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	1,221,780.21	4,410,757.63
等于：本金	1,221,469.99	4,410,757.63
加：应计利息	310.22	—
减：坏账准备	—	—
定期存款	6,658,132,820.33	8,525,000,000.00
等于：本金	6,644,000,000.00	8,525,000,000.00
加：应计利息	14,132,820.33	—
减：坏账准备	—	—
其中：存款期限 1 个月以内	—	370,000,000.00
存款期限 1-3 个月	1,441,757,638.89	1,000,000,000.00
存款期限 3 个月以上	5,216,375,181.44	7,155,000,000.00

其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	6,659,354,600.54	8,529,410,757.63

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 12 月 31 日			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	12,177,899,303.92	12,174,067,925.04	-3,831,378.88	-0.0185
	合计	12,177,899,303.92	12,174,067,925.04	-3,831,378.88	-0.0185
资产支持证券		-	-	-	-
合计		12,177,899,303.92	12,174,067,925.04	-3,831,378.88	-0.0185
项目		上年度末 2021 年 12 月 31 日			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	10,380,611,233.52	10,386,340,900.00	5,729,666.48	0.0291
	合计	10,380,611,233.52	10,386,340,900.00	5,729,666.48	0.0291
资产支持证券		-	-	-	-
合计		10,380,611,233.52	10,386,340,900.00	5,729,666.48	0.0291

注：偏离金额=影子定价-摊余成本；偏离度=偏离金额/摊余成本法确认的基金资产净值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	1,685,859,128.05	-
合计	1,685,859,128.05	-
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	1,199,108,139.42	-
合计	1,199,108,139.42	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：无

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无

7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
----	-------------------------	--------------------------

应收利息	-	55,478,841.56
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	55,478,841.56

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	222,822.25	144,460.20
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	222,822.25	144,460.20
应付利息	-	32,546.11
预提费用	249,300.00	-
预提上清所查询服务费	-	300.00
预提账户维护费	-	9,000.00
预提审计费	-	120,000.00
合计	472,122.25	306,306.31

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

国金金腾通货币 A

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	12,668,446,600.01	12,668,446,600.01
本期申购	185,954,497,061.06	185,954,497,061.06
本期赎回（以“-”号填列）	-184,799,418,532.59	-184,799,418,532.59
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	13,823,525,128.48	13,823,525,128.48

国金金腾通货币 C

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,999,144,379.37	6,999,144,379.37
本期申购	180,058,829,871.27	180,058,829,871.27
本期赎回（以“-”号填列）	-180,205,761,223.53	-180,205,761,223.53
基金拆分/份额折算前	-	-

基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	6,852,213,027.11	6,852,213,027.11

注：若本基金有分红及转换业务，申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

注：无

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

国金金腾通货币 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	357,598,377.54	-	357,598,377.54
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-357,598,377.54	-	-357,598,377.54
本期末	-	-	-

国金金腾通货币 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	107,932,271.39	-	107,932,271.39
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-107,932,271.39	-	-107,932,271.39
本期末	-	-	-

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	17,676.26	27,573.73
定期存款利息收入	210,189,070.51	300,611,314.26
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	-	-
其他	-	-
合计	210,206,746.77	300,638,887.99

7.4.7.14 股票投资收益

注：无

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
债券投资收益——利息收入	284,460,669.77	—
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,826,614.89	1,782,405.21
债券投资收益——赎回差价收入	—	—
债券投资收益——申购差价收入	—	—
合计	287,287,284.66	1,782,405.21

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	31,263,529,076.70	29,080,183,215.28
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	31,145,298,924.76	28,975,219,494.38
减：应计利息总额	115,403,537.05	103,181,315.69
减：交易费用	—	—
买卖债券差价收入	2,826,614.89	1,782,405.21

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
卖出资产支持证券成交总额	-	401,008,411.45
减：卖出资产支持证券成本总额	-	389,100,000.00
减：应计利息总额	-	11,908,411.45
减：交易费用	-	-
资产支持证券投资收益	-	-

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无

7.4.7.19 股利收益

注：无

7.4.7.20 公允价值变动收益

注：无

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
其他	20,301.37	740.00
合计	20,301.37	740.00

7.4.7.22 信用减值损失

注：无

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	120,000.00	120,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	88,494.02	87,040.34
账户维护费	35,880.00	-
中债债券账户维护费	-	18,000.00
上清所查询服务费	1,200.00	1,200.00
上清所账户维护费	-	13,500.00
合计	365,574.02	359,740.34

7.4.7.24 分部报告

无

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
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
广东宝丽华新能源股份有限公司	基金管理人股东
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
涌金投资控股有限公司	基金管理人股东

苏州元道亨经济信息咨询中心（有限合伙）	基金管理人股东
苏州元道利经济信息咨询中心（有限合伙）	基金管理人股东
苏州元道贞经济信息咨询中心（有限合伙）	基金管理人股东
上海国金理益财富基金销售有限公司	基金管理人的子公司
北京千石创富资本管理有限公司	基金管理人的子公司
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. 经国金基金管理有限公司股东会审议通过，公司股东涌金投资控股有限公司将其持有 2% 的股权转让给国金证券股份有限公司，公司已按照相关法律法规要求，完成相关备案及登记手续。

2. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

注：无

7.4.10.1.2 债券交易

注：无

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无

7.4.10.1.4 权证交易

注：无

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	51,371,389.46	45,889,764.73
其中：支付销售机构的客户维护费	4,097,922.71	18,425,791.01

注：1. 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.20% 年费率计提。管理费计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2. 客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	12,842,847.32	11,472,441.22

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方 名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国金金腾通货币 A	国金金腾通货币 C	合计
国金证券股份有限公司	-	59,495,981.63	59,495,981.63
合计	-	59,495,981.63	59,495,981.63
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国金金腾通货币 A	国金金腾通货币 C	合计
国金基金管理有限公司	-	99,173.38	99,173.38

国金证券股份有限公司	-	54,064,838.59	54,064,838.59
合计	-	54,164,011.97	54,164,011.97

注：1. 本产品不收取销售服务费，表中所列示的销售服务费为本基金 C 类份额收取的增值服务费。

2. A 类基金份额不收取增值服务费，C 类基金份额的增值服务费率年费率为 0.75%。增值服务费计提的计算方法如下：

$$H = E \times 0.75\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金增值服务费

E 为 C 类份额前一日基金资产净值

基金增值服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金增值服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给注册登记机构或基金管理人，经注册登记机构或基金管理人支付给基金销售机构。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国民生银行股份有限公司	-	-	-	-	215,000,000.00	8,720.88
上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国民生银行股份有限公司	50,003,630.14	-	-	-	500,100,000.00	22,944.43

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

国金证券通货币 A

关联方名称	本期末 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)

中国民生 银行股份 有限公司	418,321,110.76	3.0262	399,875,363.36	3.1565
----------------------	----------------	--------	----------------	--------

份额单位：份

国金金腾通货币 C

关联方名称	本期末 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
涌金投资 控股有限 公司	25.30	0.0000	167,967.11	0.0024

注：除基金管理人之外的其他关联方持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国民生银行股份有限公司-定期存款	1,891,328,269.52	65,188,119.71	2,900,000,000.00	42,208,808.33
中国民生银行股份有限公司-活期存款	1,221,780.21	17,676.26	4,410,757.63	27,573.73

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本报告期内及上年度可比期间均未参与关联方承销期内承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

国金金腾通货币 A				
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	本期利润分配合 计	备注
354,654,721.63	2,317,134.61	626,521.30	357,598,377.54	-
国金金腾通货币 C				
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	本期利润分配合 计	备注

106,653,173.51	1,169,729.86	109,368.02	107,932,271.39	-
----------------	--------------	------------	----------------	---

7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：无

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人的风险管理政策是通过事前充分到位的防范、事中实时有效的过程控制、事后完备可追踪的检查和反馈，将风险管理贯穿于投研运作的整个流程，从而使基金投资风险可测、可控、可承担，有效防范和化解投研业务的市场风险、信用风险、流动性风险及操作风险。

本基金管理人建立了董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险管理组织体系，合规风控部风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险控制委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

董事会负责公司整体风险的预防和控制，审核、监督公司风险控制制度的有效执行。董事会下设风险管理委员会，并制定《风险管理委员会议事规则》，规范其组成人员、职责、议事规则等事宜。

督察长负责公司及其投资组合运作的监察稽核工作，向董事会汇报。

总经理负责公司日常经营管理中的风险控制工作。总经理下设风险控制委员会，负责对公司经营及投资组合运作中的风险进行识别、评估和防控，负责对投资组合风险评估报告中提出的重大问题进行讨论和决定应对措施。公司制定《风险控制委员会议事规则》，规范其组成人员、职责、议事规则等事宜。

本基金管理人推行全员风险管理理念，公司各部门是风险管理的一线部门，公司各部门负责人是其部门风险管理的第一责任人，根据公司制度规定的各项作业流程和规范，加强对风险的控

制。

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制，基金经理是本基金风险管理的第一责任人。

合规风控部监察稽核团队负责对风险控制制度的建立和落实情况进行监督，在职权范围内独立履行检查、评价、报告、建议职能；合规风控部风险管理团队独立于投资研究体系，负责落实具体的风险管理政策，对投资进行事前、事中及事后的风险管理。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，并对证券交割方式进行限制，以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	140,407,965.95	689,634,620.85
合计	140,407,965.95	689,634,620.85

注：表中所列示的债券投资为短期融资券、超短期融资券及其他按短期信用评级的债券投资，其中超短期融资券无短期信用评级。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	10,362,880,624.44	8,361,208,008.05
合计	10,362,880,624.44	8,361,208,008.05

注：未评级包含发行期限小于 1 年的同业存单。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	283,093,126.67	—
AAA 以下	—	—
未评级	—	—
合计	283,093,126.67	—

注：表中所列示的债券投资为除短期融资券、超短期融资券及其他按短期信用评级列示的债券投资、国债、政策性金融债、央行票据以外的债券投资。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例、份额持有人集中度、调整平均剩余期限和平均剩余存续期、压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持大部分证券为剩余期限较短、具有良好流动性的债券和货币市场工具，除在证券交易所的债券回购及返售交易，其余均在银行间同业市场交易，因此，除在附注中列示的部分基

金资产流通暂时受限制外（如有），均能够及时变现。本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。除卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于交易所及银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 202 2 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资 产							
银 行 存 款	271,918,974.77	2,885,090,737.27	3,502,344,888.50	-	-	-	6,659,354,600.54
交 易 性	1,153,676,219.74	4,380,696,957.58	6,643,526,126.64	-	-	-	12,177,899,303.92

金融资产							
买入返售金融资产	1,685,859,128.05	-	-	-	-	-	1,685,859,128.05
应收申购款	-	-	-	-	-	166,144,039.29	166,144,039.29
资产总计	3,111,454,322.52	7,265,787,694.85	10,145,871,015.14	-	-	166,144,039.29	20,689,257,071.80
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,376,090.40	4,376,090.40
应付托管费	-	-	-	-	-	1,094,022.61	1,094,022.61
应付销售服务费	-	-	-	-	-	5,410,188.48	5,410,188.48
应付税	-	-	-	-	-	71,718.46	71,718.46

费							
应付利润	-	-	-	-	-	2,094,774.01	2,094,774.01
其他负债	-	-	-	-	-	472,122.25	472,122.25
负债总计	-	-	-	-	-	13,518,916.21	13,518,916.21
利率敏感度缺口	3,111,454,322.52	7,265,787,694.85	10,145,871,015.14	-	-	152,625,123.08	20,675,738,155.59
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	2,014,410,757.63	2,085,000,000.00	4,430,000,000.00	-	-	-	8,529,410,757.63
交易性金融资产	1,068,432,552.91	3,780,723,103.76	5,531,455,576.85	-	-	-	10,380,611,233.52
买入	1,199,108,139.42	-	-	-	-	-	1,199,108,139.42

返售金融资产							
应收申购款	-	-	-	-	-	200.06	200.06
其他资产	-	-	-	-	-	55,478,841.56	55,478,841.56
资产总计	4,281,951,449.96	5,865,723,103.76	9,961,455,576.85	-	-	55,479,041.62	20,164,609,172.19
负债							
卖出回购金融资产款	484,999,437.50	-	-	-	-	-	484,999,437.50
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,137,861.52	4,137,861.52
应付托管费	-	-	-	-	-	1,034,465.40	1,034,465.40
应付销	-	-	-	-	-	5,137,757.31	5,137,757.31

售 服 务 费							
应 交 税 费	-	-	-	-	-	43,480.08	43,480.08
应 付 利 润	-	-	-	-	-	1,358,884.69	1,358,884.69
其 他 负 债	-	-	-	-	-	306,306.31	306,306.31
负 债 总 计	484,999,437.50	-	-	-	-	12,018,755.31	497,018,192.81
利 率 敏 感 度 缺 口	3,796,952,012.45 6	5,865,723,103.7 6	9,961,455,576.8 5	-	-	43,460,286.31	19,667,590,979. 38

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日、行权日或到期日孰早者进行分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的情况下，利率发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值可参考的公允价值产生的影响。本基金本报告期末，在“影子定价”机制有效的前提下，若市场利率上升或下降 25 个基点且其他市场变量保持不变，本基金资产净值可参考的公允价值不会发生重大变动。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金主要投资于固定收益类金融工具，且以摊余成本进行后续计量，因此无重大其他价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

注：无

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：无。

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	12,177,899,303.92	10,380,611,233.52
第三层次	-	-
合计	12,177,899,303.92	10,380,611,233.52

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金本期及上年度可比期间持有的持续以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次间未发生重大转换。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

注：无

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

注：无

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 承诺事项

注：截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.15.2 其他事项

注：截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.15.3 财务报表的批准

注：本财务报表已于 2023 年 3 月 30 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	12,177,899,303.92	58.86
	其中：债券	12,177,899,303.92	58.86
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	1,685,859,128.05	8.15
	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	6,659,354,600.54	32.19
4	其他各项资产	166,144,039.29	0.80
5	合计	20,689,257,071.80	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

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	1.27	
	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	-	0.00
	其中：买断式回购融资	-	0.00

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%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	109
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	61

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。

8.3.2 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	15.04	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	18.81	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	16.33	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	8.03	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	41.04	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

合计	99.26	0.00
----	-------	------

8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：本基金本报告期末发生投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	按实际利率计算的账面价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,594,718,307.86	7.71
	其中：政策性金融债	1,391,517,586.86	6.73
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	140,407,965.95	0.68
6	中期票据	79,892,405.67	0.39
7	同业存单	10,362,880,624.44	50.12
8	其他	-	-
9	合计	12,177,899,303.92	58.90
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

8.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	按实际利率计算的账面价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	210312	21 进出 12	4,400,000	451,771,906.00	2.19
2	112211098	22 平安银行 CD098	3,000,000	300,799,000.00	1.45
3	112212079	22 北京银行 CD079	3,000,000	300,605,333.33	1.45
4	112205051	22 建设银行 CD051	3,000,000	300,553,976.22	1.45
5	112291041	22 杭州银行 CD015	3,000,000	299,599,431.02	1.45
6	112207062	22 招商银行 CD062	3,000,000	297,776,131.62	1.44
7	220404	22 农发 04	2,700,000	272,580,582.16	1.32
8	220211	22 国开 11	2,600,000	261,433,050.58	1.26
9	220206	22 国开 06	2,500,000	252,703,736.97	1.22

10	112209076	22 浦发银行 CD076	2,500,000	248,546,737.05	1.20
----	-----------	------------------	-----------	----------------	------

8.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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	0.0826%
报告期内偏离度的最低值	-0.0715%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0406%

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。

8.8 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注：无

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体中，北京银行股份有限公司于 2022 年 11 月 28 日受到国家外汇管理局给予没收违法所得 349,067.43 元人民币并罚款 156.5 万元人民币的行政处罚；国家开发银行于 2022 年 03 月 25 日受到中国银保监会给予罚款 440 万元的行政处罚；上海浦东发展银行股份有限公司于 2022 年 03 月 25 日受到中国银保监会给予罚款 420 万元行政处罚，于 2022 年 09 月 02 日受到国家外汇管理局给予罚款 933 万元人民币并没收违法所得 334.69 万元人民币的行政处罚。招商银行股份有限公司于 2022 年 03 月 25 日受到中国银保监会给予罚款 300 万元的行政处罚，于 2022 年 11 月 04 日受到中国银行保险监给予罚款 460 万元的行政处罚，于 2022 年 12 月 30 日受到中国人民银行给予没收违法所得 5.692641 万元并罚款 3423.5 万元的行政处罚；中国进出口银行于 2022 年 03 月 25 日受到中国银保监会给予罚款 420 万元的行政处罚；中国农业发展银行于 2022 年 03 月 25 日受到中国银保监会给予罚款 480 万元的行政处罚；杭州银行

股份有限公司于 2022 年 05 月 31 日受到中国人民银行杭州支行给予罚款 581 万元的行政处罚；平安银行股份有限公司于 2022 年 03 月 25 日受到中国银保监会给予罚款 400 万元的行政处罚；中国建设银行股份有限公司于 2022 年 03 月 25 日受到中国银保监会给予罚款 470 万元的行政处罚，于 2022 年 11 月 04 日受到中国银保监会给予罚款 260 万元的行政处罚，于 2022 年 10 月 28 日受到中国银保监会给予罚款 200 万元的行政处罚。

上述证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。除上述情况外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体未出现本期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。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	166,144,039.29
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	166,144,039.29

8.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
国金金腾通货币 A	228,644	60,458.73	5,431,152,291.96	39.29	8,392,372,836.52	60.71
国金金腾通货币 C	300,242	22,822.30	80,442,249.53	1.17	6,771,770,777.58	98.83
合计	528,886	39,093.00	5,511,594,541.49	26.66	15,164,143,614.10	73.34

9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例（%）
1	银行类机构	819,001,798.08	3.96
2	银行类机构	800,191,103.18	3.87
3	银行类机构	418,321,110.76	2.02
4	银行类机构	323,888,686.62	1.57
5	银行类机构	305,118,259.42	1.48
6	银行类机构	205,690,974.54	0.99
7	银行类机构	205,419,596.53	0.99
8	银行类机构	204,904,348.59	0.99
9	银行类机构	204,277,516.75	0.99
10	银行类机构	204,054,772.03	0.99

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	国金金腾通货币 A	653,075.11	0.0047
	国金金腾通货币 C	239,244.14	0.0035
	合计	892,319.25	0.0043

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	国金金腾通货币 A	0~10
	国金金腾通货币 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	国金金腾通货币 A	0
	国金金腾通货币 C	0
	合计	0

9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产情况

注：无

§ 10 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
基金合同生效日 (2014 年 2 月 17 日) 基金份额总额	201,693,057.58	—
本报告期期初基金份	12,668,446,600.01	6,999,144,379.37

额总额		
本报告期基金总申购份额	185,954,497,061.06	180,058,829,871.27
减：本报告期基金总赎回份额	184,799,418,532.59	180,205,761,223.53
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	13,823,525,128.48	6,852,213,027.11

注：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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，邵海波先生自 2022 年 1 月 28 日起担任基金管理人总经理职务，原总经理尹庆军先生自 2022 年 1 月 28 日起担任基金管理人副董事长职务。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 120,000 元人民币。截至本报告期末，该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
安信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
国融证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定要求，本基金管理人在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向券商租用了基金专用交易席位。

（1）基金专用交易席位的选择标准如下：

- ①经营行为规范，在近一年内未出现重大违规行为；
- ②财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- ③具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易需要；
- ④具有较强的研究能力，能及时、全面地提供高质量的宏观、策略、行业、上市公司、证券市场研究、固定收益研究、数量研究等报告及信息资讯服务；
- ⑤交易佣金收取标准合理。

（2）基金专用交易席位的选择程序如下：

- ①本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；
- ②本基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

2. 本基金本报告期新增东北证券、英大证券各一个交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
安信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-

注：无

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本基金本报告期内未发生偏离度绝对值达到 0.5%的情况。

11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《关于国金金腾通货币市场证券投资基金暂停机构投资者申购、转换转入及定期定额投资业务的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 1 月 5 日
2	《国金金腾通货币市场证券投资基金 2021 年第 4 季度报告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 1 月 21 日

3	《关于国金金腾货币市场证券投资基金恢复机构投资者申购业务并限制大额申购的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 1 月 27 日
4	《国金基金管理有限公司关于开展直销柜台申购费率优惠活动的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 1 月 29 日
5	《国金基金管理有限公司高级管理人员变更公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 1 月 29 日
6	《关于国金金腾货币市场证券投资基金暂停机构投资者申购、转换转入及定期定额投资业务的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 2 月 17 日
7	《国金金腾货币市场证券投资基金招募说明书（更新）》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 3 月 23 日
8	《国金金腾货币市场证券投资基金（国金金腾货币 A 份额）基金产品资料概要（更新）》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 3 月 23 日
9	《国金金腾货币市场证券投资基金（国金金腾货币 C 份额）基金产品资料概要（更新）》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 3 月 23 日
10	《国金金腾货币市场证券投资基金 2021 年年度报告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 3 月 30 日
11	《国金金腾货币市场证券投资基金 2022 年第 1 季度报告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 4 月 22 日
12	《关于终止与深圳前海凯恩斯基金销售有限公司相关销售业务的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 4 月 23 日
13	《国金基金管理有限公司关于公司直销系统升级的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 4 月 30 日

14	《国金基金管理有限公司关于公司直销系统升级的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 5 月 28 日
15	《国金基金管理有限公司关于提示投资者防止诈骗的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 7 月 15 日
16	《国金基金管理有限公司关于提示投资者防止诈骗的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 7 月 16 日
17	《国金金腾通货币市场证券投资基金 2022 年第 2 季度报告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 7 月 20 日
18	《国金基金管理有限公司关于旗下基金开展网上直销平台费率优惠活动的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 8 月 22 日
19	《国金基金管理有限公司高级管理人员变更公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 8 月 23 日
20	《国金金腾通货币市场证券投资基金 2022 年中期报告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 8 月 30 日
21	《国金基金管理有限公司关于下线及第理财 APP 运营及维护服务的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 9 月 14 日
22	《国金基金管理有限公司关于公司系统升级的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 9 月 30 日
23	《国金基金管理有限公司关于设立上海分公司的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 10 月 15 日
24	《国金金腾通货币市场证券投资基金 2022 年第 3 季度报告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 10 月 26 日

25	《国金基金管理有限公司关于公司股权变更的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 10 月 29 日
26	《关于国金金腾通货币市场证券投资基金恢复机构投资者申购业务并限制大额申购的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 12 月 6 日

注：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。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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：无

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 存放地点

本基金基金管理人的办公场所。

13.3 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

2023 年 3 月 30 日