

国金金腾通货币市场证券投资基金 2021 年第 4 季度报告

2021 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

报告送出日期：2022 年 1 月 21 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约定，于 2022 年 1 月 20 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 2021 年 10 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | | |
|-----------------|--|--------------------|
| 基金简称 | 国金金腾货币 | |
| 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 | 19,667,590,979.38 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 | 国金金腾货币 A | 国金金腾货币 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 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 12,668,446,600.01 份 | 6,999,144,379.37 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（2021年10月1日—2021年12月31日） | |
|-------------|-----------------------------|------------------|
| | 国金金腾货币 A | 国金金腾货币 C |
| 1. 本期已实现收益 | 97,271,437.50 | 33,497,449.80 |
| 2. 本期利润 | 97,271,437.50 | 33,497,449.80 |
| 3. 期末基金资产净值 | 12,668,446,600.01 | 6,999,144,379.37 |

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 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 | 0.6057% | 0.0002% | 0.0882% | 0.0000% | 0.5175% | 0.0002% |
| 过去六个月 | 1.2183% | 0.0004% | 0.1764% | 0.0000% | 1.0419% | 0.0004% |
| 过去一年 | 2.5249% | 0.0005% | 0.3500% | 0.0000% | 2.1749% | 0.0005% |
| 过去三年 | 7.9873% | 0.0016% | 1.0510% | 0.0000% | 6.9363% | 0.0016% |
| 过去五年 | 16.7340% | 0.0023% | 1.7510% | 0.0000% | 14.9830% | 0.0023% |
| 自基金合同生效起至今 | 31.3035% | 0.0076% | 2.7568% | 0.0000% | 28.5467% | 0.0076% |

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

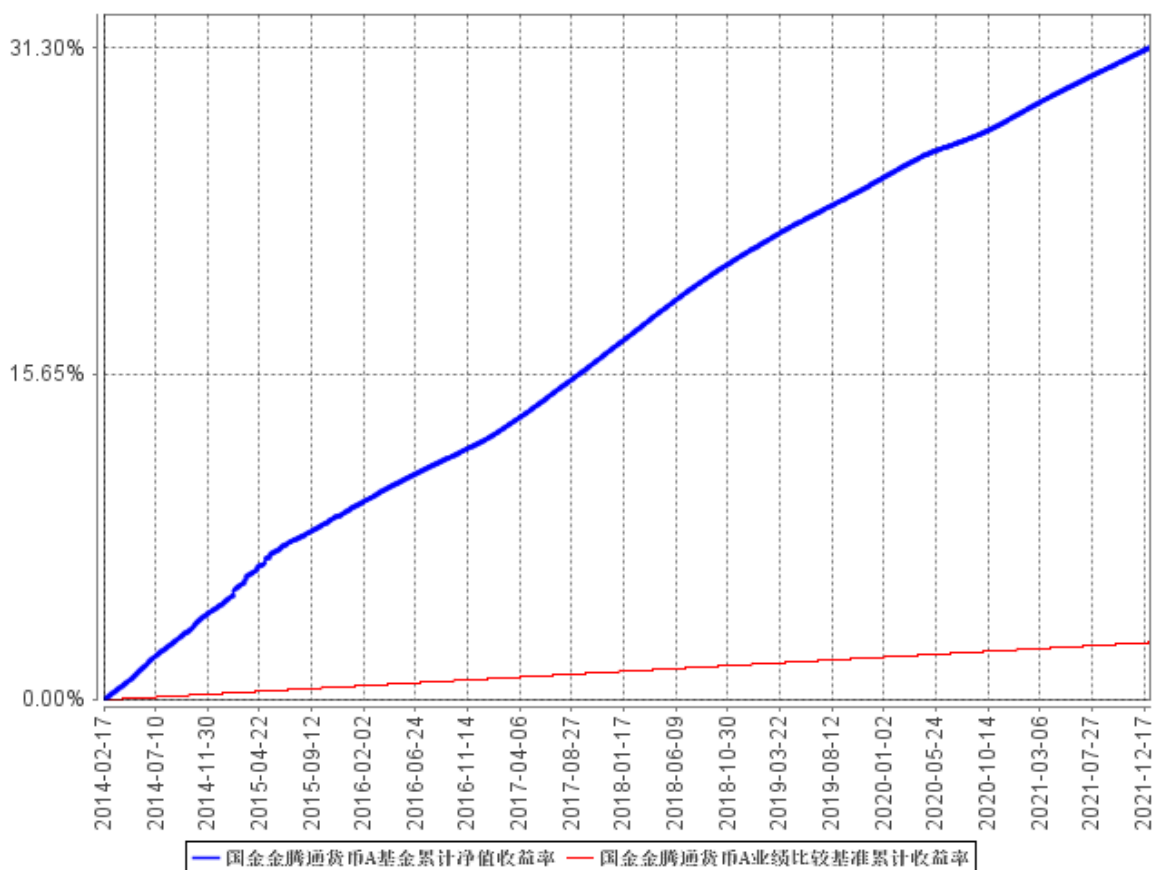
| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|-------|---------|-----------|------------|---------------|---------|---------|
| 过去三个月 | 0.4157% | 0.0002% | 0.0882% | 0.0000% | 0.3275% | 0.0002% |
| 过去六个月 | 0.8364% | 0.0004% | 0.1764% | 0.0000% | 0.6600% | 0.0004% |

| | | | | | | |
|------------|----------|---------|---------|---------|----------|---------|
| 过去一年 | 1.7592% | 0.0005% | 0.3500% | 0.0000% | 1.4092% | 0.0005% |
| 过去三年 | 5.5864% | 0.0016% | 1.0510% | 0.0000% | 4.5354% | 0.0016% |
| 过去五年 | 12.4394% | 0.0023% | 1.7510% | 0.0000% | 10.6884% | 0.0023% |
| 自基金合同生效起至今 | 15.7222% | 0.0026% | 2.1930% | 0.0000% | 13.5292% | 0.0026% |

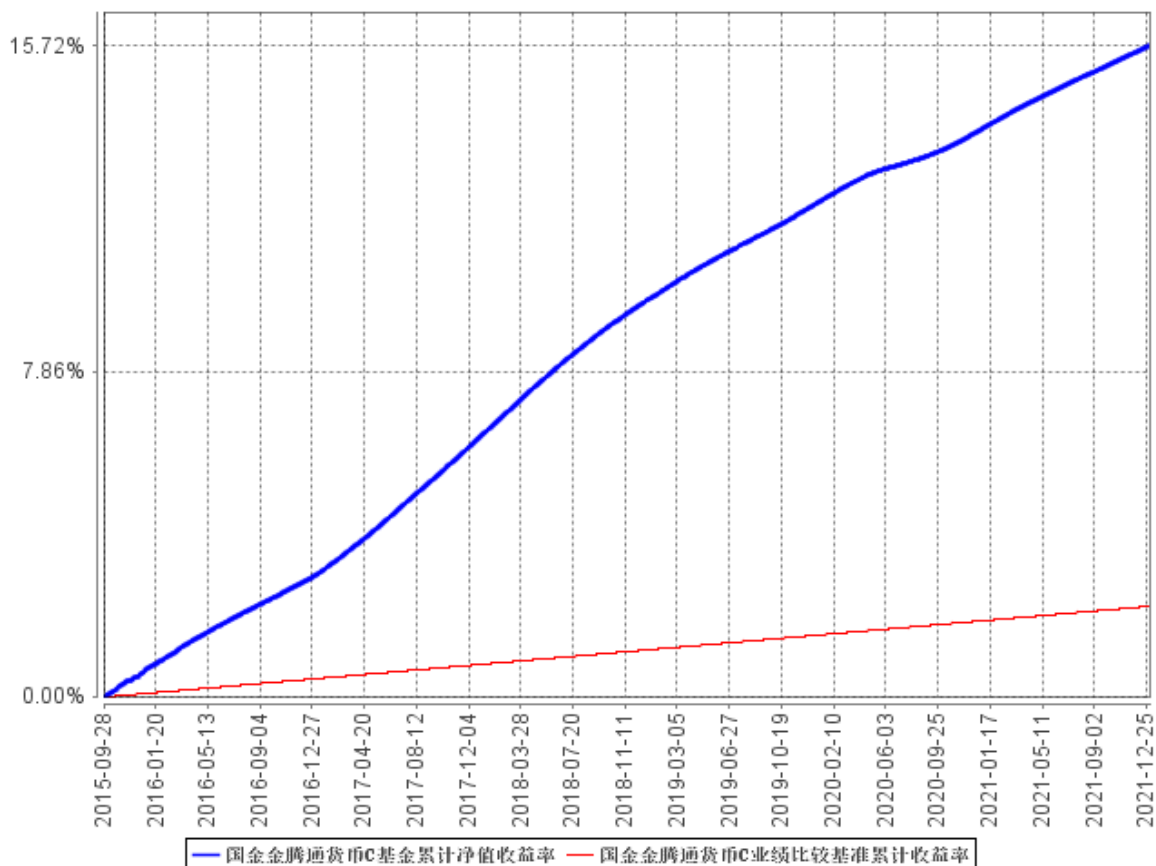
注：本基金的业绩比较基准为：人民币活期存款利率(税后)。

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基金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



国金金腾通货币C基金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 2021 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 2021 年 12 月 31 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 | | |
| 曾省强 | 本基金基金经理，国金鑫盈货币基金经理 | 2021年3月26日 | - | 5 | 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，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

报告期内，国内经济下行压力进一步加大，中央经济工作会议确认“我国经济发展面临需求收缩、供给冲击、预期转弱三重压力”。四季度房地产调控政策边际上有所放松，但在“房住不炒”的大背景下，房地产不会再成为短期拉动经济的手段，整体投资仍受抑制。消费受国内疫情防控以及居民收入增长限制，恢复速度较为缓慢。出口数据亮眼，但受到原材料价格以及航运价格高

企的影响较大。货币政策方面，央行在 12 月 6 日降低存款准备金率 0.5 个百分点，12 月 20 日引导 1 年期 LPR 下行 5bp，央行在四季度货币政策例会强调“发挥好货币政策工具的总量和结构双重功能”，释放出明确的宽松信号，边际宽松的格局进一步得到确认。

从债市表现来看，10 月初在全球通胀高企、美联储 Taper 临近的背景下，国内货币政策宽松预期落空，市场大幅调整，但随着 10 月国内 PPI 见顶，国内经济下行压力进一步加大，市场又重回基本面逻辑，配合货币政策宽松的重新确认，10 年期国债收益率由 3.05% 的位置下行至 2.77% 附近。

报告期内，本基金依旧保持稳健的操作风格，始终把控制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，提升组合收益。

4.5 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 0.6057%，同期业绩比较基准收益率为 0.0882%。

本报告期，本基金 C 类份额净值增长率为 0.4157%，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，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 | 10,380,611,233.52 | 51.48 |
| | 其中：债券 | 10,380,611,233.52 | 51.48 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 1,199,108,139.42 | 5.95 |
| | 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 | 8,529,410,757.63 | 42.30 |
| 4 | 其他资产 | 55,479,041.62 | 0.28 |

| | | | |
|---|----|-------------------|--------|
| 5 | 合计 | 20,164,609,172.19 | 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 | 283,983,558.01 | 1.18 |
| | 其中：买断式回购融资 | - | - |
| 2 | 报告期末债券回购融资余额 | 484,999,437.50 | 2.47 |
| | 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 | 112 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 85 |

注：

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。

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 | 21.77 | 2.47 |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30 天(含)-60 天 | 11.39 | 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 | 18.43 | 0.00 |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天 | - | - |

| | | | |
|---|------------------------|--------|------|
| | 天的浮动利率债 | | |
| 4 | 90 天(含)-120 天 | 7.55 | 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) | 43.10 | 0.00 |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 102.24 | 2.47 |

注：

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：本基金本报告期末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 | 354,421,408.15 | 1.80 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 975,347,196.47 | 4.96 |
| | 其中：政策性金融债 | 975,347,196.47 | 4.96 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 689,634,620.85 | 3.51 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 同业存单 | 8,361,208,008.05 | 42.51 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 10,380,611,233.52 | 52.78 |
| 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 | 112118331 | 21 华夏银行 CD331 | 3,500,000 | 345,498,158.81 | 1.76 |
| 2 | 210304 | 21 进出 04 | 3,000,000 | 300,070,864.19 | 1.53 |
| 3 | 112111137 | 21 平安银行 CD137 | 3,000,000 | 299,885,098.98 | 1.52 |
| 4 | 112172153 | 21 昆仑银行 CD106 | 3,000,000 | 299,429,734.21 | 1.52 |
| 5 | 112113099 | 21 浙商银行 CD099 | 3,000,000 | 296,941,999.27 | 1.51 |

| | | | | | |
|----|-----------|------------------|-----------|----------------|------|
| 6 | 112114157 | 21 江苏银行 CD157 | 3,000,000 | 294,784,778.91 | 1.50 |
| 7 | 210206 | 21 国开 06 | 2,700,000 | 270,056,175.93 | 1.37 |
| 8 | 112199901 | 21 南京银行 CD106 | 2,500,000 | 249,894,167.99 | 1.27 |
| 9 | 112111127 | 21 平安银行 CD127 | 2,500,000 | 247,783,698.48 | 1.26 |
| 10 | 219959 | 21 贴现国债 59 | 2,500,000 | 247,535,206.33 | 1.26 |

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 | 0.0291% |
| 报告期内偏离度的最低值 | -0.0100% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0051% |

注：

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 报告期末按摊余成本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 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。

5.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

江苏银行股份有限公司于 2020 年 12 月 31 日受到中国银保监会江苏监管局给予罚款 240 万元的行政处罚。

国家开发银行于 2021 年 1 月 8 日受到中国银保监会给予罚款 4880 万的行政处罚。

中国进出口银行于 2021 年 7 月 16 日受到中国银保监会给予罚款 7345.6 万元的行政处罚。

浙商银行股份有限公司于 2021 年 4 月 6 日受到中国银行间市场交易商协会给予罚款 20 万元的行政处罚；于 2021 年 7 月 26 日受到国家外汇管理局责令改正，警告，没收违法所得 560.3 万元，并给予罚款 267 万元的行政处罚；于 2021 年 10 月 29 日受到中国人民银行给予罚款 65 万元的行政处罚。

华夏银行股份有限公司于 2021 年 5 月 21 日受到中国银保监会给予罚款 9830 万元的行政处罚；于 2021 年 8 月 20 日受到中国人民银行给予罚款 486 万元的行政处罚。

平安银行股份有限公司于 2021 年 6 月 8 日受到中国银保监会云南监管局给予罚款 210 万元的行政处罚；于 2021 年 9 月 29 日受到国家外汇管理局责令改正、给予警告，给予罚款 187 万元和没收违法所得 1.58 万元的行政处罚。

南京银行股份有限公司于 2020 年 12 月 31 日受到中国人民银行警告，给予罚款 736 万元并没收违法所得人民币 20.8 万元。

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。

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 | 55,478,841.56 |
| 4 | 应收申购款 | 200.06 |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 其他 | - |
| 7 | 合计 | 55,479,041.62 |

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 | 12,766,971,584.22 | 7,166,383,909.05 |

| | | |
|--------------|-------------------|-------------------|
| 报告期期间基金总申购份额 | 52,301,913,837.20 | 46,996,696,611.63 |
| 报告期期间基金总赎回份额 | 52,400,438,821.41 | 47,163,936,141.31 |
| 报告期期末基金份额总额 | 12,668,446,600.01 | 6,999,144,379.37 |

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。

§ 7 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

无

§ 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、国金金腾货币市场证券投资基金基金合同；
- 3、国金金腾货币市场证券投资基金托管协议；
- 4、国金金腾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

2022 年 1 月 21 日