

# 国金金腾通货币市场证券投资基金 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 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：2022 年 8 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。本中期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 2022 年 8 月 29 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未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	<b>6</b>
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	10
<b>§4 管理人报告</b>	<b>11</b>
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 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	14
<b>§5 托管人报告</b>	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>16</b>
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17

6.3 净资产（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	20
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>49</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	49
7.2 债券回购融资情况.....	49
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	49
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
7.6 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序的前十名债券投资明细.....	51
7.7 “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.....	51
7.8 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序的所有资产支持证券投资明 细.....	52
7.9 投资组合报告附注.....	52
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>54</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
8.4 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的情况.....	55
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>55</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>56</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
10.2 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.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	58
10.9 其他重大事件.....	58
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>60</b>

---

11.1 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 .....	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	60
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>61</b>
12.1 备查文件目录.....	61
12.2 存放地点.....	61
12.3 查阅方式.....	61

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国金金腾货币市场证券投资基金	
基金简称	国金金腾货币	
场内简称	-	
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	24,387,624,972.15 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:	国金金腾货币 A	国金金腾货币 C
下属分级基金场内简称:	-	-
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	16,129,803,975.09 份	8,257,820,997.06 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。	
	国金金腾货币 A	国金金腾货币 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	姓名	张丽	罗菲菲

人	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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.gfund.com
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	国金金腾通货币 A	国金金腾通货币 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期( 2022 年 1 月 1 日 - 2022 年 6 月 30 日 )	报告期( 2022 年 1 月 1 日 - 2022 年 6 月 30 日 )
本期已实现收益	194, 149, 676. 07	60, 622, 058. 54
本期利润	194, 149, 676. 07	60, 622, 058. 54
本期净值收益率	1. 1264%	0. 7512%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末( 2022 年 6 月 30 日 )	
期末基金资产净值	16, 129, 803, 975. 09	8, 257, 820, 997. 06
期末基金份额净值	1. 0000	1. 0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末( 2022 年 6 月 30 日 )	
累计净值收益率	32. 7825%	16. 5915%

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
过去一个月	0. 1651%	0. 0003%	0. 0288%	0. 0000%	0. 1363%	0. 0003%
过去三个月	0. 5370%	0. 0005%	0. 0873%	0. 0000%	0. 4497%	0. 0005%
过去六个月	1. 1264%	0. 0005%	0. 1736%	0. 0000%	0. 9528%	0. 0005%
过去一年	2. 3584%	0. 0005%	0. 3500%	0. 0000%	2. 0084%	0. 0005%
过去三年	7. 6433%	0. 0013%	1. 0510%	0. 0000%	6. 5923%	0. 0013%
自基金合同生效起至今	32. 7825%	0. 0074%	2. 9304%	0. 0000%	29. 8521%	0. 0074%

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
过去一个月	0. 1032%	0. 0003%	0. 0288%	0. 0000%	0. 0744%	0. 0003%
过去三个月	0. 3494%	0. 0005%	0. 0873%	0. 0000%	0. 2621%	0. 0005%

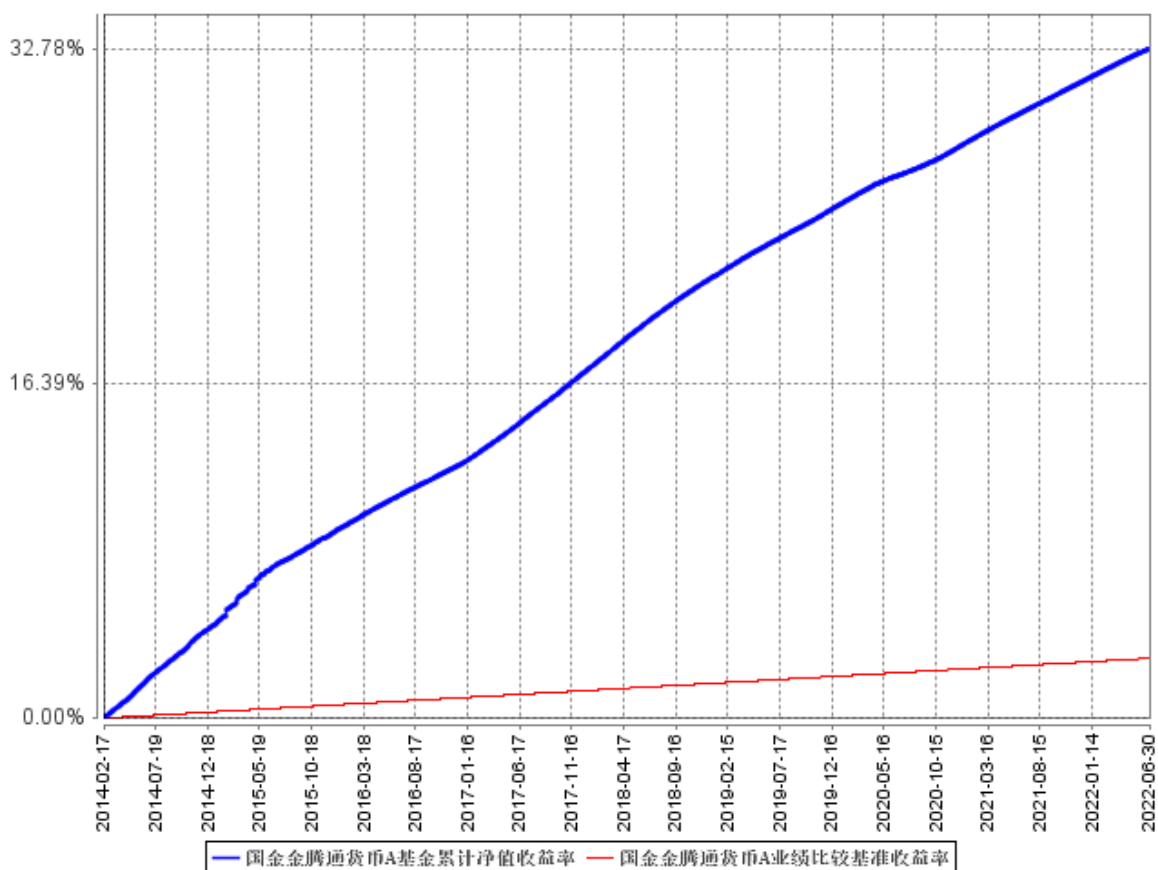


过去六个月	0.7512%	0.0005%	0.1736%	0.0000%	0.5776%	0.0005%
过去一年	1.5939%	0.0005%	0.3500%	0.0000%	1.2439%	0.0005%
过去三年	5.2489%	0.0013%	1.0510%	0.0000%	4.1979%	0.0013%
自基金合同生效起至今	16.5915%	0.0026%	2.3666%	0.0000%	14.2249%	0.0026%

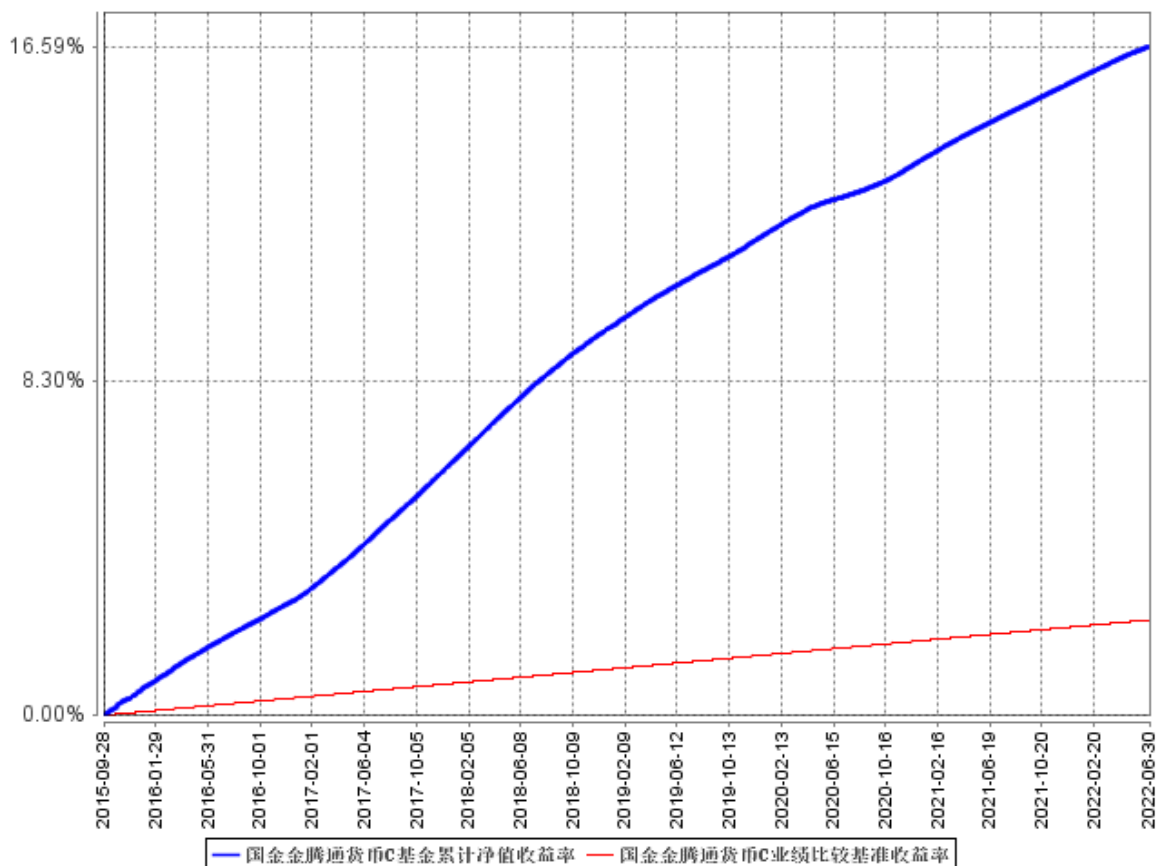
注：本基金的业绩比较基准为：人民币活期存款利率(税后)。

### 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

国金金腾通货币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 2022 年 6 月 30 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 6 月 30 日。

### 3.3 其他指标

注：无

## § 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49%、19.5%、19.5%、7%、1.5%、1.9%和1.6%。截至2022年6月30日，国金基金管理有限公司共管理28只公募基金，具体包括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指数增强证券投资基金、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、国金上证50指数增强证券投资基金（LOF）、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）、国金及第中短债债券型证券投资基金、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、国金量化多因子股票型证券投资基金、国金惠盈纯债债券型证券投资基金、国金惠鑫短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、国金惠安利率债债券型证券投资基金、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、国金鑫悦经济新动能混合型证券投资基金、国金惠宁中短期利率债债券型证券投资基金、国金自主创新混合型证券投资基金、国金惠诚债券型证券投资基金、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、国金惠利纯债债券型证券投资基金、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。

#### 4.1.3 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。

### 4.2 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 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

回顾上半年，一二月份国内经济有向好趋势，但三月以来多地疫情爆发中断了经济修复进程，极大的冲击了生产生活的正常秩序，海外面临俄乌冲突引发大宗商品价格上涨以及美联储进入加

息缩表周期等不利因素，进入五月后，疫情逐步得到控制，经济活动有序恢复，经济增长触底反弹。在复杂的海内外局势下，经济发展取得的成绩值得充分肯定。在此背景下，上半年货币政策维持宽松，降息、降准等总量工具以及结构性工具陆续推出，货币市场收益率显著下行。

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。

#### 4.4.2 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 1.1264%，同期业绩比较基准收益率为 0.1736%。

本报告期，本基金 C 类份额净值增长率为 0.7512%，同期业绩比较基准收益率为 0.1736%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，7 月底召开的中央政治局会议定调下半年经济工作基调“疫情要防住、经济要稳住、发展要安全”，目前国内经济复苏的基础还不牢固，企业和居民的信心不强，财政政策的持续发力以及宽松的货币政策将继续为稳增长保驾护航。策略方面，在宽货币到宽信用的传导过程中，密切关注央行货币政策的边际变化，灵活调整仓位和久期，提升组合收益。

#### 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，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，并每日进行支付。

#### **4.8 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》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，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，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，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规定进行。

### 5.3 托管人对本中期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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 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 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	8,622,636,173.71	8,529,410,757.63
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	12,756,449,551.73	10,380,611,233.52
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		12,756,449,551.73	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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	4,020,946,939.04	1,199,108,139.42
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		168,484.21	200.06
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	55,478,841.56
资产总计		25,400,201,148.69	20,164,609,172.19
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		1,000,071,041.10	484,999,437.50
应付清算款		-	-



应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		4,397,455.45	4,137,861.52
应付托管费		1,099,363.84	1,034,465.40
应付销售服务费		5,474,232.26	5,137,757.31
应付投资顾问费		-	-
应交税费		65,561.33	43,480.08
应付利润		1,161,632.13	1,358,884.69
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	306,890.43	306,306.31
负债合计		1,012,576,176.54	497,018,192.81
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	24,387,624,972.15	19,667,590,979.38
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-	-
净资产合计		24,387,624,972.15	19,667,590,979.38
负债和净资产总计		25,400,201,148.69	20,164,609,172.19

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，国金金腾通货币 A 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 16,129,803,975.09 份；国金金腾通货币 C 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 8,257,820,997.06 份。国金金腾通货币份额总额合计为 24,387,624,972.15 份。

## 6.2 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 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		319,495,561.49	300,630,194.41
1.利息收入		168,565,745.87	300,029,651.02
其中：存款利息收入	6.4.7.13	128,902,430.53	146,900,017.01
债券利息收入		-	115,128,937.21
资产支持证券利息收入		-	4,751,513.58
买入返售金融资产收入		39,663,315.34	33,249,183.22
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		150,909,514.25	599,803.39
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	150,909,514.25	599,803.39
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-

衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	-	-
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）	6.4.7.20	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	20,301.37	740.00
<b>减：二、营业总支出</b>		64,723,826.88	54,801,007.55
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	25,253,700.72	21,090,909.30
2. 托管费	6.4.10.2.2	6,313,425.19	5,272,727.42
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	30,234,137.38	26,202,053.44
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		2,712,285.88	2,041,999.90
其中：卖出回购金融资产支出		2,712,285.88	2,041,999.90
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		29,646.40	18,005.16
8. 其他费用	6.4.7.23	180,631.31	175,312.33
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		254,771,734.61	245,829,186.86
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		254,771,734.61	245,829,186.86
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		254,771,734.61	245,829,186.86

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

### 6.3 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 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 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)	4,720,033,992.77	-	-	4,720,033,992.77
(一)、综合收益总额	-	-	254,771,734.61	254,771,734.61
(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)	4,720,033,992.77	-	-	4,720,033,992.77
其中: 1.基金申购款	187,380,089,865.77	-	-	187,380,089,865.77
2.基金赎回款	-182,660,055,873.00	-	-	-182,660,055,873.00
(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)	-	-	-254,771,734.61	-254,771,734.61
(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)	24,387,624,972.15	-	-	24,387,624,972.15
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 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)	2,434,046,755.89	-	-	2,434,046,755.89
(一)、综合收益总额	-	-	245,829,186.86	245,829,186.86
(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)	2,434,046,755.89	-	-	2,434,046,755.89
其中: 1.基金申购款	183,532,622,405.20	-	-	183,532,622,405.20
2.基金赎回款	-181,098,575,649.31	-	-	-181,098,575,649.31
(三)、本期向基金份额	-	-	-245,829,186.86	-245,829,186.86

持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）				
（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）	20,235,884,666.00	-	-	20,235,884,666.00

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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。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（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)。

#### 6.4.2 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(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3号《半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。

#### 6.4.3 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2022年6月30日的财务状况以及2022年1月1日至2022年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

除下述变更后的会计政策外,本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

##### 6.4.4.1 会计年度

-

##### 6.4.4.2 记账本位币

-

##### 6.4.4.3 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。

#### 6.4.4.4 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有关过去事项、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。

#### **6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则**

-

#### **6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

-

#### **6.4.4.7 实收基金**

-

#### **6.4.4.8 损益平准金**

-

#### **6.4.4.9 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

使用自有资金予以弥补；

(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。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

-

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

-

#### 6.4.4.12 分部报告

-

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

-

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

##### 新金融工具准则

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

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。

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。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

##### 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。

## 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。

## 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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	1,700,924.29
等于：本金	1,700,743.50
加：应计利息	180.79
减：坏账准备	-
定期存款	8,620,935,249.42
等于：本金	8,600,000,000.00
加：应计利息	20,935,249.42
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	1,500,960,416.61
存款期限 3 个月以上	7,119,974,832.81
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计：	8,622,636,173.71

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 6 月 30 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	12,756,449,551.73	12,766,637,474.66	10,187,922.93	0.0418%
	合计	12,756,449,551.73	12,766,637,474.66	10,187,922.93	0.0418%
	资产支持证券	-	-	-	-

合计	12,756,449,551.73	12,766,637,474.66	10,187,922.93	0.0418%
----	-------------------	-------------------	---------------	---------

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。

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 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6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	4,020,946,939.04	-
合计	4,020,946,939.04	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无

#### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无

### 6.4.7.5 债权投资

#### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无

#### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无

**6.4.7.6 其他债权投资****6.4.7.6.1 其他债权投资情况**

注：无

**6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况**

注：无

**6.4.7.7 其他权益工具投资****6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

注：无

**6.4.7.8 其他资产**

注：无

**6.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30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	178,575.69
其中：交易所市场	-
银行间市场	178,575.69
-	-
应付利息	-
预提费用	128,314.74
合计	306,890.43

**6.4.7.10 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6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
本期期初	12,668,446,600.01	12,668,446,600.01
本期申购	96,342,404,003.21	96,342,404,003.21

本期赎回(以“-”号填列)	-92,881,046,628.13	-92,881,046,628.13
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	16,129,803,975.09	16,129,803,975.09

金额单位：人民币元

国金金腾通货币 C		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
本期期初	6,999,144,379.37	6,999,144,379.37
本期申购	91,037,685,862.56	91,037,685,862.56
本期赎回(以“-”号填列)	-89,779,009,244.87	-89,779,009,244.87
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	8,257,820,997.06	8,257,820,997.06

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。

**6.4.7.11 其他综合收益**

注：无

**6.4.7.12 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	194,149,676.07	-	194,149,676.07
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	-194,149,676.07	-	-194,149,676.07
本期末	-	-	-

单位：人民币元

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	60,622,058.54	-	60,622,058.54
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	-60,622,058.54	-	-60,622,058.54
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.13 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6月30日
活期存款利息收入	12,353.20
定期存款利息收入	128,890,077.33
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	128,902,430.53

#### 6.4.7.14 股票投资收益

注：无

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 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6月30日
债券投资收益——利息收入	148,436,669.87
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	2,472,844.38
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	150,909,514.25



**6.4.7.15.2 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6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	16,595,199,281.37
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	16,548,913,376.70
减：应计利息总额	43,813,060.29
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	2,472,844.38

**6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入**

注：无

**6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：无

**6.4.7.16 资产支持证券投资收益****6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

注：无

**6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

注：无

**6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

注：无

**6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

注：无

**6.4.7.17 贵金属投资收益****6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

注：无

**6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：无

**6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：无

**6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：无

**6.4.7.18 衍生工具收益****6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：无

**6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：无

**6.4.7.19 股利收益**

注：无

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

注：无

**6.4.7.21 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
其他	20,301.37
合计	20,301.37

**6.4.7.22 信用减值损失**

注：无

**6.4.7.23 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	59,507.37
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-

上清所账户维护费	8,880.00
上清所查询服务费	600.00
中债债券账户维护费	9,000.00
银行费用	43,136.57
合计	180,631.31

#### 6.4.7.24 分部报告

无

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 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。

##### 6.4.8.2 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。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

无

**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

注：无

**6.4.10.1.2 债券交易**

注：无

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

注：无

**6.4.10.1.4 权证交易**

注：无

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

注：无

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	25,253,700.72	21,090,909.30
其中：支付销售机构的客户维护费	2,046,262.32	8,787,807.38

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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	6,313,425.19	5,272,727.42

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。

#### 6.4.10.2.3 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 6 月 30 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	-	28,871,174.07	28,871,174.07
合计	-	28,871,174.07	28,871,174.07
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 6 月 30 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	-	76,369.18	76,369.18
国金证券股份有限公司	-	25,108,753.82	25,108,753.82
合计	-	25,185,123.00	25,185,123.00

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登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 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

##### 6.4.10.4.2 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

国金金腾通货币 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022 年 6 月 30 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	909,824,390.20	5.6406%	399,875,363.36	3.1565%

国金金腾通货币 C

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022 年 6 月 30 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	86,371.59	0.0010%	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。

**6.4.10.5 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6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30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—活期存款	1,700,924.29	12,353.20	8,697,836.82	19,536.53
中国民生银行股份有限公司—定期存款	3,001,969,277.90	42,223,489.13	210,000,000.00	12,206,994.41

注：本基金的银行存款由基金托管人中国民生银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

**6.4.10.6 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。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.11 利润分配情况**

金额单位：人民币元

## 国金金腾货币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
192,865,393.37	1,364,736.43	-80,453.73	194,149,676.07	-

## 国金金腾货币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
60,044,652.28	694,205.09	-116,798.83	60,622,058.54	-

**6.4.12 期末（2022年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注：无

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 1,000,071,041.10 元，是以如下债券作为质押的：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
210411	21 农发 11	2022 年 7 月 1 日	101.51	3,100,000	314,681,000.00
170212	17 国开 12	2022 年 7 月 1 日	103.62	3,000,000	310,860,000.00
200312	20 进出 12	2022 年 7 月 1 日	102.71	200,000	20,542,000.00
210312	21 进出 12	2022 年 7 月 1 日	101.63	1,500,000	152,445,000.00
160207	16 国开 07	2022 年 8 月 1 日	101.87	100,000	10,187,000.00
210308	21 进出 08	2022 年 7 月 1 日	101.14	2,700,000	273,078,000.00
合计				10,600,000	1,081,793,000.00

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 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。

#### 6.4.13.2 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。

##### 6.4.13.2.1 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6月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	101,448,978.68	-

A-1 以下	-	-
未评级	1,917,394,699.39	689,634,620.85
合计	2,018,843,678.07	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。

#### 6.4.13.2.2 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。

#### 6.4.13.2.3 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 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	9,317,334,637.79	8,361,208,008.05
合计	9,317,334,637.79	8,361,208,008.05

注：未评级包含发行期限小于 1 年的同业存单。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

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债券投资。

#### 6.4.13.2.5 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。

#### 6.4.13.2.6 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。

### 6.4.13.3 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。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

#### 6.4.13.3.2 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同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。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 2022 年 6 月 30	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
---------------------------------------	--------	--------	----------	-------	------------------	-----	----

日							
资产							
银行存款	2,312,305,562.31	2,405,275,389.18	3,905,055,222.22	-	-	-	8,622,636,173.71
交易性金融资产	1,133,530,994.68	5,943,987,275.03	5,092,604,668.60	586,326,613.42	-	-	12,756,449,551.73
买入返售金融资产	4,020,946,939.04	-	-	-	-	-	4,020,946,939.04
应收申购款	-	-	-	-	-	168,484.21	168,484.21
资产总计	7,466,783,496.03	8,349,262,664.21	8,997,659,890.82	586,326,613.42	-	168,484.21	25,400,201,148.69
负债							
卖出回购金融资产款	1,000,071,041.10	-	-	-	-	-	1,000,071,041.10
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,397,455.45	4,397,455.45
应付托管费	-	-	-	-	-	1,099,363.84	1,099,363.84
应付销售服务费	-	-	-	-	-	5,474,232.26	5,474,232.26
应付交易费用	-	-	-	-	-	178,575.69	178,575.69
应交税费	-	-	-	-	-	65,561.33	65,561.33
应付利润	-	-	-	-	-	1,161,632.13	1,161,632.13
其他负债	-	-	-	-	-	128,314.74	128,314.74
负债	1,000,071,041.10	-	-	-	-	12,505,135.44	1,012,576,176.54

总计							
利率敏感 度缺口	6,466,712,454.93	8,349,262,664.21	8,997,659,890.82	586,326,613.42	-	-12,336,651.23	24,387,624,972.15
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
买入返售 金融资产	1,199,108,139.42	-	-	-	-	-	1,199,108,139.42
应收利息	-	-	-	-	-	55,478,841.56	55,478,841.56
应收申购 款	-	-	-	-	-	200.06	200.06
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
应付销售	-	-	-	-	-	5,137,757.31	5,137,757.31

服务费							
应付交易费用		-	-	-	-	144,460.20	144,460.20
应交税费		-	-	-	-	43,480.08	43,480.08
应付利息		-	-	-	-	32,546.11	32,546.11
应付利润		-	-	-	-	1,358,884.69	1,358,884.69
其他负债		-	-	-	-	129,300.00	129,300.00
负债总计	484,999,437.50		-	-	-	12,018,755.31	497,018,192.81
利率敏感度缺口	3,796,952,012.46	5,865,723,103.76	9,961,455,576.85		-	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。

#### 6.4.13.4.1.2 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。

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

注：无。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：本报告期末及上年度末，本基金未持有交易性权益类投资，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.4 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。			
假设	1. 置信区间 -		
	2. 观察期 -		
分析	风险价值 (单位：人民币元)	本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	-	-	-
	合计	-	-

注：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。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 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。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 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 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	0.00	0.00
第二层次	12,756,449,551.73	10,380,611,233.52
第三层次	0.00	0.00
合计	12,756,449,551.73	10,380,611,233.52

###### 6.4.14.2.2 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。

###### 6.4.14.3 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。

#### **6.4.14.4 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。

#### **6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

无



## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	12,756,449,551.73	50.22
	其中:债券	12,756,449,551.73	50.22
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	4,020,946,939.04	15.83
	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	8,622,636,173.71	33.95
4	其他各项资产	168,484.21	0.00
5	合计	25,400,201,148.69	100.00

### 7.2 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	1.12	
	其中:买断式回购融资	-	
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	1,000,071,041.10	4.10
	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%。

### 7.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 7.3.1 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	92
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	107
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	63

### 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。

#### 7.3.2 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	30.41	4.10
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	16.97	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	16.23	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	12.08	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	28.46	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		104.15	4.10

### 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：本基金本报告期未发生投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

### 7.5 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	1,420,271,235.87	5.82
	其中：政策性金融债	1,420,271,235.87	5.82
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	2,018,843,678.07	8.28
6	中期票据	-	-
7	同业存单	9,317,334,637.79	38.21
8	其他	-	0.02

9	合计	12,756,449,551.73	52.31
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

## 7.6 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序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	占基金资产净值比例(%)
1	112105162	21 建设银行 CD162	4,000,000	398,643,964.02	1.63
2	210411	21 农发 11	3,100,000	314,692,615.75	1.29
3	170212	17 国开 12	3,000,000	310,851,316.91	1.27
4	012280707	22 招商局 SCP002	3,000,000	301,835,171.08	1.24
5	112212079	22 北京银行 CD079	3,000,000	300,537,333.33	1.23
6	112114157	21 江苏银行 CD157	3,000,000	298,776,401.99	1.23
7	112297798	22 重庆农村商行 CD070	3,000,000	297,857,045.45	1.22
8	112291041	22 杭州银行 CD015	3,000,000	295,747,799.56	1.21
9	112208064	22 中信银行 CD064	3,000,000	293,356,680.06	1.20
10	210308	21 进出 08	2,700,000	273,069,370.47	1.12

## 7.7 “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	-
报告期内偏离度的最高值	0.0605%
报告期内偏离度的最低值	0.0130%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0373%

### 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。

## 7.8 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序的所有资产支持证券投资明细

注：无

## 7.9 投资组合报告附注

### 7.9.1 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。

### 7.9.2 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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体中，中国建设银行股份有限公司于 2021 年 8 月 20 日受到中国人民银行给予罚款 388 万元的行政处罚；于 2022 年 3 月 25 日受到中国银保监会给予罚款 470 万元的行政处罚。中国农业发展银行于 2022 年 3 月 25 日受到中国银保监会给予罚款 480 万元的行政处罚。国家开发银行于 2022 年 3 月 25 日受到中国银保监会给予罚款 440 万元的行政处罚。北京银行股份有限公司于 2021 年 9 月 30 日受到北京银保监局给予责令改正并给予罚款 820 万元的行政处罚；于 2021 年 11 月 29 日受到北京银保监局罚款 40 万元的行政处罚。重庆农村商业银行股份有限公司于 2022 年 1 月 28 日受到重庆银保监局给予罚款 80 万元的行政处罚；于 2022 年 6 月 17 日受到重庆人民银行给予罚款 255 万元的行政处罚。杭州银行股份有限公司于 2022 年 5 月 31 日受到浙江银保监局给予罚款 580 万元的行政处罚。中信银行股份有限公司于 2021 年 11 月 20 日受到国家市场监督管理总局给予罚款 50 万元的行政处罚；于 2022 年 3 月 25 日受到中国银保监会给予罚款 290 万元的行政处罚。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 万的行政处罚；于 2022 年 3 月 25 日受到中国银保监会给予罚款 420 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。

### 7.9.3 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	168,484.21
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	168,484.21

#### 7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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	235,113	68,604.48	5,721,747,887.07	35.47%	10,408,056,088.02	64.53%
国金金腾通货币 C	298,626	27,652.72	111,035,027.53	1.34%	8,146,785,969.53	98.66%
合计	533,739	45,692.04	5,832,782,914.60	23.92%	18,554,842,057.55	76.08%

### 8.2 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	909,824,390.20	3.73%
2	银行类机构	811,398,612.24	3.33%
3	银行类机构	800,111,494.98	3.28%
4	银行类机构	404,958,965.56	1.66%
5	银行类机构	320,881,873.91	1.32%
6	银行类机构	203,781,447.19	0.84%
7	银行类机构	203,512,588.51	0.83%
8	银行类机构	203,002,123.83	0.83%
9	银行类机构	202,381,111.24	0.83%
10	银行类机构	202,160,434.40	0.83%

### 8.3 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	662,197.17	0.0041%

	国金金腾通 货币 C	476,026.17	0.0058%
	合计	1,138,223.34	0.0047%

#### 8.4 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的情况

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 开放式基金份额变动

单位：份

	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额总额	12,668,446,600.01	6,999,144,379.37
本报告期基金总申购份额	96,342,404,003.21	91,037,685,862.56
减：本报告期基金总赎回份额	92,881,046,628.13	89,779,009,244.87
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-” 填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	16,129,803,975.09	8,257,820,997.06

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。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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

本基金管理人董事会于 2021 年 12 月 13 日审议通过了《关于批准国金基金管理有限公司原任董事、总经理尹庆军先生辞职的议案》、《关于董事长纪路先生提名邵海波先生担任国金基金管理有限公司总经理的议案》等议案，邵海波先生自 2022 年 1 月 28 日起担任公司总经理职务。

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。

### 10.3 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。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金在报告期内投资策略无重大改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务至今，本报告期内会计师事务所未发生改变。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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	
中银国际证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-



安信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	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，向多家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。

2.2. 本基金本报告期新增东北证券一个交易单元。

### 10.7.2 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
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 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。

## 10.9 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》	指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》	指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》	指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》	指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》	指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》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022年2月17日
7	《国金金腾通货币市场证券投资基金招募说明书（更新）》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022年3月23日
8	《国金金腾通货币市场证券投资基金(国金金腾通货币A份额)基金产品资料概要（更新）》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022年3月23日
9	《国金金腾通货币市场证券投资基金(国金金腾通货币C份额)基金产品资料概要（更新）》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022年3月23日
10	《国金金腾通货币市场证券投资基金 2021 年年度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022年3月30日
11	《国金金腾通货币市场证券投资基金 2022 年第 1 季度报告》	指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》	指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》	指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》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022年5月28日

注：本报告期内，基金管理人按照《公开募集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。

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无
---

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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。

### 12.2 存放地点

本基金基金管理人的办公场所：北京海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 87 号 D 座 14 层。

### 12.3 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 8 月 30 日