

# 金鹰现金增益交易型货币市场基金

## 2017 年半年度报告

### 2017 年 6 月 30 日

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年八月二十六日

## 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。本半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。

基金托管人招商证券根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 3 月 20 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>2 基金简介</b> .....	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.....	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> .....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
<b>4 管理人报告</b> .....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
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.....	14
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> .....	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
<b>7 投资组合报告</b> .....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 债券回购融资情况.....	41
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	41
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.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细.....	42
7.7“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	43
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	43
7.9 投资组合报告附注.....	43
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	45

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	45
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 .....	45
<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>46</b>
<b>10 重大事件揭示</b> .....	<b>46</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	46
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 .....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	46
10.4 基金投资策略的改变 .....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	47
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 .....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	47
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况 .....	48
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>48</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 .....	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	48
<b>12 备查文件目录</b> .....	<b>48</b>
12.1 备查文件目录 .....	48
12.2 存放地点 .....	48
12.3 查阅方式 .....	48

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	金鹰现金增益交易型货币市场基金		
基金简称	金鹰现金增益		
基金主代码	511770		
交易代码	511770		
基金运作方式	契约型		
基金合同生效日	2017 年 3 月 20 日		
基金管理人	金鹰基金管理有限公司		
基金托管人	招商证券股份有限公司		
报告期末基金份额总额	3,263,855,400.17 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	金鹰现金增益 A	金鹰现金增益 B	金鹰现金增益 E
下属分级基金的交易代码	004372	004373	511770
报告期末下属分级基金的份额总额	390,721,197.12 份	2,317,906,604.65 份	555,227,598.40 份

注：金鹰现金增益 E 类基金份额上市交易，E 类基金份额面值为 100 元。本表中列示 E 类份额数据面值已折算为 1 元。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持流动性的基础上，力争获得超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	<p>本基金结合“自上而下”和“自下而上”的研究方法对各类可投资资产进行合理的配置和选择。本基金将综合宏观经济运行状况，货币政策、财政政策等政府宏观经济状况及政策，分析资本市场资金供给状况的变动趋势，预测市场利率水平变动趋势，并审慎考虑各类资产的收益性、流动性及风险性特征，在风险与收益的配比中，力求将各类风险降到最低，并在控制投资组合良好流动性的基础上为投资者获取稳定的收益，具体投资策略包含以下几个层面：</p> <p>（一）整体资产配置策略</p> <p>首先根据宏观经济形势、央行货币政策、短期资金市场状况等因素对短期利率走势进行综合判断，然后形成利率动态预期，进而调整本基金投资组合的平均剩余期限。</p> <p>（二）类属配置策略</p> <p>本基金将合理配置各类短期金融工具，如央行票据、国债、金融债、企业短期融资券以及现金等投资品种，通过类属配置满足基金流动性需求并获得投资收益。本基金将对市场资金面、基金申购赎回金额的变化进行动态分析，在高流动性资产和流动性较低资产之间寻找平衡，以满足组合的日常流动性需求；基金管理人通过对各类属的相对收益、利差变化、流动性风险、信用风险等因素的分析来确定类属配置比例，选择具有投资价值的品种，以获取较高回报。</p>

	<p>(三) 债券类资产配置策略</p> <p>本基金以安全性为第一考量, 优先选择央票、短期国债等高信用等级的债券品种以回避信用违约风险。本基金还可配置外部信用评级等级较高(符合法规规定的级别)的企业债、短期融资券等信用类债券。在具体的券种选择上, 基金管理人将在正确拟合收益率曲线的基础上, 客观分析收益率出现偏离的原因, 寻找收益率明显偏高的券种。本基金将重点关注价格被低估品种。</p> <p>(四) 流动性管理策略</p> <p>本基金将对基金的申购赎回情况、季节性资金流动情况和日历效应等因素进行跟踪, 对投资组合的现金比例进行结构化管理, 使得基金具备较高的流动性。基金管理人将综合平衡基金资产在流动性资产和收益性资产之间的配置比例, 通过现金留存、持有高流动性券种、降低组合久期等方式提高基金资产整体的流动性, 将回购或债券的到期日进行均衡等量配置, 以确保基金资产的变现需求。</p> <p>(五) 逆回购策略</p> <p>基金管理人将密切关注由于季节性需求、新股申购等原因导致短期资金需求激增的机会, 通过逆回购的方式融出资金以分享短期资金利率陡升的投资机会。</p> <p>(六) 套利策略</p> <p>本基金根据对货币市场变动趋势、各市场和品种之间的风险收益差异的充分研究和论证, 积极把握由于市场短期失衡而带来的套利机会, 通过跨市场、跨品种、跨期限等套利策略, 力求获得安全的超额收益。</p> <p>(七) 资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将分析资产支持证券的资产特征, 估计违约率和提前偿付比率, 并利用收益率曲线和期权定价模型, 对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资, 以降低流动性风险。</p>
业绩比较基准	七天通知存款税后利率
风险收益特征	本基金为货币市场基金, 是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

### 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		金鹰基金管理有限公司	招商证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	苏文锋	郭杰
	联系电话	020-83282627	0755-82943666
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		4006135888,020-83936180	95565
传真		020-83282856	0755-82960794
注册地址		广东省珠海市香洲区水湾路 246号3栋2单元3D房	深圳市福田区益田路江苏大厦 38楼-45楼

办公地址	广州市天河区珠江东路28号越秀金融大厦30层	深圳市福田区益田路江苏大厦38楼-45楼
邮政编码	510623	518026
法定代表人	刘岩	霍达

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.gefund.com.cn">http://www.gefund.com.cn</a>
基金半年度报告备置地点	广东省广州市天河区珠江新城珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	金鹰基金管理有限公司	广东省广州市天河区珠江新城珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年3月20日(基金合同生效日)至2017年6月30日)		
	金鹰现金增益 A	金鹰现金增益 B	金鹰现金增益 E
本期已实现收益	7,532,532.04	24,808,134.67	10,942,182.78
本期利润	7,532,532.04	24,808,134.67	10,942,182.78
本期净值收益率	1.1776%	1.2310%	1.1978%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)		
	金鹰现金增益 A	金鹰现金增益 B	金鹰现金增益 E
期末基金资产净值	390,721,197.12	2,317,906,604.65	555,227,598.40
期末基金份额净值	1.00	1.00	100.00
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)		
	金鹰现金增益 A	金鹰现金增益 B	金鹰现金增益 E
累计净值收益率	1.1776%	1.2310%	1.1978%

注：1、所述基金业绩制表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；

2、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。

3、本基金收益分配按日结转份额。

### 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

##### 1. 金鹰现金增益 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	0.3381%	0.0011%	0.1110%	0.0000%	0.2271%	0.0011%
过去三个月	1.0028%	0.0012%	0.3366%	0.0000%	0.6662%	0.0012%
自基金合同生效 起至今	1.1776%	0.0017%	0.3810%	0.0000%	0.7966%	0.0017%

##### 2. 金鹰现金增益 B:

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	0.3542%	0.0011%	0.1110%	0.0000%	0.2432%	0.0011%
过去三个月	1.0503%	0.0012%	0.3366%	0.0000%	0.7137%	0.0012%
自基金合同生效 起至今	1.2310%	0.0017%	0.3810%	0.0000%	0.8500%	0.0017%

##### 3. 金鹰现金增益 E:

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	0.3377%	0.0011%	0.1110%	0.0000%	0.2267%	0.0011%
过去三个月	0.9987%	0.0013%	0.3366%	0.0000%	0.6621%	0.0013%
自基金合同生效 起至今	1.1978%	0.0034%	0.3810%	0.0000%	0.8168%	0.0034%

注：（1）本基金合同生效日期为 2017 年 3 月 20 日，目前仍在建仓期。

（2）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，期限在一年以内(含一年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单，剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券，以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

（3）本基金的业绩比较基准为：七天通知存款税后利率。

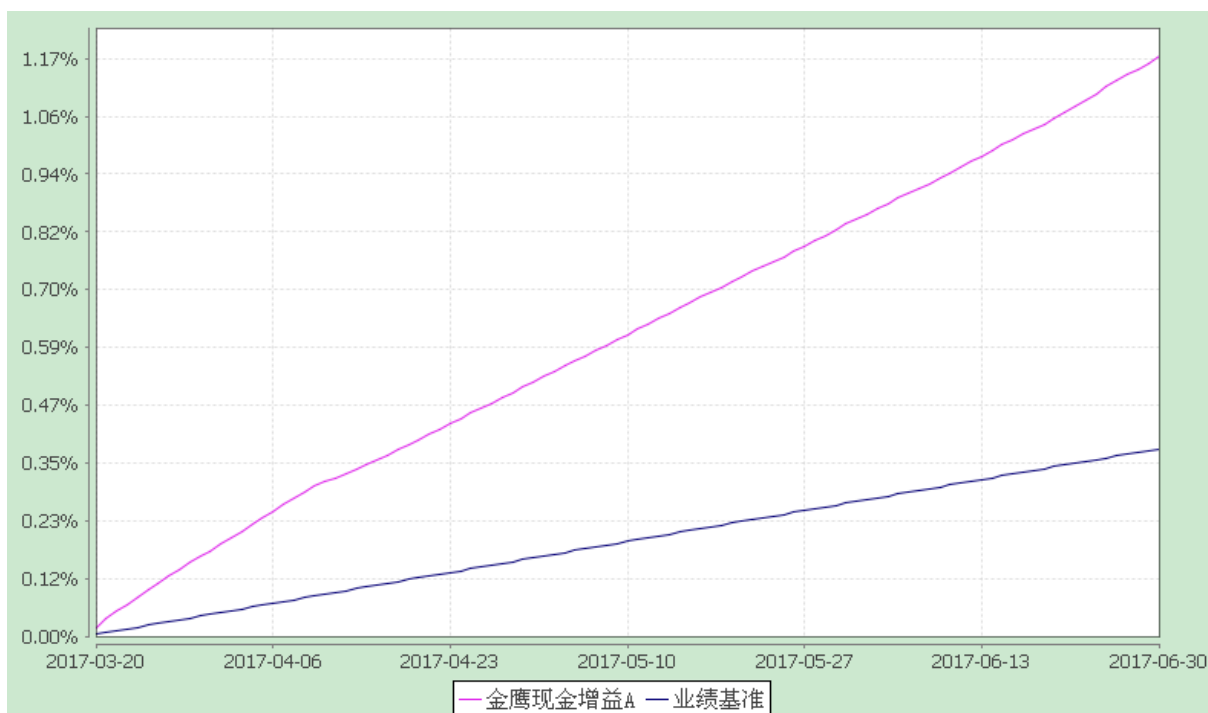
#### 3.2.2 自基金合同生效以来 基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



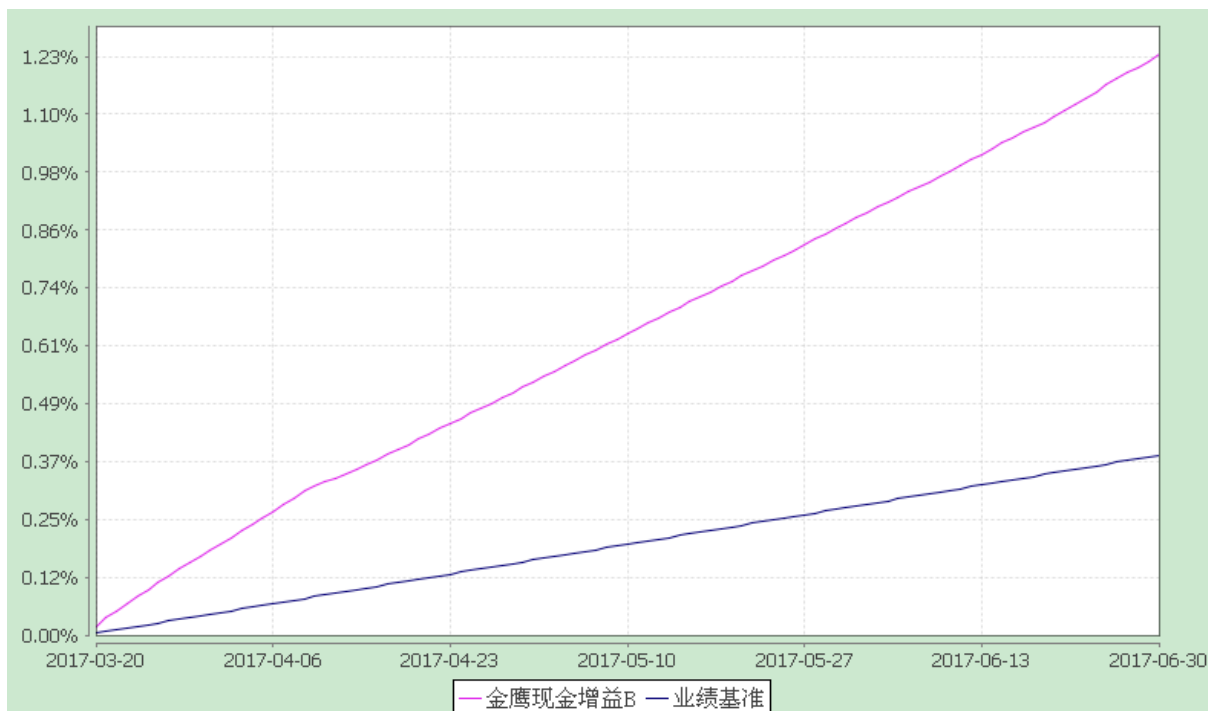
自基金合同生效以来份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017 年 3 月 20 日至 2017 年 6 月 30 日)

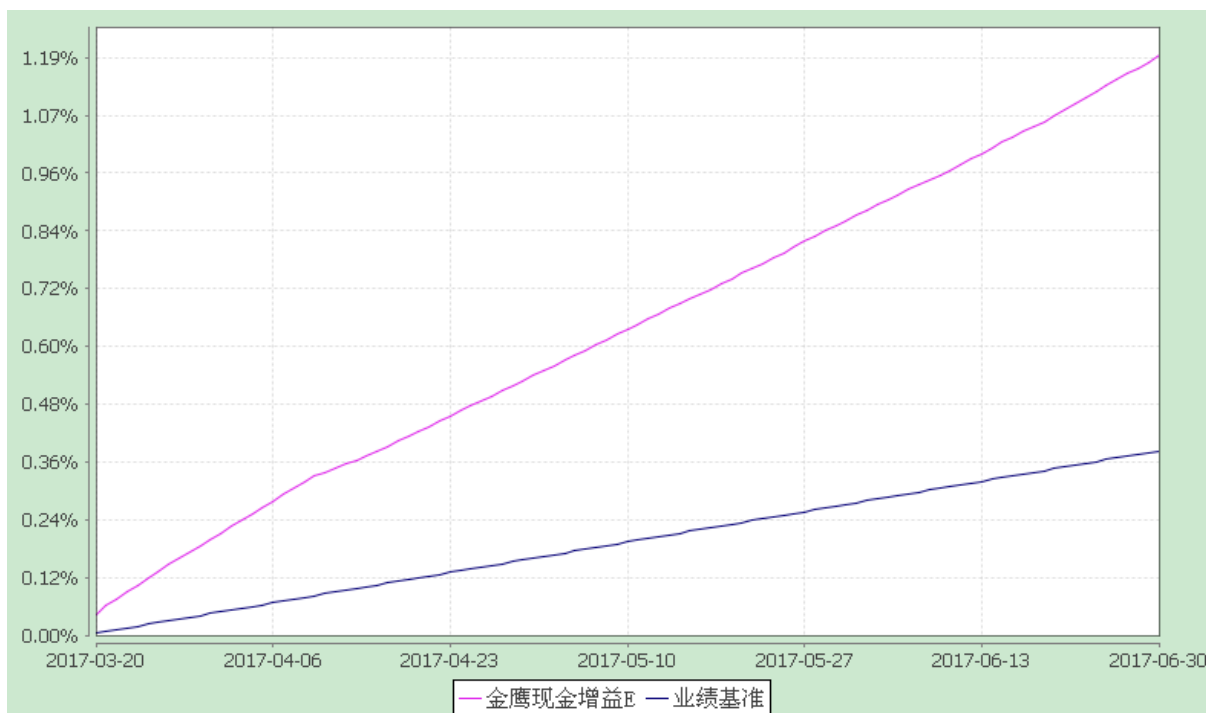
金鹰现金增益 A



金鹰现金增益 B



金鹰现金增益 E



注：（1）本基金合同生效日期为 2017 年 3 月 20 日，目前仍在建仓期。

（2）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，期限在一年以内(含一年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单，剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券，以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

（3）本基金的业绩比较基准为：七天通知存款税后利率。

## 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

金鹰基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]97 号文批准，于 2002 年 12 月 25 日成立，总部设在广州，目前注册资本 2.5 亿元人民币。2011 年 12 月公司获得特定客户资产管理计划业务资格，2013 年 7 月子公司-深圳前海金鹰资产管理有限公司成立。

“以人为本、互信协作；创新谋变、挑战超越”是金鹰人的核心价值观，在经营管理班子的带领下，公司追求以更高的标准为投资者提供贴心专业的财富管理服务，赢得市场认可。通过全体员工的奋发努力，公司各方面都发生了积极的蜕变，业绩和规模都有了较大的提升。

截至 2017 年 6 月 30 日，公司下设权益投资部等 18 个一级职能部门及北京、广州、上海、深圳、成都共五个分公司和一个子公司（深圳前海金鹰资产管理有限公司），管理公募基金 38 只，管

理资产规模 401.63 亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
刘丽娟	固定收益部总监， 基金经理	2017-03-20	-	10	刘丽娟女士，中南财经政法大学工商管理硕士，历任恒泰证券股份有限公司交易员，投资经理，广州证券股份有限公司资产管理总部固定收益投资总监。2014 年 12 月加入金鹰基金管理有限公司，任固定收益部总监。现任金鹰货币市场证券投资基金、金鹰添益纯债债券型证券投资基金、金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）、金鹰灵活配置混合型证券投资基金、金鹰元安混合型证券投资基金、金鹰元丰保本混合型证券投资基金、金鹰元祺保本混合型证券投资基金、金鹰元和保本混合型证券投资基金、金鹰添利中长期信用债债券型证券投资基金、金鹰添享纯债债券型证券投资基金、金鹰现金增益交易型货币市场基金、金鹰添荣纯债债券型证券投资基金、金鹰添惠纯债债券型证券投资基金、金鹰民丰回报定期开放混合型证券投资基金基金经理。
黄倩倩	基金经理	2017-06-06	-	5	黄倩倩女士，西南财经大学金融学硕士研究生，历任广州证券股份有限公司资产管理总部债券交易员，2014 年 11 月加入金鹰基金管理有限公司，担任固定收益部债券交易员，现任金鹰现金增益交易型货币市场基金基金经理及多个基金的基金经理助理。

注：1、任职日期和离任日期指公司公告聘任或解聘日期；

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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》和其他有关法律法规及其各项实施准则、本基金《基金合同》等法律文件的规定，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最大利益。本报告期内，基金运作基本合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

## 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，公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，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。

公司通过规范的投资交易流程、完善的权限管理机制、有效的交易控制制度，确保公平交易的实施。同时通过投资交易系统内的公平交易功能执行交易，不断强化事后监控分析，以尽可能确保公平对待各投资组合。

报告期，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 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

2017 年上半年以来，经济运行保持在合理区间，稳中向好态势趋于明显，GDP 同比增速 6.9%；工业生产持续改善，全国规模以上工业增加值同比实际增长 6.9%。投资方面，房屋销售持续向好，地产开工投资小幅回落，基建投资持续高位，制造业投资温和向上。通胀方面，CPI 从 1 月最高点持续下滑，维持在 1.5% 左右的低位区间，压力不大。

债市方面，整体收益呈现震荡态势。金融去杠杆成为今年监管主基调，MPA 考核对流动性进一步约束，资金面维持中性偏紧，市场预期偏悲观，存单的大量到期进一步抬升一级存单收益，带动一二级现券上行；直到监管发文称监管需维稳，避免发生处置风险的风险，央行呵护流动性态度显

现，没有跟随美联储加息，并利用 MLF、OMO 等工具全覆盖模式对冲了各种缺口，市场流动性显著改善，股债市场开始修复行情，债市长短端收益一并回落。

总体来看，资金面与央行货币政策紧紧相关。本基金在上半年采取了保守的配置策略，等到四月把握好了配置时点，逢低买入了一部分高收益存单和短融，在保证流动性和本金安全的情况下努力增加产品收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日，在本报告期内，本基金 A 类份额净值收益率为 1.1776%，业绩比较基准收益率为 0.3810%；B 类份额净值收益率为 1.2310%，业绩比较基准收益率为 0.3810%；E 类份额净值收益率为 1.1978%，业绩比较基准收益率为 0.3810%。

#### 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 2017 年下半年，基本面来看，中长期经济趋势走弱，短期仍相对平稳。投资方面，基建投资已处于高位，财政支出增速下滑将限制基建增速；工业投资改善空间有限；地产投资受之前房地产收紧政策影响将会维持一定程度的缓慢下行；需求的放缓可能对大宗商品价格构成压制，PPI 预计将逐步回落。通胀方面，预计 CPI 会继续维持低位。货币政策上，虽然央行并未跟随美国加息步伐，但金融去杠杆的政策主基调仍未改变，短期内资金面中性。

债市方面，震荡格局未变，牛市行情难见。虽然资金面短期宽松，皆为央行之前呵护季末流动性的结果；金融去杠杆政策还将继续，债市调整仍未结束，市场情绪依旧谨慎。投资方面，我们将继续关注利率走势，寻找一定的配置机会。基于以上判断，本基金将继续严控久期，根据市场情况调整杠杆比例并抓住市场机会，适时调整持仓债券。同时加大具有较高收益和高流动性的短期融资券与剩余期限在 1 年左右短融和存单的配置比例。

#### 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，本基金管理人严格遵守 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则》、2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》（证监会计字[2007]15 号）与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》（证监会公告[2008]38 号等相关规定和基金合同的约定，日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

为确保公司估值程序的正常进行，本公司还成立了资产估值委员会。资产估值委员会由公司总经 理、分管领导、权益投资部负责人、固定收益部负责人、研究部负责人、基金事务部负责人、基 金经理、投资经理、基金会计和相关人员组成。在特殊情况下，公司召集估值委员会会议，讨论和 决策特殊估值事项，估值委员会集体决策，需到会的三分之二估值委员会成员表决通过。

本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

报告期内,本基金未签约与估值相关的定价服务。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金 A 类份额在本报告期累计分配收益 7,532,532.04 元，其中以红利再投资方式结转入实收 基金 7,532,532.04 元；本基金 B 类份额在本报告期累计分配收益 24,808,134.67 元，其中以红利再投 资方式结转入实收基金 24,808,134.67 元；本基金 E 类份额在本报告期累计分配收益 10,942,182.78 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 10,942,182.78 元。

#### **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**

本报告期内无应当说明的预警事项。

## **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，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、 基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履 行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基 金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督， 未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

### **5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见**

本托管人复核审查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。

## 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：金鹰现金增益交易型货币市场基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日
资产：		-
银行存款	6.4.7.1	152,539,716.45
结算备付金		4,996,759.88
存出保证金		19,495.64
交易性金融资产	6.4.7.2	1,901,642,295.21
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		1,901,642,295.21
资产支持证券投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	1,676,387,199.07
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	4,211,407.81
应收股利		-
应收申购款		1,503,024.95
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	150,545.62
<b>资产总计</b>		<b>3,741,450,444.63</b>
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日
负债：		-
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债		-
卖出回购金融资产款		475,998,860.50
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		885,994.42
应付托管费		253,141.23
应付销售服务费		243,496.17
应付交易费用	6.4.7.7	61,976.60
应交税费		-
应付利息		50,407.34

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	101,168.20
负债合计		477,595,044.46
<b>所有者权益：</b>		-
实收基金	6.4.7.9	3,263,855,400.17
未分配利润	6.4.7.10	-
所有者权益合计		3,263,855,400.17
负债和所有者权益总计		3,741,450,444.63

注：1、本基金合同于 2017 年 3 月 20 日生效，故无上年度末数据；

2、截至 2017 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.0000 元，B 类基金份额净值 1.0000 元，E 类基金份额净值 100.0000 元。基金份额总额 3,263,855,400.17 份，其中 A 类基金份额的份额总额为 390,721,197.12 份，B 类基金份额的份额总额为 2,317,906,604.65 份，E 类基金份额的份额总额为 555,227,598.40 份，其中 E 类份额净值已折算为 1 元。

## 6.2 利润表

会计主体：金鹰现金增益交易型货币市场基金

本报告期：2017 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2017 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>50,730,350.59</b>
1.利息收入		51,487,202.82
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,868,455.20
债券利息收入		22,880,535.14
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		24,738,212.48
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-756,852.23
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-756,852.23
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-



5.其他收入（损失以“-”号填列）		-
<b>减：二、费用</b>		<b>7,447,501.10</b>
1. 管理人报酬		2,910,884.56
2. 托管费		831,681.26
3. 销售服务费		939,827.33
4. 交易费用	6.4.7.18	-
5. 利息支出		2,562,053.16
其中：卖出回购金融资产支出		2,562,053.16
6. 其他费用	6.4.7.19	203,054.79
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>43,282,849.49</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>43,282,849.49</b>

注：1、本基金合同于 2017 年 3 月 20 日生效，故无上年度可比期间数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金鹰现金增益交易型货币市场基金

本报告期：2017 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	43,282,849.49	43,282,849.49
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	3,263,855,400.17	-	3,263,855,400.17
其中：1.基金申购款	12,220,160,556.89	-	12,220,160,556.89
2.基金赎回款	-8,956,305,156.72	-	-8,956,305,156.72
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-43,282,849.49	-43,282,849.49
五、期末所有者权益（基金净值）	3,263,855,400.17	-	3,263,855,400.17

注：1、本基金合同于 2017 年 3 月 20 日生效，故无上年度可比期间数据；

2、本期基金份额交易产生的基金净值变动数中实收基金对应的基金申购款包含了本期经营活动而产生的红利再投金额。

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：

基金管理人负责人：刘岩，主管会计工作负责人：曾长兴，会计机构负责人：谢文君

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

金鹰现金增益交易型货币市场基金（简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（简称“中国证监会”）证监许可[2016]2827 号文《关于准予金鹰现金增益交易型货币市场基金注册的批复》批准，于 2017 年 3 月 20 日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次募集规模为 1,688,615,680.38 份基金份额。本基金募集期间自 2017 年 3 月 6 日起至 2017 年 3 月 10 日止，净认购额 1,688,615,680.38 元，认购资金在认购期间的银行利息 2,050.82 元折算成基金资产。上述资金已于 2017 年 3 月 16 日全额划入本基金在基金托管人招商证券股份有限公司开立的本基金托管专户。验资机构为中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）。基金管理人为金鹰基金管理有限公司，基金注册登记机构为金鹰基金管理有限公司，基金托管人为招商证券股份有限公司（简称“招商证券”）。

经上海证券交易所（以下简称“上交所”）上证基字[2017] 号审核同意，本基金 E 类基金份额 14,934,510.00 份于 2017 年 4 月 10 日在上交所挂牌交易。

根据《金鹰现金增益交易型货币市场基金基金合同》的有关规定，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，期限在一年以内(含一年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单，剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券，以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布并于 2014 年 7 月修改的《企业会计准则—基本准则》和 41 项具体会计准则及其应用指南、解释及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”），中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》和中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定而编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则和《证券投资基金会计核算业务指引》的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 3 月 20 日至 2017 年 6 月 30 日的经营成

果和基金净值变动情况等有关信息。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

## 6.4.4 重要会计政策和会计估计

### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。

### 6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1. 金融资产的分类 根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时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贷款及应收款项。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债券投资，在资产负债表中作为交易性金融资产列报。本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

2. 金融负债的分类 根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时全部划分为其他金融负债。其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

### 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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认，相关交易费用计入初始确认金额。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时支付的价款中包含已宣告但尚未发放的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。本基金对所持有的债券投资、贷款及应收款项和其他金融负债以摊余成本法进行后续计量。本会计期间内，本基金持有的债券投资的摊余成本接近其公允价值。

满足下列条件之一的金融资产，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且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；(3)该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。

1. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

## 债券投资

买入银行间市场交易的债券于交易日按应付或实际支付的全部价款(不含应收利息)入账,相关交易费用计入债券投资的初始成本。

买入央行票据和零息债券等贴现债券,于交易日按应付或实际支付的全部价款入账,相关交易费用计入债券投资的初始成本。

卖出银行间市场交易的债券于交易日确认债券投资收益。卖出债券按移动加权平均法结转成本。

## 2. 贷款及应收款项

### 买入返售金融资产

买入返售金融资产为本基金按照返售协议约定先买入再按固定价格返售证券等金融资产所融出的资金。

买入返售金融资产按交易日应支付或实际支付的全部价款入账,相关交易费用计入初始确认金额。买入返售金融资产于返售日按账面余额结转。

## 3. 其他金融负债

### 卖出回购金融资产款

卖出回购金融资产款为本基金按照回购协议先卖出再按固定价格买入票据、证券等金融资产所融入的资金。

卖出回购金融资产款于交易日按照应收或实际收到的金额入账,相关交易费用计入初始确认金额。卖出回购金融资产款于回购日按账面余额结转。

### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金的债券投资等金融资产,均以实际利率法计算的摊余成本估算公允价值。在本基金存续期间,基金管理人定期计算本基金投资组合摊余成本与其他可参考公允价值指标之间的偏离程度,并定期测试其他可参考公允价值指标确定方法的有效性。投资组合的摊余成本与其他可参考公允价值指标产生重大偏离的,按其他公允价值指标对组合的账面价值进行调整,调整差额确认为“公允价值变动损益”,并按其他公允价值指标进行后续计量。如基金份额净值恢复至 1 元,恢复使用摊余成本估算公允价值。如有确凿证据表明按上述方法不能客观反映交易性金融工具的公允价值,基金管理人将根据具体情况与基金托管人商定后确定最能反映公允价值的价格。

### 6.4.4.6 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,且目前可执行该种法定权利,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。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。每份基金份额面值为人民币 1.00 元。申购、赎回、转换及分红再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。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，以及因类别调整而引起的金鹰货币 A、金鹰货币 B 基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

#### 6.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

1. 利息收入 (1) 存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。(2) 本基金持有的付息债券、贴现券按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。(3) 买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

2. 投资收益 债券投资收益于交易日按卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

#### 6.4.4.9 费用的确认和计量

1. 本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 $\times 0.28\%$ 的年费率逐日计提。
2. 本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 $\times 0.08\%$ 的年费率逐日计提。
3. 本基金 A 级基金份额、B 级基金份额和 E 类基金份额的销售服务费分别按前一日该级基金资产净值的 0.20%、0.01%和 0.20%的年费率逐日计提。
4. 卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产的摊余成本在回购期限内以实际利率法逐日计提。

#### 6.4.4.10 基金的收益分配政策

- 1、本基金同一类别内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、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，为投资者记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资者记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资者不记收益；
- 4、本基金场外份额根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资者每日计

算当日收益并分配，每日进行支付。投资者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，因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止；若投资者在当日收益支付时，其当日净收益为正值，则为投资者增加相应的基金份额，其当日净收益为零，则保持投资者基金份额不变，基金管理人将采取必要措施尽量避免基金净收益小于零，若当日净收益小于零时，缩减投资者基金份额。若基金份额持有人赎回基金份额，当基金份额持有人全部赎回基金份额时，基金收益将立即结算并随赎回款项一起支付给投资者，如果基金收益为负，则扣减赎回金额；当基金份额持有人部分赎回基金份额时，不结算基金收益，若收益为负值且剩余的基金份额不足以弥补时，将自动按比例结转基金份额当前未付收益；基金管理人有权通过销售机构或自行向基金份额持有人追索，基金份额持有人应予支付；

5、本基金场内份额根据每日基金收益情况，以每百份基金已实现收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，计入投资者收益账户，投资者收益账户里的累计未付收益和其持有的基金份额一起参加当日的收益分配，若投资者收益账户内的累计收益不低于 100 元时，则 100 元整数倍的累计收益将兑付为相应场内基金份额。投资者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，因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止；投资者赎回基金份额时，其对应比例的累计收益将立即结清，以现金支付给投资者；若累计收益为负值，则从投资者赎回基金款中按比例扣除。投资者卖出部分基金份额时，不支付对应的收益；但投资者份额全部卖出时，以现金方式将全部累计收益与投资者结清；

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及对应的收益自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益；

7、投资者当日买入的基金份额自买入当日起享有基金的收益分配权益；当日卖出的基金份额自卖出当日起，不享有基金的收益分配权益；

8、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### **6.4.4.11 分部报告**

本基金本报告期内无分部报告。

#### **6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计**

无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**

本基金本报告期内无会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无差错更正。

### 6.4.6 税项

#### 1、印花税

根据财政部、国家税务总局财税字[2007]84 号文《关于调整证券（股票）交易印花税率的通知》的规定，自 2007 年 5 月 30 日起，调整证券（股票）交易印花税率，由原先的 1‰调整为 3‰；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税；

经国务院批准，根据财政部、国家税务总局《关于调整证券（股票）交易印花税率的通知》的规定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，证券（股票）交易印花税调整为单边征税，由出让方按证券（股票）交易印花税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

#### 2、营业税、增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》，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，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》，自 2016 年 5 月 1 日起，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、债券免征营业税或增值税。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，暂不缴纳企业所得税。

**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 2017年6月30日
活期存款	2,539,716.45
定期存款	150,000,000.00
其他存款	-
合计	152,539,716.45

**6.4.7.2 交易性金融资产**

单位：人民币元

项目		本期末 2017年6月30日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	1,901,642,29 5.21	1,903,028,000. 00	1,385,704.79	0.04
	合计	1,901,642,29 5.21	1,903,028,000. 00	1,385,704.79	0.04

注：1、偏离金额=影子定价-摊余成本；

2、偏离度=偏离金额/摊余成本确定的基金资产净值。

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

**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 2017年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,010,340,000.00	-
银行间市场	666,047,199.07	-
合计	1,676,387,199.07	-

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。



## 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	3,108.52
应收定期存款利息	347,638.73
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,023.65
应收债券利息	1,443,037.99
应收买入返售证券利息	2,414,026.38
应收申购款利息	1,564.62
其他	7.92
合计	4,211,407.81

## 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	150,545.62
合计	150,545.62

## 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	61,976.60
合计	61,976.60

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
其他应付款	-
审计费用	12,920.32
预提信息披露费	80,747.88
预提银行间账户维护费	7,500.00

合计	101,168.20
----	------------

**6.4.7.9 实收基金**

## 金鹰现金增益 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年3月20日（基金合同生效日）至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
本期申购	2,378,839,920.04	2,378,839,920.04
本期赎回（以“-”号填列）	-1,988,118,722.92	-1,988,118,722.92
本期末	390,721,197.12	390,721,197.12

注：1、申购份额含红利再投。

2、本基金基金合同于 2017 年 3 月 20 日生效，A 类基金份额为场外基金份额，份额净值为 1.00 元。

## 金鹰现金增益 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年3月20日（基金合同生效日）至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
本期申购	7,141,670,054.07	7,141,670,054.07
本期赎回（以“-”号填列）	-4,823,763,449.42	-4,823,763,449.42
本期末	2,317,906,604.65	2,317,906,604.65

注：1、申购份额含红利再投。

2、本基金基金合同于 2017 年 3 月 20 日生效，B 类基金份额为场外基金份额，份额净值为 1.00 元。

## 金鹰现金增益 E

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年3月20日（基金合同生效日）至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
本期申购	2,699,650,582.78	2,699,650,582.78

本期赎回（以“-”号填列）	-2,144,422,984.38	-2,144,422,984.38
本期末	555,227,598.40	555,227,598.40

注：1、申购份额含红利再投。

2、本基金基金合同于 2017 年 3 月 20 日生效，E 类基金份额为场内基金份额，场内份额折算日为基金合同生效当日。折算后 E 类基金份额的份额净值为 100.00 元。

#### 6.4.7.10 未分配利润

##### 金鹰现金增益 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	7,532,532.04	-	7,532,532.04
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	-7,532,532.04	-	-7,532,532.04
本期末	-	-	-

##### 金鹰现金增益 B

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	24,808,134.67	-	24,808,134.67
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	-24,808,134.67	-	-24,808,134.67
本期末	-	-	-

##### 金鹰现金增益 E

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	10,942,182.78	-	10,942,182.78
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	-10,942,182.78	-	-10,942,182.78
本期末	-	-	-

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2017年3月20日（基金合同生效日）至2017年6月30日
活期存款利息收入	434,507.97
定期存款利息收入	3,001,874.84
其他存款利息收入	419,148.27
结算备付金利息收入	12,850.29
其他	73.83
合计	3,868,455.20

**6.4.7.12 股票投资收益**

本基金本报告期内无买卖股票差价收入。

**6.4.7.13 债券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2017年3月20日（基金合同生效日）至2017年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,351,379,813.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,346,662,224.74
减：应收利息总额	5,474,441.09
买卖债券差价收入	-756,852.23

**6.4.7.14 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

**6.4.7.16 股利收益**

本基金本报告期内无股利收益。

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

本基金本报告期内无公允价值变动收益。

**6.4.7.18 交易费用**

本基金本报告期内无交易费用。

**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2017年3月20日（基金合同生效日）至2017年6月30日
审计费用	12,920.32
信息披露费	80,747.88
银行间账户维护费	7,960.00
银行汇划费	26,572.21
E 类份额 TA 结算服务费	74,454.38
账户开户费	400.00
合计	203,054.79

**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，本基金并无需做披露的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至本财务报表批准报出日，本基金无其他需做披露的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**

本基金本报告期不存在控制关系或其他利害关系的关联方发生变化的情况。

**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
广州证券股份有限公司	基金管理人股东、基金代销机构
招商证券股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
金鹰基金管理有限公司	基金发起人、管理人、基金销售机构

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****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**

1、本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的股票交易；

2、本基金合同于 2017 年 3 月 20 日生效，故无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

- 1、本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的权证交易；
- 2、本基金合同于 2017 年 3 月 20 日生效，故无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年3月20日（基金合同生效日）至 2017年6月30日	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券股份有限公司	119,392,823.08	100.00

注：1、本基金合同于 2017 年 3 月 20 日生效，故无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年3月20日（基金合同生效日）至 2017年6月30日	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券股份有限公司	7,577,402,000.00	100.00%

注：1、本基金合同于 2017 年 3 月 20 日生效，故无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

- 1、本基金本报告期无应支付关联方的佣金；
- 2、本基金合同于 2017 年 3 月 20 日生效，故无上年度可比期间数据。

#### 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 2017年3月20日（基金合同生效日）至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,910,884.56
其中：支付销售机构的客户	509,388.85

## 维护费

注：1、本基金合同于 2017 年 3 月 20 日生效，故无上年度可比期间数据；

2、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.28% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.28\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

## 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2017年3月20日（基金合同生效日）至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	831,681.26

注：1、本基金合同于 2017 年 3 月 20 日生效，故无上年度可比期间数据；

2、本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.08% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.08\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，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			
	2017年3月20日（基金合同生效日）至2017年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	金鹰现金增益 A	金鹰现金增益 B	金鹰现金增益 E	合计
中国建设银行股份有限公司	-	-	-	-
广州证券股份有限公司	51.41	-	1,025.57	1,076.98

金鹰基金管理有限公司	1,011.76	47,002.00	38,228.49	86,242.25
合计	1,063.17	47,002.00	39,254.06	87,319.23

注：1、本基金合同于 2017 年 3 月 20 日生效，故无上年度可比期间数据；

2、本基金 A 类基金份额的销售服务费年费率为 0.2%；本基金 B 类基金份额的销售服务费年费率为 0.01%；本基金 E 类基金份额的销售服务费年费率为 0.2%。

$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$

H 为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，自动在次月起 3 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，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

单位：人民币元

本期 2017年3月20日（基金合同生效日）至2017年6月30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
招商证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易；

2、本基金合同于 2017 年 3 月 20 日生效，故无上年度可比期间数据。

#### 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

截至本报告末，本基金管理人未持有本基金。

##### 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 2017年3月20日（基金合同生效日）至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商证券	2,539,716.45	434,507.97

注：1、本基金合同于 2017 年 3 月 20 日生效，故无上年度可比期间数据。



**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

- 1、本基金合同于 2017 年 3 月 20 日生效，故无上年度可比期间数据；
- 2、本基金本报告期无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

**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****1、金鹰现金增益 A**

单位：人民币元

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
7,532,532.04	-	-	7,532,532.04	-

**2、金鹰现金增益 B**

单位：人民币元

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
24,808,134.67	-	-	24,808,134.67	-

**3、金鹰现金增益 E**

单位：人民币元

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
10,942,182.78	-	-	10,942,182.78	-

**6.4.12 期末（2017 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**

- 1、本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券；
- 2、本基金合同于 2017 年 3 月 20 日生效，故无上年度可比期间数据。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

**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**

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
100219	10 国开 19	2017-07-07	99.90	200,000.00	19,980,000.00
120014	12 付息国债 14	2017-07-07	99.96	300,000.00	29,988,000.00
150207	15 国开 07	2017-07-07	100.43	500,000.00	50,215,000.00
179919	17 贴现国债 19	2017-07-07	99.81	200,000.00	19,962,000.00
179930	17 贴现国债 30	2017-07-07	99.23	500,000.00	49,615,000.00
111797558	17 重庆农村 商行 CD103	2017-07-03	82.81	600,000.00	49,688,000.00
111796486	17 长城华西 银行 CD053	2017-07-03	98.36	500,000.00	49,180,000.00
111798076	17 温州银行 CD111	2017-07-03	98.12	500,000.00	49,060,000.00
111795671	17 徽商银行 CD072	2017-07-03	98.66	500,000.00	49,330,000.00
111797611	17 广州农村 商业银行 CD082	2017-07-03	99.44	1,000,000.00	99,440,000.00
111797712	17 广州农村 商业银行 CD085	2017-07-03	99.41	500,000.00	49,705,000.00
合计				5,300,000.00	516,163,000.00

**6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购，因此没有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

**6.4.13 金融工具风险及管理**

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险等。基金成立以来，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，致力于内控机制的建立和完善，公司内部管理制度及业务规范流程的制定和完善，加强内部风险的控制与有效防范，以保证各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

**6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

为保证公司规范化运作，有效地防范和化解经营风险，确保基金和公司财务和其他信息真实、准确、完整、及时，从而最大程度地保护基金持有人的合法权益，本基金管理人奉行全面风险管理体系的建立，建立了科学合理、控制严密、运行高效的各项管理制度：

### 1、风险管理控制制度

风险控制制度由总则、风险控制的目标和原则、风险控制的机构设置、风险控制的程序、风险类型的界定、风险控制的主要措施、风险控制的具体制度、风险控制制度的监督与评价等部分组成。

风险控制的具体制度主要包括投资风险管理制度、交易风险控制制度、财务风险控制制度、公司资产管理制度等业务风险控制制度，以及岗位分离制度、业务空间隔离制度、作业规则、岗位职责、反馈制度、资料保全制度、保密制度、员工行为守则等程序性风险管理制度。

### 2、投资管理制度

投资管理制度包括研究业务管理制度、投资决策管理制度、基金交易管理制度等。

制订研究业务管理制度的目的是保持研究工作的独立、客观。研究业务管理制度包括：建立严密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法；根据基金合同要求，在充分研究的基础上建立和维护投资对象备选库；建立研究与投资的业务交流制度，保持通畅的交流渠道；建立研究报告质量评价体系。

制订投资决策业务管理制度的目的是严格遵守法律法规的有关规定，确保基金的投资符合基金合同所规定的投资目标、投资范围、投资策略、投资组合和投资限制等要求。投资决策业务管理制度包括投资决策授权制度；投资决策支持制度，重要投资要有详细的研究报告和风险分析支持；投资风险评估与管理制度，在设定的风险权限额度内进行投资决策；投资管理业绩评价制度等。

制订基金交易管理制度的目的是保证基金投资交易的安全、有效、公平。基金交易管理制度包括基金交易的集中交易制度；交易监测、预警、反馈机制；投资指令审核制度；投资指令公平分配制度；交易记录保管制度；交易绩效评价制度等。

### 3、监察稽核制度

监察稽核制度包括检查公司各业务部门和工作人员是否遵守法律、法规、规章的有关规定；检查公司各业务部门和工作人员对公司内部控制制度、各项管理制度、业务规章的执行情况；对公司各部门作业流程的遵守合规性和有效性的检查、监督、评价及建议等。

#### 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。本基金均投资于具有良好信用

等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

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；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，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 2017年6月30日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	-
合计	-

注：本统计数据未包含国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债、同业存单。

#### 6.4.13.2.2 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 2017年6月30日
AAA	-
AAA 以下	-
未评级	-
合计	-

注：本统计数据未包含国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债、同业存单。

#### 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。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例

要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月 30日	1个月 以内	1-3 个月	6个月 以内	3个月 -1年	6个月 -1年	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产										
银行存款	2,539,716.45	-	-	-	-	150,000,000.00	-	-	-	152,539,716.45
结算备付金	4,996,759.88	-	-	-	-	-	-	-	-	4,996,759.88
存出保证金	19,495.64	-	-	-	-	-	-	-	-	19,495.64
交易性金融资产	194,542,166.37	715,170,599.16	-	991,929,529.68	-	-	-	-	-	1,901,642,295.21
买入返售金融资产	1,676,387,199.07	-	-	-	-	-	-	-	-	1,676,387,199.07
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	4,211,407.81	4,211,407.81
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	1,503,024.95	1,503,024.95
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	150,545.62	150,545.62

资产总计	1,878,485,337.41	715,170,599.16	991,929,529.68	150,000,000.00				5,864,978.38	3,741,450,444.63
负债									
短期借款									
交易性金融负债									
卖出回购金融资产款	475,998,860.50								475,998,860.50
应付证券清算款									
应付赎回款									
应付管理人报酬								885,994.42	885,994.42
应付托管费								253,141.23	253,141.23
应付销售服务费								243,496.17	243,496.17
应付交易费用								61,976.60	61,976.60
应交税费									
应付利息								50,407.34	50,407.34
应付利润									
其他负债								101,168.20	101,168.20
负债总计	475,998,860.50							1,596,183.96	477,595,044.46
利率敏感度缺口	1,402,486,476.91	715,170,599.16	991,929,529.68	150,000,000.00				4,268,794.42	3,263,855,400.17

## 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 其他变量不变，只有利率变动通过债券公允价值变动对基金资产净值产生影响。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末
		2017年6月30日
	利率上升 25 个基点	-1,322,800.53
利率下降 25 个基点	1,322,800.53	

**6.4.13.4.2 外汇风险**

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

**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。本基金所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

**6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口**

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。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

**6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

## 金鹰现金增益 A

假设	市场其他变量保持不变，只有业绩比较基准所对应的市场组合价格发生合理、可能的变动；	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）
		本期末 2017年6月30日
	业绩比较基准变动+5%	4,557,984.29
	业绩比较基准变动-5%	-4,557,984.29

## 金鹰现金增益 B

假设	市场其他变量保持不变，只有业绩比较基准所对应的市场组合价格发生合理、可能的变动；	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）
		本期末 2017年6月30日
	业绩比较基准变动+5%	27,851,876.04
	业绩比较基准变动-5%	-27,851,876.04

## 金鹰现金增益 E

假设	市场其他变量保持不变，只有业绩比较基准所对应的市场组合价格发生合理、可能的变动；	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

	影响金额（单位：人民币万元）	
	本期末 2017 年 6 月 30 日	
业绩比较基准变动+5%		减少约 733
业绩比较基准变动-5%		增加约 733

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的不含权固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

## 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	1,901,642,295.21	50.83
	其中：债券	1,901,642,295.21	50.83
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,676,387,199.07	44.81
	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	157,536,476.33	4.21
4	其他各项资产	5,884,474.02	0.16
5	合计	3,741,450,444.63	100.00

注：其他资产包括：交易保证金、应收利息、应收证券清算款、其他应收款、应收申购款。

## 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	8.37	
	其中：买断式回购融资	0.03	
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	475,998,860.50	14.58
	其中：买断式回购融资	-	-

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金本报告期内不存在债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的情况。

## 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	68
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	76
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	0

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内不存在投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

### 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	50.75	14.58
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	14.19	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的	-	-

	浮动利率债		
3	60 天（含）—90 天	14.53	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	11.48	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	23.51	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
	合计	114.46	14.58

#### 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

本基金本报告期内不存在投资组合平均剩余期限超过 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	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	99,567,335.87	3.05
2	央行票据	-	-
3	金融债券	70,196,311.92	2.15
	其中：政策性金融债	70,196,311.92	2.15
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,731,878,647.42	53.06
8	其他	-	-
9	合计	1,901,642,295.21	58.26
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

#### 7.6 期末按摊余成本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)	摊余成本	占基金资产净
----	------	------	---------	------	--------

					值比例 (%)
1	111708079	17 中信银行 CD079	2,000,000.00	198,029,676.54	6.07
2	111795955	17 哈尔滨银行 CD077	1,000,000.00	99,805,320.41	3.06
3	111719130	17 恒丰银行 CD130	1,000,000.00	99,604,351.10	3.05
4	111797611	17 广州农村商业银行 CD082	1,000,000.00	99,440,679.83	3.05
5	111795881	17 江苏紫金农商行 CD052	1,000,000.00	98,597,172.74	3.02
6	111796818	17 吉林银行 CD070	1,000,000.00	98,369,828.62	3.01
7	111797409	17 广州农村商业银行 CD080	700,000.00	68,799,136.09	2.11
8	111799962	17 广东南粤银行 CD082	700,000.00	68,437,031.62	2.10
9	111797558	17 重庆农村商行 CD103	600,000.00	59,686,072.27	1.83
10	150207	15 国开 07	500,000.00	50,216,959.16	1.54

#### 7.7“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	0.0585%
报告期内偏离度的最低值	-0.0484%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0202%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内无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

本基金本报告期内正负偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

#### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.9 投资组合报告附注

**7.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。**

#### 7.9.2 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	19,495.64
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	4,211,407.81
4	应收申购款	1,503,024.95
5	其他应收款	-
6	待摊费用	150,545.62
7	其他	-
8	合计	5,884,474.02

### 7.9.3 其他需说明的重要事项

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 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
金鹰现金增益 A	3,651	107,017.58	2,305,255.06	0.59%	388,415,942.06	99.41%
金鹰现金增益 B	37	62,646,124.45	2,093,069,664.00	90.30%	224,836,940.65	9.70%
金鹰现金增益 E	2,484	223,521.58	133,254,623.62	24.00%	421,972,974.78	76.00%
合计	6,172	528,816.49	2,228,629,542.68	68.28%	1,035,225,857.49	31.72%

注：此处现金鹰金增益E份额是以单位净值为1.00元/份做了转换处理，实际上现金增益E的单位净值为100元/份。

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

### 金鹰现金增益 A

一级指金鹰现金增益货币 A (004372)，本份额基金非上市基金，无上市基金份额持有人。

### 金鹰现金增益B

二级指金鹰现金增益货币 B (004373)，本份额基金非上市基金，无上市基金份额持有人。

### 金鹰现金增益 E

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	南方资本—广发银行—广钜 2 号资产管理计划	1,001,994.00	18.05%
2	李维明	240,458.00	4.33%
3	徐善元	141,649.00	2.55%
4	上海金箬投资管理有限公司—金箬巴旗 1 号私募证券投资基金	78,000.00	1.41%
5	广发纳斯特投资管理有限公司—广发纳斯特策略优选 2 号证券投资基金	50,592.00	0.91%
6	王文军	50,174.00	0.90%
7	刘思	38,500.00	0.69%
8	戴芳芳	37,774.00	0.68%
9	张剑超	35,414.00	0.64%
10	娄宏洁	33,054.00	0.60%

注：三级指金鹰现金增益货币 E (511770)，本基金为上海证券交易所交易型货币基金，此处份额的单位净值为 100 元/份。

## 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	金鹰现金增益 A	1,434.43	0.00%
	金鹰现金增益 B	-	-
	金鹰现金增益 E	-	-
	合计	1,434.43	0.00%

## 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	金鹰现金增益 A	0
	金鹰现金增益 B	0
	金鹰现金增益 E	0
	合计	0

本基金基金经理持有本开放式基金	金鹰现金增益 A	0
	金鹰现金增益 B	0
	金鹰现金增益 E	0
	合计	0

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	金鹰现金增益 A	金鹰现金增益 B	金鹰现金增益 E
基金合同生效日（2017 年 3 月 20 日）基金份额总额	10,164,981.22	185,001,749.98	1,493,451,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	2,368,674,938.82	6,956,668,304.09	1,206,199,582.78
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,988,118,722.92	4,823,763,449.42	2,144,422,984.38
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	390,721,197.12	2,317,906,604.65	555,227,598.40

注：1、总申购份额包含因份额升降级导致的强制调增份额，总赎回份额包含因份额升降级导致的强制调减份额。

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会，无会议决议。

### 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

1、经本基金管理人第五届董事会第 40 次会议审议通过，报中国证券投资基金业协会备案，并于 2017 年 6 月 29 日在证监会指定媒体披露，陈瀚同志从 2017 年 6 月 28 日起担任本基金管理人的副总经理。

2、报告期内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

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金报告期内没有改变基金投资策略。

**10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

本报告期末改聘会计师事务所。

**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、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

**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	
招商证券	2	-	-	0.00	0.00%	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字[1998]29号）的有关规定要求及金鹰成份股优选证券投资基金基金合同规定的选择券商的标准，选择券商租用其席位。本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的专用交易单元。本基金专用交易单元的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 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的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

**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		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
招商证券	119,392,823.08	100.00%	7,577,402,000.00	100.00%	-	-

注：本基金专用交易单元的选择程序如下：

(1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单位的证券经营机构。

(2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单位租用协议。

### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内未出现偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

## §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

本基金报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无影响投资者决策的其他重要信息。

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准金鹰现金增益交易型货币市场基金发行及募集的文件。
- 2、《金鹰现金增益交易型货币市场基金基金合同》。
- 3、《金鹰现金增益交易型货币市场基金托管协议》。
- 4、金鹰基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程。
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照。
- 6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、季度报告、更新的招股说明书及其他临时公告。

### 12.2 存放地点

广东省广州市天河区珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅或按工本费购买复印件，也可登录本基金管理人网站查阅，本基金管理人网址：<http://www.gefund.com.cn>。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人客户服务中心，客户服务中心电话：4006-135-888 或 020-83936180。



金鹰基金管理有限公司

二〇一七年八月二十六日