

**金鹰货币市场证券投资基金**  
**2017 年年度报告摘要**  
**2017 年 12 月 31 日**

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年三月二十八日

## §1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 27 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

基金简称	金鹰货币	
基金主代码	210012	
交易代码	210012	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012 年 12 月 7 日	
基金管理人	金鹰基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	17,872,669,392.67 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	金鹰货币 A	金鹰货币 B
下属分级基金的交易代码	210012	210013
报告期末下属分级基金的份额总额	349,008,503.40 份	17,523,660,889.27 份

## 2.2 基金产品说明

投资目标	在力求保持基金资产本金的安全性和资产高流动性的基础上，力争获得超过基金业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	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：整体资产配置策略（利率分析策略、久期管理策略）、类属配置策略、债券类资产配置策略、流动性管理策略、逆回购策略。
业绩比较基准	税后一年期定期存款利率（即（一年期定期存款利率×（1-利息税率）））。
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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李云亮	田青
	联系电话	010-59944986	010-67595096
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4006135888,020-83936180	010-67595096
传真		020-83282856	010-66275853

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	<a href="http://www.gefund.com.cn">http://www.gefund.com.cn</a>
基金年度报告备置地点	广州市天河区珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年		2016 年		2015 年	
	金鹰货币 A	金鹰货币 B	金鹰货币 A	金鹰货币 B	金鹰货币 A	金鹰货币 B
本期已实现收益	10,769,158.80	632,619,195.26	2,676,174.51	183,963,388.61	5,062,541.16	42,555,132.43
本期利润	10,769,158.80	632,619,195.26	2,676,174.51	183,963,388.61	5,062,541.16	42,555,132.43
本期	4.0743%	4.3238%	2.4582%	2.7042%	3.6405%	3.8903%

净值 收益 率						
3.1.2 期 末数据 和指标	2017 年末		2016 年末		2015 年末	
	金鹰货币 A	金鹰货币 B	金鹰货币 A	金鹰货币 B	金鹰货币 A	金鹰货币 B
期末 基金 资产 净值	349,008,503. 40	17,523,660,8 89.27	137,351,911.5 1	7,830,883,180 .82	96,887,144.83	2,751,026,953 .89
期末 基金 份额 净值	1.00	1.00	1.00	1.00	1.00	1.00

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

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. 金鹰货币 A:

阶段	份额净值收 益率①	份额净值收 益率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.0533%	0.0004%	0.3781%	0.0000%	0.6752%	0.0004%
过去六个月	2.0992%	0.0004%	0.7562%	0.0000%	1.3430%	0.0004%
过去一年	4.0743%	0.0010%	1.5000%	0.0000%	2.5743%	0.0010%
过去三年	10.5146%	0.0059%	5.1205%	0.0011%	5.3941%	0.0048%
过去五年	20.4099%	0.0091%	11.0932%	0.0019%	9.3167%	0.0072%

自基金合同生效起至今	20.6281%	0.0090%	11.2986%	0.0019%	9.3295%	0.0071%
------------	----------	---------	----------	---------	---------	---------

注：1、本基金收益分配是按日结转份额。

## 2. 金鹰货币 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
过去三个月	1.1144%	0.0004%	0.3781%	0.0000%	0.7363%	0.0004%
过去六个月	2.2226%	0.0004%	0.7562%	0.0000%	1.4664%	0.0004%
过去一年	4.3238%	0.0010%	1.5000%	0.0000%	2.8238%	0.0010%
过去三年	11.3132%	0.0059%	5.1205%	0.0011%	6.1927%	0.0048%
过去五年	21.8645%	0.0091%	11.0932%	0.0019%	10.7713%	0.0072%
自基金合同生效起至今	22.1045%	0.0090%	11.2986%	0.0019%	10.8059%	0.0071%

注：1、本基金收益分配是按日结转份额。

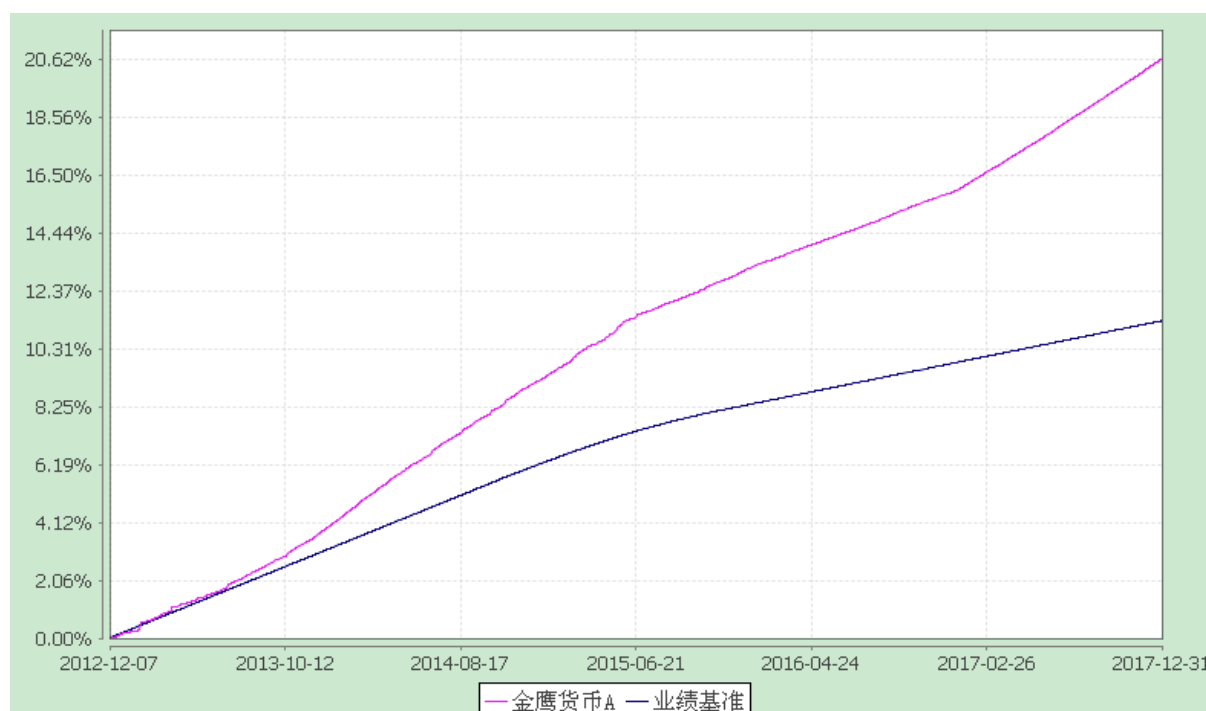
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

#### 金鹰货币市场证券投资基金

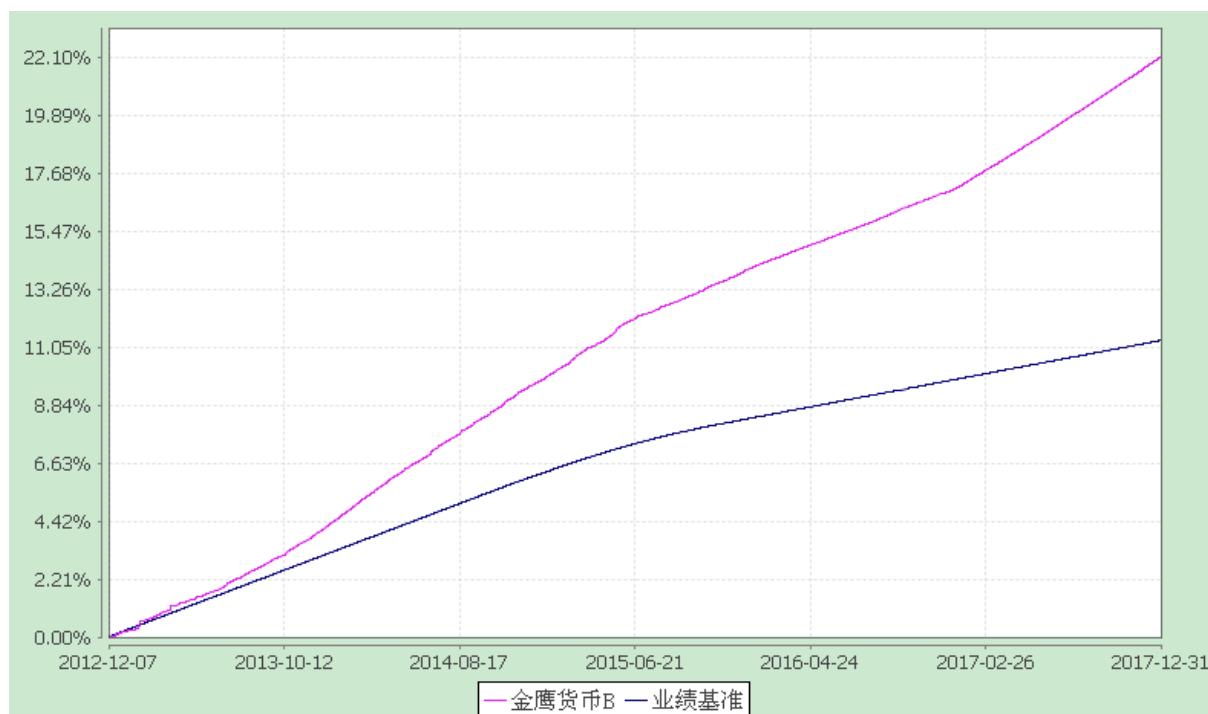
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2012 年 12 月 7 日至 2017 年 12 月 31 日)

#### 1、金鹰货币 A



## 2、金鹰货币 B



注：

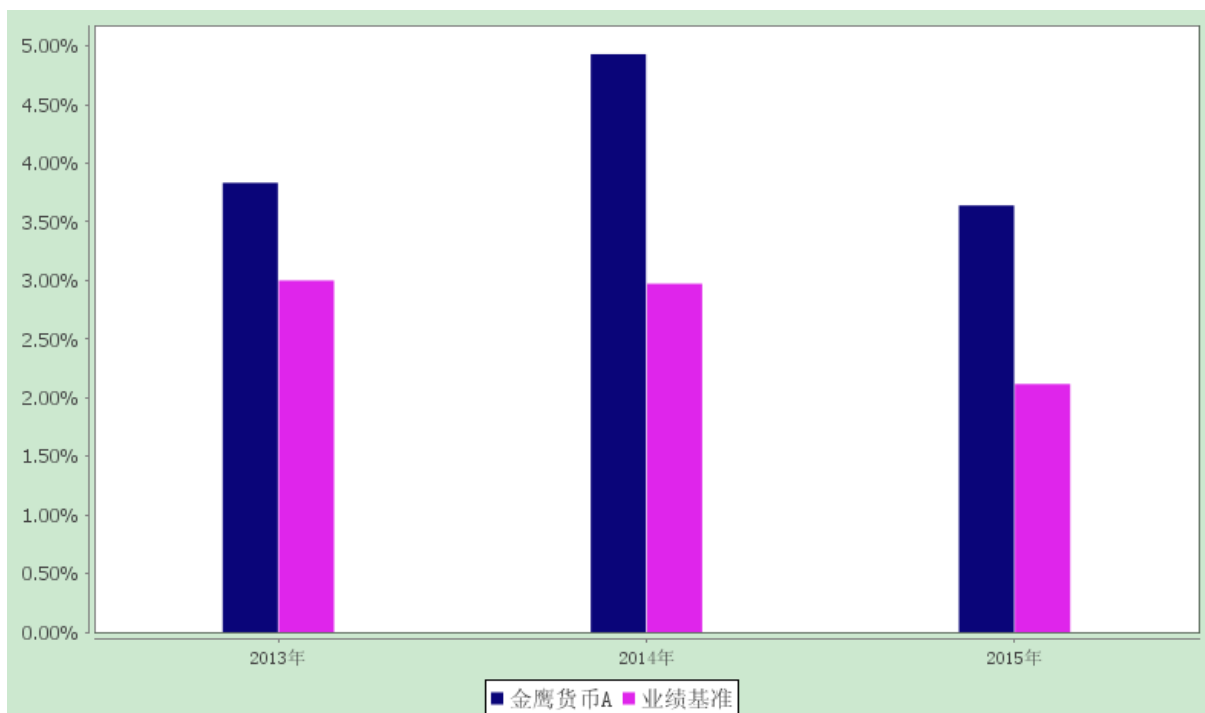
- 1、本基金于 2012 年 12 月 7 日成立。
- 2、按基金合同规定，本基金建仓期为六个月。建仓期满后，各项投资比例符合本基金合同的规定。
- 3、本基金业绩比较基准为一年期定期存款利率（税后）。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

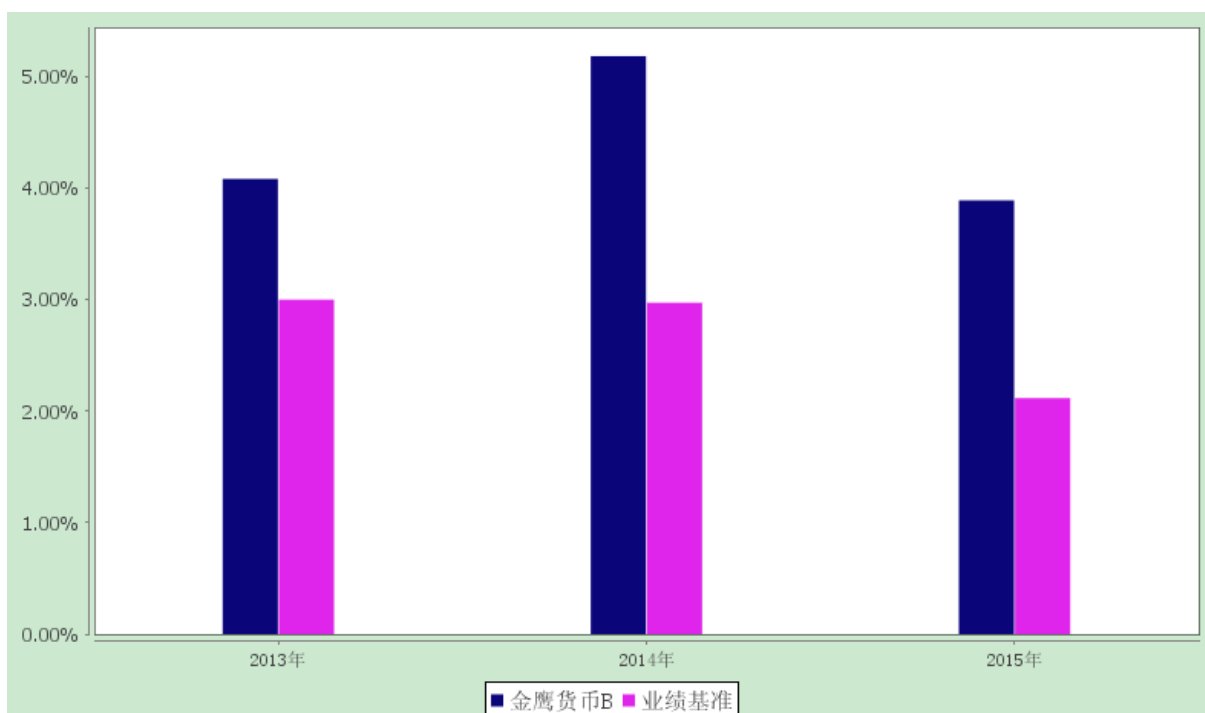
金鹰货币市场证券投资基金

过去五年基金净收益率与业绩比较基准收益率的对比图

#### 1、金鹰货币 A



## 2、金鹰货币 B



注：

1、本基金于 2012 年 12 月 7 日成立。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

金鹰货币 A：

单位：人民币元

年度	已按再投资	直接通过应付赎	应付利润本年变动	年度利润分配合	备注



	形式转实收 基金	回款转出金额		计	
2017 年	10,673,669.18	-	95,489.62	10,769,158.80	-
2016 年	2,659,113.01	-	17,061.50	2,676,174.51	-
2015 年	5,074,698.06	-	-12,156.90	5,062,541.16	-
合计	18,407,480.25	-	100,394.22	18,507,874.47	-

金鹰货币 B:

单位: 人民币元

年度	已按再投资 形式转实收 基金	直接通过应付赎 回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合 计	备注
2017 年	627,783,882.80	-	4,835,312.46	632,619,195.26	-
2016 年	182,562,831.28	-	1,400,557.33	183,963,388.61	-
2015 年	42,266,273.20	-	288,859.23	42,555,132.43	-
合计	852,612,987.28	-	6,524,729.02	859,137,716.30	-

注: 1、本基金以份额面值 1.0000 元固定份额净值交易方式, 每日计算当日收益并全部分配, 每月以红利再投资方式集中支付累计收益, 即按份额面值 1.0000 元转为基金份额;

## §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

经中国证监会证监基字[2002]97 号文批准, 金鹰基金管理有限公司于 2002 年 12 月 25 日成立, 总部设在广州。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。公司下设权益投资部等 18 个一级职能部门以及北京、广州、上海、深圳、成都等 5 个分公司。

“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, 在新经营团队的带领下, 公司回归投资本源, 坚持价值投资为导向, 资产规模结构持续优化, 不断为投资者创造稳健收益。

截至 2017 年 12 月 31 日，公司公募基金规模 447.64 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	2015-07-22	-	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、金鹰元丰债券型证券投资基金、金鹰元祺信用债债券型证券投资基金、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、金鹰鑫富灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
龙悦芳	基金经理	2017-09-08	-	7	龙悦芳女士，曾任平安证券股份有限公司投资助理、交易员、投资经理等职务。2017 年 5 月加入金鹰基金管理有限公司，现任金鹰货币市场证券投资基金、金鹰添瑞中短债债券型证券投资基金基金经理。
黄倩倩	基金经理助理	2016-07-01	-	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、基金经理助理，现任金鹰现金增益交易型货币市场基金、金鹰添益纯债债券型证券投资基金基金经理，金鹰灵活配置混合型证券投资基金等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遵规守信情况的说明

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，严格遵守本基金的基金合同、托管协议、招募说明书等法律文件的规定，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，基金运作合法合规，无出现重大违法违规或违反基金合同的行为，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 公平交易制度和控制方法

为了保证本基金管理人管理的不同投资组合得到公平对待，本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，以及公司内控大纲的要求，制定了《金鹰基金管理有限公司公平交易管理规定》并严格执行，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。本基金管理人通过投资交易系统公平交易功能，对不同投资组合进行公平交易事前控制。同时，本基金管理人引入公平交易分析系统，定期或不定期对公司旗下投资组合在一定期间内买卖相同证券的情况进行监控和分析。

##### 4.3.2 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。同时通过投资交易系统内的公平交易功能执行交易，以尽可能确保公平对待各投资组合。

报告期内，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。

#### 4.3.3 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

回顾 2017 年，债券市场收益率延续震荡向上走势。一季度，经济金融数据超预期，央行两次上调 MLF 和逆回购利率，使得债市延续 16 年末的下跌行情，10 年国债收益率由 3% 左右上行至 3.4% 以上。2 月中旬，央行定向降准例行考核被解读为定向降准，加上 3 月美联储加息幅度低于预期，市场解读为靴子落地，债券市场迎来一波小的反弹。但 3 月底开始，银监会频频发文，剑指近年来快速发展的同业链条和“三套利”行为。由此，影响债市的主基调逐渐从基本面转向金融监管，在防风险、去杠杆的大方向下，债市情绪更加敏感，10 年期国债收益率上行至 3.6% 一线。后因央行季末提前超额续作 MLF，释放流动性，债券市场又迎来一波小的反弹。三季度，经济增速较二季度略有下滑，市场预期在房地产调控和地方融资平台受限的背景下，经济将见顶回落。但由于经济见顶无法证伪，加与对监管趋严悲观预期并存，10 年期国债收益率在 3.6% 一线横盘。直到四季度，主要工业品价格继续保持高位，推动工业企业利润向好。10 月份重要会议明确了防范和化解金融风险是今后三年都要重点抓好的攻坚战，市场对金融监管持续深化的预期得以强化。周行长对下半年经济增长 7% 的乐观言论扭转了市场对经济增速回落的预期，引发了等待慢牛的拥挤的交易盘纷纷止损，债券收益率快速向上突破 4%。在市场收益率上行中，信用利差也有所走阔，但是整体信用利差仍然处于中性偏低位置。金融去杠杆带来流动性收紧，短端利率调整幅度更大，10 年期与 1 年期国债利率之差基本在 60BP 以内，在各别月份一度出现倒挂。收益率曲线平坦的程度和持续时间均创历史新高。

流动性方面，由于经济基本面平稳，加上美国处于加息周期，为保持人民币汇率稳定，面对外汇占款持续下降、基础货币供应不足的困境，央行没有选择传统的降准模式，而是用公开市场操作的方式来调节货币供给。而金融防风险、去杠杆是贯穿 2017 年市场的主线。在金融防风险去杠杆的大环境下，货币政策整体中性偏紧，央行“削峰填谷”始终维持货币供给的稳定，确保不发生系统性金融风险。货币供给总量有限，同业收缩下存款派生能力减弱，货币流通速度下降，整个金融体

系的资金供给放缓，而经济平稳，融资需求依然不弱，使得银行体系超储率依然处于低位。偏低的超储率加上银行各种流动性指标考核以及财政存款剧烈的季节性波动，引发了资金面较为频繁的波动，结构性紧张成为常态。

报告期内，我们根据对市场流动性的判断以及对持有人结构分析，对货币基金所能投资的存单、存款、现券和回购等几大类品种进行合理配比选择，适时加减久期和调整各品种在组合中占比，在季末及资金阶段性紧张时期，加大高利率同业存款、存单、逆回购的配置比例，在保持组合流动性和安全性的前提下，取得了一定超额收益，同时也保证了业绩的稳定性。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 12 月 31 日，基金 A 类份额本报告期份额净值收益率为 4.0743%，同期业绩比较基准收益率为 1.5000%；B 类份额本报告期份额净值收益率为 4.3238%，同期业绩比较基准收益率为 1.5000%。

#### 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 2018 年，经济基本上，当前经济环境还没有走出传统经济模式的束缚，以房地产和基建为代表的重资产投资模式对于当下经济仍有较强的影响力。在去杠杆和重质量的背景下，传统经济成分增速将下行。但经济中的积极因素正在逐渐显现，体现在消费贡献占比日益提升、对外贸易对经济重新产生正向推动、“三去一降下”企业资产负债表持续修复、先进制造带动制造业投资复苏的曙光乍现，这些因素对经济产生正向作用，使整体经济下行幅度可控，或呈现缓中趋稳的态势。

基本面整体平稳，为金融监管创造了良好的外部环境。防范和化解金融风险是今后三年都要重点抓好的攻坚战，金融监管在 2018 年将正式进入政策落地和实施的阶段。未来随着监管政策付诸实施，依靠货币政策收紧以倒逼金融去杠杆的必要性降低，加上经济基本面回落，人民币贬值压力减弱，2018 年货币政策在总量上或有边际改善。但考虑到，中央经济工作会议对货币政策的定调仍是“关注货币供应总闸门”，全球货币进入紧缩周期，国内基本面也难回落到需要货币政策宽松刺激的程度，因此货币政策很难明显放松，大概率依然保持中性。随着央行“货币政策+宏观审慎政策”的双支柱调控框架日渐完善，央行通过构建利率走廊，以 DR007 作为基准利率引导，锁定银行资金端的利率水平。而宏观审慎政策作为货币政策的有效补充，通过 MPA 监管，对银行本身的杠杆率、信贷扩张和流动性方面进行约束，从而压缩同业规模，减少银行对非银等的资金融出，达到逆向拆解非银和影子银行杠杆的作用。在此过程中，流动性分层将进一步加剧，机构间流动性的摩擦成本上升，资金面结构性紧张的局面或难避免。

基于以上判断,我们认为,中长期基本面来看,投资环境在逐步改善,利率上行空间或有限,但是经济短期韧性以及流动性的偏紧的状况,会制约利率的下行空间,后续债市或将继续保持震荡状态,会在上述几项因素的共同作用下继续磨顶,在流动性明显改善前,空间可能都不大,在监管的冲击下利率也存在脉冲上行的可能。在投资策略方面,我们将继续采取稳健操作策略。在确保组合良好流动性和安全性的前提下,力争有效控制并防范风险,并根据投资者结构变化,结合货币市场流动性情况,适时调整组合各类资产比例和久期,竭力为持有人服务。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会,估值委员会由基金估值业务分管领导、督察长、基金事务部负责人、基金会计、合规风控部人员及相关投研人员等组成。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。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序,指导和监督整个估值流程。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立,基金经理、投资经理可参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行,一切以维护基金持有人利益为准则。

本报告期内,参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议,由其按约定分别提供银行间同业市场债券品种的估值数据及交易所交易的债券品种的估值数据、流通受限股票流动性折扣。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规及《金鹰货币市场基金基金合同》,本基金每日将各级基金份额实现的基金净收益全额分配给基金份额持有人。

#### 4.8 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

本报告期,会计师事务所未对本基金出具非标准审计报告。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

在本报告期内,本基金未出现持有人数或资产净值达到或低于预警线的情形。

## §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，中国建设银行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。

报告期内，金鹰货币市场证券投资基金 A 实施利润分配的金额为 10,769,158.80 元。

报告期内，金鹰货币市场证券投资基金 B 实施利润分配的金额为 632,619,195.26 元。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师王兵 赵会娜签字出具了众环审字（2018）050152 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：金鹰货币市场证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日

资产：	-	-
银行存款	8,201,241,582.83	903,629,737.52
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	7,488,942,775.47	4,122,705,747.24
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	7,488,942,775.47	4,122,705,747.24
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	3,246,137,513.92	3,219,063,088.36
应收证券清算款	-	-
应收利息	70,811,129.31	28,726,746.74
应收股利	-	-
应收申购款	26,957,678.02	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>19,034,090,679.55</b>	<b>8,274,125,319.86</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2017 年 12 月 31 日</b>	<b>2016 年 12 月 31 日</b>
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	1,145,887,182.13	299,899,350.15
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	19,000.00	354,119.66
应付管理人报酬	5,088,062.74	1,933,434.61
应付托管费	1,541,837.19	585,889.27



应付销售服务费	222,345.01	83,342.05
应付交易费用	81,413.57	85,231.41
应交税费	-	-
应付利息	1,194,255.21	291,536.85
应付利润	6,720,191.03	1,789,388.95
递延所得税负债	-	-
其他负债	667,000.00	867,934.58
<b>负债合计</b>	<b>1,161,421,286.88</b>	<b>305,890,227.53</b>
<b>所有者权益：</b>	-	-
实收基金	17,872,669,392.67	7,968,235,092.33
未分配利润	-	-
<b>所有者权益合计</b>	<b>17,872,669,392.67</b>	<b>7,968,235,092.33</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>19,034,090,679.55</b>	<b>8,274,125,319.86</b>

注：截至 2017 年 12 月 31 日，本基金份额总额 17,872,669,392.67。本基金 A 类基金份额净值 1.0000 元，份额总额为 349,008,503.40 份；本基金 B 类基金份额净值 1.0000 元，份额总额为 17,523,660,889.27 份。

## 7.2 利润表

会计主体：金鹰货币市场证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	<b>726,045,591.34</b>	<b>230,605,809.53</b>
1.利息收入	737,261,596.18	229,387,642.32
其中：存款利息收入	193,676,015.72	33,825,487.32
债券利息收入	275,563,876.51	156,299,891.32
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	268,021,703.95	39,262,263.68

其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-11,229,164.84	1,129,383.58
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-11,229,164.84	1,129,383.58
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	13,160.00	88,783.63
<b>减：二、费用</b>	<b>82,657,237.28</b>	<b>43,966,246.41</b>
1. 管理人报酬	49,795,273.17	23,058,336.98
2. 托管费	15,089,476.62	6,987,374.92
3. 销售服务费	2,149,535.69	962,519.87
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	15,099,050.56	12,469,902.72
其中：卖出回购金融资产支出	15,099,050.56	12,469,902.72
6. 其他费用	523,901.24	488,111.92
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>643,388,354.06</b>	<b>186,639,563.12</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>643,388,354.06</b>	<b>186,639,563.12</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金鹰货币市场证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	7,968,235,092.33	-	7,968,235,092.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	643,388,354.06	643,388,354.06
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	9,904,434,300.34	-	9,904,434,300.34
其中：1.基金申购款	67,030,344,499.34	-	67,030,344,499.34
2.基金赎回款	-57,125,910,199.00	-	-57,125,910,199.00
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）	-	-643,388,354.06	-643,388,354.06
五、期末所有者权益（基金净值）	17,872,669,392.67	-	17,872,669,392.67
项目	上年度可比期间		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,847,914,098.72	-	2,847,914,098.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	186,639,563.12	186,639,563.12
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）	5,120,320,993.61	-	5,120,320,993.61
其中：1.基金申购款	40,808,545,941.45	-	40,808,545,941.45
2.基金赎回款	-35,688,224,947.84	-	-35,688,224,947.84

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）	-	-186,639,563.12	-186,639,563.12
五、期末所有者权益（基金净值）	7,968,235,092.33	-	7,968,235,092.33

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

金鹰货币市场基金（简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（简称“中国证监会”）证监基金字[2012]1105 号文《关于金鹰货币市场证券投资基金备案确认的函》批准，于 2012 年 12 月 7 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 2,925,528,953.04 份基金份额。本基金募集期间自 2012 年 11 月 19 日起至 2012 年 12 月 3 日止，净认购额 2,925,440,807.27 元，认购资金在认购期间的银行利息 88,145.77 元折算成基金资产。上述资金已于 2012 年 12 月 5 日全额划入本基金在基金托管人中国建设银行股份有限公司开立的本基金托管专户。验资机构为立信羊城会计师事务所（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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司（简称“建设银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《金鹰货币市场证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资于法律法规允许投资的金融工具，具体范围如下：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、大额存单；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、资产支持证券和中期票据；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。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金 2015 年度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编制。

#### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度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。

#### 7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金报告期内无需说明的重要会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计差错更正。

#### 7.4.6 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[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》，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。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号《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、债券免征增值税。

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》，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《财政部 税务总局关于资管产品增值税有关问题的通知》，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，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。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。

## 3、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[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个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字【2012】85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》以及财政部、国家税务总局、证监会财税字[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

#### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
广州证券股份有限公司	基金管理人股东
广州白云山医药集团股份有限公司	基金管理人股东
美的集团股份有限公司	基金管理人股东
东亚联丰投资管理有限公司	基金管理人股东
金鹰基金管理有限公司	基金发起人、管理人、销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
深圳前海金鹰资产管理有限公司	基金管理人子公司

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总额的 比例
广州证券股份有限公司	-	-	-	-

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

##### 7.4.8.1.2 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间

	2017年1月1日至2017年12月31日		2016年1月1日至2016年12月31日	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
广州证券股份有限公司	-	-	-	-

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.8.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广州证券股份有限公司	-	-	-	-

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 7.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

#### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

#### 7.4.8.2 关联方报酬

##### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月 31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月 31日
	当期发生的基金应支付的管理费	49,795,273.17



其中：支付销售机构的客户 维护费	807,838.06	589,659.53
---------------------	------------	------------

注：1、在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.33% 年费率计提。计算方法如下：

每日应计提的基金管理费 = 前一日的基金资产净值 × 0.33% / 当年天数

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 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、休息日，支付日期顺延。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月 31日	2016年1月1日至2016年12月 31日
当期发生的基金应支付的托 管费	15,089,476.62	6,987,374.92

注：1、基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 年费率计提。计算方法如下：

每日应计提的基金托管费 = 前一日的基金资产净值 × 0.10% / 当年天数

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，经基金托管人复核后于次月首日起 5 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，支付日期顺延；

#### 7.4.8.2.3 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1月1日至2017年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	金鹰货币 A	金鹰货币 B	合计
金鹰基金管理有限公司	191,415.64	1,424,418.19	1,615,833.83
广州证券股份有限公司	540.73	-	540.73

中国建设银行	153,195.11	4,372.40	157,567.51
合计	345,151.48	1,428,790.59	1,773,942.07
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	金鹰货币A	金鹰货币B	合计
金鹰基金管理有限公司	92,181.13	655,504.45	747,685.58
广州证券股份有限公司	689.27	-	689.27
中国建设银行	88,944.46	28,043.16	116,987.62
合计	181,814.86	683,547.61	865,362.47

注：1、本基金 A 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%，对于由 B 类降级为 A 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用 A 类基金份额的费率。B 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%，对于由 A 类升级为 B 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其升级后的下一个工作日起享受 B 类基金份额的费率。两类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同，具体如下：

每日应计提的各级基金销售服务费 = 前一日该级基金份额的基金资产净值 × R ÷ 当年天数

R 为该级基金份额的年销售服务费率

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给注册登记机构，由注册登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付；

#### 7.4.8.3 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1月1日至2017年12月31日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
建设银行	51,761,219.18	-	-	-	-	-

上年度可比期间						
2016年1月1日至2016年12月31日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
建设银行	254,402,808.49	-	-	-	-	-

#### 7.4.8.4各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	
	2017年1月1日至2017年12月31日	
	金鹰货币A	金鹰货币B
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	280,799,367.66
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	40,000,000.00
期末持有的基金份额	-	240,799,367.66
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	1.37%

##### 7.4.8.4.2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

###### 金鹰货币 A

本基金本报告期末及上年度末其他关联方未投资本基金。

###### 金鹰货币 B

本基金本报告期末及上年度末其他关联方未投资本基金。

#### 7.4.8.5 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		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年12月31日		2016年1月1日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	1,241,582.83	48,916.74	3,629,737.52	69,797.29

注：1、本基金清算备付金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算公司等结算账户；

2、2017年12月31日清算备付金期末余额0.00元，清算备付金利息收入29,983.32元，2016年12月31日清算备付金期末余额0.00元，清算备付金利息收入20,055.93元。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

##### 7.4.8.7.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

本基金本报告期及上年度可比期间未投资本基金。

#### 7.4.9 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.9.2 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。

##### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 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金融资产余额为 1,145,887,182.13 元，所抵押债券参见下表：

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
111715458	17 民生银行 CD458	2018-01-02	99.13	1,100,000.00	109,045,989.53
111772093	17 宁波银行 CD251	2018-01-02	99.62	1,000,000.00	99,624,830.94
111772112	17 广东南海 农商行 CD086	2018-01-02	98.72	1,030,000.00	101,686,255.17
111784744	17 哈尔滨银 行 CD181	2018-01-03	98.98	40,000.00	3,959,322.56
111784744	17 哈尔滨银 行 CD181	2018-01-03	98.98	1,050,000.00	103,932,217.29
111786569	17 哈尔滨银 行 CD198	2018-01-03	98.65	1,000,000.00	98,645,878.56
130220	13 国开 20	2018-01-03	99.98	500,000.00	49,991,072.91
150212	15 国开 12	2018-01-03	99.62	100,000.00	9,961,729.51
150214	15 国开 14	2018-01-03	100.05	400,000.00	40,020,052.05
150409	15 农发 09	2018-01-02	100.05	1,230,000.00	123,064,523.47
150409	15 农发 09	2018-01-02	100.05	1,020,000.00	102,053,507.27
150414	15 农发 14	2018-01-03	99.86	500,000.00	49,930,030.78
150418	15 农发 18	2018-01-03	99.79	200,000.00	19,958,219.30
170203	17 国开 03	2018-01-03	99.94	300,000.00	29,981,932.68
170204	17 国开 04	2018-01-03	99.83	550,000.00	54,907,317.38
170306	17 进出 06	2018-01-03	100.00	200,000.00	20,000,515.97
170410	17 农发 10	2018-01-03	99.78	280,000.00	27,939,201.24
170410	17 农发 10	2018-01-02	99.78	1,220,000.00	121,735,091.14
合计				11,720,000.00	1,166,437,687.75

#### 7.4.9.3.2交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金从事证券交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

#### 7.4.10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)，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，相关债券的公允价值属第二层次。

除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	7,488,942,775.47	39.34
	其中：债券	7,488,942,775.47	39.34
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	3,246,137,513.92	17.05
	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	8,201,241,582.83	43.09
4	其他各项资产	97,768,807.33	0.51
5	合计	19,034,090,679.55	100.00

## 8.2 债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	3.27	
	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	1,145,887,182.13	6.41
	其中：买断式回购融资	-	-

注：上表中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基金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

本基金本报告期内无债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20%的情况。

## 8.3 基金投资组合平均剩余期限

### 8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	83
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	95
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	34

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内投资组合平均剩余期限无超过 120 天的情况。

### 8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30 天以内	26.15	6.41
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	9.13	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	41.56	-

	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	4.68	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	24.44	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
合计		105.95	6.41

#### 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内不存在投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	914,542,625.14	5.12
	其中：政策性金融债	914,542,625.14	5.12
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	6,574,400,150.33	36.78
8	其他	-	-
9	合计	7,488,942,775.47	41.90
10	剩余存续期超过 397 天的浮动 利率债券	-	-

#### 8.6 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	111772093	17 宁波银行	5,000,000.00	498,124,154.69	2.79



		CD251			
2	111785624	17 天津农村商业银行 CD227	3,000,000.00	296,830,044.33	1.66
3	111719296	17 恒丰银行 CD296	3,000,000.00	293,823,457.62	1.64
4	111772334	17 东莞银行 CD118	3,000,000.00	292,261,972.47	1.64
5	150409	15 农发 09	2,500,000.00	250,131,145.26	1.40
6	111709483	17 浦发银行 CD483	2,000,000.00	198,264,812.36	1.11
7	111784694	17 天津银行 CD189	2,000,000.00	198,204,763.74	1.11
8	111709493	17 浦发银行 CD493	2,000,000.00	198,102,912.37	1.11
9	111785563	17 盛京银行 CD260	2,000,000.00	197,973,704.25	1.11
10	111784744	17 哈尔滨银行 CD181	2,000,000.00	197,966,128.18	1.11

#### 8.7“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	0.0744%
报告期内偏离度的最低值	-0.0714%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0262%

#### 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

本基金本报告期内未发生正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

#### 8.8期末按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投资。

#### 8.9 投资组合报告附注

##### 8.9.1 基金计价方法说明

本基金目前投资工具的估值方法如下：

(1) 基金持有的债券（包括票据）购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，按实际利率计算其摊余成本及各期利息收入，每日计提收益；

(2) 基金持有的回购以成本列示, 按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息; 合同利率与实际利率差异较小的, 也可采用合同利率计算确定利息收入;

(3) 基金持有的银行存款以本金列示, 按实际协议利率逐日计提利息。

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

如有新增事项, 按国家最新规定估值。

**8.9.2 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。**

### 8.9.3 期末其他各项资产构成

单位: 人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	70,811,129.31
4	应收申购款	26,957,678.02
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	97,768,807.33

### 8.9.4 其他需说明的重要事项标题

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。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位: 份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

			持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
金鹰货币 A	38,859	8,981.41	88,992,950.22	25.50%	260,015,553.18	74.50%
金鹰货币 B	142	123,406,062 .60	17,358,238,825 .31	99.06%	165,422,063.96	0.94%
合计	39,001	458,261.82	17,447,231,775 .53	97.62%	425,437,617.14	2.38%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

本基金非上市交易型基金。

金鹰货币 A

本基金非上市交易型基金。

金鹰货币 B

本基金非上市交易型基金。

### 9.3 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	1,400,000,000.00	7.83%
2	银行类机构	1,021,077,252.00	5.71%
3	证券类机构	870,036,536.70	4.87%
4	证券类机构	726,567,789.80	4.07%
5	银行类机构	701,757,873.10	3.93%
6	银行类机构	700,000,000.00	3.92%
7	基金类机构	650,000,000.00	3.64%
8	银行类机构	602,179,816.80	3.37%
9	银行类机构	547,602,225.00	3.06%
10	证券类机构	516,584,282.50	2.89%

### 9.4 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	金鹰货币 A	1,074,418.84	0.31%
	金鹰货币 B	-	-
	合计	1,074,418.84	0.01%

**9.5 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	金鹰货币 A	0~10
	金鹰货币 B	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	金鹰货币 A	0
	金鹰货币 B	0
	合计	0

**9.6 发起式基金发起资金持有份额情况**

本基金非发起式基金。

**§10 开放式基金份额变动**

单位：份

项目	金鹰货币 A	金鹰货币 B
基金合同生效日（2012 年 12 月 7 日） 基金份额总额	639,455,794.04	2,286,073,159.00
本报告期期初基金份额总额	137,351,911.51	7,830,883,180.82
本报告期基金总申购份额	2,205,173,684.78	64,825,170,814.56
减：本报告期基金总赎回份额	1,993,517,092.89	55,132,393,106.11
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	349,008,503.40	17,523,660,889.27

**§11 重大事件揭示****11.1 基金份额持有人大会决议**

本基金报告期内未召开基金份额持有人大会。

**11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**

报告期内基金管理人增聘陈瀚先生为公司副总经理，该事项已于 2017 年 6 月 29 日在《证券时报》等媒体进行了披露。

报告期内基金管理人免去苏文锋先生督察长职务，免去李云亮先生副总经理职务，聘请李云亮先生担任公司督察长，该事项已于 2017 年 9 月 13 日在《证券时报》等媒体进行了披露。

2017 年 9 月 1 日，基金托管人发布公告，聘任纪伟为中国建设银行资产托管业务部总经理。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金报告期内没有改变基金投资策略。

### 11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金报告期内未持有基金。

### 11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金审计的会计师事务所为中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）。

本报告期内实际应支付会计师事务所的审计费为 48000 元。

### 11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

### 11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.8.1 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

本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单位作为本基金的专用交易单位。本基金专用交易单位的选择标准如下：

- （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。

本基金专用交易单位的选择程序如下：

- （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。

#### 11.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内未发生偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

## 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017年1月11日至 2017年1月12日	1,002,896,2 96.05	-	1,026,655,2 11.44	0.00	0.00%
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内，存在报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情形，可能会存在以下风险：</p> <p>1) 基金净值大幅波动的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，因巨额赎回、份额净值小数保留位数与方式、管理费及托管费等费用计提等原因，可能会导致基金份额净值出现大幅波动；</p> <p>2) 巨额赎回的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能触发本基金巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额；</p> <p>3) 流动性风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致本基金的流动性风险；</p> <p>4) 基金提前终止、转型或与其他基金合并的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，可能导致本基金面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p> <p>5) 基金规模过小导致的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。</p> <p>6) 份额占比较高的投资者申购申请被拒绝的风险：当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金总份额的50%时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金总份额50%的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的50%，该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。</p>							

注：因本基金收益按日计算并分配，按月集中支付，期初持有份额与全部赎回的份额存在差异。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

经基金管理人第六届董事会第八次会议审议通过，免去凌富华先生董事长职务，聘请李兆廷先生担任公司董事长，该事项已于 2018 年 1 月 18 日在证监会指定媒体披露。

经基金管理人 2016 年第三次临时股东会审议通过，并经中国证券监督管理委员会批复核准（证监许可[2017]2135），公司原股东美的集团股份有限公司、东亚联丰投资管理有限公司分别将其持有的本公司 20%和 11%股权转让给东旭集团有限公司。公司股东东旭集团有限公司向本公司

增资人民币 260,200,000 元。本次股权转让及增资后，公司股权结构变更为：东旭集团有限公司 66.19%，广州证券股份有限公司 24.01%，广州白云山医药集团股份有限公司 9.80%，本公司注册资本由人民币 250,000,000 元增加至人民币 510,200,000 元。公司《公司章程》的有关条款已根据本次股权变更情况进行了相应修改。本公司已完成注册资本及股权变更事项的工商变更登记。上述事项已于 2018 年 1 月 30 日在证监会指定媒体披露。

金鹰基金管理有限公司

二〇一八年三月二十八日