

# 金鹰货币市场证券投资基金

## 2017 年年度报告

### 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 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国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。

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<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.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	11
<b>§4 管理人报告</b> .....	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	17
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	17
<b>§5 托管人报告</b> .....	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	18
<b>§6 审计报告</b> .....	18
6.1 审计意见.....	18
6.2 形成审计意见的基础.....	18
6.3 其他信息.....	18
6.4 管理层对财务报表的责任.....	19
6.5 注册会计师的责任.....	19
<b>§7 年度财务报表</b> .....	20
7.1 资产负债表.....	20
7.2 利润表.....	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	24
<b>§8 投资组合报告</b> .....	52
8.1 期末基金资产组合情况.....	52
8.2 债券回购融资情况.....	52
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.....	54

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	54
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 .....	54
8.7“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 .....	55
报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25% 情况说明 .....	55
报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5% 情况说明 .....	55
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 .....	55
8.9 投资组合报告附注 .....	55
<b>§9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>56</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	56
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	57
9.3 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....	57
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	57
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 .....	58
9.6 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	58
<b>§10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>58</b>
<b>§11 重大事件揭示</b> .....	<b>58</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	58
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 .....	58
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	59
11.4 基金投资策略的改变 .....	59
11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	59
11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	59
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 .....	59
11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	59
11.16.3 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况 .....	59
11.17 其他重大事件 .....	60
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>64</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 .....	64
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	65
<b>§13 备查文件目录</b> .....	<b>65</b>
13.1 备查文件目录 .....	65
13.2 存放地点 .....	66
13.3 查阅方式 .....	66

## §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

基金名称	金鹰货币市场证券投资基金	
基金简称	金鹰货币	
基金主代码	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
注册地址		广东省广州市南沙区滨海路 171号11楼自编1101之一J79	北京市西城区金融大街25号
办公地址		广州市天河区珠江东路28号越 秀金融大厦30层	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼
邮政编码		510623	100033
法定代表人		刘岩	田国立

## 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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	中审众环会计师事务所（特殊普 通合伙）	武汉市武昌区东湖路 169 号众环海华大厦 2-9 层
注册登记机构	金鹰基金管理有限公司	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
本期净值收益率	4.0743%	4.3238%	2.4582%	2.7042%	3.6405%	3.8903%
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	17,523,660,889.27	137,351,911.51	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
3.1.3 累计期末指标	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
累计净值收益率	20.6281%	22.1045%	15.9057%	17.0438%	13.1249%	13.9620%

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

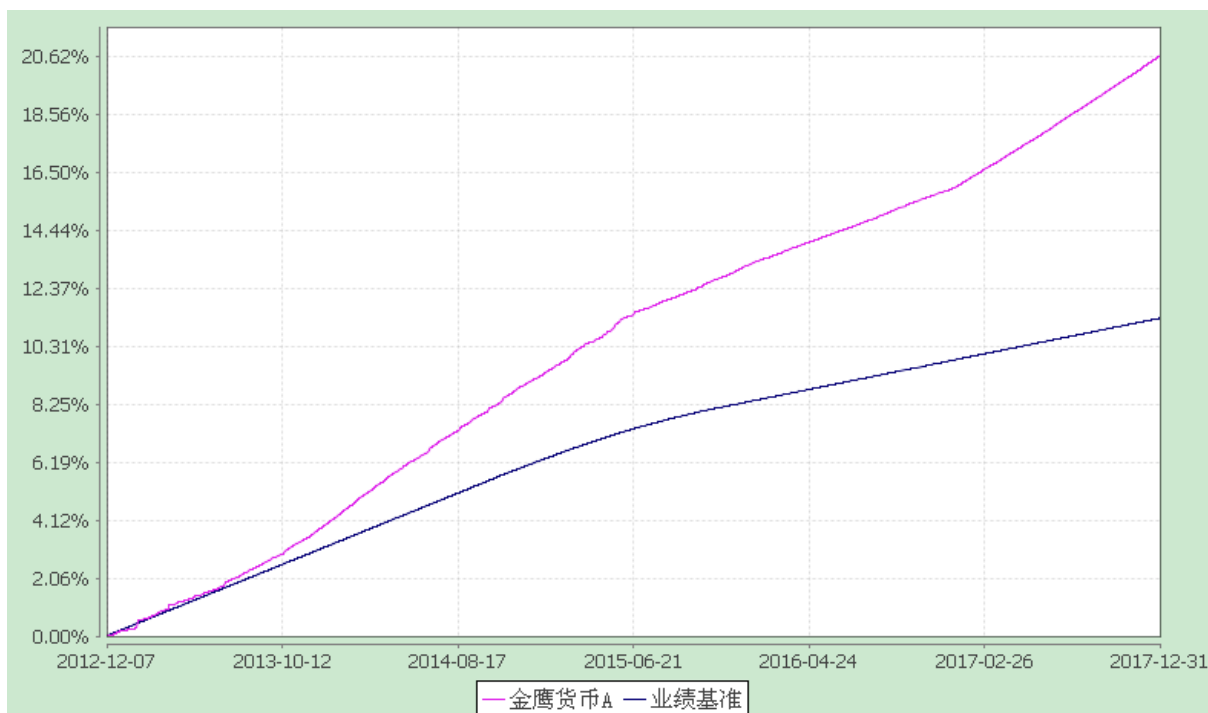
#### 金鹰货币市场证券投资基金

自基金合同生效以来累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

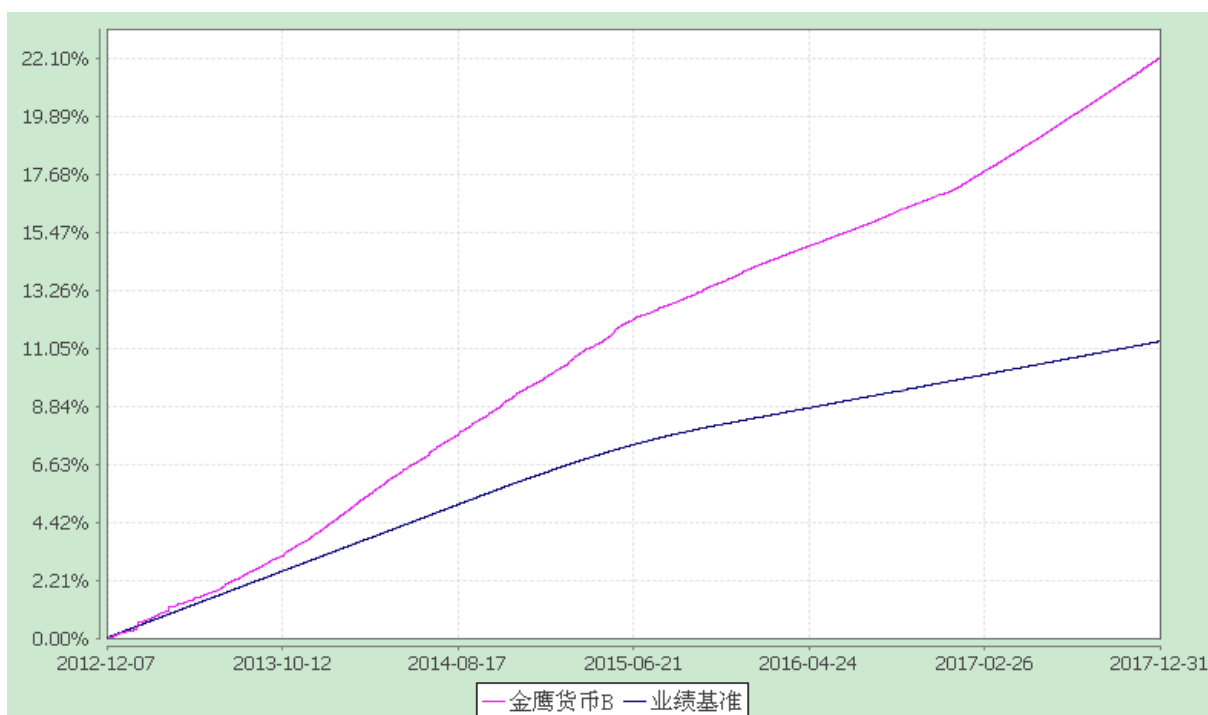
(2012 年 12 月 7 日至 2017 年 12 月 31 日)

#### 1、金鹰货币 A





## 2、金鹰货币 B



注：

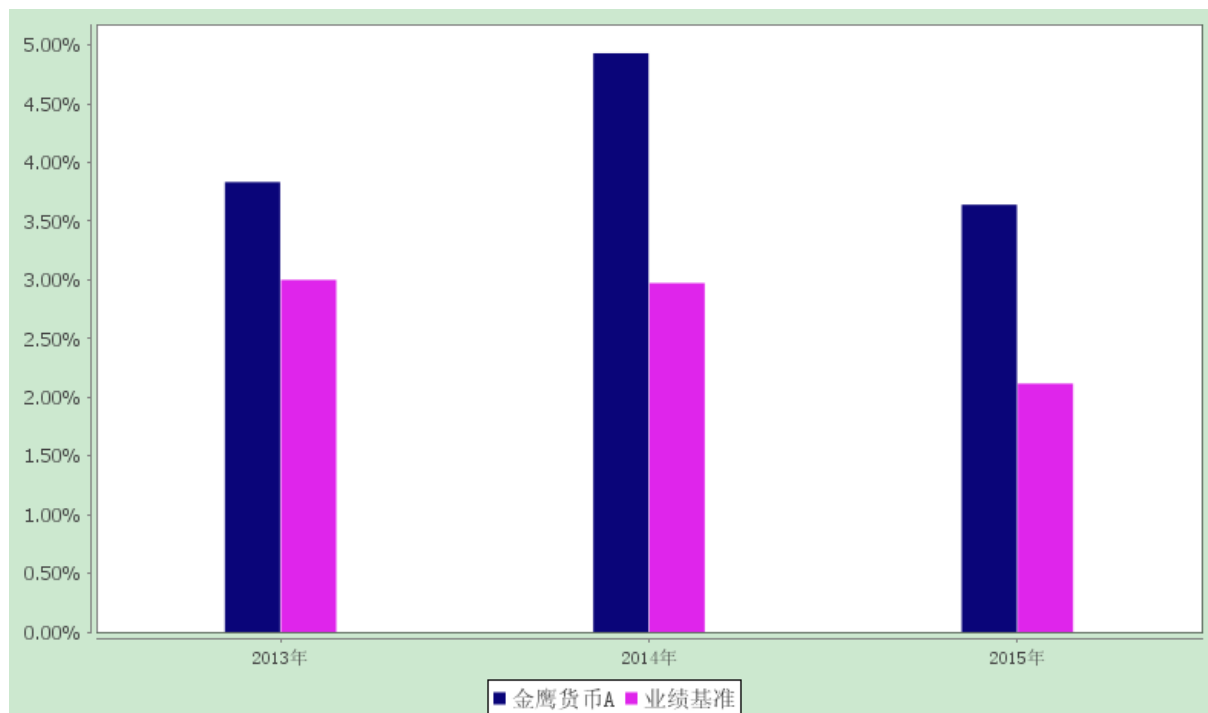
- 1、本基金于 2012 年 12 月 7 日成立。
- 2、按基金合同规定，本基金建仓期为六个月。建仓期满后，各项投资比例符合本基金合同的规定。
- 3、本基金业绩比较基准为一年期定期存款利率（税后）。

### 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

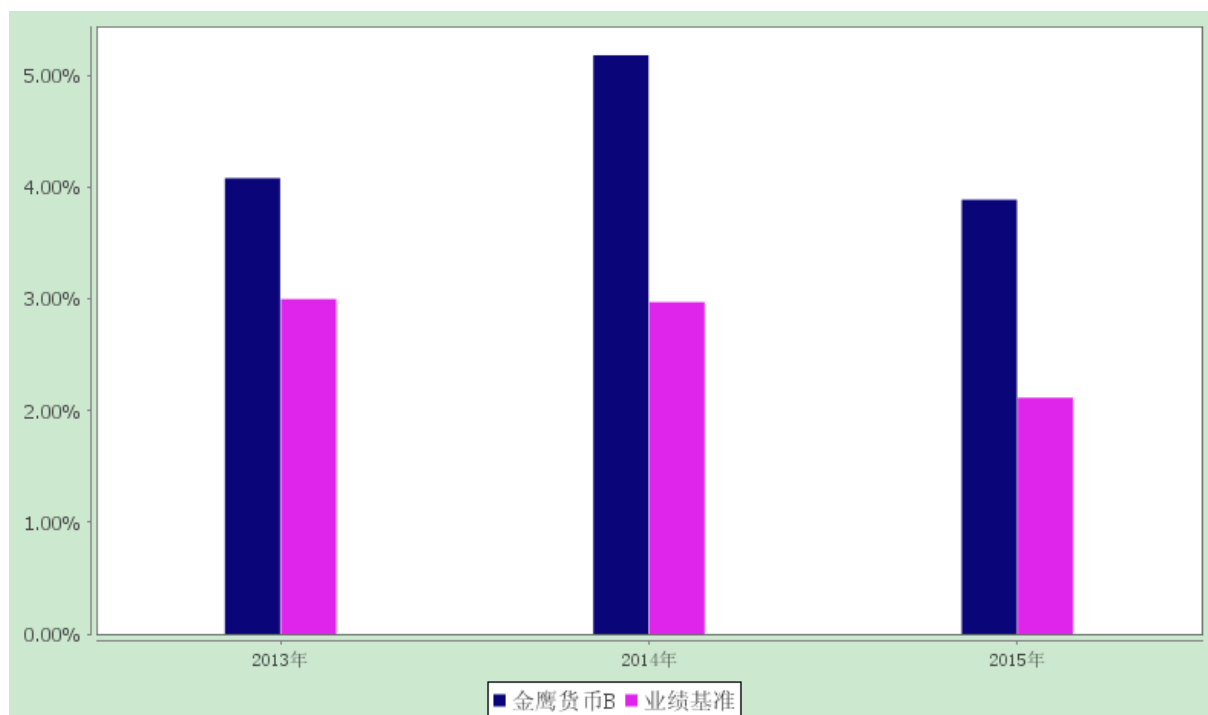
金鹰货币市场证券投资基金

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 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	10,673,669.1 8	-	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	18,407,480.2 5	-	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	42,266,273.2 0	-	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，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同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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，监察稽核工作根据独立、客观、公正的原则，按照规定的权限和程序独立开展本基金运作的合规性监察，认真履行职责，通过材料审阅、监督监控、覆盖检查、重点抽查等多种方法开展工作，督促各项业务的合规运作，发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告，定期向公司董事会和监管部门出具监察稽核报告。

本报告期有关本基金的监察稽核内容包括投资、交易、研究、市场营销、信息披露等各项业务的每个环节以及信息技术、运营保障、行政管理等后台支持工作。监察结果显示，本报告期内公司对本基金的管理基本能按照法律法规、基金合同、基金招募说明书的要求和公司制度的规定进行。本基金的投资决策、投资交易程序、投资权限等各方面均符合规定的要求；交易行为基本合法合规，未出现异常交易、操纵市场的现象；未发现内幕交易的情况；基金持有的证券符合规定的比例要求；基金专用交易席位年度交易量比例符合证监会的有关规定；相关的信息披露真实、完整、准确、及时；销售工作合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 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。

#### **4.8 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。

#### **4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明**

本报告期，会计师事务所未对本基金出具非标准审计报告。

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

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

众环审字（2018）050152 号

金鹰货币市场证券投资基金全体份额持有人：

我们审计了金鹰基金管理有限公司担任管理人（以下简称“基金管理人”）的金鹰货币市场证券投资基金（以下简称“金鹰货币基金”）财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

### 6.1 审计意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照《企业会计准则》并参照《证券投资基金会计核算业务指引》的规定编制，公允反映了金鹰货币基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和净值变动情况。

### 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于基金管理人，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 6.3 其他信息

基金管理人对其他信息负责。其他信息包括 2017 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告，金鹰货币基金 2017 年年度报告预期将在审计报告日后提供给我们。

我们对财务报表发表的审计意见并不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读上述其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

当我们阅读金鹰货币基金 2017 年年度报告后，如果确定其中存在重大错报，审计准则要求我们

与基金管理人沟通该事项并采取以下措施：如果其他信息得以更正，将根据具体情形实施必要的程序；如果与基金管理人沟通后其他信息未得到更正，将考虑其法律权利和义务，并采取恰当的措施，以提醒审计报告使用者恰当关注未更正的重大错报。

#### 6.4 管理层对财务报表的责任

基金管理人负责按照《企业会计准则》并参照《证券投资基金会计核算业务指引》的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

#### 6.5 注册会计师的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

（一）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

（二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

（三）评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

（四）评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

王兵 赵会娜

武汉市武昌区东湖路 169 号众环海华大厦 2-9 层

2018 年 3 月 20 日

## §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	附注号	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	7.4.7.1	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	7.4.7.2	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	3,246,137,513.92	3,219,063,088.36
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	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	7.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>19,034,090,679.55</b>	<b>8,274,125,319.86</b>
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 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		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	7.4.7.7	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	7.4.7.8	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	7.4.7.9	17,872,669,392.67	7,968,235,092.33
未分配利润	7.4.7.10	-	-
<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	附注号	本期	上年度可比期间
		2017 年 1 月 1 日至	2016 年 1 月 1 日至

		2017 年 12 月 31 日	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	7.4.7.11	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	7.4.7.12	-	-
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	-11,229,164.84	1,129,383.58
资产支持证券投资收益	7.4.7.14.2	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	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	7.4.7.20	-	-
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	7.4.7.21	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	-	186,639,563.12	186,639,563.12

金净值变动数（本期利润）			
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 重要会计政策和会计估计

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。

##### 7.4.4.1 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。

##### 7.4.4.2 记账本位币

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

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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。

##### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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。

#### 7.4.4.5 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。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且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。

#### 7.4.4.7 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。

#### 7.4.4.8 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) 本基金持有的附息债券、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。

#### 7.4.4.9 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×0.33%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×0.10%的年费率逐日计提。

3. 本基金 A 级基金份额和 B 级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 0.25% 和 0.01% 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。

#### 7.4.4.10 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、“每日分配、按月支付”。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，每月集中支付。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按截尾原则处理，因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止；

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

5、本基金每日进行收益计算并分配时，每月累计收益支付方式只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益；若投资人在每月累计收益支付时，其累计收益为正值，则为投资人增加相应的基金份额，其累计收益为负值，则缩减投资人基金份额。若投资人赎回基金份额时，其对应收益将立即结清；若收益为负值，则从投资人赎回基金款中扣除；

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

7、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 7.4.4.11 分部报告

本基金本报告期内无分部报告。

#### 7.4.4.12 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。

### 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 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	1,241,582.83	3,629,737.52
定期存款	8,200,000,000.00	900,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	2,800,000,000.00	600,000,000.00

存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 3-6 个月(含)	5,400,000,000.00	300,000,000.00
其他存款	-	-
合计	8,201,241,582.83	903,629,737.52

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2017 年 12 月 31 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	7,488,942,775.47	7,480,105,000.00	-8,837,775.47	-0.05
	合计	7,488,942,775.47	7,480,105,000.00	-8,837,775.47	-0.05
项目		上年度末 2016 年 12 月 31 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	4,122,705,747.24	4,119,376,000.00	-3,329,747.24	-0.04
	合计	4,122,705,747.24	4,119,376,000.00	-3,329,747.24	-0.04

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

## 7.4.7.4 买入返售金融资产

## 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	2,423,520,000.00	-

银行间市场	822,617,513.92	-
合计	3,246,137,513.92	-
项目	上年度末	
	2016 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,640,150,000.00	-
银行间市场	1,578,913,088.36	-
合计	3,219,063,088.36	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	996.68	1,063.97
应收定期存款利息	42,386,026.97	1,660,694.85
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	10.27	2,430.00
应收债券利息	21,962,648.05	23,320,525.75
应收买入返售证券利息	6,461,447.34	3,742,032.17
应收申购款利息	-	-
其他	-	-
合计	70,811,129.31	28,726,746.74

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末



	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	0.00	0.00
银行间市场应付交易费用	81,413.57	85,231.41
合计	81,413.57	85,231.41

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	934.58
其他	10,000.00	10,000.00
信息披露费	600,000.00	800,000.00
银行间帐户维护费	9,000.00	9,000.00
审计费	48,000.00	48,000.00
合计	667,000.00	867,934.58

## 7.4.7.9 实收基金

金鹰货币 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	137,351,911.51	137,351,911.51
本期申购	2,205,173,684.78	2,205,173,684.78
本期赎回（以“-”号填列）	-1,993,517,092.89	-1,993,517,092.89
本期末	349,008,503.40	349,008,503.40

金鹰货币 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	7,830,883,180.82	7,830,883,180.82
本期申购	64,825,170,814.56	64,825,170,814.56
本期赎回（以“-”号填列）	-55,132,393,106.11	-55,132,393,106.11
本期末	17,523,660,889.27	17,523,660,889.27

注：表内各级基金的申购份额包含因份额升降级导致的强制调增份额,赎回份额包含因份额升降级导致的强制调减份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

##### 金鹰货币 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	10,769,158.80	-	10,769,158.80
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	-10,769,158.80	-	-10,769,158.80
本期末	-	-	-

##### 金鹰货币 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	632,619,195.26	-	632,619,195.26
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	-632,619,195.26	-	-632,619,195.26
本期末	-	-	-

#### 7.4.7.11 存款利息收入

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
活期存款利息收入	48,916.74	69,797.29
定期存款利息收入	193,597,115.66	33,735,634.10
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	29,983.32	20,055.93
其他	-	-
合计	193,676,015.72	33,825,487.32

**7.4.7.12 股票投资收益**

本基金本报告期内及上年度可比期间内无股票投资收益。

**7.4.7.13 基金投资收益**

本基金本报告期内及上年度可比期间内无基金投资收益。

**7.4.7.14 债券投资收益****7.4.7.14.1 债券投资收益——买卖债券差价收入**

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
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	22,909,296,918.56	19,796,922,308.97
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	22,849,610,629.70	19,633,605,652.26
减：应收利息总额	70,915,453.70	162,187,273.13
买卖债券差价收入	-11,229,164.84	1,129,383.58

**7.4.7.14.2 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期内及上年度可比期间内无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.15 贵金属投资收益**

本基金本报告期内及上年度可比期间内无贵金属投资收益。

**7.4.7.16 衍生工具收益****7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内及上年度可比期间内无衍生工具收益。

**7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期内及上年度可比期间内无衍生工具收益。

**7.4.7.17 股利收益**

本基金本报告期内及上年度可比期间内无股利收益。

**7.4.7.18 公允价值变动收益**

本基金本报告期内及上年度可比期间内无公允价值变动收益。

**7.4.7.19 其他收入**

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
基金赎回费收入	-	-
其他收入	13,160.00	88,783.63
合计	13,160.00	88,783.63

**7.4.7.20 交易费用**

本基金所进行的交易，交易费用均计入成本，故本报告期内及上年度可比期间内本基金未产生交易费用。

**7.4.7.21 其他费用**

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
审计费用	48,000.00	48,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
其他	452.30	533.50

帐户维护费	37,560.00	37,160.00
汇划手续费	137,888.94	102,418.42
合计	523,901.24	488,111.92

#### 7.4.7.22 分部报告

本基金无分部报告。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截止本财务报告批准报出日，本基金没有重大须作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
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

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

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。

#### 7.4.10.1.2 权证交易

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。

#### 7.4.10.1.3 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。

#### 7.4.10.1.4 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。

#### 7.4.10.1.5 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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	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管理费	49,795,273.17	23,058,336.98
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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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；

#### 7.4.10.2.3 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；

#### 7.4.10.3 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	-	-	-	-	-

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

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%

**7.4.10.4.2 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**

## 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。

**7.4.10.5 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		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。

**7.4.10.6 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。

**7.4.10.7 其他关联交易事项的说明****7.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明**

无。

**7.4.10.7.2 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。

**7.4.11 利润分配情况**

## 1、金鹰货币 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
10,673,669.18	-	95,489.62	10,769,158.8 0	-

## 2、金鹰货币 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
627,783,882.80	-	4,835,312.46	632,619,195. 26	-

注：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。

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

## 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

## 7.4.12.2 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。

## 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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	2018-01-03	98.65	1,000,000.00	98,645,878.56

	行 CD198				
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

#### 7.4.12.3.2 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。

#### 7.4.13 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。

##### 7.4.13.1 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

公司设立督察长，负责监察稽核工作，督察长由总经理提名，经董事会聘任，对董事会负责，报中国证监会核准。

除应当回避的情况外，督察长可以列席公司相关会议，调阅公司相关档案，就内部控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能。

督察长应当定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况，董事会应当对督察长的报告进行审议。

公司设立监察稽核部门，具体执行监察稽核工作。公司明确规定了监察稽核部门及内部各岗位的具体职责，严格审查监察稽核人员的专业任职条件，配备了充足的合格的监察稽核人员，明确规定了监察稽核的操作程序和组织纪律。

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。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可

靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级等级的证券，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。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控制证券发行人的信用风险，建立了内部评级体系，通过内部评级与外部评级相结合的方法充分评估证券的风险。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017年12月31日	上年末 2016年12月31日
A-1	0.00	-
A-1 以下	0.00	-
未评级	0.00	180,090,579.64
合计	0.00	180,090,579.64

注：本统计数据未包含国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债和同业存单。

##### 7.4.13.2.2 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12月31日	上年末 2016年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00

合计	0.00	0.00
----	------	------

注：本统计数据未包含国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债和同业存单。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自于投资品种流动性不足，导致金融资产不能在合理价格变现。本基金采用分散投资、监控流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时基金管理人通过分析持有人结构、申购赎回行为分析、变现比例、压力测试等方法评估组合的流动性风险。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金为货币市场基金，主要投资于现金，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。总体来看，本基金的投资标的具有良好的流动性。

报告期内，基金管理人根据持有人结构，严格控制投资组合的平均剩余期限和平均存续期限，并且将现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内的其他金融工具等高流动性资产占基金资产净值的比例保持在规定比例。在流动性新规实施之后，本基金按法规要求逐步调整不符合流动性新规要求的指标，并在规定期限内调整完毕。报告期末，本基金投资组合的平均剩余期限为 83 天，平均剩余存续期为 84 天，高流动性资产占基金资产净值的比例为 20.07%，流动性受限资产的市值合计占基金资产净值的比例为 2.94%。总体来看，本基金的资产组合具有良好的流动性。

报告期内，本基金的投资比例严格遵守相关法律法规和基金合同规定的比例，符合组合管理、分散投资的原则，持仓结构保持一定的高流动性资产，严格控制流动性受限资产的投资比例，并且充分降低金融工具的集中度，确保组合的分散度，将基金的流动性风险控制较低的水平。

### 7.4.13.4 市场风险

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

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金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。基金管理人通过久期、凸度等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对利率风险进

行管理。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年12月31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	1,201,241,582.83	-	-	-	-	7,000,000,000.00	-	-	-	8,201,241,582.83
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	617,840,878.26	-	-	-	-	6,871,101,897.21	-	-	-	7,488,942,775.47
买入返售金融资产	3,246,137,513.92	-	-	-	-	-	-	-	-	3,246,137,513.92
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	70,811,129.31	70,811,129.31
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	26,957,678.02	26,957,678.02
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	5,065,219,975.01	-	-	-	-	13,871,101,897.21	-	-	97,768,807.33	19,034,090,679.55
负债										
短期借款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	1,145,887,182.13	-	-	-	-	-	-	-	-	1,145,887,182.13
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	19,000.00	19,000.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	5,088,062.74	5,088,062.74
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	1,541,837.19	1,541,837.19
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-	-	222,345.00	222,345.00



									01	01
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	81,413.57	81,413.57
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-	1,194,255.21	1,194,255.21
应付利润	-	-	-	-	-	-	-	-	6,720,191.03	6,720,191.03
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	667,000.00	667,000.00
负债总计	1,145,887,182.13	-	-	-	-	-	-	-	15,534,104.75	1,161,421,286.88
利率敏感度缺口	3,919,332,792.88	-	-	-	-	13,871,101,897.21	-	-	82,234,702.58	17,872,669,392.67
上年度末 2016 年 12 月 31 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	103,629,737.52	-	-	-	-	800,000,000.00	-	-	-	903,629,737.52
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	1,198,988,821.16	-	-	-	-	2,923,716,926.08	-	-	-	4,122,705,747.24
买入返售金融资产	3,219,063,088.36	-	-	-	-	-	-	-	-	3,219,063,088.36
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	28,726,746.74	28,726,746.74
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	4,521,681,647.04	-	-	-	-	3,723,716,926.08	-	-	28,726,746.74	8,274,125,319.86

负债										
短期借款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	299,899,350.15	-	-	-	-	-	-	-	-	299,899,350.15
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	354,119.66	354,119.66	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	1,933,434.61	1,933,434.61	-
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	585,889.27	585,889.27	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-	83,342.05	83,342.05	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	85,231.41	85,231.41	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	291,536.85	291,536.85	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-	1,789,388.95	1,789,388.95	-
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	867,934.58	867,934.58	-
负债总计	299,899,350.15	-	-	-	-	-	-	5,990,877.38	305,890,227.53	-
利率敏感度缺口	4,221,782,296.89	-	-	-	-	3,723,716,926.08	-	22,735,869.36	7,968,235,092.33	-

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的摊余成本，并按照金融资产及金融负债的剩余到期日孰早者进行了分类。

#### 7.4.13.4.1.2 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	上年度末

		2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
	利率上升 25 个基点	-5,950,873.75	-2,593,097.60
	利率下降 25 个基点	5,950,873.75	2,593,097.60

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

##### 7.4.13.4.3.1 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。本基金主要投资于具有良好流动性的货币市场工具，不投资股票、权证等其他交易性金融资产，于本期末和上一年度末，无重大其他市场价格风险。

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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：人民币元）	
		本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	业绩比较基准变动+5%	1,035,921.59	1,231,062.27
	业绩比较基准变动-5%	-1,035,921.59	-1,231,062.27

#### 7.4.14 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)，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 CD251	5,000,000.00	498,124,154.69	2.79
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。

#### 11.16.3 偏离度绝对值超过 0.5% 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。

## 11.17 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	金鹰基金管理有限公司关于旗下开放式基金资产净值等的公告	证券时报等	2017-01-03
2	金鹰基金管理有限公司关于新增上海华信证券为代销机构并代销旗下部分基金的公告	证券时报等	2017-01-05
3	金鹰基金管理有限公司北京分公司办公地址变更的公告	证券时报等	2017-01-07
4	金鹰基金管理有限公司关于新增北京植信基金销售有限公司为我司旗下部分基金代销机构的公告	证券时报等	2017-01-10
5	金鹰基金管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告	证券时报等	2017-01-12
6	金鹰货币市场证券投资基金更新的招募说明书全文 2016 年第 2 号	证券时报等	2017-01-16
7	金鹰货币市场证券投资基金更新的招募说明书摘要 2016 年第 2 号	证券时报等	2017-01-16
8	金鹰基金管理有限公司关于独立董事变更的公告	证券时报等	2017-01-18
9	金鹰基金管理有限公司关于中信银行股份有限公司代销旗下部分基金开通转换业务的公告	证券时报等	2017-01-19
10	金鹰货币市场证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	证券时报等	2017-01-20
11	金鹰货币市场证券投资基金春节前三个工作日暂停申购及转换转入业务的公告	证券时报等	2017-01-21
12	金鹰基金管理有限公司关于金鹰货币市场证券投资基金暂停大额申购转入业务的公告	证券时报等	2017-01-25
13	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华龙证券股份有限公司为代销机构的公告	证券时报等	2017-02-17
14	金鹰基金管理有限公司关于基金经理助理任免的公告	证券时报等	2017-02-17
15	金鹰基金管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告	证券时报等	2017-03-01
16	金鹰基金管理有限公司关于放开部分代销机构转换转入业务的公告	证券时报等	2017-03-03
17	金鹰基金管理有限公司关于金鹰货币市场证券投资基金新增北京肯特瑞财富投资管理有限公司为代销机构并开通定投和转换业务的公告	证券时报等	2017-03-09
18	金鹰基金管理有限公司关于新增上海华夏财富投资管理有限公司为我司旗下部分基金代	证券时报等	2017-03-23

	销机构的公告		
19	金鹰基金管理有限公司关于放开部分代销机构转换转入业务的公告	证券时报等	2017-03-24
20	金鹰基金管理有限公司关于新增湖北银行股份有限公司为我司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务的公告	证券时报等	2017-03-24
21	金鹰基金管理有限公司关于金鹰货币市场证券投资基金 2017 年清明节假期前两个工作日暂停申购及转换转入业务的公告	证券时报等	2017-03-28
22	【年报】金鹰货币市场证券投资基金 2016 年年度报告（摘要）	证券时报等	2017-03-29
23	【年报】金鹰货币市场证券投资基金 2016 年年度报告	证券时报等	2017-03-20
24	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增江苏汇林保大基金销售有限公司为代销机构的公告	证券时报等	2017-04-06
25	金鹰基金管理有限公司关于新增大河财富基金销售有限公司为我司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务的公告	证券时报等	2017-04-06
26	金鹰基金管理有限公司关于开放部分代销机构转换业务的公告	证券时报等	2017-04-11
27	金鹰货币市场证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	证券时报等	2017-04-24
28	金鹰基金管理有限公司关于金鹰货币市场证券投资基金 2017 年劳动节假期前两个工作日暂停申购及转换转入业务的公告	证券时报等	2017-04-26
29	金鹰基金管理有限公司关于金鹰货币市场证券投资基金 2017 年端午节假期前两个工作日暂停申购及转换转入业务的公告	证券时报等	2017-05-23
30	金鹰基金管理有限公司关于新增深圳盈信基金销售有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务的公告	证券时报等	2017-06-02
31	金鹰基金管理有限公司关于新增上海挖财金融信息服务有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务的公告	证券时报等	2017-06-26
32	金鹰基金管理有限公司关于新增中民财富管理（上海）有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务的公告	证券时报等	2017-06-26
33	金鹰基金管理有限公司关于增聘副总经理的公告	证券时报等	2017-06-29
34	金鹰基金管理有限公司关于旗下开放式基金资产净值等的公告	证券时报等	2017-07-01
35	金鹰基金管理有限公司关于开放部分代销机	证券时报等	2017-07-03

	构转换业务的公告		
36	金鹰基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告	证券时报等	2017-07-15
37	金鹰货币市场证券投资基金更新的招募说明书全文 2017 年第 1 号	证券时报等	2017-07-18
38	金鹰货币市场证券投资基金更新的招募说明书摘要 2017 年第 1 号	证券时报等	2017-07-18
39	金鹰货币市场证券投资基金 2017 年第 2 季度报告	证券时报等	2017-07-20
40	金鹰基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	证券时报等	2017-07-20
41	金鹰基金管理有限公司关于新增深圳市小牛投资咨询有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务的公告	证券时报等	2017-07-25
42	金鹰基金管理有限公司关于新增中衍期货有限公司为代销机构的公告	证券时报等	2017-07-25
43	金鹰基金管理有限公司关于开放部分代销机构转换业务的公告	证券时报等	2017-08-02
44	金鹰基金管理有限公司关于新增深圳前海汇联基金销售有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务的公告	证券时报等	2017-08-04
45	金鹰基金管理有限公司关于金鹰货币市场证券投资基金限制大额申购及转换转入业务的公告	证券时报等	2017-08-10
46	金鹰基金管理有限公司关于上海浦东发展银行股份有限公司代销旗下部分基金并开通转换业务的公告	证券时报等	2017-08-15
47	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金参与财达证券等代销机构的定投及费率优惠活动的公告	证券时报等	2017-08-18
48	关于金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增万家财富为代销机构的公告	证券时报等	2017-08-18
49	金鹰基金管理有限公司关于中国民生银行股份有限公司开通旗下部分基金转换业务的公告	证券时报等	2017-08-23
50	【半年报】金鹰货币市场证券投资基金 2017 年半年度报告（摘要）	证券时报等	2017-08-26
51	【半年报】金鹰货币市场证券投资基金 2017 年半年度报告	证券时报等	2017-08-26
52	金鹰基金管理有限公司关于金鹰货币市场证券投资基金增聘基金经理的公告	证券时报等	2017-09-08
53	金鹰基金管理有限公司关于督察长变更的公告	证券时报等	2017-09-13

54	关于金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增宜信普泽投资顾问（北京）有限公司为代销机构并开通基金转换、基金定投及费率优惠的公告	证券时报等	2017-09-25
55	金鹰基金管理有限公司关于金鹰货币市场证券投资基金 2017 年中秋节、国庆节假期前两个工作日暂停申购、定投及转换转入业务的公告	证券时报等	2017-09-26
56	金鹰基金管理有限公司关于新增喜鹊财富基金销售有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务的公告	证券时报等	2017-09-27
57	金鹰基金管理有限公司关于新增通华财富（上海）基金销售有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务的公告	证券时报等	2017-10-11
58	金鹰基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新身份证件或者身份证明文件的公告	证券时报等	2017-10-26
59	金鹰基金管理有限公司关于新增扬州国信嘉利基金销售有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务的公告	证券时报等	2017-10-23
60	金鹰货币市场证券投资基金 2017 年第 3 季度报告	证券时报等	2017-10-25
61	金鹰基金管理有限公司关于新增海银基金销售有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务的公告	证券时报等	2017-10-25
62	金鹰基金管理有限公司关于新增北京电盈基金销售有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通定投、转换及费率优惠的公告	证券时报等	2017-11-02
63	金鹰基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新身份证件或者身份证明文件的公告	证券时报等	2017-11-06
64	金鹰基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	证券时报等	2017-11-21
65	金鹰基金管理有限公司关于新增联储证券有限责任公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通定投、转换及费率优惠的公告	证券时报等	2017-12-13
66	金鹰基金管理有限公司关于新增华瑞保险销售有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务的公告	证券时报等	2017-12-18
67	金鹰基金管理有限公司关于新增北京坤元基金销售有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通定投、转换及费率优惠的公告	证券时报等	2017-12-18
68	金鹰基金管理有限公司关于新增华信期货股份有限公司为本公司旗下部分基金代销机构	证券时报等	2017-12-20

	并开通基金转换、基金定投业务的公告		
69	金鹰基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新身份证件或者身份证明文件的公告	证券时报等	2017-12-22
70	金鹰基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新身份证件或者身份证明文件的公告	证券时报等	2017-12-25
71	金鹰基金管理有限公司关于金鹰货币市场证券投资基金 2018 年元旦节假日前两个工作日暂停大额申购、定投及转换转入业务的公告	证券时报等	2017-12-26
72	金鹰基金管理有限公司关于新增上海有鱼基金销售有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务的公告	证券时报等	2017-12-26
73	金鹰基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新身份证件或者身份证明文件的公告	证券时报等	2017-12-27
74	金鹰基金管理有限公司关于新增上海大智慧财富管理有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务的公告	证券时报等	2017-12-28
75	金鹰基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新身份证件或者身份证明文件的公告	证券时报等	2017-12-30
76	金鹰基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金缴纳增值税及附加税费的公告	证券时报等	2017-12-30

注：相关信息披露文件请登录本基金管理人网站查询。

## §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	1,002,896,296.05	-	1,026,655,211.44	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>							



- 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。
- 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。
- 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。

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。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准金鹰货币市场证券投资基金发行及募集的文件。
- 2、《金鹰货币市场证券投资基金基金合同》。
- 3、《金鹰货币市场证券投资基金托管协议》。
- 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、季度报告及其他临时公告。

### 13.2 存放地点

广州市天河区珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

### 13.3 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

二〇一八年三月二十八日