

金鹰现金增益交易型货币市场基金

2020 年第 1 季度报告

2020 年 3 月 31 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：二〇二〇年四月二十一日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 4 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金鹰现金增益
场内简称	金鹰增益
基金主代码	511770
基金运作方式	契约型
基金合同生效日	2017 年 3 月 20 日
报告期末基金份额总额	13,231,174,852.93 份
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	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

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：

（一）整体资产配置策略

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。

（二）类属配置策略

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。

（三）债券类资产配置策略

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。

（四）流动性管理策略

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

	<p>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。		
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		
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	198,694,817.67 份	13,023,717,433.62 份	8,762,601.64 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。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2020年1月1日-2020年3月31日)		
	金鹰现金增益 A	金鹰现金增益 B	金鹰现金增益 E
1.本期已实现收益	1,266,776.22	77,859,424.45	36,551.45
2.本期利润	1,266,776.22	77,859,424.45	36,551.45
3.期末基金资产净值	198,694,817.67	13,023,717,433.62	8,762,601.64

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 本报告期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	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6628%	0.0014%	0.3357%	0.0000%	0.3271%	0.0014%

注：本基金收益分配是按日结转份额。

2、金鹰现金增益 B:

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.7103%	0.0013%	0.3357%	0.0000%	0.3746%	0.0013%

注：本基金收益分配是按日结转份额。

3、金鹰现金增益 E:

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.3166%	0.0016%	0.3357%	0.0000%	-0.0191%	0.0016%

注：本基金收益分配是按日结转份额。

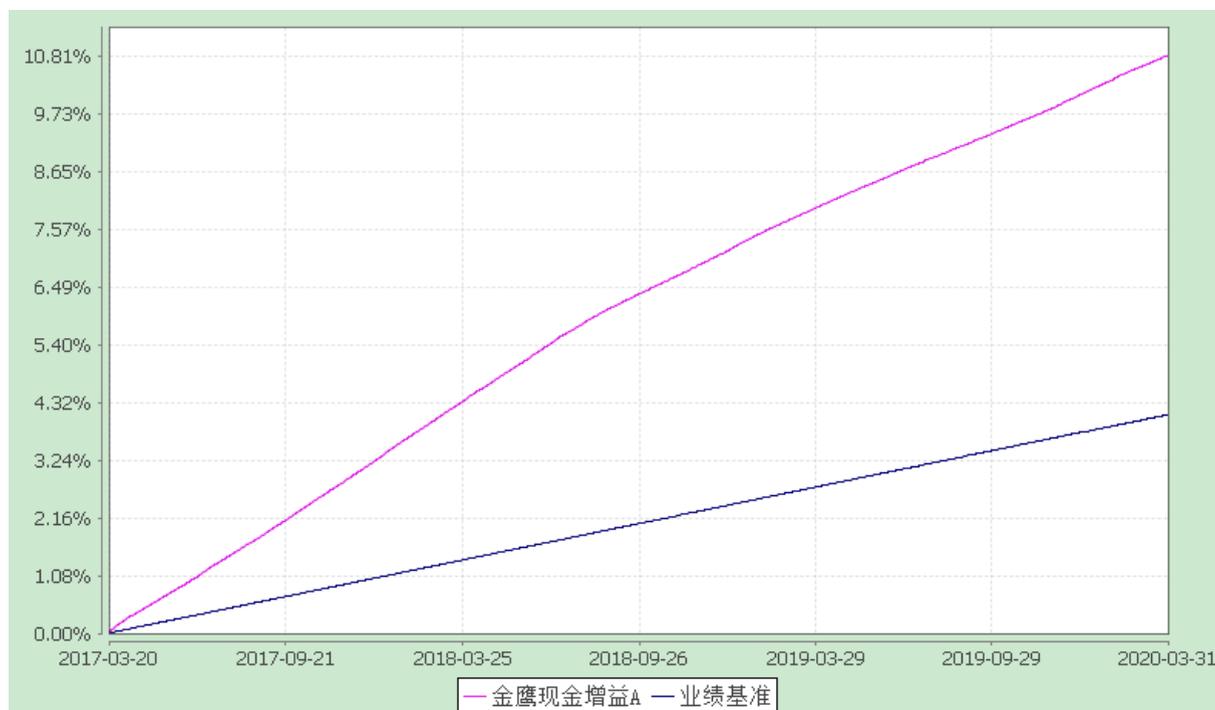
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

金鹰现金增益交易型货币市场基金

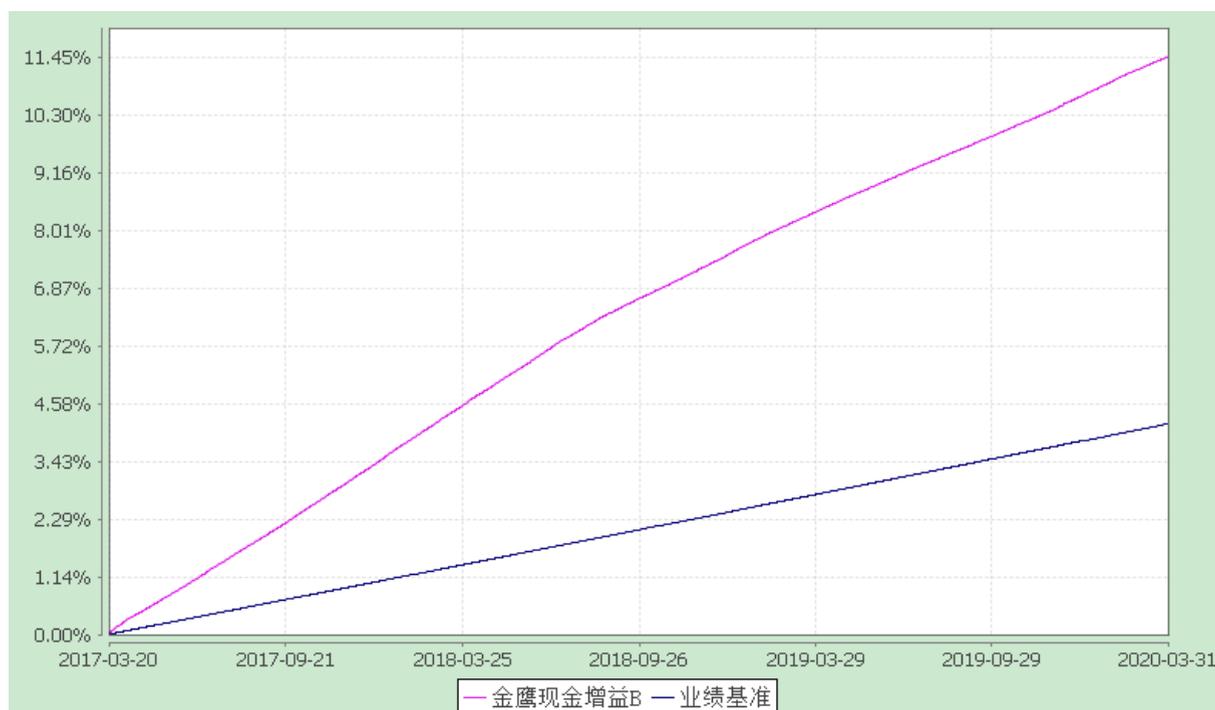
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017 年 3 月 20 日至 2020 年 3 月 31 日)

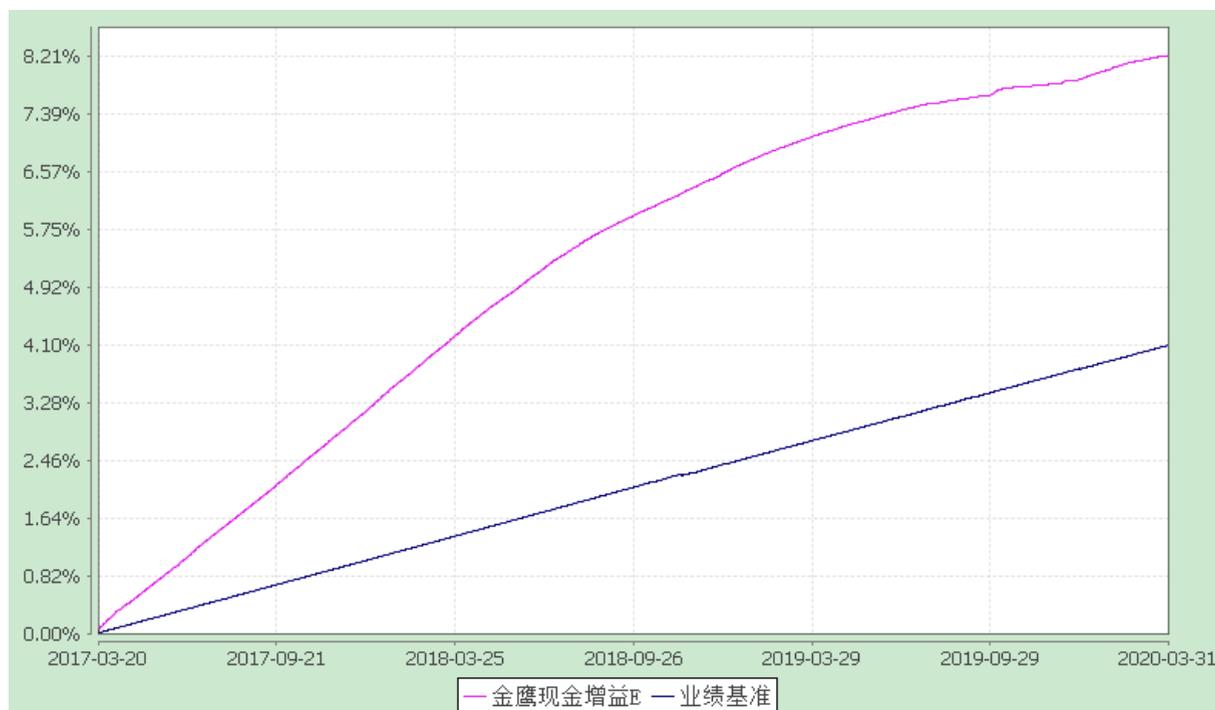
1、金鹰现金增益 A



2、金鹰现金增益 B



3、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。

（2）截至报告日本基金的各项投资比例基本符合本基金基金合同规定，即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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘丽娟	本基金的基金经理，公司固定收益部总监	2017-03-20	-	13	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。现任固定收益部基金经理。
黄倩倩	本基金的基金经理	2017-06-06	-	8	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，现任固定收益部基金经理。

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，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。

4.3.2 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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2020 年一季度，受新冠肺炎疫情疫情影响，大部分行业在春节后一个月内均呈现低复工甚至未复工的状态，整体经济表现欠佳。工业生产、建筑业施工、餐饮、旅游、娱乐、地产销售等行业均呈现负增长，压力较大；而其他行业如农林牧渔、金融、信息运输业、教育、医疗等行业受影响较小，呈现一定正增长；总体而言，一季度经济出现较大幅度的负增长可能性不大。3 月以来，国内疫情得到有效控制，规模以上企业复工已接近完成，中小企业复工率也逐步上升至 70% 以上。内需方面，土地成交景气度有所回升，房地产销售成交和乘用车零售批发销量较 2 月读数均低位反弹；另外，据商务部数据显示，百货商场销售额较差，而大型连锁超市和品牌便利店已有较好恢复。进出口方面，受海外疫情日趋严重的影响，外需较弱，进出口均呈现不同程度的负增长，表现为衰退式的顺差。通胀方面，食品项，受春节因素和疫情所带来的农产品产销秩序受阻的叠加影响，CPI 食品方面 1、2 月都保持在 5 以上的高位，3 月随天气转暖以及农产品产销秩序恢复等利好因素影响略有下行；非食品项，国际原油价格月均价格环比下跌幅度高达 40% 左右，国内汽油价格大幅下调 1015 元/吨。PPI 方面，受疫情影响，大宗商品价格继续下行，南华工业品指数持续下滑，PPI 呈现一定程度的负增长。

货币政策方面，央行一季度实施了更加积极的货币政策，前后两次定向降准并下调了 OMO 利率。1 月 1 日下午，央行便公布了今年以来的第一个利好，将于 1 月 6 日下调金融机构存款准备金率 0.5%，约释放长期资金 8000 多亿元。为应对春节提现压力和

企业所得税缴税期，央行又多次通过 OMO 释放流动性。新冠肺炎疫情之后，3 月 16 日，央行再次实施普惠金融定向降准，对达到考核标准的银行定向降准 0.5 至 1 个百分点，另对符合条件的股份制商业银行再额外定向降准 1 个百分点，支持发放普惠金融领域贷款，共释放长期资金 5500 亿元左右。3 月 30 日，央行重启公开市场逆回购操作，并下调公开市场 7 天逆回购利率 20bp，降幅创 2015 年来新高。

受疫情带来的市场风险偏好降低叠加货币政策的利好，债券市场一季度表现抢眼，整体震荡下行，长端利率总体下行 55bp 左右，短端利率下行 100bp 左右。受国内外新冠肺炎疫情影响，市场风险偏好降低，全球呈现降准降息格局，货币政策宽松，短端资产收益率陆续下行，一年存单从 1 月初的 2.95% 下行到 2 月底的 2.4% 左右；3 月初，海外疫情大爆发，美股多次熔断，对于流动性危机的担忧引发作为避险资产的债券、黄金和日元等资产跟随大跌，除美元以外的资产表现一片狼藉；加之国内市场对央行的降准预期迟迟未到，国内债券收益率跟随上行，短端收益率小幅震荡；为应对流动性危机，美国陆续购买 5000 亿美元的美债和 2000 亿美元的 MBS、2 万亿美元刺激计划等一系列积极的货币政策，而市场均未买单继续狂跌；直到 3 月中旬美国通过无限量 QE 草案，市场流动性危机有所缓解，避险资产反弹，债券收益开始向下回调，一年存单继续下行至 2.2% 附近。整个报告期间，DR001 大部分时间保持在 1%-2% 区间，个别时候触及最低点 0.8% 附近后反弹；DR007 则总体维持在 1.2%-2.4% 区间。

本基金一季度抓住了货币政策宽松的利好，大幅增配了一部分半年以上的较好资质存单，辅以部分短久期存款和回购，长短结合，锁定了高票息的同时兼顾了流动性，并享受到了收益率下行所带来的资本利得，增厚了组合回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

在本报告期内，本基金 A 类份额净值收益率为 0.6628%，业绩比较基准收益率为 0.3357%；B 类份额净值收益率为 0.7103%，业绩比较基准收益率为 0.3357%；E 类份额净值收益率为 0.3166%，业绩比较基准收益率为 0.3357%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望二季度，随着逆周期政策的提前加码，疫情后企业复工复产状态逐步修复完毕，预计宏观经济大概率将延续小幅反弹。投资方面，政治局会议已确定“财政三架马车”（赤

字率、专项债、特别国债)的扩张,对后续基建产业链带来一定支撑;地产方面,一季度货币政策执行报告再次指出“坚持房子是用来住的、不是用来炒的”的定位,按照“因城施策”的基本原则,加快建立房地产金融长效管理机制,不将房地产作为短期刺激经济的手段,不将房地产作为短期刺激经济的手段,叠加疫情影响,地产销售表现较弱,去库存能力弱化,对新开工和投资也形成一定拖累;制造业投资方面,虽然 PMI3 月同比较 2 月降幅有所收窄,但工业品价格持续走弱表达了需求不足,短期投资偏谨慎,制造业景气度较弱。根据 3 月宏观高频数据显示,供给方面,六大发电集团日均耗煤量和高炉开工率周度高频数据均呈逐步回升趋势;需求方面也有所起色,土地成交景气度回升,房地产销售成交和乘用车零售批发销量较 2 月读数均低位反弹。价格方面,果蔬等农产品价格受疫情后物流秩序恢复等利好逐步回落,禽肉价格也保持稳定;非食品方面,螺纹钢价格震荡下行,动力煤表现相对趋弱,南华工业品指数跌幅继续扩大,水泥、玻璃价格环比继续回落。货币政策方面,为更好的配合财政政策实现逆周期调节,对冲一季度疫情损失和经济惯性下滑风险,实现全年经济增长和就业的目标,二季度显得尤为重要,预计短期内政策面的宽松格局不会改变。

综合以上分析,本基金认为二季度货币政策的持续宽松将给债市的低利率带来一定支撑,短期内将维持目前的配置情况不变,我们将继续密切观察疫情发展情况以及宏观高频数据变化,待更确定的利空之后再择机降低久期。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内无应当说明的预警事项。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	5,098,800,002.46	37.60
	其中: 债券	5,048,800,002.46	37.23

	资产支持证券	50,000,000.00	0.37
2	买入返售金融资产	5,148,750,888.37	37.96
	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	3,292,753,916.32	24.28
4	其他资产	21,851,746.15	0.16
5	合计	13,562,156,553.30	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。

5.2 报告期债券回购融资情况

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	15.92	
	其中：买断式回购融资	0.01	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	301,566,770.85	2.28
	其中：买断式回购融资	78,467,082.40	0.59

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

本基金本报告期内没有出现债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
----	----

报告期末投资组合平均剩余期限	81
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	85
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	39

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限无超过120天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30天以内	49.01	2.28
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天（含）—60天	14.97	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	8.50	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天（含）—120天	2.64	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天（含）—397天（含）	26.86	-

	其中：剩余存续期超过 397天的浮动利率债	-	-
	合计	101.98	2.28

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内无平均剩余存续期超过240天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值 比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	395,432,774.81	2.99
	其中：政策性金融债	314,260,599.61	2.38
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	350,020,953.75	2.65
6	中期票据	-	-
7	同业存单	4,303,346,273.90	32.52
8	其他	-	-
9	合计	5,048,800,002.46	38.16
10	剩余存续期超过 397 天 的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量 (张)	摊余成本(元)	占基金资 产净值比 例(%)
1	112094273	20 恒生银行 CD011	3,000,000.00	292,583,572.36	2.21
2	111903112	19 农业银行	2,200,000.00	217,586,610.23	1.64

		CD112			
3	111915129	19 民生银行 CD129	2,000,000.00	199,764,475.51	1.51
4	111973837	19 河北银行 CD149	2,000,000.00	199,130,708.02	1.51
5	112093555	20 汇丰银行 CD014	2,000,000.00	197,777,263.61	1.49
6	111910399	19 兴业银行 CD399	2,000,000.00	197,731,043.17	1.49
7	111905149	19 建设银行 CD149	2,000,000.00	196,850,252.81	1.49
8	112006033	20 交通银行 CD033	2,000,000.00	195,302,268.61	1.48
9	112008014	20 中信银行 CD014	1,500,000.00	146,410,753.49	1.11
10	180304	18 进出 04	1,300,000.00	132,898,481.69	1.00

5.7“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	-次
报告期内偏离度的最高值	0.1292%
报告期内偏离度的最低值	0.0358%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0686%

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

本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	168089	安润 2A1	500,000.00	50,000,000.00	0.38

注：本基金本报告期末仅持有1只资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本基金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。

5.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体之一的中国民生银行股份有限公司因贷后管理不到位及以贷收贷、以贷转存等行为，分别于 2019 年 4 月 2 日、4 月 3 日、4 月 16 日被中国银行业监督管理委员会大连监管局罚款 100 万元、50 万元、100 万元。因同业票据业务管理失控、违反内控指引要求计量转贴现卖断业务信用风险加权资产等行为，于 2019 年 8 月 23 日被中国银行业监督管理委员会北京监管局采取责令改正并给予合计 700 万元罚款的行政处罚。因未按规定履行客户身份识别义务等行为，于 2020 年 2 月 14 日被中国人民银行罚款 2360 万元。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。本基金投资的前十名证券的发行主体之一的中信银行股份有限公司因未按规定向监管提供报表等行为，于 2019 年 8 月 9 日被中国银行保险监督管理委员会罚款 2190 万元。因违规发放土地储备贷款等行为，于 2020 年 2 月 21 日被中国银行保险监督管理委员会北京监管局罚款 2020 万元并责令改正。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

5.9.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	21,163.51
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	20,498,413.65

4	应收申购款	1,332,168.99
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	21,851,746.15

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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。

§6 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
本报告期期初基金份额总额	177,046,135.40	10,191,413,615.11	16,106,589.73
报告期基金总申购份额	279,545,732.51	7,108,595,248.64	37,351.45
报告期基金总赎回份额	257,897,050.24	4,276,291,430.13	7,381,339.54
报告期基金拆分变动份额	-	-	-
报告期期末基金份额总额	198,694,817.67	13,023,717,433.62	8,762,601.64

注：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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

本基金非发起式基金。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 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。

10.2 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

10.3 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。

二〇二〇年四月二十一日