

金鹰现金增益交易型货币市场基金

2020 年第 2 季度报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年七月十八日

§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 7 月 17 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 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金鹰增益货币
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	12,307,495,075.79 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	149,662,029.76 份	12,151,351,099.89 份	6,481,946.14 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4月1日-2020年6月30日)		
	金鹰现金增益 A	金鹰现金增益 B	金鹰现金增益 E
1.本期已实现收益	827,721.47	71,176,562.11	4,136.65
2.本期利润	827,721.47	71,176,562.11	4,136.65
3.期末基金资产净值	149,662,029.76	12,151,351,099.89	6,481,946.14

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	0.4815%	0.0009%	0.3357%	0.0000%	0.1458%	0.0009%
过去六个月	1.1475%	0.0015%	0.6713%	0.0000%	0.4762%	0.0015%
过去一年	2.4510%	0.0016%	1.3500%	0.0000%	1.1010%	0.0016%
过去三年	10.0505%	0.0024%	4.0451%	0.0000%	6.0054%	0.0024%
自基金合同生效起至今	11.3464%	0.0025%	4.4261%	0.0000%	6.9203%	0.0025%

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	0.5292%	0.0009%	0.3357%	0.0000%	0.1935%	0.0009%
过去六个月	1.2433%	0.0015%	0.6713%	0.0000%	0.5720%	0.0015%
过去一年	2.6461%	0.0016%	1.3500%	0.0000%	1.2961%	0.0016%
过去三年	10.6808%	0.0024%	4.0451%	0.0000%	6.6357%	0.0024%
自基金合同生效起至今	12.0432%	0.0025%	4.4261%	0.0000%	7.6171%	0.0025%

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	0.0522%	0.0006%	0.3357%	0.0000%	-0.2835%	0.0006%
过去六个月	0.3690%	0.0019%	0.6713%	0.0000%	-0.3023%	0.0019%
过去一年	0.7765%	0.0021%	1.3500%	0.0000%	-0.5735%	0.0021%
过去三年	6.9866%	0.0039%	4.0451%	0.0000%	2.9415%	0.0039%
自基金合同	8.2681%	0.0042%	4.4261%	0.0000%	3.8420%	0.0042%

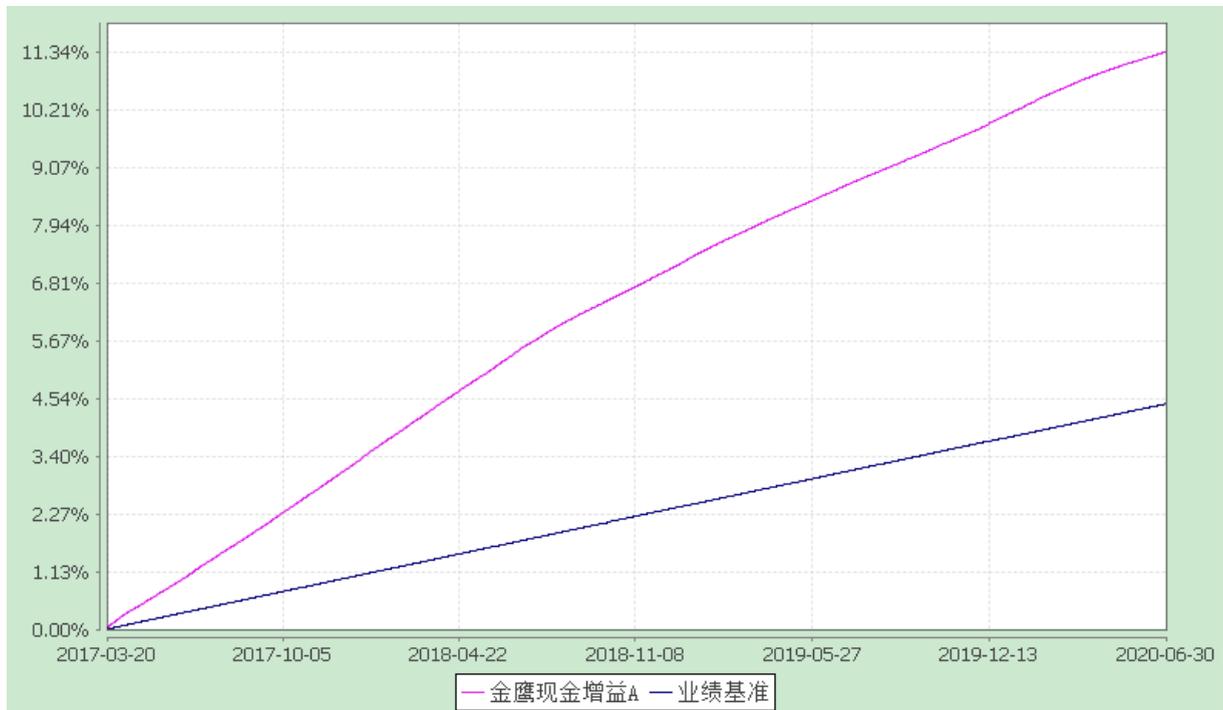
生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

注：本基金收益分配是按日结转份额。

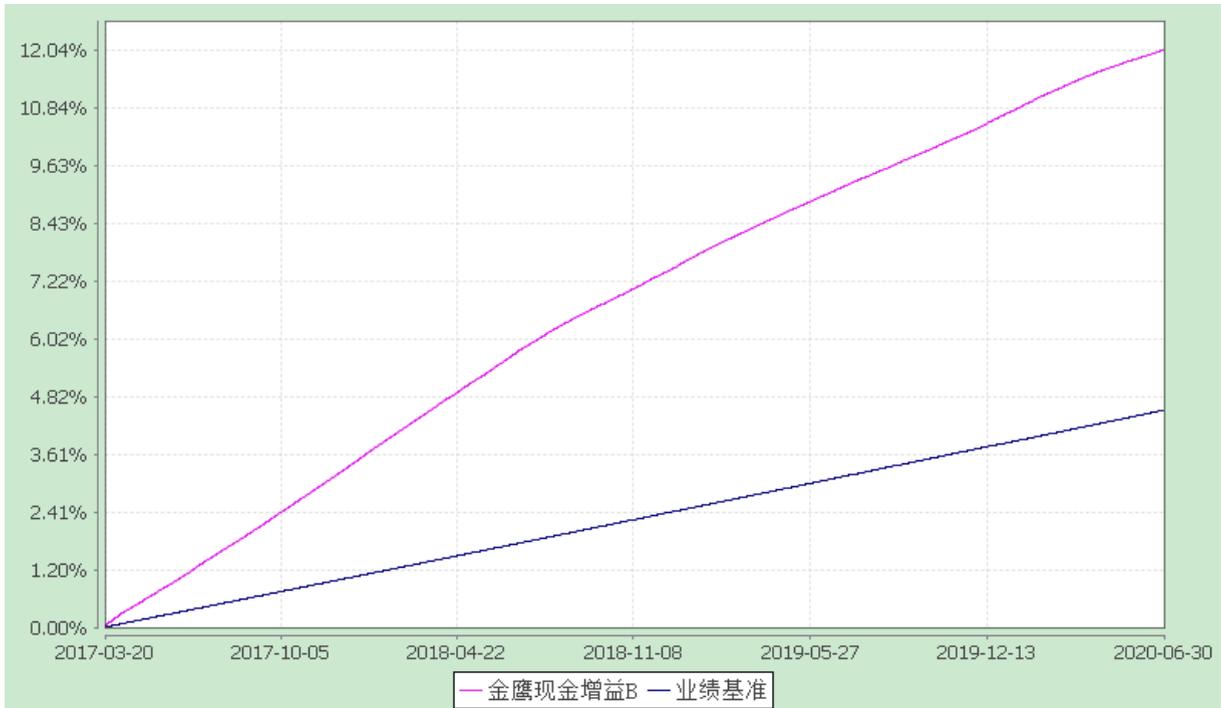
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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 6 月 30 日)

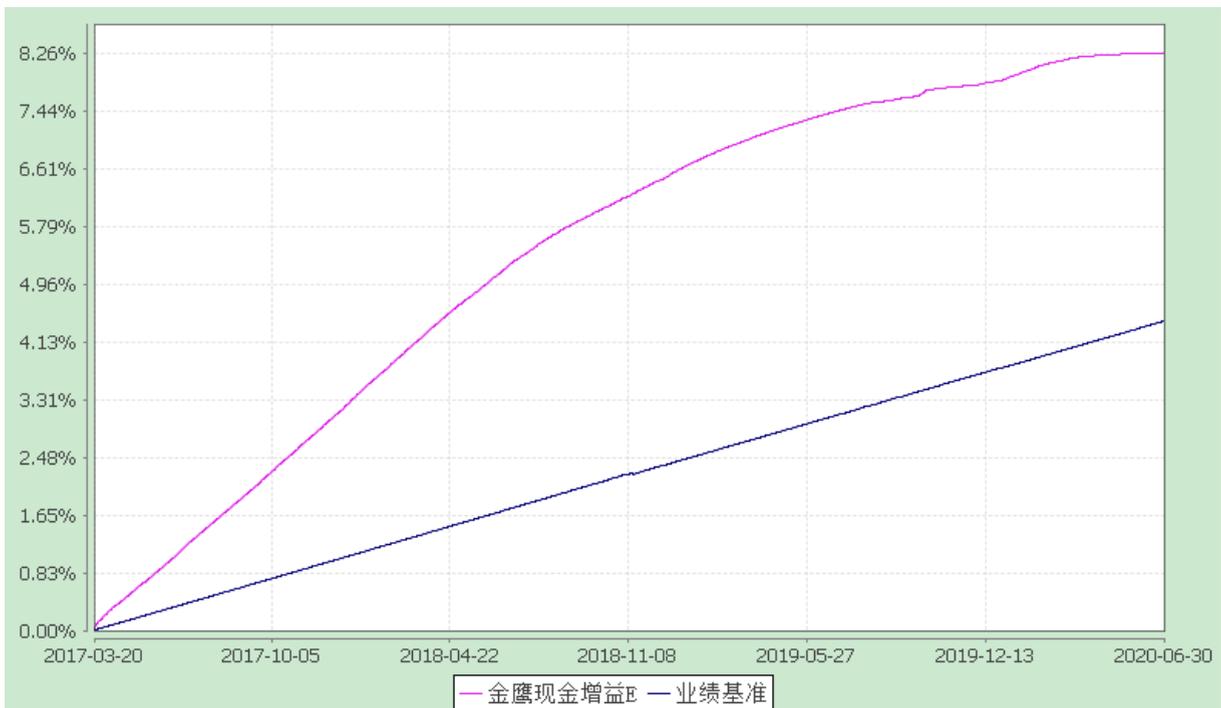
1、金鹰现金增益 A



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 年二季度，国内疫情已得到有效控制，随着逆周期政策的提前加码，各企业加快复工复产，欧美已逐步重启经济对外需构成一定支撑，整体经济基本面逐步复苏，基建、地产总体好于制造业投资。工业生产方面，黑色金属和有色金属价格都持续回升，夏季来临的季节性因素叠加工业用电量需求逐步恢复拉动发电耗煤量环比持续走

高，显示工业生产在逐步有序恢复；内需方面，土地成交面积和乘用车零售批发销量均持续回升。进出口方面，受海外疫情影响，防疫物资出口创历史新高，对出口构成短暂性支撑。食品价格方面，猪肉、蔬菜、水果等持续降价，国际油价有所回升但总体维持历史地位，通胀无忧。海外方面，中美关系加速恶化，5月下旬美国开始陆续发布对华制裁，先强化对华为使用美国半导体技术的限制，后又于5月29日宣布研究中国在美国上市公司规则、限制部分中国学生和学者入境美国、取消对香港的特别待遇政策、终止与世卫组织关系等；直到6月17日，外媒报道称经美国商务部证实，修改对与中国华为公司有业务往来的美国公司的禁令，允许它们与华为联手为5G网络制定标准。受此影响，人民币先贬后升，总体显现震荡格局。货币政策方面，央行延续一季度的宽松货币政策，为实体保障充裕的流动性。4月3日，央行公告将对中小银行定向降准1%，于4月15日和5月15日分两次实施到位，每次下调0.5%，共释放长期资金约4000亿；同时自4月7日起将金融机构在央行超额存款准备金利率从0.72%下调至0.35%，推动银行提高资金使用效率。5月，鉴于资金面有所收紧，央行于5月底重启公开市场操作，主要以开展7天逆回购为主，累计释放了6700亿资金，但价格尚未调降，略超预期。

受央行定向降准的利好影响，资金面宽松，4月初债券市场利率急速下行，长端下行10bp左右，短端下行50bp左右，1年利率债下至1.3左右，而1年存单下至1.6附近；利好兑现完毕，长短端皆进入震荡上行模式，4月总体上行20bp，1年存单调整至1.8附近。5月对流动性进一步宽松的预期迟迟未兑现，资金利率中枢抬升，短端跟随长端进入急速上行模式，6月初1年存单调整50bp至2.3左右，而3个月存单调整至2.1附近。整个6月央行公开市场操作较为保守，整体资金面中性，短端延续小幅震荡。

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；同时在四五月陆续止盈了部分1年期存单，保证了收益。

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0.4815%，业绩比较基准收益率为0.3357%；B类份额净值收益率为0.5292%，业绩比较基准收益率为0.3357%；E类份额净值收益率为0.0522%，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

展望三季度，宏观经济将延续渐进式修复，疫情可能反复的不确定性依旧对生产活动和生活带来一定制约，经济修复速度存在一定不确定性。从投资方面来看，总地产投资方面，地产销售该季度以来保持着较好的增速，加之土地购置费或将持续回升，带动地产投资或持续修复；基建投资方面，地方政府债的发行以及基建信托的规模逐渐增大，对基建投资增速构成支撑，下半年或将继续大幅上行；制造业投资预计修复较弱，主要归因于国内经济的不确定性犹存，政策支持力度也并未显著增大。进出口方面，随着海外陆续复工复产以及疫情持续恶化，医疗物资出口仍然较多，叠加之前出口订单和供给的转移，出口或保持较好增速；而进口方面主要受海外供给不足所拖累，总体或将延续贸易顺差的态势。CPI 方面，受暴雨天气的持续影响，蔬菜肉等价格或将有所抬升，影响食品项方面走高；而非食品项方面，则主要受油价企稳的影响而不再下跌，总体通胀将有所抬升。PPI 方面，虽然 5 月较 4 月有所回落，但随着油价大幅走高及黑色等工业品价格回升等，PPI 跌幅后续或将明显收窄，并将保持上行趋势。货币政策方面，为配合财政政策更快更好的修复实体经济，货币政策难言退出之时；但为避免资金淤积非实体空转套利，货币政策总体将保持中性，更进一步的宽松政策难见。

综合以上分析，本基金认为三季度债市将保持震荡趋势，短期内维持低仓位低久期的策略，密切观察疫情发展情况以及宏观高频数据变化，寻求一些交易性机会，在保持流动性安全的基础上增厚投资组合回报。

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	6,892,576,201.06	51.65

	其中：债券	6,744,230,614.65	50.54
	资产支持证券	148,345,586.41	1.11
2	买入返售金融资产	4,665,842,837.89	34.97
	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	1,758,537,201.25	13.18
4	其他资产	27,116,405.87	0.20
5	合计	13,344,072,646.07	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	13.83	
	其中：买断式回购融资	-	
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	591,949,306.15	4.81
	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	80
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	80
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	43

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	47.82	8.26
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天（含）—60天	17.54	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	15.88	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天（含）—120天	3.31	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天（含）—397天	23.66	-

	(含)		
	其中：剩余存续期超过 397天的浮动利率债	-	-
	合计	108.20	8.26

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	837,540,228.10	6.81
	其中：政策性金融债	605,259,495.78	4.92
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	444,926,272.56	3.62
6	中期票据	-	-
7	同业存单	5,461,764,113.99	44.38
8	其他	-	-
9	合计	6,744,230,614.65	54.80
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	3,000,000.00	294,533,138.37	2.39

		CD011			
2	111903112	19 农业银行 CD112	2,200,000.00	219,210,487.49	1.78
3	190307	19 进出 07	2,000,000.00	200,244,488.69	1.63
4	111983725	19 长沙银行 CD135	2,000,000.00	199,599,781.35	1.62
5	112011057	20 平安银行 CD057	2,000,000.00	199,365,365.03	1.62
6	112093555	20 汇丰银行 CD014	2,000,000.00	199,079,213.09	1.62
7	111910399	19 兴业银行 CD399	2,000,000.00	199,043,016.15	1.62
8	111905149	19 建设银行 CD149	2,000,000.00	198,306,418.61	1.61
9	112011089	20 平安银行 CD089	2,000,000.00	196,936,856.01	1.60
10	112006033	20 交通银行 CD033	2,000,000.00	196,556,078.38	1.60

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	0 次
报告期内偏离度的最高值	0.2032%
报告期内偏离度的最低值	0.0030%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1119%

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	138570	嘉泰 01 优	500,000.00	50,000,000.00	0.41

2	168089	安润 2A1	500,000.00	37,755,000.00	0.31
3	138294	荣耀 03A	300,000.00	30,205,886.41	0.25
4	168341	安润 4A1	200,000.00	17,510,000.00	0.14
5	168460	安润 5A1	100,000.00	10,000,000.00	0.08
6	168180	安润 3A1	34,000.00	2,874,700.00	0.02

注：本基金本报告期末仅持有6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农业银行股份有限公司，因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在错报漏报等行为，于 2020 年 4 月 22 日被中国银行保险监督管理委员会罚款 230 万元。因“两会一层”境外机构管理履职不到位等行为，于 2020 年 5 月 9 日被中国银行保险监督管理委员会罚款 200 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长沙银行股份有限公司，因账户可疑交易监测不到位等行为，于 2020 年 2 月 26 日被中国人民银行长沙市中心支行公开批评并罚款 80 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平安银行股份有限公司因汽车金融事业部将贷款调查的核心事项委托第三方完成等行为，于 2020 年 2 月 3 日被中国银行业监督管理委员会深圳监管局罚款 720 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国建设银行股份有限公司因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在漏报错报，于 2020 年 5 月 9 日被中国银行保险监督管理委员会罚款 230 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交通银行股份有限公司因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在漏报错报，于 2020 年 5 月 9 日被中国银行保险监督管理委员会罚款 260 万元。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	31,629.12
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	25,447,642.48
4	应收申购款	1,561,724.33
5	其他应收款	-
6	待摊费用	75,409.94
7	其他	-
8	合计	27,116,405.87

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	198,694,817.67	13,023,717,433.62	8,762,601.64
报告期基金总申购份额	224,917,560.98	5,702,439,535.10	1,173,736.65
报告期基金总赎回份额	273,950,348.89	6,574,805,868.83	3,454,392.15

报告期基金拆分变动份额	-	-	-
报告期期末基金份额总额	149,662,029.76	12,151,351,099.89	6,481,946.14

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。

金鹰基金管理有限公司

二〇二〇年七月十八日