

# 金鹰货币市场证券投资基金

## 2022 年中期报告

### 2022 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇二二年八月三十日

## § 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。本中期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 2022 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 债券回购融资情况	41
7.3 基金投资组合平均剩余期限	42
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	43
7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离	44
报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25% 情况说明	44
报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5% 情况说明	44
7.8 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	44
7.9 投资组合报告附注	44

<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	47
8.3 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	47
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
8.5 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.....	48
8.6 发起式基金发起资金持有份额情况.....	48
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	48
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	49
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件.....	49
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	50
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.9 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	51
10.10 其他重大事件.....	51
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
11.1 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
<b>§12 备查文件目录</b> .....	54
12.1 备查文件目录.....	54
12.2 存放地点.....	54
12.3 查阅方式.....	54

## §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	14,240,202,120.44 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	142,153,413.38 份	14,098,048,707.06 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。
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	凡湘平	李申
	联系电话	020-83936180	021-60637102
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		4006135888	021-60637111
传真		020-83282856	021-60635778
注册地址		广州市南沙区横沥镇汇通二街	北京市西城区金融大街25号

	2号3212房	
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	姚文强	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》
登载基金中期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>
基金中期报告备置地点	广东省广州市天河区珠江新城珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

## 2.5 其他相关资料

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

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日）	
	金鹰货币 A	金鹰货币 B
本期已实现收益	1,577,722.00	120,486,671.52
本期利润	1,577,722.00	120,486,671.52
本期净值收益率	0.9826%	1.1033%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
	金鹰货币 A	金鹰货币 B
期末基金资产净值	142,153,413.38	14,098,048,707.06
期末基金份额净值	1.00	1.00
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
	金鹰货币 A	金鹰货币 B
累计净值收益率	35.4672%	38.6140%

注：1、上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。

### 3.2 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

##### 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
过去一个月	0.1456%	0.0009%	0.1233%	0.0000%	0.0223%	0.0009%
过去三个月	0.4578%	0.0007%	0.3740%	0.0000%	0.0838%	0.0007%
过去六个月	0.9826%	0.0011%	0.7438%	0.0000%	0.2388%	0.0011%
过去一年	2.1133%	0.0015%	1.5000%	0.0000%	0.6133%	0.0015%
过去三年	6.8502%	0.0016%	4.5041%	0.0000%	2.3461%	0.0016%
自基金合同生效起至今	35.4672%	0.0069%	18.0466%	0.0017%	17.4206%	0.0052%

注：本基金收益分配是按日结转份额。

##### 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
过去一个月	0.1654%	0.0009%	0.1233%	0.0000%	0.0421%	0.0009%
过去三个月	0.5180%	0.0007%	0.3740%	0.0000%	0.1440%	0.0007%
过去六个月	1.1033%	0.0011%	0.7438%	0.0000%	0.3595%	0.0011%
过去一年	2.3588%	0.0015%	1.5000%	0.0000%	0.8588%	0.0015%
过去三年	7.6231%	0.0016%	4.5041%	0.0000%	3.1190%	0.0016%
自基金合同生效起至今	38.6140%	0.0069%	18.0466%	0.0017%	20.5674%	0.0052%

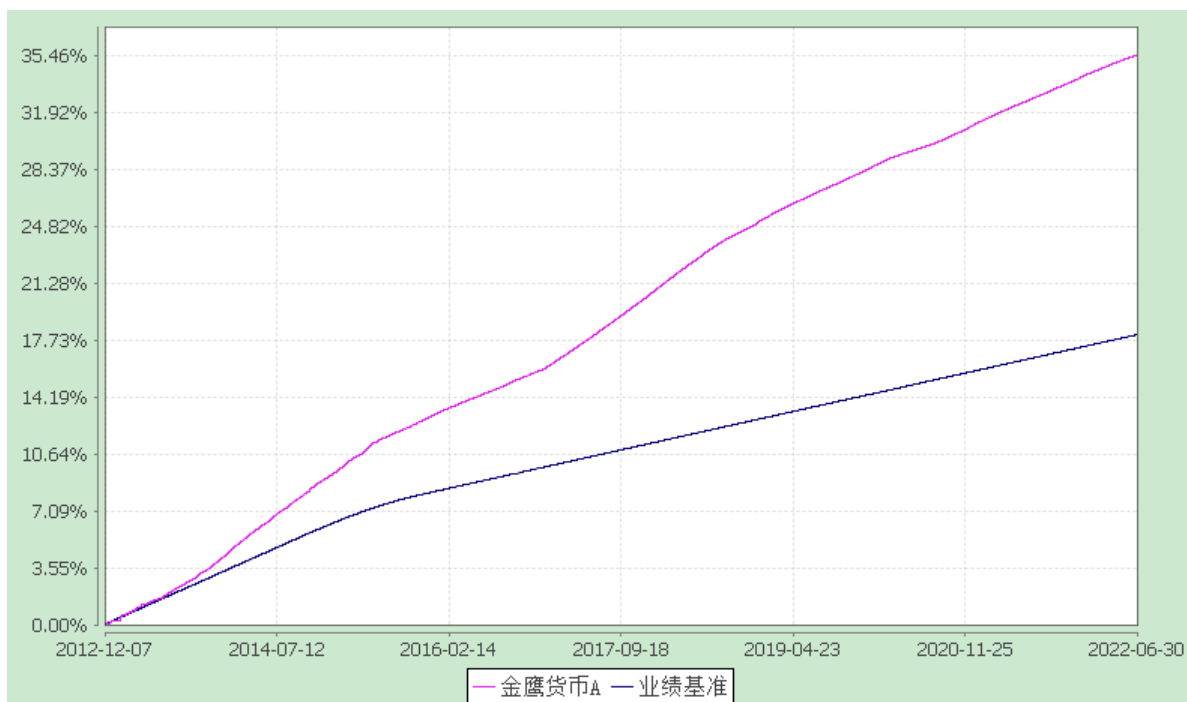
注：本基金收益分配是按日结转份额。

#### 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

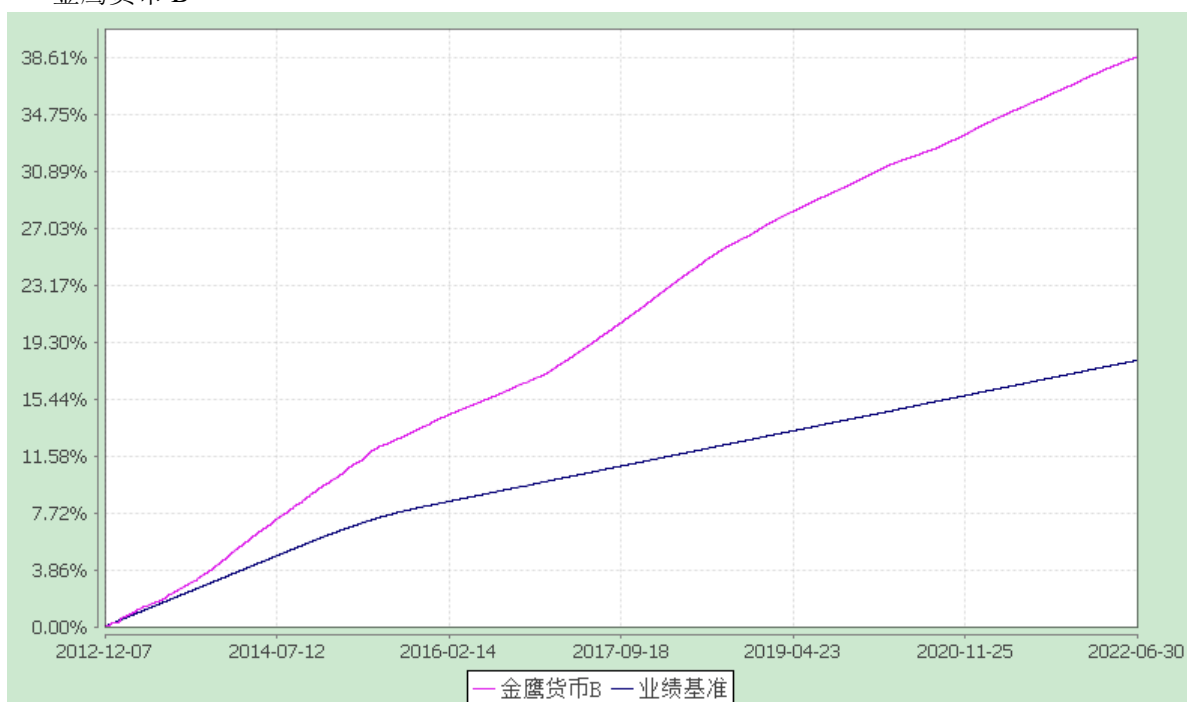
金鹰货币市场证券投资基金  
 份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2012 年 12 月 7 日至 2022 年 6 月 30 日)

金鹰货币 A



### 金鹰货币 B



- 注：1、本基金于 2012 年 12 月 7 日成立。
- 2、本报告期末，本基金各项投资比例符合基金合同约定。
- 3、本基金业绩比较基准为一年期定期存款利率（税后）。



## §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。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——广州金鹰资产管理有限公司成立。2015 年 12 月，获得受托管理保险资金投资管理资格。

“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。公司坚持价值投资为导向，着力打造高水准的投研团队，努力为投资者创造丰厚回报。金鹰基金拥有一支经验丰富，风格多元的投资团队。

公司秉承开放、包容、多元的投资文化，采取基金经理负责制，将产品契约与基金经理风格有机结合，鼓励基金经理个人风格的充分展现，强化产品投资风格的稳定性，逐步形成了风险收益特征多元，投资研究体系有机互补的整体投研平台和基金产品线。截至报告期末，合计管理公募基金 55 只。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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	本基金的基金经理，公司固定收益部总经理	2015-07-22	-	15	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，任固定收益部总经理。现任固定收益部基金经理。
周雅雯	本基金的基金经理	2022-07-27	-	5	周雅雯女士，上海财经大学金融学硕士研究生，2018 年 8 月加入金鹰基金管理有限公司，担任绝对收益投资部信用研究员职务，现任基金经理职务。
黄倩倩	本基金的基金经理	2019-04-26	2022-01-27	10	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，曾任债券交易员、基金经理助理、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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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、《金鹰货币市场证券投资基金合同》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，无损害基金持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司通过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中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，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间向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾上半年债券市场行情，在流动性较为宽松下，短端品种下行幅度较大，而长端品种在多重因素影响下呈窄幅区间震荡走势。年初在降息及经济悲观预期推动下，十年期国债收益率下行突破

2.7%的低位；春节后，受一月份金融数据超预期走强、国内稳增长信号明显、多地房地产政策边际松绑、俄乌冲突、海外流动性收紧等因素影响，债券收益率向上调整至上半年高位；3月中下旬，在二月份金融数据大幅低于市场预期、居民中长期贷款首次负增长、国内疫情多地爆发、3月降息预期落空等多重因素影响下，债券收益率震荡下行；4月中下旬，在中美利差倒挂、人民币快速贬值、金融数据好于预期、宽信用政策发力等利空因素影响下，十年期国债等长端利率向上调整；5月在资金利率中枢进一步下行、上海北京疫情对经济影响显现、金融数据大幅不及预期且结构不佳、全国经济相关电话工作会议凸显经济下行压力大，但并未推出非常规刺激政策，十年期国债再度下行至 2.7%左右低位；6月以来，随着上海复工复产、一系列稳增长政策细则落地、经济金融数据的修复，长端利率震荡向上，短端在季末因素影响下也小幅调整。整个上半年来看，十年期国债收益率小幅上行约 5BP，一年期国债收益率下行约 30BP，收益率曲线进一步陡峭化。

流动性层面，央行于 1 月降低公开市场逆回购及 MLF 操作利率各 10BP，在经济下行压力仍大、宽信用效果尚未显现前，货币市场流动性易松难紧。自 4 月以来，在全面降准、央行利润上缴、企业留抵退税、结构性工具投放及实体融资需求较弱等因素影响下，货币市场流动性极为宽松，隔夜回购利率维持在 1.5%左右低位，7 天回购利率在 1.8%左右，大幅低于 2.1%的公开市场 7 天操作利率，宽松维持时间超过市场预期。6 月末虽面临年中考核，但央行在公开市场大幅投放 4500 亿跨季资金维护市场流动性，跨季资金利率水平仍处于较低位置。

在流动性极为宽松背景下，作为货基主要配置标的的同业存单利率下行幅度也较大，1 年国股存单利率与 MLF 利率大幅倒挂，整体处于较低水平，收益率曲线极为陡峭。我们根据市场利率走势调整组合持仓，在市场收益率处于低位时，维持组合较低久期和杠杆；在月末、季末由于流动性小幅收紧，短端利率冲高时，加大对同业存款和存单的配置力度；严控投资标的信用风险和流动性风险，在回购利率受缴税、月末季末等时点冲击小幅冲高时，加大了逆回购配置比例，保持组合流动性的同时锁定收益；根据对市场流动性的判断以及对持有人结构分析，严格遵守流动性新规要求，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。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 6 月 30 日，基金 A 类份额本报告期份额净值收益率为 0.9826%，同期业绩比较基准收益率为 0.7438%；B 类份额本报告期份额净值收益率为 1.1033%，同期业绩比较基准收益率为 0.7438%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，从基本面来看，当前我国经济下行压力仍大，外部环境仍处复杂严峻。具体来看，

地产调控政策虽有转松，但在“房住不炒”的大原则下，地产销售数据仍未好转，房地产投资下行压力仍较大；今年财政前置，上半年专项债已基本发行完毕，三季度将加快财政资金使用进程，预计基建投资托底经济；在外需、地产投资及工业企业利润增速下滑影响下，制造业投资预计将小幅下行；出口在海外经济走弱下存下行隐忧；消费增速目前离疫情前仍有较大差距，在防疫常态化措施下，将持续温和复苏。PPI 已自高位逐步回落，预计 CPI 将温和抬升，继续运行在合理区间。关注海外通胀及加息对国内货币政策和汇率的影响。

流动性层面上，7 月以来，央行根据市场情况每日调整公开市场操作量，银行间市场回购利率相比二季度更低，流动性仍处于极宽松的状态。在经济基本面仍处疫后小复苏背景下，流动性收紧的可能性较低，但在美国加息、通胀上行压力下，政策利率调整空间受制约，继续加码放松的可能性也较低，预计在宽信用稳增长的推进下，回购资金利率小幅缓步向上，央行综合运用多种货币政策工具投放资金，保持流动性合理充裕。

基于以上判断，我们认为在经济下行压力仍大、宽信用尚未见效前，预计市场流动性将维持较宽松的水平，但目前短端利率已偏离政策利率较多，处于历史较低水平，进一步下行空间受限，在政策利率未调整及经济企稳前，预计利率将呈现窄幅区间震荡行情，如因时点或事件冲击导致收益率较快上行时，或将提供较好的投资机会。我们将在缴税、月末季末等资金季节性紧张时点加大对高利率同业存单存款、长期限逆回购的配置，适度拉长组合久期和提升杠杆，精选资质较好、性价比比较高的优质信用债进行配置，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，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、基金估值核算负责人、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、中债金融估值中心有限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 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内无应当说明的预警事项。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，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，本基金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，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

#### 5.3 托管人对本中期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 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：金鹰货币市场证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	794,137,889.09	1,330,574,904.47
结算备付金		49,036,634.58	10,161,832.39
存出保证金		2,881.17	7,975.24
交易性金融资产	6.4.7.2	8,559,456,976.15	6,554,194,581.44
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		8,556,516,628.77	6,111,688,049.21
资产支持证券投资		2,940,347.38	442,506,532.23
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	4,840,878,091.08	3,557,080,731.43
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		302,887.14	12,206,926.13
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	29,111,275.29
资产总计		14,243,815,359.21	11,493,338,226.39
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	49,999,855.00
应付清算款		-	139,499,520.42
应付赎回款		24,270.02	120,386.15
应付管理人报酬		1,667,164.47	2,720,468.94
应付托管费		520,988.91	824,384.51
应付销售服务费		133,147.93	119,997.19
应付投资顾问费		-	-

应交税费		18,604.57	30,287.17
应付利润		875,539.67	916,389.85
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	373,523.20	450,087.55
负债合计		3,613,238.77	194,681,376.78
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	14,240,202,120.44	11,298,656,849.61
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-	-
净资产合计		14,240,202,120.44	11,298,656,849.61
负债和净资产总计		14,243,815,359.21	11,493,338,226.39

注：截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.0000 元，A 类基金份额总额为 142,153,413.38 份；B 类基金份额净值为 1.0000 元，B 类基金份额总额为 14,098,048,707.06 份。

## 6.2 利润表

会计主体：金鹰货币市场证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		146,926,149.98	152,056,706.91
1.利息收入		59,203,780.88	147,964,320.97
其中：存款利息收入	6.4.7.9	17,605,425.25	13,356,182.22
债券利息收入		-	80,843,900.62
资产支持证券利息收入		-	7,407,830.42
买入返售金融资产收入		41,598,355.63	46,356,407.71
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		87,722,369.10	4,092,385.94
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	84,794,666.34	4,094,751.37
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	2,927,702.76	-2,365.43
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号	6.4.7.17	-	-

填列)			
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		24,861,756.46	25,679,060.56
1. 管理人报酬		15,303,038.86	16,550,488.16
2. 托管费		4,663,753.87	5,015,299.44
3. 销售服务费		745,347.92	681,594.75
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		4,005,079.57	3,159,632.90
其中：卖出回购金融资产支出		4,005,079.57	3,159,632.90
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		10,062.43	121,915.27
8. 其他费用	6.4.7.19	134,473.81	150,130.04
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>122,064,393.52</b>	<b>126,377,646.35</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>122,064,393.52</b>	<b>126,377,646.35</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		122,064,393.52	126,377,646.35

### 6.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	11,298,656,849.61	-	-	11,298,656,849.61
二、本期期初净资产（基金净值）	11,298,656,849.61	-	-	11,298,656,849.61
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,941,545,270.83	-	-	2,941,545,270.83
（一）、综合收益总额	-	-	122,064,393.52	122,064,393.52
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	2,941,545,270.83	-	-	2,941,545,270.83



(净值减少以“-”号填列)				
其中: 1.基金申购款	21,503,876,390.09	-	-	21,503,876,390.09
2.基金赎回款	-18,562,331,119.26	-	-	-18,562,331,119.26
(三)、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)	-	-	-122,064,393.52	-122,064,393.52
四、本期期末净资产(基金净值)	14,240,202,120.44	-	-	14,240,202,120.44
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益(若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	11,060,212,700.49	-	-	11,060,212,700.49
二、本期期初净资产(基金净值)	11,060,212,700.49	-	-	11,060,212,700.49
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-195,639,267.27	-	-	-195,639,267.27
(一)、综合收益总额	-	-	126,377,646.35	126,377,646.35
(二)、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)	-195,639,267.27	-	-	-195,639,267.27
其中: 1.基金申购款	14,659,890,437.31	-	-	14,659,890,437.31
2.基金赎回款	-14,855,529,704.58	-	-	-14,855,529,704.58
(三)、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)	-	-	-126,377,646.35	-126,377,646.35
四、本期期末净资产(基金净值)	10,864,573,433.22	-	-	10,864,573,433.22

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4, 财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人：周蔚，主管会计工作负责人：耿源，会计机构负责人：董霞

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本基金的财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则(以下简称“企业会计准则”)要求，并按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在会计核算和信息披露方面亦参考了中国证券投资基金业协会（以下简称“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》及其发布的若干基金行业实务操作。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会及基金业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

### 6.4.4 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

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量（修订）》、《企业会计准则

第 23 号—金融资产转移（修订）》、《企业会计准则第 24 号—套期会计（修订）》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报（修订）》（以下统称“新金融工具准则”）相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，本基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。本基金按照新金融工具准则的衔接规定，对新金融工具准则施行日（即 2022 年 1 月 1 日）未终止确认的金融工具的分类和计量（含减值）进行追溯调整。本基金于本报告期采用的会计政策、会计估计以及执行新金融工具准则对 2022 年 1 月 1 日本基金资产负债表各项目的具体影响可参照财务报表附注 6.4.5。

#### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### 1. 金融资产的分类

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产包括债券投资、资产支持证券和衍生工具投资等，其中债券投资和资产支持证券在资产负债表中作为交易性金融资产列报，衍生工具投资在资产负债表中作为衍生金融资产列报。

##### 2. 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

##### - 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

##### - 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认，相关交易费用计入初始确认金额。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取

得时支付的价款中包含已宣告但尚未发放的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

#### 1. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

债券及资产支持证券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一估值日评估影子价格（即相关金融工具的公允价值），以避免上述投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。

#### 2. 金融负债

买入返售金融资产采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

卖出回购金融资产款采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，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。

终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金的债券投资等金融资产，均以实际利率法计算的摊余成本估算公允价值。为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用金融工具的公允价值确定影子价格。

当影子定价确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的负偏离度绝对值达到 0.25% 时，基金管理人应当在 5 个交易日内将负偏离度绝对值调整到 0.25% 以内。当正偏离度绝对值达到 0.5% 时，基金管理人应当暂停接受申购并在 5 个交易日内将正偏离度绝对值调整到 0.5% 以内。当负偏离度绝对值达到 0.5% 时，基金管理人应当使用风险准备金或者固有资金弥补潜在资产损失，将负偏离度绝对值控制在 0.5% 以内。当负偏离度绝对值连续两个交易日超过 0.5% 时，基金管理人应当采用公允价值估值方法对持有投资组合的账面价值进行调整，或者采取暂停接受所有赎回申请并终止基金合同进行财产清算等措施。

计算影子价格时按如下原则确定金融工具的公允价值：

1、存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2、对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

3、如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

4、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融工具公允价值的，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。

#### **6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### **6.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金红利再投资和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。

#### **6.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量**

##### **1. 利息收入**

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

(2) 买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

##### **2. 投资收益**

(1) 债券、资产支持证券投资收益于卖出证券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应收利息及相关费用(若有)后的差额确认。

(2) 衍生工具投资收益于交易日按交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本及相关费用(若有)后的差额确认。

(3) 债券、资产支持证券利息按其投资的摊余成本与实际利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认,在证券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债,采用实际支付价款(包含交易费用)确定初始成本,每日按摊余成本和实际利率确定投资收益。

### 3、其他收入

在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以计量的时候确认。

#### 6.4.4.9 费用的确认和计量

1. 本基金的基金管理费按前一日基金资产净值 $\times 0.16\%$ 的年费率逐日计提。

2. 本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 $\times 0.05\%$ 的年费率逐日计提。

3. 本基金 A 类基金份额和 B 类基金份额的销售服务费分别按前一日该类基金资产净值的  $0.25\%$  和  $0.01\%$  的年费率逐日计提。

4. 卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额,在资金实际占用期内以实际利率法逐日确认,直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

#### 6.4.4.10 基金的收益分配政策

1、本基金同一类别内的每份基金份额享有同等分配权;

2、本基金收益分配方式为红利再投资,免收再投资的费用;

3、“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。

#### 6.4.4.11 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

#### 6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

无其他重要的会计政策和会计估计。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量（修订）》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移（修订）》、《企业会计准则第 24 号—套期会计（修订）》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报（修订）》（以下统称“新金融工具准则”）相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，本基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

新金融工具准则修订了财政部于 2006 年颁布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》和《企业会计准则第 24 号——套期保值》以及财政部于 2014 年修订的《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“原金融工具准则”）。

新金融工具准则将金融资产划分为三个基本分类：（1）以摊余成本计量的金融资产；（2）以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；及（3）以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在新金融工具准则下，金融资产的分类是基于本基金管理金融资产的业务模式及该资产的合同现金流量特征而确定。新金融工具准则取消了原金融工具准则中规定的持有至到期投资、贷款和应收款项及可供出售金融资产三个分类类别。根据新金融工具准则，嵌入衍生工具不再从金融资产的主合同中分拆出来，而是将混合金融工具整体适用关于金融资产分类的相关规定。同时，原债券、资产支持证券利息收入计入投资收益。

本基金按照新金融工具准则的衔接规定，对新金融工具准则施行日（即 2022 年 1 月 1 日）未终止确认的金融工具的分类和计量（含减值）进行追溯调整。本基金未调整比较财务报表数据，将金融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行日的新账面价值之间的差额计入 2022 年年初留存收益或其他综合收益。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

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》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《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》、财税[2015]101号《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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1.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;对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税;同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。2018年1月1日(含)以后,资管产品管理人(以下称管理人)运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,以管理人为增值税纳税人,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日以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,已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

2.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。

3.对基金从上市公司取得的股息、红利所得,由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起,对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额: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,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入个人所得税应纳税所得额。

4.对基金取得的债券利息收入,由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税,暂不缴纳企业所得税。



5.对于基金从事 A 股买卖, 出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税, 对受让方不再缴纳印花税。

6.基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价, 暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

7.对基金在 2018 年 1 月 1 日 (含) 以后运营过程中缴纳的增值税, 分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率, 计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	534,401.12
等于: 本金	529,513.93
加: 应计利息	4,887.19
定期存款	793,603,487.97
等于: 本金	790,000,000.00
加: 应计利息	3,603,487.97
其中: 存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	200,111,111.10
存款期限 3 个月以上	593,492,376.87
其他存款	-
等于: 本金	-
加: 应计利息	-
合计	794,137,889.09

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目		本期末 2022 年 6 月 30 日			
		按实际利率计算的 账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	8,556,516,628.77	8,560,089,034.51	3,572,405.74	0.0251
	合计	8,556,516,628.77	8,560,089,034.51	3,572,405.74	0.0251
资产支持证券		2,940,347.38	2,943,347.38	3,000.00	0.0000
合计		8,559,456,976.15	8,563,032,381.89	3,575,405.74	0.0251

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债****6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额**

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

**6.4.7.4 买入返售金融资产****6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,617,165,371.38	-
银行间市场	3,223,712,719.70	-
合计	4,840,878,091.08	-

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 其他资产**

本基金本报告期末无其他资产。

**6.4.7.6 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	171,825.34
其中：交易所市场	-
银行间市场	171,825.34
应付利息	-
其他应付款	10,575.00
预提审计费用	22,315.49
预提信息披露费	159,507.37
预提中债登账户维护费	4,500.00
预提上清所账户维护费	4,800.00
合计	373,523.20

**6.4.7.7 实收基金****金鹰货币 A**

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	254,593,701.20	254,593,701.20
本期申购	186,529,691.60	186,529,691.60
本期赎回（以“-”号填列）	-298,969,979.42	-298,969,979.42
本期末	142,153,413.38	142,153,413.38

**金鹰货币 B**

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,044,063,148.41	11,044,063,148.41
本期申购	21,317,346,698.49	21,317,346,698.49
本期赎回（以“-”号填列）	-18,263,361,139.84	-18,263,361,139.84
本期末	14,098,048,707.06	14,098,048,707.06

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。

**6.4.7.8 未分配利润**

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。

**6.4.7.9 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	8,755.59
定期存款利息收入	11,208,141.05
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	6,388,480.38
其他	48.23
合计	17,605,425.25

**6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入**

本基金本报告期无股票投资收益。

**6.4.7.11 基金投资收益**

本基金本报告期无基金投资收益。

**6.4.7.12 债券投资收益****6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	79,818,314.83
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	4,976,351.51
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	84,794,666.34

#### 6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	10,208,113,447.11
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	10,175,445,165.76
减：应计利息总额	27,691,929.84
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	4,976,351.51

#### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	2,922,723.08
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	4,979.68
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	2,927,702.76

##### 6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日

卖出资产支持证券成交总额	456,254,805.50
减：卖出资产支持证券成本总额	449,341,320.32
减：应计利息总额	6,908,505.50
减：交易费用	-
资产支持证券投资收益	4,979.68

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

本基金本报告期无公允价值变动收益。

#### 6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	22,315.49
信息披露费	59,507.37
汇划手续费	36,890.95
账户维护费	15,760.00
合计	134,473.81

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

#### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

关联方名称	与本基金的关系
金鹰基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

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。

**6.4.10.1.2 权证交易**

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权证交易。

**6.4.10.1.3 债券交易**

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交易。

**6.4.10.1.4 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。

**6.4.10.1.5 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。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	15,303,038.86	16,550,488.16
其中：支付销售机构的客户维护费	667,471.98	585,097.34

注：1、在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.16% 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 × 0.16% / 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。

2、自 2022 年 5 月 10 日起，本基金的基金管理费由“按前一日基金资产净值的 0.33% 年费率计提”调整为“按前一日基金资产净值的 0.16% 年费率计提”。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,663,753.87	5,015,299.44

注：1、基金托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 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×0.05%/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。

2、自 2022 年 5 月 10 日起，本基金的基金托管费由“按前一日基金资产净值的 0.10% 年费率计提”调整为“按前一日基金资产净值的 0.05% 年费率计提”。

**6.4.10.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2022年1月1日至2022年6月30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
中国建设银行股份有限公司	30,811.15	198.75	31,009.90
金鹰基金管理有限公司	45,172.66	460,750.72	505,923.38
合计	75,983.81	460,949.47	536,933.28
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2021年1月1日至2021年6月30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
中国建设银行股份有限公司	37,664.68	234.08	37,898.76
金鹰基金管理有限公司	26,851.14	437,733.88	464,585.02
合计	64,515.82	437,967.96	502,483.78

注：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。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	金鹰货币A	金鹰货币B	金鹰货币A	金鹰货币B
基金合同生效日 (2012年12月7日)				
持有的基金份额	0.00	0.00	0.00	0.00
报告期初持有的基 金份额	0.00	114,214,048.92	0.00	42,540,391.69
报告期间申购/买入 总份额	0.00	1,412,481.38	0.00	30,186,544.59
报告期间因拆分变 动份额	0.00	0.00	0.00	0.00
减：报告期间赎回/ 卖出总份额	0.00	0.00	0.00	59,780,000.00
报告期末持有的基 金份额	0.00	115,626,530.30	0.00	12,946,936.28
报告期末持有的基 金份额占基金总份 额比例	0.00%	0.82%	0.00%	0.12%

注：报告期申购总份额中包含了当期因分红收益变动增加的份额。

##### 6.4.10.4.2 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

本报告期末及上年度末无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 B



本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	534,401.12	8,755.59	3,311,577.65	2,962.44

注：本基金用于证券交易结算的资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司等结算账户，按银行同业利率或约定利率计息，在资产负债表“结算备付金”科目单独列示。2022年6月30日清算备付金期末余额 49,036,634.58 元，清算备付金利息收入 6,388,480.38 元；2021年6月30日清算备付金期末余额 0.00 元，清算备付金利息收入 378,907.43 元。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

##### 6.4.10.7.2 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无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。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 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
1,589,006.62	-	-11,284.62	1,577,722.00	-

##### 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
120,516,237.08	-	-29,565.56	120,486,671. 52	-

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。

#### 6.4.12 期末（2022 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发而流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

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

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

###### 1、风险管理控制制度

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

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

###### 2、投资管理制度

投资管理制度包括研究业务管理制度、投资决策管理制度、基金交易管理制度等。

制订研究业务管理制度的目的是保持研究工作的独立、客观。研究业务管理制度包括：建立严

密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法；根据基金合同要求，在充分研究的基础上建立和维护投资对象备选库；建立研究与投资的业务交流制度，保持通畅的交流渠道；建立研究报告质量评价体系。

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

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

### 3、监察稽核制度

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

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	0.00	60,000,826.10
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	20,051,072.87	319,729,061.56
合计	20,051,072.87	379,729,887.66

注：本统计数据未包含国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债、同业存单。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末	上年度末
--------	-----	------

	2022年6月30日	2021年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：以上数据按照最新发行人评级填列。

#### 6.4.13.2.4 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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	0.00	120,495,571.77
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	120,495,571.77

注：本统计数据未包含国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债、同业存单。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	2,940,347.38	442,506,532.23
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	2,940,347.38	442,506,532.23

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	7,593,420,420.91	4,576,556,264.14
AAA 以下	168,738,197.05	463,911,404.05
未评级	0.00	0.00
合计	7,762,158,617.96	5,040,467,668.19

注：以上数据按照最新发行人评级填列。

### 6.4.13.3 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。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限资产投资比例等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间市场进行交易，除本报告所列示的期末本基金持有的流通受限证券暂时不能自由转让外，本基金持有的其余资产均能及时变现。评估结果显示本基金的组合持仓变现能力较好，流动性风险可控。

### 6.4.13.4 市场风险

市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	794,137,889.09	-	-	-	794,137,889.09
结算备付金	49,036,634.58	-	-	-	49,036,634.58

存出保证金	2,881.17	-	-	-	2,881.17
交易性金融资产	8,559,456,976.15	-	-	-	8,559,456,976.15
买入返售金融资产	4,840,878,091.08	-	-	-	4,840,878,091.08
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	302,887.14	302,887.14
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	14,243,512,472.07	-	-	302,887.14	14,243,815,359.21
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	24,270.02	24,270.02
应付管理人报酬	-	-	-	1,667,164.47	1,667,164.47
应付托管费	-	-	-	520,988.91	520,988.91
应付销售服务费	-	-	-	133,147.93	133,147.93
应交税费	-	-	-	18,604.57	18,604.57
应付利润	-	-	-	875,539.67	875,539.67
其他负债	-	-	-	373,523.20	373,523.20
负债总计	-	-	-	3,613,238.77	3,613,238.77
利率敏感度缺口	14,243,512,472.07	-	-	-3,310,351.63	14,240,202,120.44
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,330,574,904.47	-	-	-	1,330,574,904.47
结算备付金	10,161,832.39	-	-	-	10,161,832.39
存出保证金	7,975.24	-	-	-	7,975.24
交易性金融资产	6,554,194,581.44	-	-	-	6,554,194,581.44

买入返售金融资产	3,557,080,731.43	-	-	-	3,557,080,731.43
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	29,111,275.29	29,111,275.29
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	12,206,926.13	12,206,926.13
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	11,452,020,024.97	-	-	41,318,201.42	11,493,338,226.39
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	49,999,855.00	-	-	-	49,999,855.00
应付证券清算款	-	-	-	139,499,520.42	139,499,520.42
应付赎回款	-	-	-	120,386.15	120,386.15
应付管理人报酬	-	-	-	2,720,468.94	2,720,468.94
应付托管费	-	-	-	824,384.51	824,384.51
应付销售服务费	-	-	-	119,997.19	119,997.19
应付交易费用	-	-	-	179,987.15	179,987.15
应交税费	-	-	-	30,287.17	30,287.17
应付利息	-	-	-	-14,251.32	-14,251.32
应付利润	-	-	-	916,389.85	916,389.85
其他负债	-	-	-	284,351.72	284,351.72
负债总计	49,999,855.00	-	-	144,681,521.78	194,681,376.78
利率敏感度缺口	11,402,020,169.97	-	-	-103,363,320.36	11,298,656,849.61

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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
		2022年6月30日	2021年12月31日
	利率上升 25 个基点	-6,128,498.52	-5,362,194.57
	利率下降 25 个基点	6,152,712.06	5,385,911.21

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

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

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资占基金资产净值的比例为 0.00%，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响，所以未进行其他价格风险的敏感性分析。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层次可分为：

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次输入值是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。

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	8,559,456,976.15	6,554,194,581.44
第三层次	-	-
合计	8,559,456,976.15	6,554,194,581.44



**6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动**

本基金本报告期内无公允价值所属层级间的重大变动。

**6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

**6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

**6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

于 2022 年 6 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

**§7 投资组合报告****7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	8,559,456,976.15	60.09
	其中：债券	8,556,516,628.77	60.07
	资产支持证券	2,940,347.38	0.02
2	买入返售金融资产	4,840,878,091.08	33.99
	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	843,174,523.67	5.92
4	其他各项资产	305,768.31	0.00
5	合计	14,243,815,359.21	100.00

注：其他各项资产包括：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、待摊费用。

**7.2 债券回购融资情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)
----	----	----------------

1	报告期内债券回购融资余额	4.40	
	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	0.00	0.00
	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

本基金本报告期债券正回购的资金余额均未超过基金资产净值的 20%。

## 7.3 基金投资组合平均剩余期限

### 7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	71
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	26

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内无投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

### 7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	37.98	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	11.35	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	18.89	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	11.05	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	20.63	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

合计	99.89	0.00
----	-------	------

#### 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内不存在投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	39,924,557.02	0.28
2	央行票据	-	-
3	金融债券	734,382,380.92	5.16
	其中：政策性金融债	734,382,380.92	5.16
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	20,051,072.87	0.14
6	中期票据	-	-
7	同业存单	7,762,158,617.96	54.51
8	其他	-	-
9	合计	8,556,516,628.77	60.09
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

#### 7.6 期末按实际利率计算账面价值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）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	112281892	22 广州农村商业银行 CD077	5,000,000.00	497,858,018.98	3.50
2	112206078	22 交通银行 CD078	3,000,000.00	298,736,548.30	2.10
3	112282087	22 西安银行 CD008	3,000,000.00	298,664,177.11	2.10
4	112282234	22 重庆农村商行 CD137	3,000,000.00	298,645,742.46	2.10
5	112219218	22 恒丰银行 CD218	3,000,000.00	294,958,007.18	2.07

6	112109239	21 浦发银行 CD239	2,500,000.00	249,370,466.00	1.75
7	190214	19 国开 14	2,200,000.00	224,999,051.99	1.58
8	112103099	21 农业银行 CD099	2,000,000.00	199,747,194.19	1.40
9	112298993	22 长沙银行 CD110	2,000,000.00	199,564,278.09	1.40
10	112104043	21 中国银行 CD043	2,000,000.00	199,371,040.29	1.40

### 7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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	0.0784%
报告期内偏离度的最低值	0.0129%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0510%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内不存在负偏离度的绝对值达到 0.25% 情况。

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到 0.5% 情况。

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	193404	永安 6A1	300,000.00	2,940,347.38	0.02

注：本基金本报告期末仅持有 1 只资产支持证券。

### 7.9 投资组合报告附注

#### 7.9.1 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。

**7.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体之一的广州农村商业银行股份有限公司因违反金融统计管理规定、违反支付结算管理规定等未依法履行其他职责的行为，于 2022 年 6 月 28 日被中国人民银行广州分行公开处罚、批评、给予警告，罚款 232.9 万元；因对非保本同业理财产品出具保本保收益承诺、虚假转让非标债权资产，于 2022 年 1 月 30 日被中国银行保险监督管理委员会广东监管局公开处罚，罚款 100 万元；因未按规定履行客户身份识别义务、未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告等未依法履行其他职责的行为，于 2022 年 1 月 6 日被中国人民银行广州分行公开处罚，罚款 590 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违法违规等未依法履行其他职责的行为，于 2022 年 3 月 25 日被中国银行保险监督管理委员会公开处罚，罚款 420 万元；因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，于 2021 年 8 月 20 日被中国人民银行公开处罚，罚款 62 万元；因理财业务和同业业务制度不健全等未依法履行其他职责的行为，于 2021 年 7 月 16 日被中国银行保险监督管理委员会公开处罚，罚款 4100 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西安银行股份有限公司因整改不到位、屡查屡犯，贷款用途改变且风险分类不实等未依法履行其他职责的行为，于 2022 年 1 月 29 日被中国银行保险监督管理委员会陕西监管局公开处罚，罚款 282 万元；因信贷业务违规、员工行为管理不到位，2022 年 1 月 26 日被中国银行保险监督管理委员会陕西监管局公开处罚，罚款 100 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重庆农村商业银行股份有限公司因未按照规定履行客户身份识别义务、未按规定保存客户身份资料和交易记录等未依法履行其他职责的行为，于 2022 年 6 月 17 日被中国人民银行重庆营业管理部公开处罚，罚款 255 万元；因信贷资金被挪用、个人经营性贷款未按规定受托支付，2022 年 1 月 28 日被中国银行保险监督管理委员会重庆监管局公开处罚，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恒丰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违法违规等未依法履行其他职责的行为，于 2022 年 3 月 25 日被中国银行

保险监督管理委员会公开处罚，罚款 480 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上海浦东发展银行股份有限公司因为监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送存在违法违规等未依法履行其他职责的行为，于 2022 年 3 月 25 日被中国银行保险监督管理委员会公开处罚，罚款 420 万元；因配合现场检查不力等未依法履行其他职责的行为，于 2021 年 7 月 16 日被中国银行保险监督管理委员会公开处罚，处罚款共计 6,920 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国家开发银行因为监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送存在违法违规等未依法履行其他职责的行为，于 2022 年 3 月 25 日被中国银行保险监督管理委员会公开处罚，罚款 440 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农业发展银行因为监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送存在违法违规等未依法履行其他职责的行为，于 2022 年 3 月 25 日被中国银行保险监督管理委员会公开处罚，罚款 480 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经营用途贷款直接流入房地产企业、贷款管理不到位，经营用途贷款间接流入房地产企业等未依法履行其他职责的行为，于 2022 年 2 月 18 日被中国银行保险监督管理委员会湖南监管局公开处罚，罚款 130 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银行股份有限公司因中国银行理财业务老产品规模在部分时点出现反弹的违法违规等未依法履行其他职责，于 2022 年 6 月 2 日被中国银行保险监督管理委员会公开处罚，罚款 200 万元；因监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送存在违法违规等未依法履行其他职责的行为，于 2022 年 3 月 25 日被中国银行保险监督管理委员会公开处罚，罚款 480 万元。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

### 7.9.3 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	2,881.17
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	302,887.14
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-

7	其他	-
8	合计	305,768.31

#### 7.9.4 其他需说明的重要事项

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### §8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
金鹰货币 A	92,725	1,533.06	29,221,378.01	20.56%	112,932,035.37	79.44%
金鹰货币 B	121	116,512,799.23	14,064,175,968.32	99.76%	33,872,738.74	0.24%
合计	92,846	153,374.43	14,093,397,346.33	98.97%	146,804,774.11	1.03%

#### 8.2 期末上市基金前十名持有人

本基金非上市基金。

#### 8.3 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	保险类机构	600,132,903.61	4.21%
2	银行类机构	511,395,488.86	3.59%
3	保险类机构	489,872,543.90	3.44%
4	保险类机构	422,198,926.25	2.96%
5	保险类机构	413,626,909.92	2.90%
6	券商类机构	409,894,181.70	2.88%
7	银行类机构	404,512,102.45	2.84%
8	保险类机构	404,388,205.30	2.84%

9	券商类机构	403,436,951.28	2.83%
10	券商类机构	403,231,691.72	2.83%

#### 8.4 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	2,495,926.35	1.76%
	金鹰货币 B	0.00	0.00%
	合计	2,495,926.35	0.02%

#### 8.5 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	10~50
	金鹰货币 B	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	金鹰货币 A	0~10
	金鹰货币 B	0
	合计	0~10

#### 8.6 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金非发起式基金。

### 9 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	254,593,701.20	11,044,063,148.41
本报告期基金总申购份额	186,529,691.60	21,317,346,698.49
减：本报告期基金总赎回份额	298,969,979.42	18,263,361,139.84
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	142,153,413.38	14,098,048,707.06

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。



## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会，无会议决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期，本基金管理人高级管理人员进行了调整。2022 年 3 月 5 日，王铁先生离任公司董事长；姚文强先生离任公司总经理，转任公司董事长；周蔚女士离任公司常务副总经理，转任公司总经理。2022 年 3 月 18 日，公司法定代表人变更为姚文强先生。2022 年 3 月 19 日，姚文强先生离任公司首席信息官；刘盛先生离任公司督察长，转任公司副总经理兼首席信息官；凡湘平先生担任公司督察长。截至报告日，姚文强先生担任公司董事长及法定代表人，周蔚女士担任公司总经理，耿源先生担任公司副总经理，牟敦国先生担任公司副总经理，刘盛先生担任公司副总经理兼首席信息官，凡湘平先生担任公司督察长。

2、本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金报告期内没有改变基金投资策略。

### 10.5 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。

### 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期未改聘会计师事务所。

### 10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.8.1 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

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东吴证券	2	-	-	-	-	-

注：本基金所进行的交易，交易费用均计入成本，故本报告期内本基金未产生交易费用。

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。

#### 10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东吴证券	30,319,000.0	100.00%	39,073,60	100.00%	-	-

	0	1,000.00			
--	---	----------	--	--	--

### 10.9 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。

### 10.10 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终止杭州科地瑞富基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证监会规定媒介	2022-01-12
2	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与平安证券股份有限公司代销机构费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2022-01-19
3	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金参与北京证券交易所股票投资及相关风险揭示的公告	证监会规定媒介	2022-01-19
4	金鹰货币市场证券投资基金 2021 年四季度报告	证监会规定媒介	2022-01-24
5	金鹰基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年第四季度报告提示性公告	证监会规定媒介	2022-01-24
6	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与万联证券股份有限公司代销机构费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2022-01-24
7	金鹰基金管理有限公司金鹰货币市场证券投资基金暂停大额申购（转换转入、定期定额投资）公告	证监会规定媒介	2022-01-26
8	金鹰货币市场证券投资基金基金经理变更公告	证监会规定媒介	2022-01-27
9	金鹰货币市场证券投资基金招募说明书更新	证监会规定媒介	2022-01-29
10	金鹰货币市场证券投资基金 A 类份额基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2022-01-29
11	金鹰货币市场证券投资基金 B 类份额基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2022-01-29
12	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增申万宏源西部证券有限公司为代销机构并开通基金转换、基金定投业务及费率优惠的公告	证监会规定媒介	2022-02-21
13	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国信证券股份有限公司代销机构费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2022-03-01

14	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与阳光人寿保险股份有限公司代销机构费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2022-03-01
15	金鹰基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证监会规定媒介	2022-03-05
16	金鹰基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证监会规定媒介	2022-03-05
17	金鹰基金管理有限公司关于董事变更的公告	证监会规定媒介	2022-03-05
18	金鹰基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证监会规定媒介	2022-03-05
19	金鹰货币市场证券投资基金更新的招募说明书	证监会规定媒介	2022-03-07
20	关于金鹰货币市场证券投资基金收益分配方式调整有关事项的公告	证监会规定媒介	2022-03-07
21	金鹰货币市场证券投资基金基金合同更新	证监会规定媒介	2022-03-07
22	金鹰货币市场证券投资基金托管协议更新	证监会规定媒介	2022-03-07
23	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与西部证券股份有限公司代销机构费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2022-03-10
24	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与山西证券股份有限公司等代销机构费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2022-03-15
25	金鹰基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告	证监会规定媒介	2022-03-19
26	金鹰基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证监会规定媒介	2022-03-19
27	金鹰基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证监会规定媒介	2022-03-19
28	金鹰基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证监会规定媒介	2022-03-19
29	金鹰基金管理有限公司金鹰货币市场证券投资基金暂停大额申购（转换转入、定期定额投资）公告	证监会规定媒介	2022-03-21
30	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增上海陆享基金销售有限公司为代销机构并开通基金转换、基金定投业务及费率优惠的公告	证监会规定媒介	2022-03-25
31	金鹰货币市场证券投资基金 2021 年年度报告	证监会规定媒介	2022-03-30
32	金鹰基金管理有限公司旗下全部基金年度报告提示性公告	证监会规定媒介	2022-03-30
33	金鹰基金管理有限公司金鹰货币市场证券投资基金暂停大额申购（转换转入、定期定额投资）公告	证监会规定媒介	2022-03-30
34	金鹰基金管理有限公司金鹰货币市场证券投资基金暂停大额申购（转换转入、定期定额投	证监会规定媒介	2022-04-08

	资) 公告		
35	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与泰信财富基金销售有限公司代销机构费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2022-04-13
36	金鹰货币市场证券投资基金 2022 年一季度报告	证监会规定媒介	2022-04-22
37	金鹰基金管理有限公司旗下全部基金 2022 年第一季度报告提示性公告	证监会规定媒介	2022-04-22
38	关于终止深圳前海凯恩斯基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证监会规定媒介	2022-04-23
39	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与渤海证券股份有限公司代销机构费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2022-04-25
40	金鹰基金管理有限公司金鹰货币市场证券投资基金暂停大额申购(转换转入、定期定额投资)公告	证监会规定媒介	2022-04-27
41	金鹰货币市场证券投资基金托管协议(2022 年 5 月)	证监会规定媒介	2022-05-10
42	金鹰货币市场证券投资基金基金合同(2022 年 5 月)	证监会规定媒介	2022-05-10
43	关于调低金鹰货币市场证券投资基金管理费率 and 托管费率并相应修改法律文件的公告	证监会规定媒介	2022-05-10
44	金鹰货币市场证券投资基金更新的招募说明书	证监会规定媒介	2022-05-13
45	金鹰货币市场证券投资基金 A 类份额基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2022-05-13
46	金鹰货币市场证券投资基金 B 类份额基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2022-05-13
47	金鹰基金管理有限公司关于董事变更的公告	证监会规定媒介	2022-05-21
48	金鹰基金管理有限公司金鹰货币市场证券投资基金暂停大额申购(转换转入、定期定额投资)公告	证监会规定媒介	2022-05-31
49	金鹰货币市场证券投资基金 A 类份额基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2022-06-02
50	金鹰货币市场证券投资基金 B 类份额基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2022-06-02
51	金鹰基金管理有限公司金鹰货币市场证券投资基金暂停在中国建设银行股份有限公司大额申购(转换转入、定期定额投资)公告	证监会规定媒介	2022-06-06
52	金鹰基金管理有限公司基金管理人住所变更公告	证监会规定媒介	2022-06-08
53	金鹰基金管理有限公司金鹰货币市场证券投资基金暂停在中国建设银行股份有限公司大额申购(转换转入、定期定额投资)公告	证监会规定媒介	2022-06-20

注：相关信息披露文件请通过本基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站及规定报刊查询。

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 影响投资者决策的其他重要信息

无影响投资者决策的其他重要信息。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准金鹰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规定媒介公开披露的基金份额净值、季度报告、年度报告及其他公告。

### 12.2 存放地点

广东省广州市天河区珠江新城珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

### 12.3 查阅方式

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

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

金鹰基金管理有限公司

二〇二二年八月三十日