

# 金鹰现金增益交易型货币市场基金

2024 年中期报告

2024 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

送出日期：二〇二四年八月三十日

## § 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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2024 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                          | 6  |
| 2.4 信息披露方式                               | 7  |
| 2.5 其他相关资料                               | 7  |
| §3 主要财务指标和基金净值表现                         | 7  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                          | 7  |
| 3.2 基金净值表现                               | 8  |
| §4 管理人报告                                 | 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               | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                  | 12 |
| 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              | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望              | 13 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                 | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                  | 14 |
| 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        | 14 |
| §5 托管人报告                                 | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                   | 14 |
| 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  | 14 |
| 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        | 15 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计）                       | 15 |
| 6.1 资产负债表                                | 15 |
| 6.2 利润表                                  | 16 |
| 6.3 净资产变动表                               | 17 |
| 6.4 报表附注                                 | 19 |
| §7 投资组合报告                                | 39 |
| 7.1 期末基金资产组合情况                           | 39 |
| 7.2 债券回购融资情况                             | 40 |
| 7.3 基金投资组合平均剩余期限                         | 40 |
| 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          | 41 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                     | 41 |
| 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 | 42 |
| 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       | 42 |
| 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明                 | 42 |
| 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明                  | 42 |
| 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   | 43 |
| 7.9 投资组合报告附注                             | 43 |

|  |    |
|--|----|
| <b>§8 基金份额持有人信息</b> .....              | 44 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....             | 44 |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人.....                  | 44 |
| 8.3 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....            | 45 |
| 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....          | 46 |
| 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..... | 46 |
| 8.6 发起式基金发起资金持有份额情况.....               | 46 |
| <b>§9 开放式基金份额变动</b> .....              | 46 |
| <b>§10 重大事件揭示</b> .....                | 47 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                  | 47 |
| 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.....  | 47 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....       | 47 |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                    | 47 |
| 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件.....           | 47 |
| 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况.....             | 47 |
| 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.....     | 48 |
| 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....            | 48 |
| 10.9 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....             | 49 |
| 10.10 其他重大事件.....                      | 49 |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....        | 50 |
| 11.1 影响投资者决策的其他重要信息.....               | 50 |
| <b>§12 备查文件目录</b> .....                | 50 |
| 12.1 备查文件目录.....                       | 50 |
| 12.2 存放地点.....                         | 51 |
| 12.3 查阅方式.....                         | 51 |

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                     |                     |                 |
|-----------------|---------------------|---------------------|-----------------|
| 基金名称            | 金鹰现金增益交易型货币市场基金     |                     |                 |
| 基金简称            | 金鹰增益货币              |                     |                 |
| 场内简称            | 金鹰增益货币 ETF          |                     |                 |
| 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     |                     |                 |
| 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          |                     |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 11,859,470,849.12 份 |                     |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期                 |                     |                 |
| 基金份额上市的证券交易所    | 上海证券交易所             |                     |                 |
| 上市日期            | 2017 年 4 月 10 日     |                     |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 金鹰增益货币 A            | 金鹰增益货币 B            | 金鹰增益货币 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 | 221,435,488.57 份    | 11,542,691,973.70 份 | 95,343,386.85 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。

### 2.2 基金产品说明

|      |   |
|------|---|
| 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 | <p>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：</p> <p>（一）整体资产配置策略</p> <p>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。</p> <p>（二）类属配置策略</p> <p>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</p> |

|        |   |
|--------|---|
|        | <p>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。</p> <p>（三）债券类资产配置策略</p> <p>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的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。</p> <p>（四）流动性管理策略</p> <p>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。   |

### 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           | 招商证券股份有限公司          |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 凡湘平                  | 韩鑫普                 |
|             | 联系电话 | 020-83936180         | 0755-82943666       |
|             | 电子邮箱 | csmail@gefund.com.cn | tgb@cmschina.com.cn |

|        |                            |                        |
|--------|----------------------------|------------------------|
| 客户服务电话 | 4006135888                 | 95565                  |
| 传真     | 020-83282856               | 0755-82960794          |
| 注册地址   | 广州市南沙区横沥镇汇通二街<br>2号3212房   | 深圳市福田区福田街道福华一<br>路111号 |
| 办公地址   | 广州市天河区珠江东路28号越<br>秀金融大厦30层 | 深圳市福田区福田街道福华一<br>路111号 |
| 邮政编码   | 510623                     | 518000                 |
| 法定代表人  | 姚文强                        | 霍达                     |

## 2.4 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《证券时报》  |
| 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 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京西城区太平大街 17 号                    |
| 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 |

注：本基金 E 类份额注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，A、B 类份额注册登记机构为金鹰基金管理有限公司。

## §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（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日） |                   |               |
|---------------|--------------------------------------|-------------------|---------------|
|               | 金鹰增益货币 A                             | 金鹰增益货币 B          | 金鹰增益货币 E      |
| 本期已实现收益       | 2,328,089.78                         | 107,711,357.86    | 40,127.43     |
| 本期利润          | 2,328,089.78                         | 107,711,357.86    | 40,127.43     |
| 本期净值收益率       | 0.9590%                              | 1.0546%           | 0.1609%       |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2024 年 6 月 30 日)                |                   |               |
|               | 金鹰增益货币 A                             | 金鹰增益货币 B          | 金鹰增益货币 E      |
| 期末基金资产净值      | 221,435,488.57                       | 11,542,691,973.70 | 95,343,386.85 |
| 期末基金份额净值      | 1.00                                 | 1.00              | 1.00          |

| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2024年6月30日) |          |          |
|--------------|------------------|----------|----------|
|              | 金鹰增益货币 A         | 金鹰增益货币 B | 金鹰增益货币 E |
| 累计净值收益率      | 20.8972%         | 22.5818% | 10.6146% |

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、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

##### 金鹰增益货币 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      | 0.1409%  | 0.0016%     | 0.1110%    | 0.0000%       | 0.0299%  | 0.0016% |
| 过去三个月      | 0.4361%  | 0.0014%     | 0.3366%    | 0.0000%       | 0.0995%  | 0.0014% |
| 过去六个月      | 0.9590%  | 0.0013%     | 0.6732%    | 0.0000%       | 0.2858%  | 0.0013% |
| 过去一年       | 1.9716%  | 0.0013%     | 1.3537%    | 0.0000%       | 0.6179%  | 0.0013% |
| 过去三年       | 6.0999%  | 0.0012%     | 4.0537%    | 0.0000%       | 2.0462%  | 0.0012% |
| 自基金合同生效起至今 | 20.8972% | 0.0025%     | 9.8384%    | 0.0000%       | 11.0588% | 0.0025% |

##### 金鹰增益货币 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      | 0.1565%  | 0.0016%     | 0.1110%    | 0.0000%       | 0.0455%  | 0.0016% |
| 过去三个月      | 0.4836%  | 0.0014%     | 0.3366%    | 0.0000%       | 0.1470%  | 0.0014% |
| 过去六个月      | 1.0546%  | 0.0013%     | 0.6732%    | 0.0000%       | 0.3814%  | 0.0013% |
| 过去一年       | 2.1659%  | 0.0013%     | 1.3537%    | 0.0000%       | 0.8122%  | 0.0013% |
| 过去三年       | 6.7067%  | 0.0012%     | 4.0537%    | 0.0000%       | 2.6530%  | 0.0012% |
| 自基金合同生效起至今 | 22.5818% | 0.0025%     | 9.8384%    | 0.0000%       | 12.7434% | 0.0025% |

##### 金鹰增益货币 E

| 阶段 | 份额净值收 | 份额净值收 | 业绩比较基 | 业绩比较基 | ①-③ | ②-④ |
|----|-------|-------|-------|-------|-----|-----|
|----|-------|-------|-------|-------|-----|-----|

|                | 益率①      | 益率标准差<br>② | 准收益率③   | 准收益率标<br>准差④ |          |         |
|----------------|----------|------------|---------|--------------|----------|---------|
| 过去一个月          | 0.0661%  | 0.0022%    | 0.1110% | 0.0000%      | -0.0449% | 0.0022% |
| 过去三个月          | 0.0980%  | 0.0015%    | 0.3366% | 0.0000%      | -0.2386% | 0.0015% |
| 过去六个月          | 0.1609%  | 0.0013%    | 0.6732% | 0.0000%      | -0.5123% | 0.0013% |
| 过去一年           | 0.4832%  | 0.0020%    | 1.3537% | 0.0000%      | -0.8705% | 0.0020% |
| 过去三年           | 2.0716%  | 0.0022%    | 4.0537% | 0.0000%      | -1.9821% | 0.0022% |
| 自基金合同生效<br>起至今 | 10.6146% | 0.0041%    | 9.8384% | 0.0000%      | 0.7762%  | 0.0041% |

注：（1）本报告期末，本基金各项投资比例符合基金合同约定。

（2）本基金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。

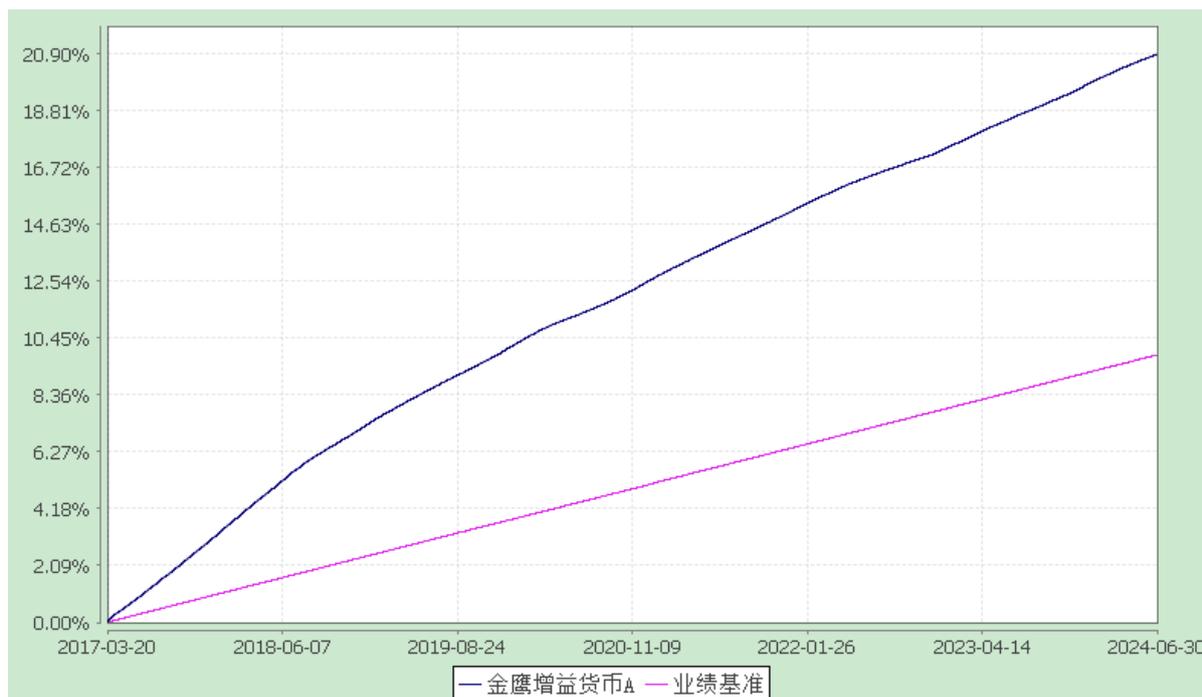
（3）本基金的业绩比较基准为：七天通知存款税后利率。

### 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

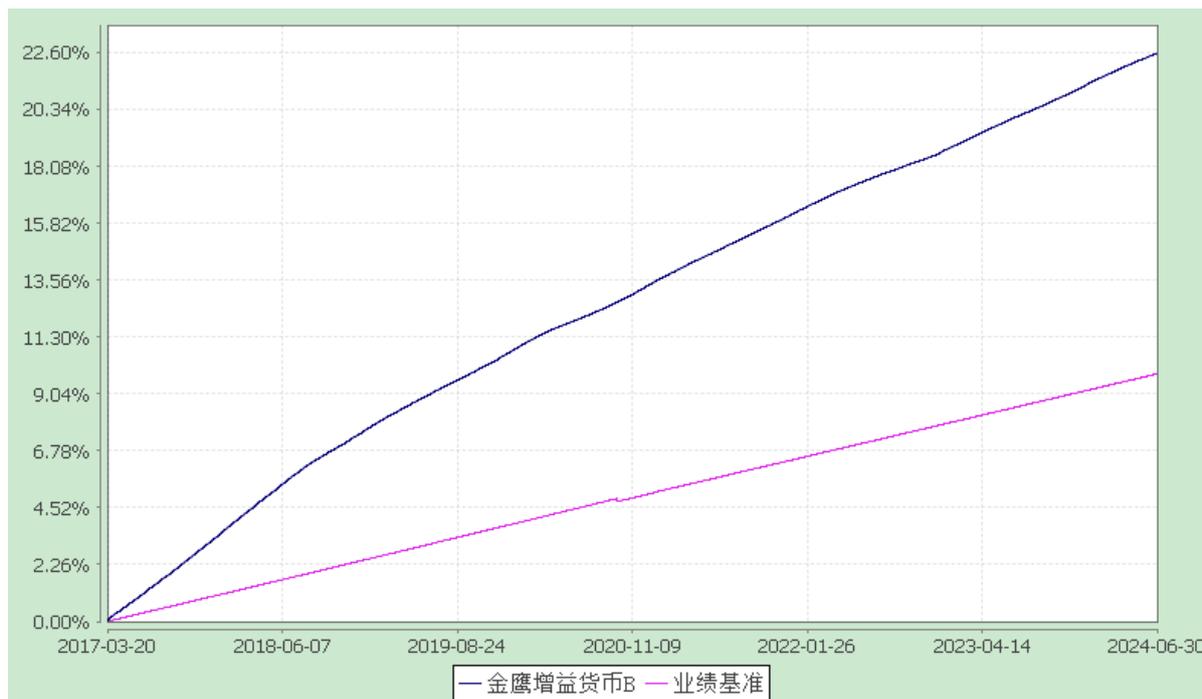
金鹰现金增益交易型货币市场基金  
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2017 年 3 月 20 日至 2024 年 6 月 30 日）

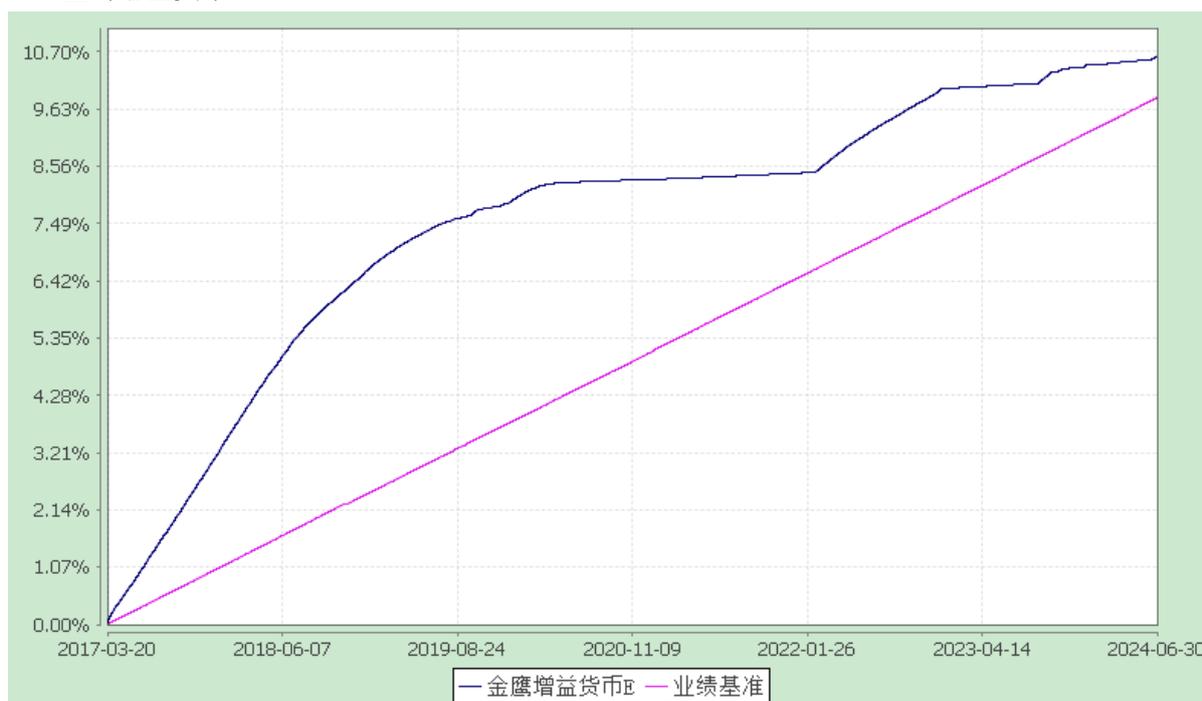
金鹰增益货币 A



金鹰增益货币 B



金鹰增益货币 E



注：(1) 本基金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。

(2) 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。

“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 68 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<br>基金经理（助<br>理）期限 |          | 证券<br>从业<br>年限 | 说明   |
|-------------|----------|-------------------------|----------|----------------|--|
|             |          | 任职<br>日期                | 离任<br>日期 |                |  |
| 陈<br>双<br>双 | 本基金的基金经理 | 2022-<br>06-15          | -        | 8              | 陈双双女士，中南财经政法大学经济学硕士。2016 年 7 月加入金鹰基金管理有限公司，曾任交易员、基金经理助理，现任固定收益部基金经理。 |

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理/基金经理助理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

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、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 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中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 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 2024 年上半年，新质生产力下国内经济修复缓慢，居民和企业融资需求较弱，财政政策不及预期，货币政策稳健宽松。在城投债务管控和禁止手工补息影响下资产荒逻辑不断演绎，债券市场总体在震荡中维持上行状态，信用利差和等级利差不断压缩。具体来看，年初在 CPI 环比转正、社融同比多增和降息预期落空等因素综合扰动下，1 年期国股存单在 2.45% 附近震荡；1 月 24 日央行宣布降准 0.5 个百分点，短端收益率迎来一波下行，叠加春节后多家大型银行下调存款利率，理财和货币基金规模快速增长，资金分层压力大幅缓解，短端配置压力激增，1 年期国股存单迅速下行至 2.25% 附近。3 月在汇率压力和央行公开市场缩量操作下引发市场对防止资金空转的担忧，1 年期国股存单维持 2.25% 附近震荡。进入二季度，中小行陆续下调存款利率以及理财资金回流，银行

间流动性充裕，在欠配压力下 1 年期国股存单从 2.23% 迅速下降至 2.0% 附近；临近月末禁止手工补息影响凸显，大量存款从银行表内向非银机构转移，短期银行缺负债，通过大幅提价吸收同业负债，同业存单快速上行至 2.16% 附近。进入 5 月银行贷款开始萎缩，缩表后负债压力相应缓解，资金面均衡偏松，流动性分层也基本消失。6 月税期扰动较小，市场担忧的理财回表和赎回负反馈迟迟没有来，等待机会成本较高，市场开始抢跑；叠加季末在汇率波动加大情况下央行依然在公开市场进行大额净投放呵护资金面，1 年期国股存单从 2.04% 附近迅速下行至 1.96% 附近。

本基金在报告期内根据对债市判断和资产性价比合理安排逆回购、同业存单、银行存款以及资质较好信用债的配置比例，在严控风险和保持较好的流动性前提下，竭力为持有人服务。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 6 月 30 日，在本报告期内，本基金 A 类份额净值收益率为 0.9590%，业绩比较基准收益率为 0.6732%；B 类份额净值收益率为 1.0546%，业绩比较基准收益率为 0.6732%；E 类份额净值收益率为 0.1609%，业绩比较基准收益率为 0.6732%。

#### 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 2024 年下半年，在经济转型、高质量发展以及新旧动能转换下国内经济基本面或将继续承压，基建、高端制造业和消费等是稳增长重要抓手，居民和企业收入下滑和杠杆约束下融资需求或将继续回落，通胀在低基数下逐步抬升，但在内需偏弱情况下或难有持续上行的趋势。新质生产力下的货币政策更加注重内外均衡和预期管理，实体信贷由供给约束转为需求驱动，降低融资成本的诉求在不断提升。我们看到 7 月下旬央行在公开市场操作中下调 7 天逆回购 10BP，下调 LPR10BP，并“加场”开展 2000 亿 MLF 且利率下调 20BP，节奏超预期，在稳增长进程中发挥货币先行的作用。当前利率走廊下限 1.5% 对回购利率进一步走低的制约效果很明显，在降息已然兑现情况下，下半年更关注财政发力的节奏和央行配合，债券市场可能从震荡上行转为关注波动变化，应对可能比预测更加重要，建议继续紧跟金融脱媒进程和资产荒的程度，以更加合理区间和静态票息来参与债市投资。

#### 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《金鹰现金增益交易型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，招商证券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。

### 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：金鹰现金增益交易型货币市场基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产           | 附注号        | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日         |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>   |            |                                |                                  |
| 货币资金          | 6.4.7.1    | 1,217,848,105.56               | 2,812,491,418.21                 |
| 结算备付金         |            | 37,229,470.20                  | 14,269,798.82                    |
| 存出保证金         |            | 114,715.02                     | 22,511.16                        |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 6,132,645,479.15               | 6,649,933,685.21                 |
| 其中：股票投资       |            | -                              | -                                |
| 基金投资          |            | -                              | -                                |
| 债券投资          |            | 6,132,645,479.15               | 6,649,933,685.21                 |
| 资产支持证券投资      |            | -                              | -                                |
| 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    | 4,664,609,797.89               | 4,609,530,109.32                 |
| 应收清算款         |            | -                              | -                                |
| 应收股利          |            | -                              | -                                |
| 应收申购款         |            | 2,618,674.96                   | 40,534,631.47                    |
| 递延所得税资产       |            | -                              | -                                |
| 其他资产          | 6.4.7.5    | 75,409.12                      | -                                |
| 资产总计          |            | 12,055,141,651.90              | 14,126,782,154.19                |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2024 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2023 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   |         | 20,061,022.50     | 312,843,028.05    |
| 应付清算款       |         | 170,095,536.99    | 675,268,643.84    |
| 应付赎回款       |         | 40.00             | 10,248.93         |
| 应付管理人报酬     |         | 2,488,152.60      | 2,418,304.81      |
| 应付托管费       |         | 710,900.73        | 690,944.26        |
| 应付销售服务费     |         | 127,847.16        | 121,255.75        |
| 应付投资顾问费     |         | -                 | -                 |
| 应交税费        |         | 10,867.66         | 14,828.00         |
| 应付利润        |         | 1,793,541.64      | 3,261,182.46      |
| 递延所得税负债     |         | -                 | -                 |
| 其他负债        | 6.4.7.6 | 382,893.50        | 355,870.98        |
| 负债合计        |         | 195,670,802.78    | 994,984,307.08    |
| <b>净资产：</b> |         |                   |                   |
| 实收基金        | 6.4.7.7 | 11,859,470,849.12 | 13,131,797,847.11 |
| 其他综合收益      |         | -                 | -                 |
| 未分配利润       | 6.4.7.8 | -                 | -                 |
| 净资产合计       |         | 11,859,470,849.12 | 13,131,797,847.11 |
| 负债和净资产总计    |         | 12,055,141,651.90 | 14,126,782,154.19 |

注：截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 11,859,470,849.12。其中 A 类份额基金份额净值 1.0000 元，A 类份额总额 221,435,488.57 份，B 类份额基金份额净值 1.0000 元，B 类份额总额 11,542,691,973.70 份；E 类份额基金份额净值 1.0000 元，E 类份额总额 95,343,386.85 份。

## 6.2 利润表

会计主体：金鹰现金增益交易型货币市场基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目               | 附注号      | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至<br>2023 年 6 月 30 日 |
|------------------|----------|--|---|
| <b>一、营业总收入</b>   |          | 134,232,209.73                           | 151,149,030.28                                |
| 1.利息收入           |          | 55,924,048.20                            | 91,167,420.74                                 |
| 其中：存款利息收入        | 6.4.7.9  | 25,524,876.37                            | 44,355,123.43                                 |
| 债券利息收入           |          | -  | -   |
| 资产支持证券利息收入       |          | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入       |          | 30,399,171.83                            | 46,812,297.31                                 |
| 其他利息收入           |          | -  | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） |          | 78,260,865.53                            | 59,934,230.54                                 |
| 其中：股票投资收益        | 6.4.7.10 | -  | -   |
| 基金投资收益           |          | -  | -   |
| 债券投资收益           | 6.4.7.11 | 78,260,865.53                            | 59,934,230.54                                 |

|                            |          |                       |                       |
|----------------------------|----------|-----------------------|-----------------------|
| 资产支持证券投资收益                 | 6.4.7.12 | -                     | -                     |
| 贵金属投资收益                    | 6.4.7.13 | -                     | -                     |
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.14 | -                     | -                     |
| 股利收益                       | 6.4.7.15 | -                     | -                     |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 6.4.7.16 | -                     | -                     |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |          | -                     | -                     |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 6.4.7.17 | 47,296.00             | 47,379.00             |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |          | 24,152,634.66         | 26,744,647.60         |
| 1. 管理人报酬                   |          | 14,684,220.16         | 15,479,802.12         |
| 其中：暂估管理人报酬（若有）             |          | -                     | -                     |
| 2. 托管费                     |          | 4,195,491.32          | 4,422,800.59          |
| 3. 销售服务费                   |          | 760,682.36            | 812,626.00            |
| 4. 投资顾问费                   |          | -                     | -                     |
| 5. 利息支出                    |          | 4,304,175.98          | 5,833,805.84          |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | 4,304,175.98          | 5,833,805.84          |
| 6. 信用减值损失                  | 6.4.7.18 | -                     | -                     |
| 7. 税金及附加                   |          | 5,114.37              | 20,550.49             |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.19 | 202,950.47            | 175,062.56            |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>110,079,575.07</b> | <b>124,404,382.68</b> |
| 减：所得税费用                    |          | -                     | -                     |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>110,079,575.07</b> | <b>124,404,382.68</b> |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |          | -                     | -                     |
| <b>六、综合收益总额</b>            |          | <b>110,079,575.07</b> | <b>124,404,382.68</b> |

### 6.3 净资产变动表

会计主体：金鹰现金增益交易型货币市场基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |                |       |                   |
|------------------|---------------------------------------|----------------|-------|-------------------|
|                  | 实收基金                                  | 其他综合<br>收益（若有） | 未分配利润 | 净资产合计             |
| 一、上期期末净资产        | 13,131,797,847.11                     | -              | -     | 13,131,797,847.11 |
| 二、本期期初净资产        | 13,131,797,847.11                     | -              | -     | 13,131,797,847.11 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-” | -1,272,326,997.99                     | -              | -     | -1,272,326,997.99 |

|  |  |            |                 |                    |
|--|--|------------|-----------------|--------------------|
| 号填列)                                     |  |            |                 |                    |
| (一)、综合收益总额                               | -  | -          | 110,079,575.07  | 110,079,575.07     |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)      | -1,272,326,997.99                          | -          | -               | -1,272,326,997.99  |
| 其中: 1.基金申购款                              | 19,868,179,084.21                          | -          | -               | 19,868,179,084.21  |
| 2.基金赎回款                                  | -21,140,506,082.20                         | -          | -               | -21,140,506,082.20 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | -  | -          | -110,079,575.07 | -110,079,575.07    |
| 四、本期期末净资产                                | 11,859,470,849.12                          | -          | -               | 11,859,470,849.12  |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 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                                | 11,981,468,675.56                          | -          | -               | 11,981,468,675.56  |
| 二、本期期初净资产                                | 11,981,468,675.56                          | -          | -               | 11,981,468,675.56  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | 1,480,464,045.60                           | -          | 0.00            | 1,480,464,045.60   |
| (一)、综合收益总额                               | -  | -          | 124,404,382.68  | 124,404,382.68     |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)      | 1,480,464,045.60                           | -          | -               | 1,480,464,045.60   |
| 其中: 1.基金申购款                              | 21,008,206,263.37                          | -          | -               | 21,008,206,263.37  |
| 2.基金赎回款                                  | -19,527,742,217.77                         | -          | -               | -19,527,742,217.77 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净                   | -  | -          | -124,404,382.68 | -124,404,382.68    |

|                    |                   |   |   |                   |
|--------------------|-------------------|---|---|-------------------|
| 资产变动（净资产减少以“-”号填列） |                   |   |   |                   |
| 四、本期期末净资产          | 13,461,932,721.16 | - | - | 13,461,932,721.16 |

注：本期基金份额交易产生的基金净值变动数中实收基金对应的基金申购款包含了本期经营活动而产生的红利再投金额。

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：刘盛，会计机构负责人：董霞

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

金鹰现金增益交易型货币市场基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2016]2827 号文《关于准予金鹰现金增益交易型货币市场基金注册的批复》批准，由金鹰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《金鹰现金增益交易型货币市场基金基金合同》（以下简称“基金合同”）发起募集。经向中国证监会备案，基金合同于 2017 年 3 月 20 日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，基金管理人为金鹰基金管理有限公司，托管人为招商证券股份有限公司。

本基金募集期限自 2017 年 3 月 6 日至 2017 年 3 月 10 日止，首次设立募集资金为人民币 1,688,617,731.20 元，有效认购户数为 4716 户。其中金鹰增益货币基金 A 为人民币 10,164,981.22 元，金鹰增益货币基金 B 为人民币 185,001,749.98 元，金鹰增益货币基金 E 为人民币 1,493,451,000.00 元。经中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）出具验资报告予以验证。

经上海证券交易所（以下简称“上交所”）自律监管决定书[2017] 80 号审核同意，本基金 E 类基金份额 14,934,510.00 份，每份面值 100.00 元于 2017 年 4 月 10 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和基金合同的有关规定，本基金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。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会

计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况、本报告期的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### **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**

本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### **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**

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

##### **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[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号）、财税[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》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《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[2008]1 号文《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》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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》、财税 [2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、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，本基金适用的主要税项列示如下：

(a)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b)自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，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。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；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。

(c) 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。

(d)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。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司 (“挂牌公司”) 取得的股息、红利所得, 由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。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, 其股息红利所得暂减按 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。

(e) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税, 买入股票不征收股票交易印花税。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入, 暂不征收企业所得税。

(g) 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 货币资金

单位: 人民币元

| 项目              | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 |
|-----------------|------------------------|
| 活期存款            | 614,419,632.42         |
| 等于: 本金          | 614,001,640.86         |
| 加: 应计利息         | 417,991.56             |
| 定期存款            | 603,428,473.14         |
| 等于: 本金          | 600,000,000.00         |
| 加: 应计利息         | 3,428,473.14           |
| 其中: 存款期限 1 个月以内 | -                      |
| 存款期限 1-3 个月     | 150,089,375.00         |
| 存款期限 3 个月以上     | 453,339,098.14         |
| 其他存款            | -                      |
| 等于: 本金          | -                      |
| 加: 应计利息         | -                      |
| 合计              | 1,217,848,105.56       |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

| 项目 | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 |
|----|------------------------|
|    |                        |

|        |       | 按实际利率计算的<br>账面价值 | 影子定价                 | 偏离金额         | 偏离度 (%) |
|--------|-------|------------------|----------------------|--------------|---------|
| 债券     | 交易所市场 | 204,099,279.29   | 203,962,566.<br>57   | -136,712.72  | -0.0012 |
|        | 银行间市场 | 5,928,546,199.86 | 5,932,905,29<br>1.28 | 4,359,091.42 | 0.0368  |
|        | 合计    | 6,132,645,479.15 | 6,136,867,85<br>7.85 | 4,222,378.70 | 0.0356  |
| 资产支持证券 |       | -                | -                    | -            | -       |
| 合计     |       | 6,132,645,479.15 | 6,136,867,85<br>7.85 | 4,222,378.70 | 0.0356  |

注：1、偏离金额=影子定价-摊余成本；

2、偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

### 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

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/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<br>2024年6月30日 |           |
|-------|-------------------|-----------|
|       | 账面余额              | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 180,000,000.00    | -         |
| 银行间市场 | 4,484,609,797.89  | -         |
| 合计    | 4,664,609,797.89  | -         |

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2024年6月30日 |
|-------|-------------------|
| 应收利息  | -                 |
| 其他应收款 | -                 |
| 待摊费用  | 75,409.12         |
| 合计    | 75,409.12         |

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2024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      | 171,544.26        |
| 其中：交易所市场    | -                 |
| 银行间市场       | 171,544.26        |
| 应付利息        | -                 |
| 审计费用        | 22,376.90         |
| 预提中债登帐户维护费  | 4,500.00          |
| 预提信息披露费     | 179,672.34        |
| 预提上清所帐户维护费  | 4,800.00          |
| 合计          | 382,893.50        |

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 金鹰增益货币 A

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |                 |
|---------------|----------------------------|-----------------|
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额            |
| 上年度末          | 269,067,560.85             | 269,067,560.85  |
| 本期申购          | 586,183,481.73             | 586,183,481.73  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -633,815,554.01            | -633,815,554.01 |
| 本期末           | 221,435,488.57             | 221,435,488.57  |

注：1、申购份额含红利再投。

2、A类基金份额为场外基金份额，份额净值为1.00元。

##### 金鹰增益货币 B

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |                    |
|---------------|----------------------------|--------------------|
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额               |
| 上年度末          | 12,834,799,019.46          | 12,834,799,019.46  |
| 本期申购          | 19,178,279,349.18          | 19,178,279,349.18  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -20,470,386,394.94         | -20,470,386,394.94 |
| 本期末           | 11,542,691,973.70          | 11,542,691,973.70  |

注：1、申购份额含红利再投。

2、B类基金份额为场外基金份额，份额净值为1.00元。

##### 金鹰增益货币 E

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|    |    |

|               | 2024年1月1日至2024年6月30日 |                |
|---------------|----------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）              | 账面金额           |
| 上年度末          | 27,931,266.80        | 27,931,266.80  |
| 本期申购          | 103,716,253.30       | 103,716,253.30 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -36,304,133.25       | -36,304,133.25 |
| 本期末           | 95,343,386.85        | 95,343,386.85  |

注：1、申购份额含红利再投。

2、E类基金份额为场内基金份额，场内份额折算日为基金合同生效当日。折算后E类基金份额的份额净值为100.00元。

#### 6.4.7.8 未分配利润

##### 金鹰增益货币 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       |
|----------------|---------------|-------|---------------|
| 上年度末           | -             | -     | -             |
| 本期期初           | -             | -     | -             |
| 本期利润           | 2,328,089.78  | 0.00  | 2,328,089.78  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 0.00          | 0.00  | 0.00          |
| 其中：基金申购款       | 0.00          | 0.00  | 0.00          |
| 基金赎回款          | 0.00          | 0.00  | 0.00          |
| 本期已分配利润        | -2,328,089.78 | -     | -2,328,089.78 |
| 本期末            | 0.00          | 0.00  | 0.00          |

##### 金鹰增益货币 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         |
|----------------|-----------------|-------|-----------------|
| 上年度末           | -               | -     | -               |
| 本期期初           | -               | -     | -               |
| 本期利润           | 107,711,357.86  | 0.00  | 107,711,357.86  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 0.00            | 0.00  | 0.00            |
| 其中：基金申购款       | 0.00            | 0.00  | 0.00            |
| 基金赎回款          | 0.00            | 0.00  | 0.00            |
| 本期已分配利润        | -107,711,357.86 | -     | -107,711,357.86 |
| 本期末            | 0.00            | 0.00  | 0.00            |

##### 金鹰增益货币 E

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   |
|------|-----------|-------|-----------|
| 上年度末 | -         | -     | -         |
| 本期期初 | -         | -     | -         |
| 本期利润 | 40,127.43 | 0.00  | 40,127.43 |

|                |            |      |            |
|----------------|------------|------|------------|
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 0.00       | 0.00 | 0.00       |
| 其中：基金申购款       | 0.00       | 0.00 | 0.00       |
| 基金赎回款          | 0.00       | 0.00 | 0.00       |
| 本期已分配利润        | -40,127.43 | 0.00 | -40,127.43 |
| 本期末            | 0.00       | 0.00 | 0.00       |

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 9,453,915.33               |
| 定期存款利息收入  | 15,894,987.37              |
| 其他存款利息收入  | -                          |
| 结算备付金利息收入 | 170,762.68                 |
| 其他        | 5,210.99                   |
| 合计        | 25,524,876.37              |

#### 6.4.7.10 股票投资收益

本基金本报告期内无股票投资收益。

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 72,896,039.05              |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 5,364,826.48               |
| 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                           | 78,260,865.53              |

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 12,087,650,954.01          |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 12,031,330,657.37          |

|          |               |
|----------|---------------|
| 减：应计利息总额 | 50,955,470.16 |
| 减：交易费用   | -             |
| 买卖债券差价收入 | 5,364,826.48  |

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

##### 6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益。

##### 6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

本基金本报告期内无公允价值变动收益。

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | -                          |
| 其他收入    | 47,296.00                  |
| 合计      | 47,296.00                  |

#### 6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目           | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|--------------|----------------------------|
| 审计费用         | 22,376.90                  |
| 信息披露费        | 59,672.34                  |
| 债券交易费        | 46,110.35                  |
| 回购交易费        | 200.00                     |
| E类中登TA 结算服务费 | 74,590.88                  |

|    |            |
|----|------------|
| 合计 | 202,950.47 |
|----|------------|

#### 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，本基金并无需做披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无其他需做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 |
| 招商证券股份有限公司   | 基金托管人、基金销售机构        |
| 广州金鹰资产管理有限公司 | 基金管理人子公司            |
| 招商证券资产管理有限公司 | 基金托管人子公司            |

#### 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均未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |              | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年6月30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 |
| 招商证券股份有限公司 | 901,840,563.00             | 100.00%      | 110,444,120.00                  | 100.00%      |

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |
|-------|----------------------------|---------------------------------|
|-------|----------------------------|---------------------------------|

|            | 成交金额              | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额              | 占当期债券回购成交总额的比例 |
|------------|-------------------|----------------|-------------------|----------------|
| 招商证券股份有限公司 | 22,286,605,000.00 | 100.00%        | 18,463,016,000.00 | 100.00%        |

#### 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均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<br>2024年1月1日至2024年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年6月<br>30日 |
|------------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 14,684,220.16                  | 15,479,802.12                       |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 1,670,937.82                   | 1,083,964.29                        |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 13,013,282.34                  | 14,395,837.83                       |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.28% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.28\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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 3 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |
|----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 4,195,491.32               | 4,422,800.59                    |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.08% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.08\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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，基金

托管人复核后于次月首日起 3 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

#### 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<br>2024年1月1日至2024年6月30日      |            |          |            |
|----------------|---------------------------------|------------|----------|------------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |            |          |            |
|                | 金鹰增益货币 A                        | 金鹰增益货币 B   | 金鹰增益货币 E | 合计         |
| 招商证券股份有限公司     | 1,475.49                        | 162.53     | 17.42    | 1,655.44   |
| 金鹰基金管理有限公司     | 29,956.46                       | 334,186.81 | 339.49   | 364,482.76 |
| 合计             | 31,431.95                       | 334,349.34 | 356.91   | 366,138.20 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |            |          |            |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |            |          |            |
|                | 金鹰增益货币 A                        | 金鹰增益货币 B   | 金鹰增益货币 E | 合计         |
| 招商证券股份有限公司     | 1,896.87                        | 29.97      | 16.05    | 1,942.89   |
| 金鹰基金管理有限公司     | 132,258.68                      | 406,434.68 | 353.68   | 539,047.04 |
| 合计             | 134,155.55                      | 406,464.65 | 369.73   | 540,989.93 |

注：本基金 A 类基金份额的销售服务费年费率为 0.2%；本基金 B 类基金份额的销售服务费年费率为 0.01%；本基金 E 类基金份额的销售服务费年费率为 0.2%。

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，自动在次月起 3 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。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。

#### 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均未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

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

**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****金鹰增益货币 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。

**金鹰增益货币 B**

份额单位：份

| 关联方名称        | 本期末<br>2024年6月30日 |                          | 上年度末<br>2023年12月31日 |                          |
|--------------|-------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------|
|              | 持有的<br>基金份额       | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例 | 持有的<br>基金份额         | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例 |
| 广州金鹰资产管理有限公司 | 42,202,726.69     | 0.37%                    | 41,758,304.94       | 0.33%                    |
| 招商证券股份有限公司   | 300,152,181.65    | 2.60%                    | 200,416,166.51      | 1.56%                    |
| 招商证券投资有限公司   | 0.00              | 0.00%                    | 200,033,313.23      | 1.56%                    |
| 招商证券资产管理有限公司 | 50,002,639.19     | 0.43%                    | 0.00                | 0.00%                    |

**金鹰增益货币 E**

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<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |              | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023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       |
| 招商证券股份有限公司 | 614,419,632.42             | 9,453,915.33 | 1,204,408,598.86                | 8,589,336.87 |

注：本基金用于证券交易结算的资金通过“招商证券基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率或约定利率计息，在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示。清算备付金本报告期末余额 37,229,470.2 元，利息收入 170,762.68 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均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。

**6.4.11 利润分配情况**

## 金鹰增益货币 A

单位：人民币元

| 已按再投资形式转<br>实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润分<br>配合计 | 备注 |
|------------------|-------------------|--------------|--------------|----|
| 2,360,863.08     | -                 | -32,773.30   | 2,328,089.78 | -  |

## 金鹰增益货币 B

单位：人民币元

| 已按再投资形式转<br>实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动  | 本期利润分<br>配合计       | 备注 |
|------------------|-------------------|---------------|--------------------|----|
| 109,152,699.51   | -                 | -1,441,341.65 | 107,711,357.<br>86 | -  |

## 金鹰增益货币 E

单位：人民币元

| 已按再投资形式转<br>实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润分<br>配合计 | 备注 |
|------------------|-------------------|--------------|--------------|----|
| 33,653.30        | -                 | 6,474.13     | 40,127.43    | -  |

## 6.4.12 期末（2024 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认购新发/增发股票或债券流通受限情况。

## 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 2024 年 6 月 30 日止，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金融资产余额。

## 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 20,061,022.50 元，于 2024 年 7 月 1 日到期，该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券或在新质押式回购下转入质押库的债券按照证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的金额。

## 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制的建设，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。

#### 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。

#### 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<br>2024年6月30日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1    | 40,557,704.92     | 0.00                |
| A-1 以下 | 0.00              | 0.00                |
| 未评级    | 752,053,476.63    | 341,302,356.01      |
| 合计     | 792,611,181.55    | 341,302,356.01      |

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<br>2024年6月30日 | 上年度末<br>2023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<br>2024年6月30日 | 上年度末<br>2023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<br>2024年6月30日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | 438,898,780.79    | 470,512,356.70      |

|        |                |                |
|--------|----------------|----------------|
| AAA 以下 | 92,087,263.88  | 0.00           |
| 未评级    | 0.00           | 0.00           |
| 合计     | 530,986,044.67 | 470,512,356.70 |

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<br>2024年6月30日 | 上年度末<br>2023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                |

#### 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<br>2024年6月30日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | 4,213,123,216.94  | 5,171,549,171.87    |
| AAA 以下 | 595,925,035.99    | 436,506,079.18      |
| 未评级    | 0.00              | 0.00                |
| 合计     | 4,809,048,252.93  | 5,608,055,251.05    |

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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2024年6月30日 | 1年以内              | 1-5年 | 5年以上 | 不计息            | 合计                |
|-------------------|-------------------|------|------|----------------|-------------------|
| 资产                |                   |      |      |                |                   |
| 货币资金              | 1,217,848,105.56  | -    | -    | -              | 1,217,848,105.56  |
| 结算备付金             | 37,229,470.20     | -    | -    | -              | 37,229,470.20     |
| 存出保证金             | 114,715.02        | -    | -    | -              | 114,715.02        |
| 交易性金融资产           | 6,132,645,479.15  | -    | -    | -              | 6,132,645,479.15  |
| 买入返售金融资产          | 4,664,609,797.89  | -    | -    | -              | 4,664,609,797.89  |
| 应收证券清算款           | -                 | -    | -    | -              | -                 |
| 应收股利              | -                 | -    | -    | -              | -                 |
| 应收申购款             | -                 | -    | -    | 2,618,674.96   | 2,618,674.96      |
| 其他资产              | -                 | -    | -    | 75,409.12      | 75,409.12         |
| 资产总计              | 12,052,447,567.82 | -    | -    | 2,694,084.08   | 12,055,141,651.90 |
| 负债                |                   |      |      |                |                   |
| 短期借款              | -                 | -    | -    | -              | -                 |
| 交易性金融负债           | -                 | -    | -    | -              | -                 |
| 卖出回购金融资产款         | 20,061,022.50     | -    | -    | -              | 20,061,022.50     |
| 应付证券清算款           | -                 | -    | -    | 170,095,536.99 | 170,095,536.99    |
| 应付赎回款             | -                 | -    | -    | 40.00          | 40.00             |
| 应付管理人报酬           | -                 | -    | -    | 2,488,152.60   | 2,488,152.60      |

|                          |                   |       |       |                 |                   |
|--------------------------|-------------------|-------|-------|-----------------|-------------------|
| 应付托管费                    | -                 | -     | -     | 710,900.73      | 710,900.73        |
| 应付销售服务费                  | -                 | -     | -     | 127,847.16      | 127,847.16        |
| 应交税费                     | -                 | -     | -     | 10,867.66       | 10,867.66         |
| 应付利润                     | -                 | -     | -     | 1,793,541.64    | 1,793,541.64      |
| 其他负债                     | -                 | -     | -     | 382,893.50      | 382,893.50        |
| 负债总计                     | 20,061,022.50     | -     | -     | 175,609,780.28  | 195,670,802.78    |
| 利率敏感度缺口                  | 12,032,386,545.32 | -     | -     | -172,915,696.20 | 11,859,470,849.12 |
| 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 | 1 年以内             | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息             | 合计                |
| 资产                       |                   |       |       |                 |                   |
| 货币资金                     | 2,812,491,418.21  | -     | -     | -               | 2,812,491,418.21  |
| 结算备付金                    | 14,269,798.82     | -     | -     | -               | 14,269,798.82     |
| 存出保证金                    | 22,511.16         | -     | -     | -               | 22,511.16         |
| 交易性金融资产                  | 6,649,933,685.21  | -     | -     | -               | 6,649,933,685.21  |
| 买入返售金融资产                 | 4,609,530,109.32  | -     | -     | -               | 4,609,530,109.32  |
| 应收证券清算款                  | -                 | -     | -     | -               | -                 |
| 应收股利                     | -                 | -     | -     | -               | -                 |
| 应收申购款                    | -                 | -     | -     | 40,534,631.47   | 40,534,631.47     |
| 其他资产                     | -                 | -     | -     | -               | -                 |
| 资产总计                     | 14,086,247,522.72 | -     | -     | 40,534,631.47   | 14,126,782,154.19 |
| 负债                       |                   |       |       |                 |                   |
| 短期借款                     | -                 | -     | -     | -               | -                 |
| 交易性金融负债                  | -                 | -     | -     | -               | -                 |
| 卖出回购金融资产款                | 312,843,028.05    | -     | -     | -               | 312,843,028.05    |
| 应付证券清算款                  | -                 | -     | -     | 675,268,643.84  | 675,268,643.84    |
| 应付赎回款                    | -                 | -     | -     | 10,248.93       | 10,248.93         |
| 应付管理人报酬                  | -                 | -     | -     | 2,418,304.81    | 2,418,304.81      |
| 应付托管费                    | -                 | -     | -     | 690,944.26      | 690,944.26        |
| 应付销售服务费                  | -                 | -     | -     | 121,255.75      | 121,255.75        |
| 应交税费                     | -                 | -     | -     | 14,828.00       | 14,828.00         |

|         |                   |   |   |                 |                   |
|---------|-------------------|---|---|-----------------|-------------------|
| 应付利润    | -                 | - | - | 3,261,182.46    | 3,261,182.46      |
| 其他负债    | -                 | - | - | 355,870.98      | 355,870.98        |
| 负债总计    | 312,843,028.05    | - | - | 682,141,279.03  | 994,984,307.08    |
| 利率敏感度缺口 | 13,773,404,494.67 | - | - | -641,606,647.56 | 13,131,797,847.11 |

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 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<br>2024年6月30日           | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|    | 利率上升 25 个基点 | -5,615,946.15               | -5,442,048.80       |
|    | 利率下降 25 个基点 | 5,645,739.33                | 5,464,166.48        |

#### 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 2024 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<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | -                      | -                        |
| 第二层次          | 6,132,645,479.15       | 6,649,933,685.21         |
| 第三层次          | -                      | -                        |
| 合计            | 6,132,645,479.15       | 6,649,933,685.21         |

##### 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。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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证券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 6 月 30 日，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 2024 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            | 6,132,645,479.15  | 50.87  |
|   | 其中：债券             | 6,132,645,479.15  | 50.87  |
|   | 资产支持证券            | -                 | -      |
| 2 | 买入返售金融资产          | 4,664,609,797.89  | 38.69  |
|   | 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      | 1,255,077,575.76  | 10.41  |
| 4 | 其他各项资产            | 2,808,799.10      | 0.02   |
| 5 | 合计                | 12,055,141,651.90 | 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 |                | 4.59           |
|    | 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 | 20,061,022.50  | 0.17           |
|    | 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

本基金本报告期内不存在债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的情况。

## 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    | 79 |
| 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 | 48 |

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内不存在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                 | 51.63               | 1.60                |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 2  | 30 天（含）—60 天           | 5.82                | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 3  | 60 天（含）—90 天           | 17.83               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 4  | 90 天（含）—120 天          | 0.84                | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 5  | 120 天（含）—397 天（含）      | 25.37               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
|    | 合计                     | 101.48              | 1.60                |

#### 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期限超过 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      | -              | -            |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 571,543,749.59 | 4.82         |
|    | 其中：政策性金融债 | -              | -            |
| 4  | 企业债券      | -              | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | 752,053,476.63 | 6.34         |

|    |                      |                  |       |
|----|----------------------|------------------|-------|
| 6  | 中期票据                 | -                | -     |
| 7  | 同业存单                 | 4,809,048,252.93 | 40.55 |
| 8  | 其他                   | -                | -     |
| 9  | 合计                   | 6,132,645,479.15 | 51.71 |
| 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  | 112304023 | 23 中国银行 CD023 | 2,000,000.00 | 199,715,970.52 | 1.68         |
| 2  | 112409177 | 24 浦发银行 CD177 | 2,000,000.00 | 199,112,675.85 | 1.68         |
| 3  | 112481456 | 24 东莞银行 CD109 | 2,000,000.00 | 199,103,216.90 | 1.68         |
| 4  | 112421086 | 24 渤海银行 CD086 | 2,000,000.00 | 197,856,561.75 | 1.67         |
| 5  | 112497373 | 24 成都银行 CD089 | 2,000,000.00 | 197,701,891.22 | 1.67         |
| 6  | 112481122 | 24 郑州银行 CD151 | 2,000,000.00 | 197,058,737.47 | 1.66         |
| 7  | 072410033 | 24 西部证券 CP003 | 1,500,000.00 | 150,790,745.65 | 1.27         |
| 8  | 112493611 | 24 湖北银行 CD031 | 1,500,000.00 | 148,545,175.60 | 1.25         |
| 9  | 112404004 | 24 中国银行 CD004 | 1,500,000.00 | 148,139,522.88 | 1.25         |
| 10 | 112419232 | 24 恒丰银行 CD232 | 1,500,000.00 | 147,811,192.72 | 1.25         |

### 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                   | 0.0786% |
| 报告期内偏离度的最低值                   | 0.0315% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.0553% |

#### 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。

## 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 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中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局北京市分局、国家金融监督管理总局的处罚。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东莞银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局东莞监管分局、国家金融监督管理总局深圳监管局的处罚。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湖北银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局湖北监管局的处罚。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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。

### 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 | 114,715.02 |
| 2  | 应收清算款 | -          |

|   |       |              |
|---|-------|--------------|
| 3 | 应收利息  | -            |
| 4 | 应收申购款 | 2,618,674.96 |
| 5 | 其他应收款 | -            |
| 6 | 待摊费用  | 75,409.12    |
| 7 | 其他    | -            |
| 8 | 合计    | 2,808,799.10 |

#### 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 |
| 金鹰增益货币 A | 29,716   | 7,451.73   | 40,117,783.77     | 18.12% | 181,317,704.80 | 81.88% |
| 金鹰增益货币 B | 43,347   | 266,285.83 | 11,219,908,326.95 | 97.20% | 322,783,646.75 | 2.80%  |
| 金鹰增益货币 E | 125      | 762,747.09 | 93,055,145.57     | 97.60% | 2,288,241.28   | 2.40%  |
| 合计       | 73,188   | 162,041.19 | 11,353,081,256.29 | 95.73% | 506,389,592.83 | 4.27%  |

注：此处现金鹰金增益 E 份额是以单位净值为 1.00 元/份做了转换处理，实际上现金增益 E 的单位净值为 100 元/份。

#### 8.2 期末上市基金前十名持有人

金鹰增益货币 A

金鹰现金增益货币 A 类份额为非上市交易份额，无上市基金份额持有人。

#### 金鹰增益货币B

金鹰现金增益货币 B 类份额为非上市交易份额，无上市基金份额持有人。

#### 金鹰增益货币 E

| 序号 | 持有人名称                               | 持有份额（份）       | 占上市总份额比例 |
|----|-------------------------------------|---------------|----------|
| 1  | 深圳国源信达资本管理有限公司—国源不争 4 号私募证券投资基金     | 25,007,300.00 | 26.23%   |
| 2  | 深圳国源信达资本管理有限公司—国源不争 1 号私募证券投资基金     | 25,006,000.00 | 26.23%   |
| 3  | 精砚私募基金管理（广东）有限公司—精砚增益私募证券投资基金       | 11,001,700.00 | 11.54%   |
| 4  | 广东展麟私募基金管理有限公司—展麟高富 11 号私募证券投资基金    | 10,000,900.00 | 10.49%   |
| 5  | 精砚私募基金管理（广东）有限公司—精砚共赢私募证券投资基金       | 8,011,600.00  | 8.40%    |
| 6  | 精砚私募基金管理（广东）有限公司—精砚增益私募证券投资基金       | 3,000,400.00  | 3.15%    |
| 7  | 上海汐泰投资管理有限公司—汐泰明俊 5 号私募证券投资基金       | 3,000,200.00  | 3.15%    |
| 8  | 精砚私募基金管理（广东）有限公司—精砚优选创利 1 号私募证券投资基金 | 2,000,500.00  | 2.10%    |
| 9  | 精砚私募基金管理（广东）有限公司—精砚优选创利 3 号私募证券投资基金 | 2,000,400.00  | 2.10%    |
| 10 | 精砚私募基金管理（广东）有限公司—精砚优选创利 5 号私募证券投资基金 | 1,000,200.00  | 1.05%    |

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。

### 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  | 银行类机构 | 523,356,222.58 | 4.41%  |
| 2  | 券商类机构 | 510,685,247.77 | 4.31%  |
| 3  | 银行类机构 | 409,975,732.64 | 3.46%  |

|    |       |                |       |
|----|-------|----------------|-------|
| 4  | 券商类机构 | 402,634,167.40 | 3.40% |
| 5  | 券商类机构 | 316,900,628.18 | 2.67% |
| 6  | 银行类机构 | 303,043,802.52 | 2.56% |
| 7  | 银行类机构 | 302,809,559.52 | 2.55% |
| 8  | 保险类机构 | 300,621,100.96 | 2.53% |
| 9  | 券商类机构 | 300,152,181.65 | 2.53% |
| 10 | 保险类机构 | 300,116,452.84 | 2.53% |

#### 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<br>所有从业人<br>员持有本基<br>金 | 金鹰增益货币 A | 1.00       | 0.00%    |
|                              | 金鹰增益货币 B | 437,214.31 | 0.00%    |
|                              | 金鹰增益货币 E | 0.00       | 0.00%    |
|                              | 合计       | 437,215.31 | 0.00%    |

#### 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<br>研究部门负责人持有本开放式基金 | 金鹰增益货币 A | 0                 |
|                                    | 金鹰增益货币 B | 0~10              |
|                                    | 金鹰增益货币 E | 0                 |
|                                    | 合计       | 0~10              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 金鹰增益货币 A | 0                 |
|                                    | 金鹰增益货币 B | 0~10              |
|                                    | 金鹰增益货币 E | 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                             | 金鹰增益货币 A       | 金鹰增益货币 B          | 金鹰增益货币 E         |
|--------------------------------|----------------|-------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2017 年 3 月 20 日）基金份额总额 | 10,164,981.22  | 185,001,749.98    | 1,493,451,000.00 |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 269,067,560.85 | 12,834,799,019.46 | 27,931,266.80    |

|               |                |                   |                |
|---------------|----------------|-------------------|----------------|
| 本报告期基金总申购份额   | 586,183,481.73 | 19,178,279,349.18 | 103,716,253.30 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 633,815,554.01 | 20,470,386,394.94 | 36,304,133.25  |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -              | -                 | -              |
| 本报告期末基金份额总额   | 221,435,488.57 | 11,542,691,973.70 | 95,343,386.85  |

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、本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。
- 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、公募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

本报告期末改聘会计师事务所。

## 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

### 10.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

### 10.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，托管人托管业务部门及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

## 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 |    |
| 兴业证券  | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 太平洋证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 招商证券  | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字[1998]29号）的有关规定要求及本基金合同规定的选择券商的标准，选择券商租用其席位。本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的专用交易单元。本基金专用交易单元的选择标准如下：

- （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。

### 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 |
|-------|----------------|--------------|-------------------|----------------|------|--------------|
| 兴业证券  | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 太平洋证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 招商证券  | 901,840,563.00 | 100.00%      | 22,286,605,000.00 | 100.00%        | -    | -            |

注：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。

### 10.9 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内未出现偏离度的绝对值达到 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旗下基金 2023 年第四季度报告提示性公告               | 证监会规定媒介 | 2024-01-22 |
| 2  | 金鹰现金增益交易型货币市场基金 2023 年第四季度报告                   | 证监会规定媒介 | 2024-01-22 |
| 3  | 金鹰基金管理有限公司金鹰现金增益交易型货币市场基金暂停大额申购（转换转入、定期定额投资）公告 | 证监会规定媒介 | 2024-01-29 |
| 4  | 金鹰基金管理有限公司关于调整旗下公募基金产品风险等级评级方式相关事项的公告          | 证监会规定媒介 | 2024-02-01 |
| 5  | 金鹰基金管理有限公司金鹰现金增益交易型货币市场基金暂停大额申购（转换转入、定期定额投资）公告 | 证监会规定媒介 | 2024-03-28 |
| 6  | 金鹰基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告                 | 证监会规定媒介 | 2024-03-29 |
| 7  | 金鹰现金增益交易型货币市场基金 2023 年年度报告                     | 证监会规定媒介 | 2024-03-29 |
| 8  | 金鹰基金管理有限公司旗下基金 2024 年第一季度报告提示性公告               | 证监会规定媒介 | 2024-04-22 |
| 9  | 金鹰现金增益交易型货币市场基金 2024 年第一季度报告                   | 证监会规定媒介 | 2024-04-22 |

|    |  |         |            |
|----|--|---------|------------|
| 10 | 金鹰基金管理有限公司金鹰现金增益交易型货币市场基金暂停大额申购（转换转入、定期定额投资）公告 | 证监会规定媒介 | 2024-04-26 |
| 11 | 金鹰现金增益交易型货币市场基金（金鹰增益货币 A）基金产品资料概要更新            | 证监会规定媒介 | 2024-05-31 |
| 12 | 金鹰现金增益交易型货币市场基金（金鹰增益货币 B）基金产品资料概要更新            | 证监会规定媒介 | 2024-05-31 |
| 13 | 金鹰现金增益交易型货币市场基金（金鹰增益货币 E）基金产品资料概要更新            | 证监会规定媒介 | 2024-05-31 |
| 14 | 金鹰现金增益交易型货币市场基金招募说明书更新                         | 证监会规定媒介 | 2024-05-31 |
| 15 | 金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国泰君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 | 2024-05-31 |
| 16 | 金鹰基金管理有限公司金鹰现金增益交易型货币市场基金暂停大额申购（转换转入、定期定额投资）公告 | 证监会规定媒介 | 2024-06-03 |

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和营业执照。
5. 基金托管人业务资格批件和营业执照。
6. 本报告期内在规定媒介公开披露的公告。

## 12.2 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

## 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

二〇二四年八月三十日