

# 金鹰现金增益交易型货币市场基金

## 2020 年中期报告

### 2020 年 6 月 30 日

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

送出日期：二〇二〇年八月二十九日

## § 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 2020 年 8 月 28 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 2020 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	12
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	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	20
§ 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	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	43
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	43
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

§ 8 基金份额持有人信息.....	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	46
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.....	47
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
§ 9 开放式基金份额变动.....	48
§ 10 重大事件揭示.....	48
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
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.....	49
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.9 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	50
10.10 其他重大事件.....	50
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	52
11.1 影响投资者决策的其他重要信息.....	52
§ 12 备查文件目录.....	53
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	53
12.3 查阅方式.....	53

## § 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		
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	12,307,495,075.79 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	金鹰现金增益 A	金鹰现金增益 B	金鹰现金增益 E
下属分级基金的交易代码	004372	004373	511770
报告期末下属分级基金的份额总额	149,662,029.76 份	12,151,351,099.89 份	6,481,946.14 份

注：金鹰现金增益 E 类基金份额上市交易，E 类基金份额面值为 100 元。本表中列示 E 类份额数据面值已折算为 1 元。

### 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 负责人	姓名	徐娇娇	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	广东省广州市南沙区滨海路 171号11楼自编1101之一J79	深圳市福田区福田街道福华一 路111号
办公地址	广州市天河区珠江东路28号越 秀金融大厦30层	深圳市福田区福田街道福华一 路111号
邮政编码	510623	518000
法定代表人	王铁	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（2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日）		
	金鹰现金增益 A	金鹰现金增益 B	金鹰现金增益 E
本期已实现收益	2,094,497.69	149,035,986.56	40,688.10
本期利润	2,094,497.69	149,035,986.56	40,688.10
本期净值收益率	1.1475%	1.2433%	0.3690%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)		
	金鹰现金增益 A	金鹰现金增益 B	金鹰现金增益 E
期末基金资产净值	149,662,029.76	12,151,351,099.89	6,481,946.14
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(2020年6月30日)		
	金鹰现金增益 A	金鹰现金增益 B	金鹰现金增益 E
累计净值收益率	11.3464%	12.0432%	8.2681%

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

##### 金鹰现金增益 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	0.1558%	0.0011%	0.1107%	0.0000%	0.0451%	0.0011%
过去三个月	0.4815%	0.0009%	0.3357%	0.0000%	0.1458%	0.0009%
过去六个月	1.1475%	0.0015%	0.6713%	0.0000%	0.4762%	0.0015%
过去一年	2.4510%	0.0016%	1.3500%	0.0000%	1.1010%	0.0016%
过去三年	10.0505%	0.0024%	4.0451%	0.0000%	6.0054%	0.0024%
自基金合同生效起至今	11.3464%	0.0025%	4.4261%	0.0000%	6.9203%	0.0025%

##### 金鹰现金增益 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	0.1715%	0.0011%	0.1107%	0.0000%	0.0608%	0.0011%
过去三个月	0.5292%	0.0009%	0.3357%	0.0000%	0.1935%	0.0009%
过去六个月	1.2433%	0.0015%	0.6713%	0.0000%	0.5720%	0.0015%
过去一年	2.6461%	0.0016%	1.3500%	0.0000%	1.2961%	0.0016%
过去三年	10.6808%	0.0024%	4.0451%	0.0000%	6.6357%	0.0024%
自基金合同生效起至今	12.0432%	0.0025%	4.4261%	0.0000%	7.6171%	0.0025%

##### 金鹰现金增益 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 ②	准收益率③	准收益率标 准差④		
过去一个月	0.0136%	0.0002%	0.1107%	0.0000%	-0.0971%	0.0002%
过去三个月	0.0522%	0.0006%	0.3357%	0.0000%	-0.2835%	0.0006%
过去六个月	0.3690%	0.0019%	0.6713%	0.0000%	-0.3023%	0.0019%
过去一年	0.7765%	0.0021%	1.3500%	0.0000%	-0.5735%	0.0021%
过去三年	6.9866%	0.0039%	4.0451%	0.0000%	2.9415%	0.0039%
自基金合同生效 起至今	8.2681%	0.0042%	4.4261%	0.0000%	3.8420%	0.0042%

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。

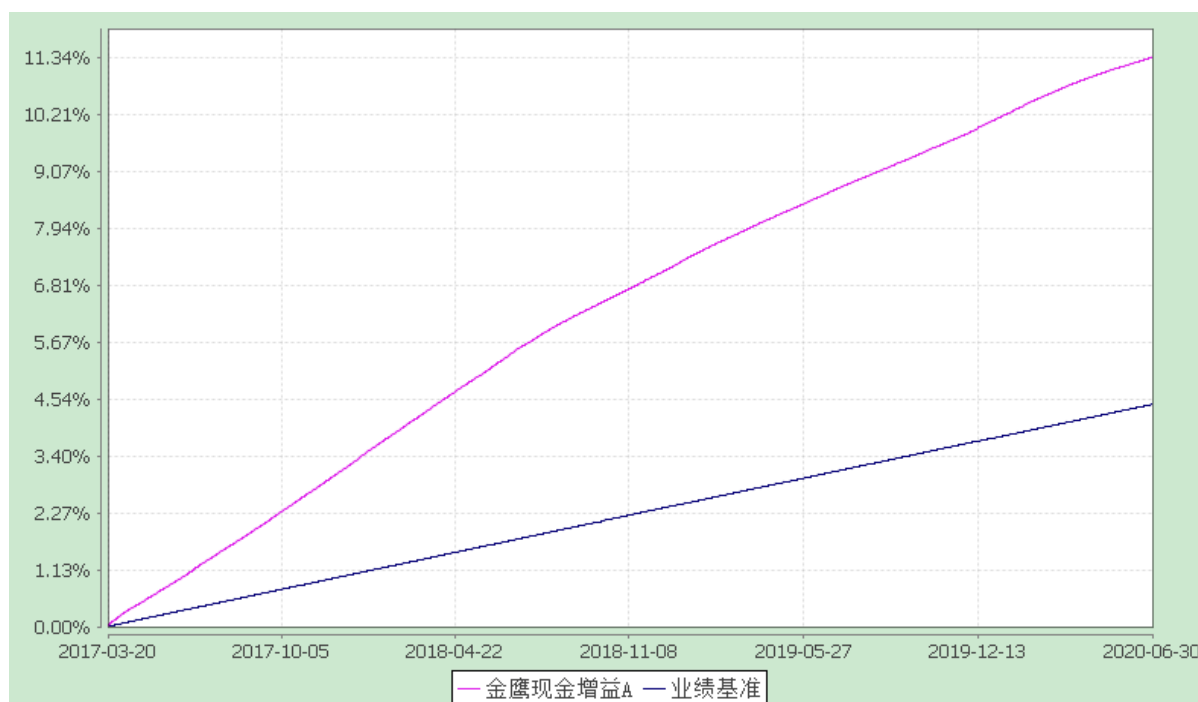
（3）本基金的业绩比较基准为：七天通知存款税后利率。

### 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

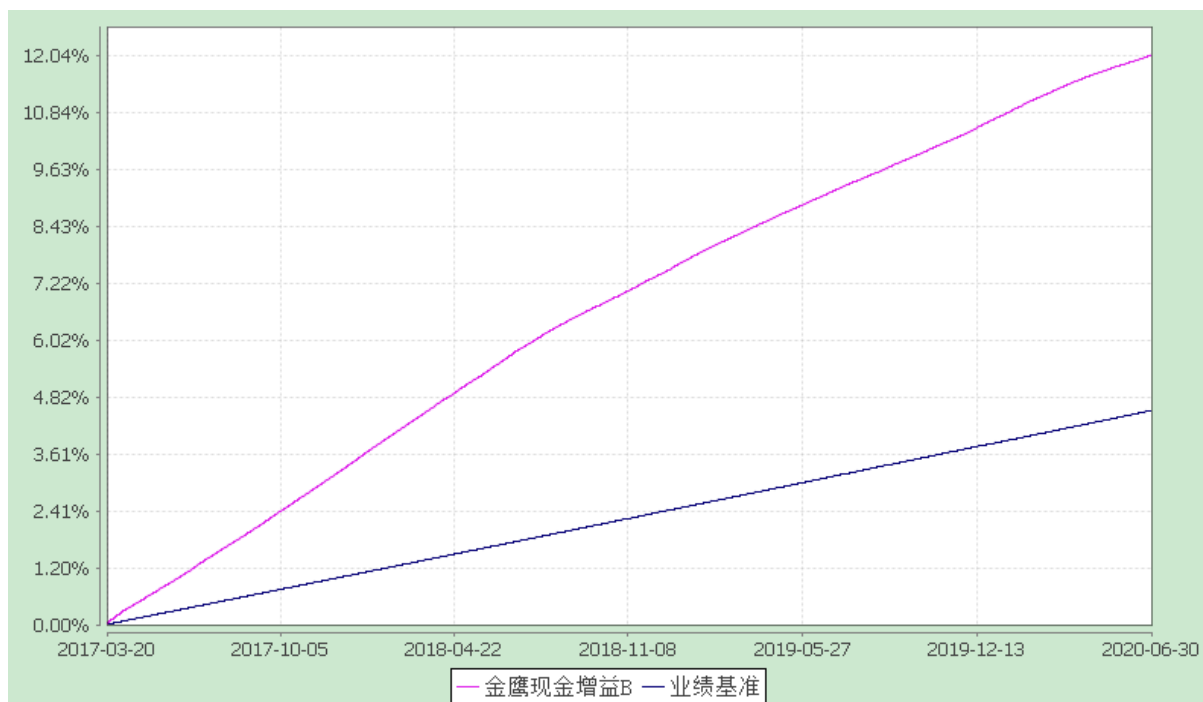
金鹰现金增益交易型货币市场基金  
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2017 年 3 月 20 日至 2020 年 6 月 30 日）

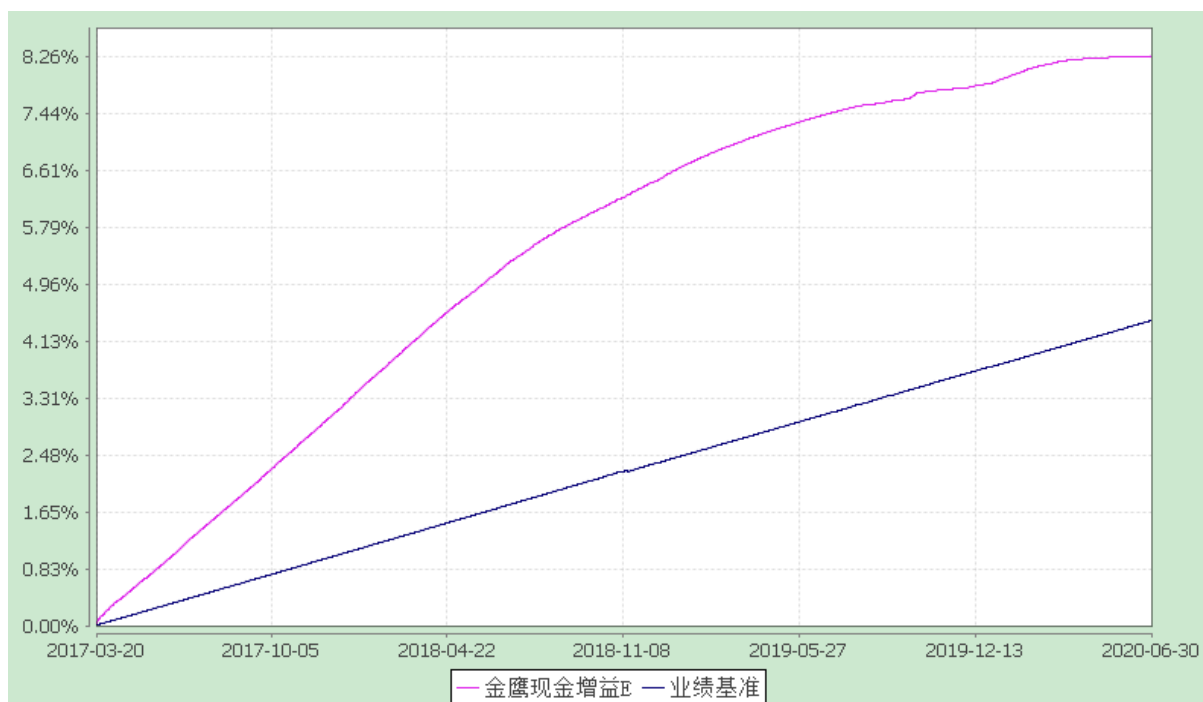
金鹰现金增益 A



金鹰现金增益 B



金鹰现金增益 E



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。

## § 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 46 支。

#### 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，公司固定收益部总监	2017-03-20	-	13	刘丽娟女士，中南财经政法大学工商管理硕士，历任恒泰证券股份有限公司交易员，投资经理，广州证券股份有限公司资产管理总部固定收益投资总监。2014 年 12 月加入金鹰基金管理有限公司，任固定收益部总监。现任固定收益部基金经理。
黄倩倩	本基金的基金经理	2017-06-06	-	8	黄倩倩女士，西南财经大学金融学硕士研究生，历任广州证券股份有限公司资产管理总部债券交易员，2014 年 11 月加入金鹰基金管理有限公司，担任固定收益部债券交易员、基金经理助理，现任固定收益部基金经理。

注：1、任职日期和离任日期指公司公告聘任或解聘日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》和其他有关法律法规及其各项实施准则、本基金《基金合同》等法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作基本合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 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内的公平交易功能执行交易，不断强化事后监控分析，以尽可能确保公平对待各投资组合。

报告期，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 4.4 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

今年以来，受新冠肺炎疫情疫情影响，大部分行业 2 月处于停工状态；3 月以后，国内疫情得到有效控制，各大企业开始陆续复工复产，国内 GDP 一季度呈负增长，同比下降 6.8%；随着逆周期政策的加码，企业复产速度加快，国内宏观经济从二季度开始逐步缓慢修复，整体经济基本面上半年呈 V 形走势。生产端，工业增加值同比从 4 月恢复正增长，并在 5 月回升至 4.4%，表现较好。内需方面，土地成交景气度在 3 月开始率先回升，地产销售面积低位反弹，带动地产投资逐步回升；基建投资方面，受益于财政政策的发力也表现抢眼；制造业投资受库存积压和盈利不足等影响表现较

弱。外需方面，3 月海外疫情爆发并持续恶化，防疫物资出口创历史新高，对出口构成支撑；二季度海外陆续复工复产，订单量弱回升，出口表现超预期。通胀方面，食品项，受春节因素和疫情所带来的农产品产销秩序受阻的叠加影响，CPI 食品方面 1、2 月都保持在 5 以上的高位，3 月以后随天气转暖以及农产品产销秩序恢复等利好因素影响逐步回落；非食品项，国际原油价格受海外疫情影响急速大跌，月均价格环比下跌幅度最高达 40% 左右，后缓慢回升，仍处于低位空间。PPI 方面，受疫情影响，大宗商品价格继续下行，南华工业品指数持续下滑，PPI 呈现一定程度的负增长；二季度大宗商品价格回升，而 PPI 表现滞后，依然处于筑底期。汇率方面，前期受美国流动性恐慌的影响，美元指数飙升；叠加美国重启对华为制裁等事件，造成人民币兑美元短期贬值，后美国宣布取消对华为更为严厉制裁，加之国内经济逐步企稳，人民币逐步回升。

货币政策方面，为应对疫情对经济的负面影响，全球呈现降准降息格局，央行上半年也实施了更加积极的货币政策，前后三次定向降准并下调了 OMO 利率。1 月 1 日下午，央行便公布了今年以来的第一个利好，将于 1 月 6 日下调金融机构存款准备金率 0.5%，约释放长期资金 8000 多亿元。为应对春节提现压力和企业所得税缴税期，央行又多次通过 OMO 释放流动性。新冠肺炎疫情之后，3 月 16 日，央行再次实施普惠金融定向降准，对达到考核标准的银行定向降准 0.5 至 1 个百分点，另对符合条件的股份制商业银行再额外定向降准 1 个百分点，支持发放普惠金融领域贷款，共释放长期资金 5500 亿元左右。3 月 30 日，央行重启公开市场逆回购操作，并下调公开市场 7 天逆回购利率 20bp，降幅创 2015 年来新高。4 月 3 日央行公告于 2020 年 4 月 15 日和 5 月 15 日分两次对中小银行定向降准，每次下调 0.5 个百分点，共释放资金约 4000 亿元；并于 4 月 7 日下调金融机构在央行超额存款准备金利率 37 个基点至 0.35%。5 月，鉴于资金面有所收紧，央行于 5 月底重启公开市场操作，主要以开展 7 天逆回购为主，累计释放了 6700 亿资金，但价格尚未调降，略超预期。

债券市场上半年总体表现呈 V 型态势。1-4 月受疫情带来的市场风险偏好降低叠加货币政策放松的利好，债券收益率震荡下行，10 年国债总体下行 65bp 左右。受新冠疫情先后于国内外爆发并蔓延的影响，市场风险偏好下行，全球呈降准降息格局，美股大跌，美国十年国债持续下行，债券收益率陆续下行约 55bp 左右，从 3.1% 下行到 2.52%；3 月 9 日晚间，美股首次熔断，随后两周内陆续再熔断了 3 次；市场的恐慌情绪蔓延到极致，对于流动性危机的担忧引发作为避险资产的债券、黄金和日元等资产跟随大跌，除美元以外的资产表现一片狼藉；加之国内市场对央行的降准预期迟迟未到，国内债券收益率跟随上行。为应对流动性危机，美国陆续购买 5000 亿美元的美债和 2000 亿美元 MBS、2 万亿美元刺激计划等一系列积极的货币政策，而市场均未买单继续狂跌；直到 3 月中旬美国通过无限量 QE 草案，市场流动性危机有所缓解，避险资产反弹，债券收益开始向下回调，期间振幅最大 10bp 左右。4 月 3 日闭市后，央行公告对中小银行实施定向降准 100bp，并将超额准

备金率从 0.72% 下调至 0.35%，超额准备金率的下调超出市场预期，长短端集体下行，1 年国开下行 40bp，10 年国开下行 10bp，曲线依然陡峭。到 5 月开始呈现震荡上行的格局，主要系货币政策未能进一步宽松略超市场预期，叠加前期债券下行过多回调的因素，10 年国债转而上行约 25bp 左右；短端从 5 月下旬开始亦随资金面的收紧而逐步上行，1 年利率较 4 月末上行 20bp 左右，1 年国股存单上行 20bp 左右。6 月市场延续纠结态势，央行反复放话“将进一步降准，引导实体经济融资成本降低”，给予了市场期望却又迟迟未兑现；加之特别国债和专项债的集中发行让供给端承压，10 年国开进一步大幅上行，最高上行 20bp 有余，后小幅回调 5bp 左右。整个二季度长端利率债上行约 35bp，200210 季末收于 3.15 左右，已回到今年降准前的位置。

本基金集中于一二月份提高了杠杆比例和久期，充分享受了宽松货币政策所带来的投资收益，增厚了组合回报；并在二季度开始陆续降低久期和杠杆，置换为逆回购，落袋为安，在保障了流动性安全的同时获得了较好的收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 6 月 30 日，在本报告期内，本基金 A 类份额净值收益率为 1.1475%，业绩比较基准收益率为 0.6713%；B 类份额净值收益率为 1.2433%，业绩比较基准收益率为 0.6713%；E 类份额净值收益率为 0.3690%，业绩比较基准收益率为 0.6713%。

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

货币政策总体将保持中性，短期内更进一步的宽松政策难见。但若三季度经济修复速度难以为继，央行进一步宽松的政策仍然可期。

综合以上分析，本基金依然保持短期谨慎长期看多的观点，预计三季度债市将保持震荡趋势，短期内维持低仓位低久期的策略，密切观察疫情发展情况以及宏观高频数据变化以修正预期，并寻求一些交易性机会以及数据证伪所带来的配置性机会，在确保组合良好流动性和安全性的前提下，竭力为持有人带来更高的回报。

#### 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

本基金 A 类份额在本报告期累计分配收益 2,094,497.69 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 2,094,497.69 元；本基金 B 类份额在本报告期累计分配收益 149,035,986.56 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 149,035,986.56 元；本基金 E 类份额在本报告期累计分配收益 40,688.10 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 40,688.10 元。

#### 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：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,757,981,645.69	3,147,638,435.70
结算备付金		555,555.56	26,132,405.75
存出保证金		31,629.12	19,769.38



交易性金融资产	6.4.7.2	6,892,576,201.06	5,954,542,673.98
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		6,744,230,614.65	5,904,541,146.90
资产支持证券投资		148,345,586.41	50,001,527.08
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	4,665,842,837.89	3,735,087,989.63
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	25,447,642.48	31,381,926.21
应收股利		-	-
应收申购款		1,561,724.33	532,834.55
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	75,409.94	-
<b>资产总计</b>		<b>13,344,072,646.07</b>	<b>12,895,336,035.20</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年6月30日</b>	<b>上年度末 2019年12月31日</b>
负债：			
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		591,949,306.15	1,858,596,409.70
应付证券清算款		424,932,693.85	648,689,740.27
应付赎回款		15,001,622.68	-
应付管理人报酬		3,088,125.51	2,222,229.24
应付托管费		882,321.58	634,922.65
应付销售服务费		136,693.72	105,225.85
应付交易费用	6.4.7.7	245,938.05	151,271.47
应交税费		6,412.26	8,120.33
应付利息		61,247.42	184,475.45
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	273,209.06	177,300.00
负债合计		1,036,577,570.28	2,510,769,694.96
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	12,307,495,075.79	10,384,566,340.24
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		12,307,495,075.79	10,384,566,340.24
负债和所有者权益总计		13,344,072,646.07	12,895,336,035.20

注：截至 2020 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.0000 元，B 类基金份额净值 1.0000 元，E 类基金份额净值 100.0000 元。基金份额总额 12,307,495,075.79 份，其中 A 类基金份额的份额总额为 149,662,029.76 份，B 类基金份额的份额总额为 12,151,351,099.89 份，E 类基金份额的份额总额为 6,481,946.14 份，其中 E 类份额净值已折算为 1 元。

## 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>188,716,606.77</b>	<b>224,038,137.72</b>
1.利息收入		186,271,471.38	223,667,481.84
其中：存款利息收入	6.4.7.11	61,083,198.15	43,077,324.07
债券利息收入		77,243,043.60	119,709,706.91
资产支持证券利息收入		1,533,303.99	723,357.52
买入返售金融资产收入		46,411,925.64	60,157,093.34
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,427,865.39	370,655.88
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	2,427,865.39	370,655.88
资产支持证券投资收益	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“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
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	17,270.00	-
<b>减：二、费用</b>		<b>37,545,434.42</b>	<b>37,741,223.06</b>
1. 管理人报酬		17,375,477.27	17,733,284.61
2. 托管费		4,964,422.08	5,066,652.73
3. 销售服务费		801,924.25	835,937.62
4. 交易费用	6.4.7.19	-	-
5. 利息支出		14,210,392.09	13,698,624.60
其中：卖出回购金融资产支出		14,210,392.09	13,698,624.60
6. 税金及附加		4,958.92	18,876.72
7. 其他费用	6.4.7.20	188,259.81	387,846.78
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>151,171,172.35</b>	<b>186,296,914.66</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>151,171,172.35</b>	<b>186,296,914.66</b>

## 6.3 所有者权益（基金净值）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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	10,384,566,340.24	-	10,384,566,340.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	151,171,172.35	151,171,172.35
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	1,922,928,735.55	-	1,922,928,735.55
其中：1.基金申购款	13,316,709,165.33	-	13,316,709,165.33
2.基金赎回款	-11,393,780,429.78	-	-11,393,780,429.78
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-151,171,172.35	-151,171,172.35
五、期末所有者权益（基金净值）	12,307,495,075.79	-	12,307,495,075.79
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	11,161,579,463.97	-	11,161,579,463.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	186,296,914.66	186,296,914.66
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-498,993,333.89	-	-498,993,333.89
其中：1.基金申购款	12,156,862,078.92	-	12,156,862,078.92
2.基金赎回款	-12,655,855,412.81	-	-12,655,855,412.81
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-186,296,914.66	-186,296,914.66
五、期末所有者权益（基金净值）	10,662,586,130.08	-	10,662,586,130.08

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：姚文强，主管会计工作负责人：刘盛，会计机构负责人：谢文君

## 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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日起至 2020 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

本基金本报告期所采用的会计政策与上年度财务报表一致。

#### 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[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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	607,981,645.69
定期存款	1,150,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	720,000,000.00
存款期限 3 个月以上	430,000,000.00
其他存款	-
合计	1,757,981,645.69

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020 年 6 月 30 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度（%）
债券	交易所市场	232,280,732.32	231,011,000.00	-1,269,732.32	-0.0103

	银行间市场	6,511,949,88 2.33	6,514,839,500. 00	2,889,617.67	0.0235
	合计	6,744,230,61 4.65	6,745,850,500. 00	1,619,885.35	0.0132
	资产支持证券	148,345,586. 41	148,112,140.00	-233,446.41	-0.0019
	合计	6,892,576,20 1.06	6,893,962,640. 00	1,386,438.94	0.0113

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

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 2020年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	320,600,000.00	-
银行间市场	4,345,242,837.89	-
合计	4,665,842,837.89	-

##### 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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	524,339.86
应收定期存款利息	4,168,987.47
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	250.00
应收债券利息	15,585,854.55
应收资产支持证券利息	1,105,624.18
应收买入返售证券利息	4,062,572.22
应收申购款利息	-
其他	14.20
合计	25,447,642.48

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	75,409.94
合计	75,409.94

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	245,938.05
合计	245,938.05

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,039.32
E类中登TA结算服务费	-
审计费用	70,376.90
信息披露费	179,672.34
银行间帐户维护费	9,300.00
E类上市费	12,820.50
合计	273,209.06

**6.4.7.9 实收基金**

金鹰现金增益 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	177,046,135.40	177,046,135.40
本期申购	504,463,293.49	504,463,293.49
本期赎回（以“-”号填列）	-531,847,399.13	-531,847,399.13
本期末	149,662,029.76	149,662,029.76

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。

金鹰现金增益 B

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----



	2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,191,413,615.11	10,191,413,615.11
本期申购	12,811,034,783.74	12,811,034,783.74
本期赎回（以“-”号填列）	-10,851,097,298.96	-10,851,097,298.96
本期末	12,151,351,099.89	12,151,351,099.89

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。

#### 金鹰现金增益 E

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	16,106,589.73	16,106,589.73
本期申购	1,211,088.10	1,211,088.10
本期赎回（以“-”号填列）	-10,835,731.69	-10,835,731.69
本期末	6,481,946.14	6,481,946.14

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。

#### 6.4.7.10 未分配利润

##### 金鹰现金增益 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	-	-	-
本期利润	2,094,497.69	-	2,094,497.69
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-2,094,497.69	-	-2,094,497.69
本期末	-	-	-

##### 金鹰现金增益 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	-	-	-
本期利润	149,035,986.56	-	149,035,986.56
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-

基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-149,035,986.56	-	-149,035,986.56
本期末	-	-	-

## 金鹰现金增益 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	-	-	-
本期利润	40,688.10	-	40,688.10
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-40,688.10	-	-40,688.10
本期末	-	-	-

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	36,458,809.45
定期存款利息收入	24,444,851.03
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	179,291.07
其他	246.60
合计	61,083,198.15

## 6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期内无买卖股票差价收入。

## 6.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	10,196,279,227.66
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	10,153,471,008.32
减：应收利息总额	40,380,353.95
买卖债券差价收入	2,427,865.39

## 6.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

## 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

#### 6.4.7.17 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。

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	-
其他收入	17,270.00
合计	17,270.00

#### 6.4.7.19 交易费用

本基金本报告期内无交易费用。

##### 6.4.7.19.1 持有基金产生的费用

本基金本报告期内未投资基金。

##### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020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	18,600.00
回购交易费	200.01
E 类中登 TA 结算服务费	74,590.06
E 类上市费	12,820.50
合计	188,259.81

#### 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

经基金管理人 2019 年第一次临时股东会审议通过，并经中国证券监督管理委员会批复核准（证

监许可[2019]2306)，基金管理人原股东中信证券华南股份有限公司（原广州证券股份有限公司）将其持有的本公司 24.01%股权转让给广州越秀金融控股集团股份有限公司。本次股权转让后，基金管理人股权结构变更为：东旭集团有限公司 66.19%，广州越秀金融控股集团股份有限公司 24.01%，广州白云山医药集团股份有限公司 9.80%。基金管理人已完成股权变更事项的工商变更登记。上述事项已于 2020 年 1 月 4 日在证监会规定媒介披露。

#### 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
招商证券资产管理有限公司	基金托管人子公司
金鹰基金管理有限公司	基金管理人、销售机构
招商证券股份有限公司	基金托管人

#### 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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	357,355,081.10	100.00%	437,298,625.48	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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	18,816,225,000.00	100.00%	35,667,649,000.00	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。

上述佣金按市场佣金率计算，以扣除中国证券登记结算公司收取的证管费、经手费和使用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 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
	2020年1月1日至2020年6月30日	2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	17,375,477.27	17,733,284.61
其中：支付销售机构的客户维护费	372,163.22	804,546.19

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	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年6月30日	2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,964,422.08	5,066,652.73

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 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	金鹰现金增益 A	金鹰现金增益 B	金鹰现金增益 E	合计
金鹰基金管理有限公司	24,109.91	583,383.17	1,409.75	608,902.83
合计	24,109.91	583,383.17	1,409.75	608,902.83
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	金鹰现金增益A	金鹰现金增益B	金鹰现金增益E	合计
广州证券股份有限公司	93.73	-	57.56	151.29
金鹰基金管理有限公司	9,746.46	578,264.15	3,778.30	591,788.91
合计	9,840.19	578,264.15	3,835.86	591,940.20

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

#### 金鹰现金增益 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。

**金鹰现金增益 B**

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020年6月30日		上年度末 2019年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
招商证券股份有限 公司	300,810,684.08	2.48%	0.00	0.00%
招商证券资产管理 有限公司	404,245,564.10	3.33%	150,261,922.03	1.47%

**金鹰现金增益 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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	607,981,645.69	36,458,809.45	99,227,328.69	514,688.65

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 555,555.56 元，利息收入 179,291.07 元。2019 年 6 月 30 日余额 21,791,941.03 元，利息收入 269,581.44 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。

**6.4.10.7.2 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**

无。

**6.4.11 利润分配情况****金鹰现金增益 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
2,094,497.69	-	-	2,094,497.69	-

## 金鹰现金增益 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
149,035,986.56	-	-	149,035,986.56	-

## 金鹰现金增益 E

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
40,688.10	-	-	40,688.10	-

## 6.4.12 期末（2020 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

## 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 2020 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产余额为 902,138,948.93 元，所抵押债券参见下表：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值总额
112009039	20 浦发银行 CD039	2020-06-30	98.85	1,000,000.00	98,851,844.61
112015044	20 民生银行 CD044	2020-06-30	99.00	300,000.00	29,699,250.34
112011089	20 平安银行 CD089	2020-06-30	98.47	2,000,000.00	196,936,856.01
160206	16 国开 06	2020-06-30	100.51	500,000.00	50,253,397.87
180302	18 进出 02	2020-06-30	101.28	500,000.00	50,640,462.84
180304	18 进出 04	2020-06-30	101.68	1,000,000.00	101,679,881.87
180208	18 国开 08	2020-06-30	101.46	700,000.00	71,022,131.04
190307	19 进出 07	2020-06-30	100.12	2,000,000.00	200,244,488.69
200211	20 国开 11	2020-06-30	99.18	300,000.00	29,753,751.48



180203	18 国开 03	2020-06-30	101.67	1,000,000.00	101,665,381.99
111903112	19 农业银行 CD112	2020-06-30	99.64	2,200,000.00	219,210,487.49
112007012	20 招商银行 CD012	2020-06-30	98.42	1,000,000.00	98,424,363.48
112015044	20 民生银行 CD044	2020-06-30	99.00	200,000.00	19,799,500.23
112006033	20 交通银行 CD033	2020-06-30	98.28	2,000,000.00	196,556,078.38
112094273	20 恒生银行 CD011	2020-06-30	98.18	2,300,000.00	225,808,739.42
112011057	20 平安银行 CD057	2020-06-30	99.68	2,000,000.00	199,365,365.03
111977047	19 厦门国际 银行 CD282	2020-06-30	98.50	1,000,000.00	98,499,946.37
112094021	20 昆仑银行 CD038	2020-06-30	98.89	850,000.00	84,054,488.18
180208	18 国开 08	2020-07-01	101.46	700,000.00	71,022,131.04
200211	20 国开 11	2020-07-01	99.18	300,000.00	29,753,751.48
160206	16 国开 06	2020-07-01	100.51	500,000.00	50,253,397.87
180302	18 进出 02	2020-07-01	101.28	500,000.00	50,640,462.84
180203	18 国开 03	2020-07-01	101.67	1,000,000.00	101,665,381.99
180304	18 进出 04	2020-07-01	101.68	1,000,000.00	101,679,881.87
190307	19 进出 07	2020-07-01	100.12	2,000,000.00	200,244,488.69
合计				26,850,000.00	2,677,725,911.10

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末交易所市场债券正回购余额 55,527,000.00 元，以交易所标准券作为质押券。

#### 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；对公司各部门业务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 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
A-1	384,962,701.15	580,005,328.80
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	59,963,571.41	50,000,022.98
合计	444,926,272.56	630,005,351.78

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 2020年6月30日	上年度末 2019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 2020年6月30日	上年度末 2019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 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	232,280,732.32	80,147,955.19
AAA 以下	0.00	70,188,553.71
未评级	0.00	0.00
合计	232,280,732.32	150,336,508.90

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 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	148,345,586.41	50,001,527.08

AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	148,345,586.41	50,001,527.08

#### 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 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	5,103,592,415.41	4,010,849,181.56
AAA 以下	358,171,698.58	513,603,235.12
未评级	0.00	0.00
合计	5,461,764,113.99	4,524,452,416.68

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 2020年6月 30日	1个月 以内	1-3 个月	6个月 以内	3个月 -1年	6个月 -1年	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产										
银行存款	1,187,981,645.69	-	-	-	-	570,000,000.00	-	-	-	1,757,981,645.69
结算备付金	555,555.56	-	-	-	-	-	-	-	-	555,555.56
存出保证金	31,629.12	-	-	-	-	-	-	-	-	31,629.12
交易性金融资产	370,139,778.68	-	-	-	-	6,522,436,422.38	-	-	-	6,892,576,201.06
买入返售金融资产	4,665,842,837.89	-	-	-	-	-	-	-	-	4,665,842,837.89
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	25,447,642.48	25,447,642.48
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	1,561,724.33	1,561,724.33
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	75,409.94	75,409.94
资产总计	6,224,551,446.94	-	-	-	-	7,092,436,422.38	-	-	27,084,776.75	13,344,072,646.07
负债										
短期借款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	591,949,306.15	-	-	-	-	-	-	-	-	591,949,306.15
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	424,932,693.85	424,932,693.85
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	15,001,622.68	15,001,622.68

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	-	3,088,125.51	3,088,125.51
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	882,321.58	882,321.58
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	136,693.72	136,693.72
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	-	245,938.05	245,938.05
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	6,412.26	6,412.26
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-	-	61,247.42	61,247.42
应付利润	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-	273,209.06	273,209.06
负债总计	591,949,306.15	-	-	-	-	-	-	-	-	444,628,264.13	1,036,577,570.28
利率敏感缺口	5,632,602,140.79	-	-	-	-	7,092,436,422.38	-	-	-	-417,543,487.38	12,307,495,075.79
上年度末 2019年12月31日	1个月以内	1-3个月	6个月以内	3个月-1年	6个月-1年	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计	
资产											
银行存款	1,557,638,435.70	-	-	-	-	1,590,000,000.00	-	-	-	-	3,147,638,435.70
结算备付金	26,132,405.75	-	-	-	-	-	-	-	-	-	26,132,405.75
存出保证金	19,769.38	-	-	-	-	-	-	-	-	-	19,769.38
交易性金融资产	679,585,774.25	-	-	-	-	5,274,956,899.73	-	-	-	-	5,954,542,673.98
买入返售金融资产	3,735,087,989.63	-	-	-	-	-	-	-	-	-	3,735,087,989.63
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	-	31,381,926.21	31,381,926.21

应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	532,834.55	532,834.55
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	5,998,464,374.71	-	-	-	-	6,864,956,899.73	-	31,914,760.76	12,895,336,035.20
负债									
短期借款	-	-	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	1,858,596,409.70	-	-	-	-	-	-	-	1,858,596,409.70
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	648,689,740.27	648,689,740.27
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	2,222,229.24	2,222,229.24
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	634,922.65	634,922.65
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-	105,225.85	105,225.85
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	151,271.47	151,271.47
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	8,120.33	8,120.33
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	184,475.45	184,475.45
应付利润	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	177,300.00	177,300.00
负债总计	1,858,596,409.70	-	-	-	-	-	-	652,173,285.26	2,510,769,694.96
利率敏感度缺口	4,139,867,965.01	-	-	-	-	6,864,956,899.73	-	-620,258,524.50	10,384,566,340.24

## 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 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
利率上升 25 个基点	-6,234,519.04	-4,022,250.72
利率下降 25 个基点	6,268,445.45	4,039,309.16

#### 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。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 1. 公允价值

###### (1) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

###### (2) 以公允价值计量的金融工具

###### (i) 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。

###### (ii) 各层级金融工具公允价值

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第二层级的余额为 6,892,576,201.06 元。无属于第一、三层级的金额。

###### (iii) 公允价值所属层级间的重大变动



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。

2. 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	6,892,576,201.06	51.65
	其中：债券	6,744,230,614.65	50.54
	资产支持证券	148,345,586.41	1.11
2	买入返售金融资产	4,665,842,837.89	34.97
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	1,758,537,201.25	13.18
4	其他各项资产	27,116,405.87	0.20
5	合计	13,344,072,646.07	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	14.85	
	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	591,949,306.15	4.81

其中：买断式回购融资	-
------------	---

### 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	80
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	85
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	39

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内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	44.36	4.81
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	17.54	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	15.88	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	3.31	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	23.66	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	104.74	4.81

## 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	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	837,540,228.10	6.81
	其中：政策性金融债	605,259,495.78	4.92
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	444,926,272.56	3.62
6	中期票据	-	-
7	同业存单	5,461,764,113.99	44.38
8	其他	-	-
9	合计	6,744,230,614.65	54.80
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

## 7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	112094273	20 恒生银行 CD011	3,000,000.00	294,533,138.37	2.39
2	111903112	19 农业银行 CD112	2,200,000.00	219,210,487.49	1.78
3	190307	19 进出 07	2,000,000.00	200,244,488.69	1.63
4	111983725	19 长沙银行 CD135	2,000,000.00	199,599,781.35	1.62
5	112011057	20 平安银行 CD057	2,000,000.00	199,365,365.03	1.62
6	112093555	20 汇丰银行 CD014	2,000,000.00	199,079,213.09	1.62
7	111910399	19 兴业银行 CD399	2,000,000.00	199,043,016.15	1.62
8	111905149	19 建设银行 CD149	2,000,000.00	198,306,418.61	1.61
9	112011089	20 平安银行 CD089	2,000,000.00	196,936,856.01	1.60
10	112006033	20 交通银行 CD033	2,000,000.00	196,556,078.38	1.60

## 7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
----	------

报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.2032%
报告期内偏离度的最低值	0.0030%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0908%

### 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

本基金本报告期内正负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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	138570	嘉泰 01 优	500,000.00	50,000,000.00	0.41
2	168089	安润 2A1	500,000.00	37,755,000.00	0.31
3	138294	荣耀 03A	300,000.00	30,205,886.41	0.25
4	168341	安润 4A1	200,000.00	17,510,000.00	0.14
5	168460	安润 5A1	100,000.00	10,000,000.00	0.08
6	168180	安润 3A1	34,000.00	2,874,700.00	0.02

注：本基金本报告期末仅持有 6 只资产支持证券。

### 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农业银行股份有限公司，因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在错报漏报等行为，于 2020 年 4 月 22 日被中国银行保险监督管理委员会罚款 230 万元。因“两会一层”境外机构管理履职不到位等行为，于 2020 年 5 月 9 日被中国银行保险监督管理委员会罚款 200 万元。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。**

本基金投资的前十名证券的发行主体之一的长沙银行股份有限公司，因账户可疑交易监测不到位等行为，于 2020 年 2 月 26 日被中国人民银行长沙市中心支行公开批评并罚款 80 万元。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

本基金投资的前十名证券的发行主体之一的平安银行股份有限公司因汽车金融事业部将贷款调查的核心事项委托第三方完成等行为，于 2020 年 2 月 3 日被中国银行业监督管理委员会深圳监管局罚款 720 万元。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

本基金投资的前十名证券的发行主体之一的中国建设银行股份有限公司因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在漏报错报，于 2020 年 5 月 9 日被中国银行保险监督管理委员会罚款 230 万元。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

本基金投资的前十名证券的发行主体之一的交通银行股份有限公司因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在漏报错报，于 2020 年 5 月 9 日被中国银行保险监督管理委员会罚款 260 万元。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

### 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	31,629.12
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	25,447,642.48
4	应收申购款	1,561,724.33
5	其他应收款	-

6	待摊费用	75,409.94
7	其他	-
8	合计	27,116,405.87

#### 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
金鹰现金增益 A	10,446	14,327.21	43,701,312.69	29.20%	105,960,717.07	70.80%
金鹰现金增益 B	83	146,401,820.48	12,131,908,938.13	99.84%	19,442,161.76	0.16%
金鹰现金增益 E	197	32,903.28	-	0.00%	6,481,946.14	100.00%
合计	10,726	1,147,445.00	12,175,610,250.82	98.93%	131,884,824.97	1.07%

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

##### 金鹰现金增益 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。

##### 金鹰现金增益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。

#### 金鹰现金增益 E

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	钱宪民	606,500.00	9.39%
2	唐冰痕	324,800.00	5.03%
3	梁绢丽	282,700.00	4.38%
4	苏贵红	246,400.00	3.81%
5	张砚华	231,600.00	3.58%
6	余庆	220,100.00	3.41%
7	李小芳	217,300.00	3.36%
8	钱中明	180,000.00	2.79%
9	沈卫国	178,100.00	2.76%
10	王志中	162,900.00	2.52%

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	516,897,260.18	4.20%
2	银行类机构	503,608,683.50	4.09%
3	券商类机构	409,685,072.01	3.33%
4	券商类机构	404,245,564.10	3.28%
5	银行类机构	404,214,137.11	3.28%
6	银行类机构	403,081,756.31	3.28%
7	保险类机构	402,709,112.59	3.27%
8	银行类机构	402,458,470.16	3.27%
9	银行类机构	402,396,411.24	3.27%
10	银行类机构	401,564,652.83	3.26%

#### 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	金鹰现金增益 A	213,811.55	0.14%
	金鹰现金增益 B	-	-
	金鹰现金增益 E	-	-
	合计	213,811.55	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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	金鹰现金增益 A	0
	金鹰现金增益 B	0
	金鹰现金增益 E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	金鹰现金增益 A	0~10
	金鹰现金增益 B	0
	金鹰现金增益 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	金鹰现金增益 A	金鹰现金增益 B	金鹰现金增益 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
本报告期初基金份额总额	177,046,135.40	10,191,413,615.11	16,106,589.73
本报告期基金总申购份额	504,463,293.49	12,811,034,783.74	1,211,088.10
减：本报告期基金总赎回份额	531,847,399.13	10,851,097,298.96	10,835,731.69
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	149,662,029.76	12,151,351,099.89	6,481,946.14

注：总申购份额包含因份额升降级导致的强制调增份额，总赎回份额包含因份额升降级导致的强制调减份额。

## § 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，本基金管理人法定代表人、董事长、总经理、副总经理等进行了调整。截至报告日，王铁先生担任公司法定代表人及董事长、姚文强先生担任公司总经理，徐娇娇女士担任公司督察长，刘盛先生担任公司副总经理及首席信息官职务。

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	

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）的有关规定要求及金鹰成份股优选证券投资基金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；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
招商证券	357,355,081.10	100.00%	18,816,225,000.00	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关于旗下基金参加中	证监会规定媒介	2020-01-02

	国工商银行“2020 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告		
2	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2020-01-02
3	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金参加中国工商银行 AI 投服务基金申购费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2020-01-02
4	金鹰基金高级管理人员变更公告	证监会规定媒介	2020-01-04
5	金鹰基金管理有限公司关于公司股权变更的公告	证监会规定媒介	2020-01-04
6	金鹰基金高级管理人员变更公告	证监会规定媒介	2020-01-04
7	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与万家财富基金销售（天津）有限公司定投及费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2020-01-09
8	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、赎回、转换转出、定期定额投资）公告	证监会规定媒介	2020-01-20
9	金鹰现金增益交易型货币市场基金修改基金合同的公告	证监会规定媒介	2020-01-20
10	金鹰现金增益交易型货币市场基金托管协议更新	证监会规定媒介	2020-01-20
11	金鹰现金增益交易型货币市场基金基金合同更新	证监会规定媒介	2020-01-20
12	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	2020-01-20
13	金鹰增益货币招募说明书摘要更新	证监会规定媒介	2020-01-20
14	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订基金合同、托管协议的提示性公告	证监会规定媒介	2020-01-20
15	金鹰现金增益交易型货币市场基金 2019 年四季度报告	证监会规定媒介	2020-01-21
16	金鹰基金管理有限公司关于调整旗下基金产品 2020 年春节假期相关安排的提示性公告	证监会规定媒介	2020-01-30
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	2020-03-11
18	金鹰基金管理有限公司关于董事会成员变更的公告	证监会规定媒介	2020-03-13
19	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告	证监会规定媒介	2020-03-13
20	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国国际期货股份有限公司定投及费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2020-03-18
21	金鹰基金管理有限公司关于延期披露旗下基金 2019 年年度报告的公告	证监会规定媒介	2020-03-27

22	金鹰基金行业高级管理人员变更公告	证监会规定媒介	2020-03-28
23	金鹰现金增益交易型货币市场基金增加扩位 证券简称的公告	证监会规定媒介	2020-04-10
24	金鹰基金管理有限公司关于网上交易系统升 级暂停服务的公告	证监会规定媒介	2020-04-11
25	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金调整长 期停牌股票估值方法的公告	证监会规定媒介	2020-04-17
26	金鹰基金管理有限公司旗下全部基金季度报 告提示性公告	证监会规定媒介	2020-04-21
27	金鹰货币市场证券投资基金 2020 年一季 度报告	证监会规定媒介	2020-04-21
28	金鹰基金管理有限公司董事长变更公告	证监会规定媒介	2020-04-24
29	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、赎回、转换转出、定期 定额投资）公告	证监会规定媒介	2020-04-28
30	金鹰现金增益交易型货币市场基金 2019 年 年度报告	证监会规定媒介	2020-04-30
31	金鹰关于公司法定代表人变更公告	证监会规定媒介	2020-05-06
32	金鹰关于网上交易系统升级暂停服务的公告	证监会规定媒介	2020-05-08
33	金鹰基金关于终止泰诚财富基金销售（大连） 有限公司办理相关销售业务的公告	证监会规定媒介	2020-05-11
34	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增深 圳腾元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	2020-05-27
35	金鹰基金管理有限公司关于网上交易系统升 级暂停服务的公告	证监会规定媒介	2020-05-29
36	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	2020-06-22

注：相关信息披露文件请登录本基金管理人网站查询。

## § 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、营业执照、公司章程。
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照。
- 6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、季度报告、年度报告、更新的招股说明书及其他临时公告。

### 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  
二〇二〇年八月二十九日