

金鹰货币市场证券投资基金
2015 年年度报告摘要
2015 年 12 月 31 日

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年三月三十日

§1 重要提示

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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经审计。中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	金鹰货币	
基金主代码	210012	
交易代码	210012	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012 年 12 月 7 日	
基金管理人	金鹰基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,847,914,098.72 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	金鹰货币 A	金鹰货币 B
下属分级基金的交易代码	210012	210013
报告期末下属分级基金的份额总额	96,887,144.83 份	2,751,026,953.89 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在力求保持基金资产本金的安全性和资产高流动性的基础上，力争获得超过基金业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	本基金结合“自上而下”和“自下而上”的研究方法对各类可投资资产进行合理的配置和选择。 本基金的投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 120 天；定期存款的比例不得超过基金资产净值的 30%；存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 30%；存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 5%；其它资产配置按基金合规定执行。
业绩比较基准	税后一年期定期存款利率（即（一年期定期存款利率×（1-利息税率））。
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		金鹰基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	苏文锋	田青
	联系电话	020-83282627	010-67595096
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4006135888,020-83936180	010-67595096
传真		020-83282856	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	http://www.gefund.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市天河区珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况**3.1 主要会计数据和财务指标**

金额单位：人民币元

3.1.	2015 年		2014 年		2013 年	
1 期 间 数 据 和 指 标	金鹰货币 A	金鹰货币 B	金鹰货币 A	金鹰货币 B	金鹰货币 A	金鹰货币 B
本 期 已 实	5,062,541.16	42,555,132.43	12,699,161.36	25,949,074.58	4,256,924.99	3,911,895.78

现 收 益						
本 期 利 润	5,062,541.16	42,555,132.43	12,699,161.36	25,949,074.58	4,256,924.99	3,911,895.78
本 期 净 值 收 益 率	3.6405%	3.8903%	4.9315%	5.1843%	3.8333%	4.0829%
3.1.	2015 年末		2014 年末		2013 年末	
2 期 末 数 据 和 指 标	金鹰货币 A	金鹰货币 B	金鹰货币 A	金鹰货币 B	金鹰货币 A	金鹰货币 B
期 末 基 金 资 产 净 值	96,887,144.8 3	2,751,026,953. 89	261,316,943.4 9	714,306,664.9 4	632,046,442.5 2	1,022,235,788. 43

期 末 基 金 份 额 净 值	1.00	1.00	1.00	1.00	1.00	1.00
--------------------------------------	------	------	------	------	------	------

注：本基金合同于 2012 年 12 月 07 日生效，截至本报告季末本基金成立已经满三年。

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

1. 金鹰货币 A:

阶段	份额净值收 益率①	份额净值收 益率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.7663%	0.0068%	0.3938%	0.0003%	0.3725%	0.0065%
过去六个月	1.4057%	0.0060%	0.8733%	0.0006%	0.5324%	0.0054%
过去一年	3.6405%	0.0092%	2.1164%	0.0012%	1.5241%	0.0080%
过去三年	12.9203%	0.0113%	8.0890%	0.0013%	4.8313%	0.0100%
成立至今	13.1249%	0.0113%	8.2945%	0.0013%	4.8304%	0.0100%

注：本基金收益分配是按日结转份额。

2. 金鹰货币 B:

阶段	份额净值收 益率①	份额净值收 益率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.8274%	0.0068%	0.3938%	0.0003%	0.4336%	0.0065%
过去六个月	1.5291%	0.0060%	0.8733%	0.0006%	0.6558%	0.0054%
过去一年	3.8903%	0.0092%	2.1164%	0.0012%	1.7739%	0.0080%
过去三年	13.7380%	0.0114%	8.0890%	0.0013%	5.6490%	0.0101%
成立至今	13.9620%	0.0113%	8.2945%	0.0013%	5.6675%	0.0100%

注：本基金收益分配是按日结转份额。

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

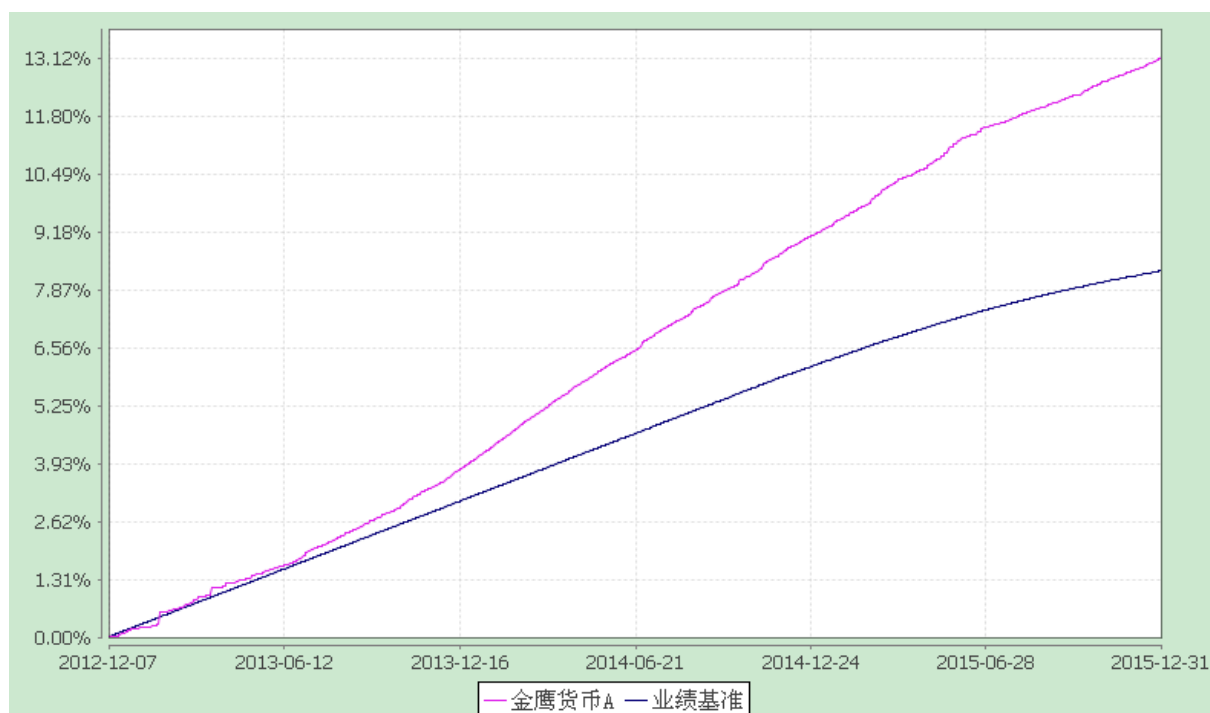
较

金鹰货币市场证券投资基金

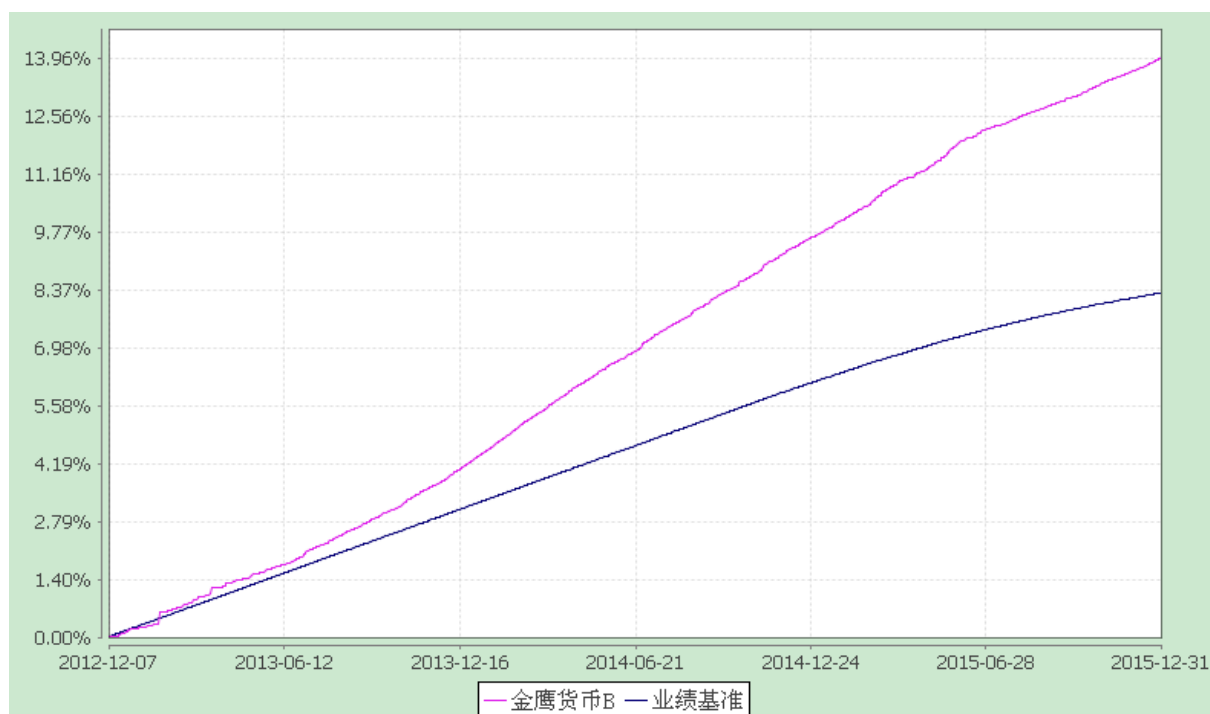
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2012 年 12 月 7 日至 2015 年 12 月 31 日)

1、金鹰货币 A



2、金鹰货币 B



注：1、本基金于 2012 年 12 月 7 日成立。2、按基金合同规定，本基金建仓期为六个月。建仓

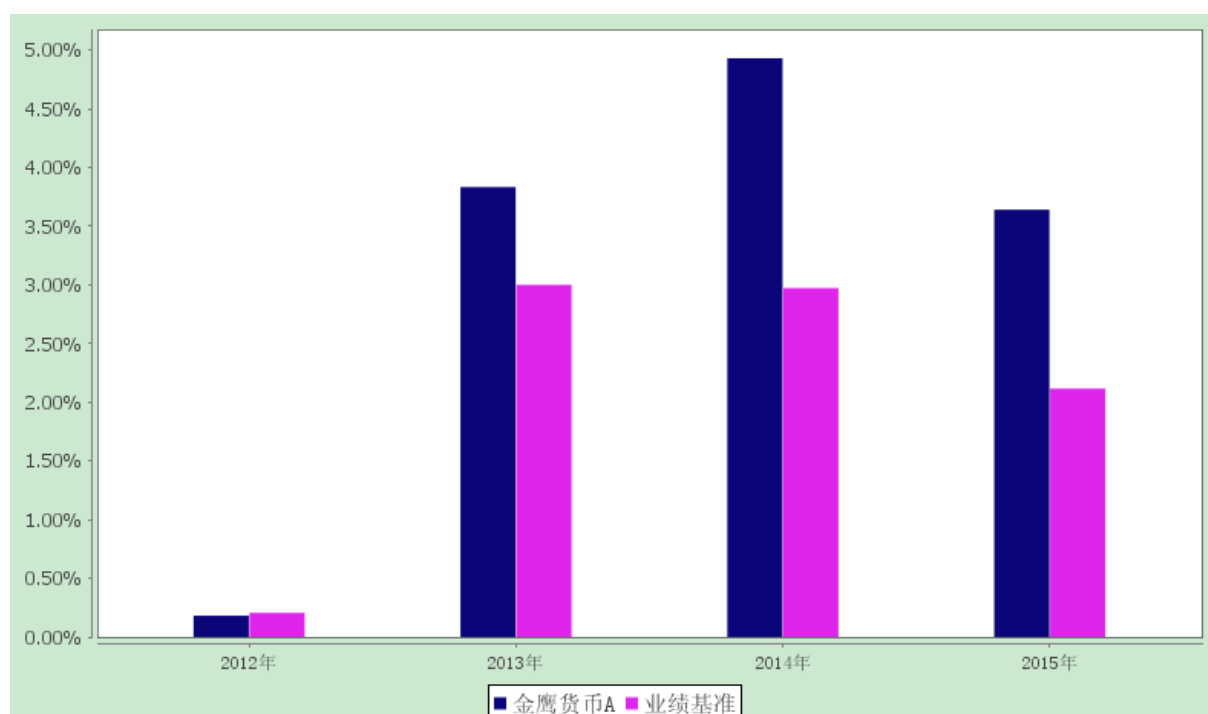
期满后，基金的投资比例符合投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 120 天；定期存款的比例不得超过基金资产净值的 30%；存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 30%；存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 5%；其它资产配置比例按基金合同规定执行。3、本基金业绩比较基准为一年期定期存款利率（税后）。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

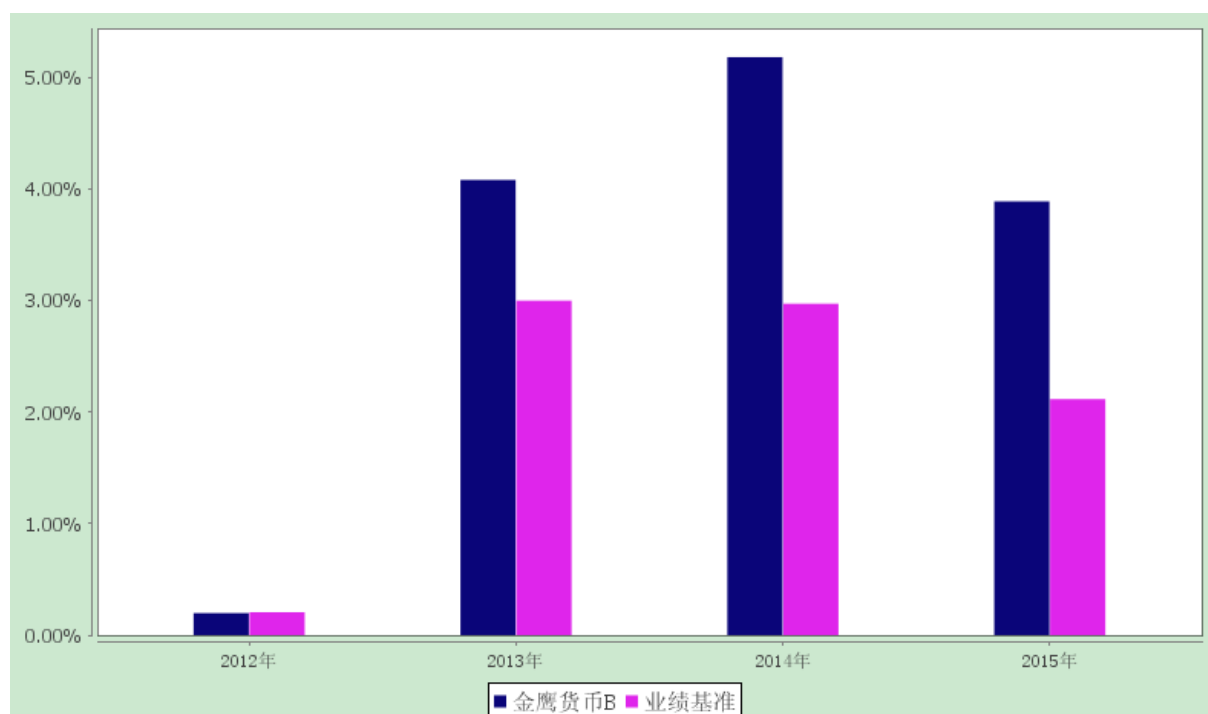
金鹰货币市场证券投资基金

自基金合同生效以来基金净收益率与业绩比较基准收益率的对比图

1、金鹰货币 A



2、金鹰货币 B



3.3 过去三年基金的利润分配情况

金鹰货币 A:

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合 计	备注
2015 年	5,074,698.06	-	-12,156.90	5,062,541.16	-
2014 年	12,775,714.59	-	-76,553.23	12,699,161.36	-
2013 年	4,222,823.84	-	34,101.15	4,256,924.99	-
合计	22,073,236.49	-	-54,608.98	22,018,627.51	-

金鹰货币 B:

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合 计	备注
2015 年	42,266,273.20	-	288,859.23	42,555,132.43	-
2014 年	26,047,824.0	-	-98,749.50	25,949,074.58	-

	8				
2013 年	4,058,239.93	-	-146,344.15	3,911,895.78	-
合计	72,372,337.2				
	1	-	43,765.58	72,416,102.79	-

注：1、本基金以份额面值 1.0000 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并全部分配，每月以红利再投资方式集中支付累计收益，即按份额面值 1.0000 元转为基金份额；

2、本基金合同于 2012 年 12 月 07 日成立，截至报告期末已满三年。

§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

金鹰基金管理有限公司经中国证监会证监基字[2002]97 号文批准，于 2002 年 12 月 25 日成立，是自律制度下中国证监会批准设立的首批基金管理公司之一。公司注册资本 2.5 亿元人民币，股东包括广州证券股份有限公司、广州白云山医药集团股份有限公司、美的集团股份有限公司和东亚联丰投资管理有限公司，分别持有 49%、20%、20%和 11%的股份。

公司设立了投资决策委员会、风险控制委员会、资产估值委员会等专业委员会。投资决策委员会负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。风险控制委员会负责全面评估公司的经营过程中的各项风险，并提出防范措施。资产估值委员会负责依照基金合同和基金估值制度的规定，确定基金资产估值的原则、方法、程序及其他相关的估值事宜。

公司目前下设 16 个一级职能部门，分别是权益投资部、研究部、集中交易部、指数及量化投资部、产品研发部、固定收益部、零售业务部、电子商务部、机构业务部、专户投资部、信息技术部、基金事务部、风险管理部、监察稽核部、财务管理部、综合管理部。

权益投资部负责基金权益类投资；研究部负责宏观经济、行业、上市公司研究和投资策略研究；集中交易部负责完成基金经理投资指令；指数及量化投资部负责指数量化产品的研究投资、金融工程研究、数量分析工作；产品研发部负责基金新产品、新业务的研究和设计工作；固定收益部负责固定收益证券以及债券、货币市场的研究和投资管理工作；零售业务部负责市场营销策划、基金销售与渠道管理、客户服务及媒介宣传推广等业务；电子商务部负责公司网络平台及网上交易系统的建设、维护和电子商务的推广；机构业务部负责机构客户的开发、维护、管理及业务拓展；专户投资部负责特定客户资产的投资和管理；信息技术部负责公司信息系统的日常运行与维护,跟踪研究新技术,进行相应的技术系统规划与开发；基金事务部负责基金会计核算、估值、开放式基金注册、登

记和清算等业务；风险管理部负责公司风险的识别、评估、控制等管理工作；监察稽核部负责对公司和基金运作以及公司员工遵守国家相关法律、法规和公司内部规章制度等情况进行监督和检查；财务管理部负责公司的财务预算、财务管理及会计核算等工作；综合管理部负责公司企业文化建设、文字档案、后勤服务、人力资源管理、薪酬制度、人员培训、人事档案等综合事务管理。

截至 2015 年 12 月 31 日，公司共管理二十一开放式基金：金鹰成份股优选证券投资基金、金鹰中小盘精选证券投资基金、金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金、金鹰行业优势混合型证券投资基金、金鹰稳健成长混合型证券投资基金、金鹰主题优势混合型证券投资基金、金鹰保本混合型证券投资基金、金鹰技术领先灵活配置混合型证券投资基金、金鹰策略配置混合型证券投资基金、金鹰持久增利债券型证券投资基金（LOF）、金鹰核心资源混合型证券投资基金、金鹰中证 500 指数分级证券投资基金、金鹰灵活配置混合型证券投资基金、金鹰货币市场证券投资基金、金鹰元丰保本混合型证券投资基金、金鹰元安保本混合型证券投资基金、金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）、金鹰科技创新股票型证券投资基金、金鹰民族新兴灵活配置混合型证券投资基金、金鹰产业整合灵活配置混合型证券投资基金、金鹰改革红利灵活配置混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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	固定收益部副总监、基金经理	2015-07-22	-	9	刘丽娟女士，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固定收益总监。2014 年 12 月加入金鹰基金管理有限公司，任固定收益部副总监。现任金鹰货币市场证券投资基金基金经理。
洪利平	基金经理	2013-07-11	2015-08-13	7	洪利平女士，西南财经大学硕士，证券从业年限 4 年，曾任职于生命人寿保险股份有限公司，任债券交易员；2010 年 7 月加入金鹰基金管理有限公司，先后担任研究员和基金经理。

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。

3、本基金从 2015 年 7 月 22 日增聘刘丽娟女士为基金经理，与洪利平女士共同管理本基金。2015

年 8 月 13 日洪利平女士离任后，由刘丽娟女士单独管理本基金。

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，严格遵守本基金的基金合同、托管协议、招募说明书等法律文件的规定，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，基金运作合法合规，无出现重大违法违规或违反基金合同的行为，无损害基金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 公平交易制度和控制方法

为了保证本基金管理人管理的不同投资组合得到公平对待，本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，以及公司内控大纲的要求，制定了《金鹰基金管理有限公司公平交易管理规定》并严格执行，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。本基金管理人通过投资交易系统公平交易功能，对不同投资组合进行公平交易事前控制。同时，本基金管理人引入公平交易分析系统，定期或不定期对公司旗下投资组合在一定期间内买卖相同证券的情况进行监控和分析。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现。同时通过投资交易系统内的公平交易功能执行交易，以尽可能确保公平对待各投资组合。

报告期内，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。

4.3.3 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

2015 年国内经济持续下行，工业增加值下探至 6% 左右低位，CPI 全年维持低位。投资方面，虽然商品房销售持续回暖，但在库存高企的背景下，并未传导至房地产投资终端，房地产投资持续低迷；制造业仍在艰难的去产能过程中；基建投资虽维持高位但仍不足以抵消房地产和制造业投资下行的压力。全年宽松货币政策不断加码，先后经历了五次降息、四次降准，同时引导公开市场利率下行，货币市场流动性非常充裕，短期资金价格迅速下滑。自 6 月中旬开始，股市经历了大幅调整，市场风险偏好急剧下降，加之监管机构严查违规配资以及 IPO 的暂停，上半年为理财带来超额收益的打新、配资优先级等低风险高收益类固定收益资产大幅萎缩，大量资金回流至货币和债券市场，全年收益率大幅下行，长端利率债下行近 100BP，短券收益率降幅近 200BP。

因预期收益率将趋势性下行，在受人民币贬值预期及季末等短期因素影响而导致资金面略有收紧，短券收益率上行时，我们在合同允许范围内拉长久期、提升杠杆，并取得了一定超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 12 月 31 日，基金 A 类份额本报告期份额净值收益率为 3.6405%，同期业绩比较基准收益率为 2.1164%；B 类份额本报告期份额净值收益率为 3.8903%，同期业绩比较基准收益率为 2.1164%。

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 2016 年，国内经济仍在促改革、调结构过程中，传统经济去产能去杠杆，新经济增长尚在培育中，预计整体固定资产投资增速将持续低位；在经济下行过程中，居民消费现隐忧。国际上，全球经济分化，美国独树一帜，美联储在去年 12 月底首次启动加息，在强美元和供过于求的双重打击下，大宗商品价格维持低位，新兴经济体货币贬值压力仍大，经济遭遇较大冲击。基本面仍支撑债市走势。

在股市震荡、全球金融市场波动加剧的背景下，市场风险偏好急剧下降，大量资金堆积在债券市场短端品种，同时在经济下行、传统行业去产能、供给侧改革、信用债大量到期的大背景下，信用债违约风险明显加大将是 2016 年信用债券投资中将面临的风险点，低评级债券的信用利差将向上重估。新出台的《货币市场基金监督管理办法》对货币基金的流动性资产占比、投资比例、债券

资质和久期等的要求比以往提升，短久期高评级的信用债将继续受到资金追捧。我们将细化信用分析逻辑，精选个券，根据投资者结构变化，结合市场形势，适时调整现券比例和久期，竭力为持有人服务。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则》、2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》（证监会计字[2007]15 号）与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》（证监会公告[2008]38 号等相关规定和基金合同的约定，日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

为确保公司估值程序的正常进行，本公司还成立了资产估值委员会。资产估值委员会由公司总经理、分管总经理助理、权益投资部总监、固定收益部总监、研究发展部总监、基金事务部总监、基金经理、投资经理、基金会计和相关人员组成。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。

本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

报告期内,本基金未签约与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规及《金鹰货币市场基金基金合同》，本基金每日将各级基金份额实现的基金净收益全额分配给基金份额持有人。

4.8 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

本报告期，会计师事务所未对本基金出具非标准审计报告。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内无应当说明的预警事项。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、

基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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。

报告期内，金鹰货币市场证券投资基金 A 实施利润分配的金额为 5,062,541.16 元。

报告期内，金鹰货币市场证券投资基金 B 实施利润分配的金额为 42,555,132.43 元。

5.3 托管人对本年度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 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）审计，出具了众环审字（2016）050133 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：金鹰货币市场证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：	-	-
银行存款	255,310,744.21	181,749,992.94
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	2,314,300,594.13	619,443,919.67

其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	2,314,300,594.13	619,443,919.67
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	411,100,418.02	294,751,002.13
应收证券清算款	61,010,756.50	-
应收利息	33,281,162.88	10,265,247.09
应收股利	-	-
应收申购款	-	9,667.50
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,075,003,675.74	1,106,219,829.33
负债和所有者权益	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
负债：	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	224,999,407.50	129,599,485.60
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	4,926.81	-
应付管理人报酬	704,182.95	239,294.59
应付托管费	213,388.73	72,513.52
应付销售服务费	45,438.43	67,827.19
应付交易费用	64,275.40	31,631.31
应交税费	-	-
应付利息	14,113.89	29,900.90
应付利润	371,770.12	95,067.79

递延所得税负债	-	-
其他负债	672,073.19	460,500.00
负债合计	227,089,577.02	130,596,220.90
所有者权益：	-	-
实收基金	2,847,914,098.72	975,623,608.43
未分配利润	-	-
所有者权益合计	2,847,914,098.72	975,623,608.43
负债和所有者权益总计	3,075,003,675.74	1,106,219,829.33

注：截至报告期末 2015 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.00 元，基金份额总额为 2,847,914,098.72 份。

7.2 利润表

会计主体：金鹰货币市场证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入	57,768,873.36	45,789,484.95
1.利息收入	44,400,136.71	40,197,529.71
其中：存款利息收入	10,106,788.10	19,462,347.54
债券利息收入	30,693,962.85	15,947,710.45
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	3,599,385.76	4,787,471.72
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	13,368,736.65	5,591,955.24
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	13,368,736.65	5,591,955.24
资产支持证券投资收益	-	-

衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-	-
减：二、费用	10,151,199.77	7,141,249.01
1. 管理人报酬	4,617,453.11	2,623,620.95
2. 托管费	1,399,228.23	795,036.62
3. 销售服务费	481,314.23	726,595.41
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	3,205,532.31	2,553,654.63
其中：卖出回购金融资产支出	3,205,532.31	2,553,654.63
6. 其他费用	447,671.89	442,341.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	47,617,673.59	38,648,235.94
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	47,617,673.59	38,648,235.94

注：本基金合同于 2012 年 12 月 07 日生效，截至本报告期末成立已满三年。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金鹰货币市场证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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）	975,623,608.43	-	975,623,608.43
二、本期经营活动产生的基	-	47,617,673.59	47,617,673.59

金净值变动数（本期利润）			
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）	1,872,290,490.29	-	1,872,290,490.29
其中：1.基金申购款	9,196,070,766.51	-	9,196,070,766.51
2.基金赎回款	-7,323,780,276.22	-	-7,323,780,276.22
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）	-	-47,617,673.59	-47,617,673.59
五、期末所有者权益（基金净值）	2,847,914,098.72	-	2,847,914,098.72
项目	上年度可比期间		
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 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）	1,654,282,230.95	-	1,654,282,230.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	38,648,235.94	38,648,235.94
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）	-678,658,622.52	-	-678,658,622.52
其中：1.基金申购款	5,494,134,147.75	-	5,494,134,147.75
2.基金赎回款	-6,172,792,770.27	-	-6,172,792,770.27
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）	-	-38,648,235.94	-38,648,235.94
五、期末所有者权益（基金净值）	975,623,608.43	-	975,623,608.43

注：本基金合同于 2012 年 12 月 07 日生效，截至报告期末已满三年。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘岩，主管会计工作负责人：曾长兴，会计机构负责人：谢文君

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

金鹰货币市场基金（简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（简称“中国证监会”）证监基金字[2012]1105 号文《关于金鹰货币市场证券投资基金备案确认的函》批准，于 2012 年 12 月 7 日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次募集规模为 2,925,528,953.04 份基金份额。本基金募集期间自 2012 年 11 月 19 日起至 2012 年 12 月 3 日止，净认购额 2,925,440,807.27 元，认购资金在认购期间的银行利息 88,145.77 元折算成基金资产。上述资金已于 2012 年 12 月 5 日全额划入本基金在基金托管人中国建设银行股份有限公司开立的本基金托管专户。验资机构为立信羊城会计师事务所（特殊普通合伙）。基金管理人为金鹰基金管理有限公司，基金注册登记机构为金鹰基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司（简称“建设银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《金鹰货币市场证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资于法律法规允许投资的金融工具，具体范围如下：现金；通知存款；短期融资券；一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、资产支持证券和中期票据；期限在一年以内（含一年）的债券回购；期限在一年以内（含一年）的中央银行票据以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金 2015 年度财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布并于 2014 年 7 月修改的《企业会计准则—基本准则》和 41 项具体会计准则及其应用指南、解释及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”），中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》和中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则和《证券投资基金会计核算业务指引》的要求，真实、完整地反映了本基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.4 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

本报告期所采用的会计政策不变，会计估计与最近一期年度报告相比有调整。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期内改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无会计差错更正。

7.4.6 税项

(1) 印花税

根据财政部、国家税务总局财税字【2007】84 号文《关于调整证券（股票）交易印花税率的通知》的规定，自 2007 年 5 月 30 日起，调整证券（股票）交易印花税率，由原先的 1‰调整为 3‰；

根据财政部、国家税务总局财税字【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》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税；

经国务院批准，根据财政部、国家税务总局《关于调整证券（股票）交易印花税率的通知》的规定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，证券（股票）交易印花税调整为单边征税，由出让方按证券（股票）交易印花税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

(2) 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字【2004】78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》，自

2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（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、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字【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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

（3）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字【2002】128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字【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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字【2012】85 号文《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》，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、证监会财税字[2015]101 号文《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》，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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；上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。（上市公司派发股息红利，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日之后的，股息红利所得按照本通知的规定执行。）

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
广州证券股份有限公司	基金管理人股东、基金代销机构
广州白云山医药集团股份有限公司	基金管理人股东
美的集团股份有限公司	基金管理人股东

东亚联丰投资管理有限公司	基金管理人股东
金鹰基金管理有限公司	基金发起人、管理人、销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
深圳前海金鹰资产管理有限公司	基金管理人子公司

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31 日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,617,453.11	2,623,620.95
其中：支付销售机构的客户维护费	382,287.08	799,874.80

注：1、在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.33% 年费率计提。计算方法如下：

每日应计提的基金管理费=前一日的基金资产净值×0.33%/当年天数

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,399,228.23	795,036.62

注：1、基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10%年费率计提。计算方法如下：

每日应计提的基金托管费=前一日的基金资产净值×0.10%/当年天数

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，

若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延；

7.4.8.2.3 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		
	2015年1月1日至2015年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	金鹰货币 A	金鹰货币 B	合计
金鹰基金管理有限公司	20,675.58	93,241.99	113,917.57
中国建设银行	205,428.73	12,135.64	217,564.37
广州证券股份有限公司	418.29	0.00	418.29
合计	226,522.60	105,377.63	331,900.23
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2014年1月1日至2014年12月31日		

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	金鹰货币A	金鹰货币B	合计
金鹰基金管理有限公司	19,972.03	21,131.64	41,103.67
中国建设银行	418,641.25	18,316.71	436,957.96
广州证券股份有限公司	676.01	0.00	676.01
合计	439,289.29	39,448.35	478,737.64

注：1、本基金 A 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%，对于由 B 类降级为 A 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用 A 类基金份额的费率。B 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%，对于由 A 类升级为 B 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其升级后的下一个工作日起享受 B 类基金份额的费率。两类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同，具体如下：

每日应计提的各级基金销售服务费 = 前一日该级基金份额的基金资产净值 × R ÷ 当年天数

R 为该级基金份额的年销售服务费率

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给注册登记机构，由注册登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付；

7.4.8.3 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各关联方进行银行间市场交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末其他关联方未投资本基金。

7.4.8.5 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	上年度可比期间
-------	----	---------

	2015年1月1日至2015年12月31日		2014年1月1日至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	2,310,744.21	24,339.89	1,749,992.94	33,761.58

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.9 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 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 224,999,407.50 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
090205	09 国开 05	2016-01-04	100.37	300,000.00	30,111,000.00
011551002	15 中船 SCP002	2016-01-04	100.31	700,000.00	70,217,000.00
071550001	15 华龙证券 CP001	2016-01-04	100.11	600,000.00	60,066,000.00
011599479	15 国药控股 SCP003	2016-01-04	100.32	650,000.00	65,208,000.00
合计				-	-

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产余额为 0，无抵押债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**金融工具公允价值计量的方法**

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会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股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的不含权固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2015 年 3 月 25 日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

§8 投资组合报告**8.1 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	2,314,300,594.13	75.26
	其中：债券	2,314,300,594.13	75.26
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	411,100,418.02	13.37
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	81,599,283.77	2.65
3	银行存款和结算备付金合计	255,310,744.21	8.30
4	其他各项资产	94,291,919.38	3.07

5	合计	3,075,003,675.74	100.00
---	----	------------------	--------

8.2 债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	10.09	
	其中：买断式回购融资	0.01	
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	224,999,407.50	7.90
	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

本报告期内本货币市场基金没有出现债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的情况。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	88
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	118
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	32

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内投资组合平均剩余期限无超过 120 天的情况。

8.3.2 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	21.92	7.90
	其中：剩余存续期超过 397 天的	-	-

	浮动利率债		
2	30 天（含）—60 天	8.07	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	22.88	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—180 天	51.12	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
5	180 天（含）—397 天（含）	2.81	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
合计		106.81	7.90

8.4 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	168,154,633.03	5.90
	其中：政策性金融债	168,154,633.03	5.90
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,909,588,861.07	67.05
6	中期票据	-	-
7	同业存单	236,557,100.03	8.31
8	其他	-	-
9	合计	2,314,300,594.13	81.26

10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-
----	----------------------	---	---

8.5 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	011599362	15 南方水泥 SCP005	1,500,000.00	150,491,055.63	5.28
2	011599315	15 龙源 SCP005	1,000,000.00	100,242,117.13	3.52
3	011520003	15 中铝 SCP003	1,000,000.00	100,232,374.59	3.52
4	011573006	15 鲁高速 SCP006	1,000,000.00	100,148,071.70	3.52
5	011551002	15 中船 SCP002	1,000,000.00	100,004,975.32	3.51
6	011599479	15 国药控股 SCP003	800,000.00	80,020,703.44	2.81
7	110221	11 国开 21	780,000.00	78,041,428.23	2.74
8	011599536	15 同方 SCP003	750,000.00	75,154,330.55	2.64
9	011537008	15 中建材 SCP008	700,000.00	70,253,278.21	2.47
10	041559001	15 宏图 CP001	600,000.00	60,084,038.58	2.11

8.6 “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	28
报告期内偏离度的最高值	0.3955%
报告期内偏离度的最低值	-0.0068%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1655%

8.7 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。

8.8 投资组合报告附注

8.8.1 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。

8.8.2 本基金本报告期内不存在剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券摊余成本超过当日基金资产净值 20% 的情况。

8.8.3 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现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。

8.8.4 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	61,010,756.50
3	应收利息	33,281,162.88
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	94,291,919.38

8.8.5 其他需说明的重要事项标题

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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
金鹰货币 A	3,228	30,014.60	9,901,866.20	10.22%	86,985,278.63	89.78%
金鹰货币 B	33	83,364,453.15	2,705,084,803.76	98.33%	45,942,150.13	1.67%
合计	3,261	873,325.39	2,714,986,669.96	95.33%	132,927,428.76	4.67%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	金鹰货币 A	122,308.73	0.13%
	金鹰货币 B	0.00	0.00%
	合计	122,308.73	0.00%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	金鹰货币 A	0
	金鹰货币 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	金鹰货币 A	0
	金鹰货币 B	0
	合计	0

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金非发起式基金。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	金鹰货币 A	金鹰货币 B
----	--------	--------

基金合同生效日（2012 年 12 月 7 日）		
基金份额总额	639,455,794.04	2,286,073,159.00
本报告期期初基金份额总额	261,316,943.49	714,306,664.94
本报告期基金总申购份额	771,484,324.32	8,424,586,442.19
减：本报告期基金总赎回份额	935,914,122.98	6,387,866,153.24
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	96,887,144.83	2,751,026,953.89

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 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

报告期内，本基金管理人的董事长由刘东先生变更为凌富华先生，相关事项已于 2015 年 1 月 10 日进行了信息披露。

报告期内，本基金托管人 2015 年 1 月 4 日发布任免通知，聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。本基金托管人 2015 年 9 月 18 日发布任免通知，解聘纪伟中国建设银行投资托管业务部副总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金审计的会计师事务所为中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）。

本报告期内实际应支付会计师事务所的审计费为 53000 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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

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

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内未发生偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

§12 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期，本基金原审计机构中审亚太会计师事务所（特殊普通合伙）广东分所已与众环海华会计师事务所（特殊普通合伙）合并为中审众环会计师事务所（特殊普通合伙），经公司第五届董事会第 20 次会议决议通过，旗下相关基金的审计机构由“中审亚太会计师事务所（特殊普通合伙）”相应变更为中审众环会计师事务所（特殊普通合伙），此项变更已于 2015 年 12 月 31 日在指定媒体公告，并按规定向证监会备案。

金鹰基金管理有限公司

二〇一六年三月三十日