金鹰货币市场证券投资基金

2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇二一年八月二十八日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 27 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 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
§4 管理人报告 9
4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 13
§5 托管人报告 13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 13
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 14
6.1 资产负债表 14
6.2 利润表 15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 16
6.4 报表附注 17
§7 投资组合报告 37
7.1 期末基金资产组合情况 37
7.2 债券回购融资情况 37
7.3 基金投资组合平均剩余期限 38
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 38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 38
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 39
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 39
报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明 40
报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明 40
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 40
7.9 投资组合报告附注 40

§8 基金份额持有人信息 42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 42
8.2 期末上市基金前十名持有人 42
8.3 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 43
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 43
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 43
8.6 发起式基金发起资金持有份额情况 43
§9 开放式基金份额变动 43
§10 重大事件揭示 44
10.1 基金份额持有人大会决议 44
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 44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 44
10.4 基金投资策略的改变 44
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 45
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 45
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 45
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 45
10.9 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 46
10.10 其他重大事件 46
§11 影响投资者决策的其他重要信息 47
11.1 影响投资者决策的其他重要信息 47
§12 备查文件目录 47
12.1 备查文件目录 47
12.2 存放地点 48
12.3 查阅方式 48

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	金鹰货币市场证券投资基金	
基金简称	金鹰货币	
基金主代码	210012	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012 年 12 月 7 日	
基金管理人	金鹰基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	10,864,573,433.22 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	147,518,615.55 份	10,717,054,817.67 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在力求保持基金资产本金的安全性和资产高流动性的基础上，力争获得超过基金业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	本基金结合“自上而下”和“自下而上”的研究方法对各类可投资资产进行合理的配置和选择。
业绩比较基准	税后一年期定期存款利率（即（一年期定期存款利率×（1-利息税率））。
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		金鹰基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘盛	李申
	联系电话	020-83936180	021-60637102
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		4006135888	021-60637111
传真		020-83282856	021-60635778
注册地址		广东省广州市南沙区滨海路	北京市西城区金融大街25号

	171号11楼自编1101之一J79	
办公地址	广州市天河区珠江东路28号越秀金融大厦30层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	510623	100033
法定代表人	王铁	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.gefund.com.cn
基金中期报告备置地点	广东省广州市天河区珠江新城珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	**报告期（2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日）**	
	金鹰货币 A	金鹰货币 B
本期已实现收益	1,715,516.32	124,662,130.03
本期利润	1,715,516.32	124,662,130.03
本期净值收益率	1.1393%	1.2599%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2021 年 6 月 30 日)**	
	金鹰货币 A	金鹰货币 B
期末基金资产净值	147,518,615.55	10,717,054,817.67
期末基金份额净值	1.00	1.00
3.1.3 累计期末指标	**报告期末(2021 年 6 月 30 日)**	
	金鹰货币 A	金鹰货币 B
累计净值收益率	32.6636%	35.4198%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除

相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

金鹰货币 A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.1808%	0.0012%	0.1233%	0.0000%	0.0575%	0.0012%
过去三个月	0.5420%	0.0013%	0.3740%	0.0000%	0.1680%	0.0013%
过去六个月	1.1393%	0.0013%	0.7438%	0.0000%	0.3955%	0.0013%
过去一年	2.3044%	0.0017%	1.5000%	0.0000%	0.8044%	0.0017%
过去三年	7.7491%	0.0017%	4.5041%	0.0000%	3.2450%	0.0017%
过去五年	15.8740%	0.0025%	7.5041%	0.0000%	8.3699%	0.0025%
成立至今	32.6636%	0.0072%	16.5466%	0.0018%	16.1170%	0.0054%

注：本基金收益分配是按日结转份额。

金鹰货币 B

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.2005%	0.0012%	0.1233%	0.0000%	0.0772%	0.0012%
过去三个月	0.6022%	0.0013%	0.3740%	0.0000%	0.2282%	0.0013%
过去六个月	1.2599%	0.0013%	0.7438%	0.0000%	0.5161%	0.0013%
过去一年	2.5498%	0.0017%	1.5000%	0.0000%	1.0498%	0.0017%
过去三年	8.5285%	0.0017%	4.5041%	0.0000%	4.0244%	0.0017%
过去五年	17.2726%	0.0025%	7.5041%	0.0000%	9.7685%	0.0025%
成立至今	35.4198%	0.0072%	16.5466%	0.0018%	18.8732%	0.0054%

注：本基金收益分配是按日结转份额。

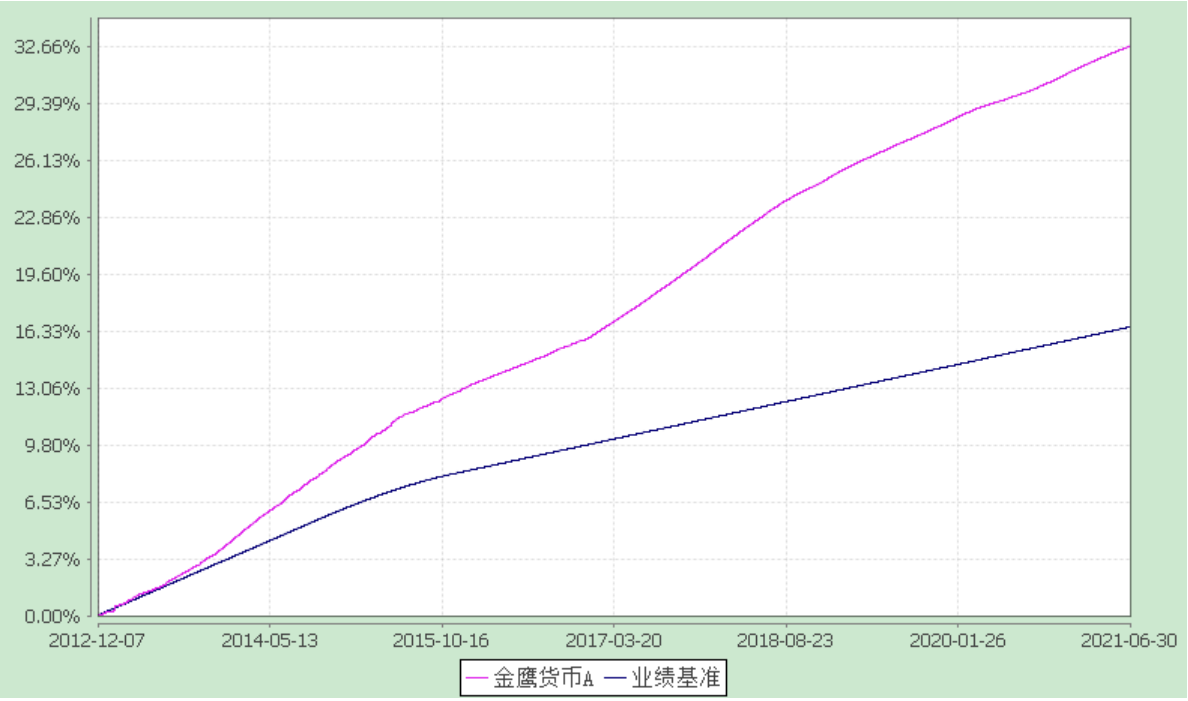
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

金鹰货币市场证券投资基金

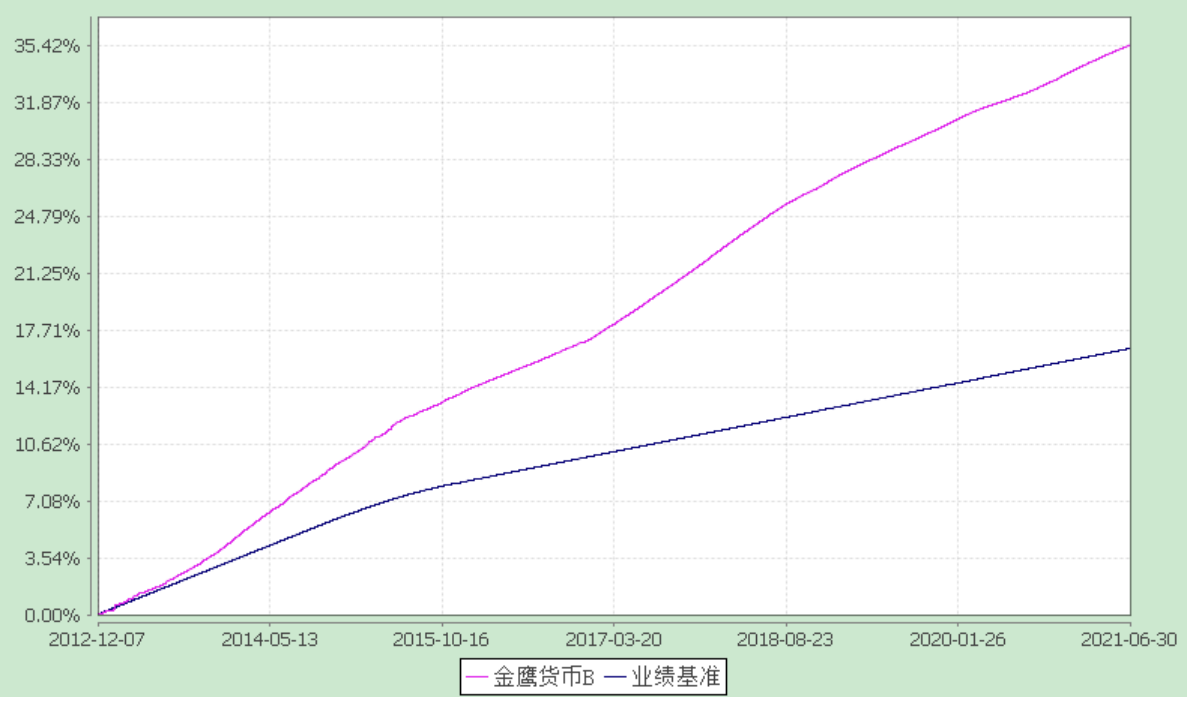
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2012 年 12 月 7 日至 2021 年 6 月 30 日）

金鹰货币 A



金鹰货币 B



注：1、本基金于 2012 年 12 月 7 日成立。

2、本报告期末，本基金各项投资比例符合基金合同约定。

3、本基金业绩比较基准为一年期定期存款利率（税后）。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基字[2002]97 号文批准，金鹰基金管理有限公司于 2002 年 12 月 25 日成立。2011 年 12 月公司获得特定客户资产管理计划业务资格，2013 年 7 月子公司——广州金鹰资产管理有限公司成立。2015 年 12 月，获得受托管理保险资金投资管理人资格。

“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 50 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	2015-07-22	-	14	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	2019-04-26	-	9	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，现任混合投资部基金经理。

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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》和其他有关法律法规及其各项实施准则、《金鹰货币市场证券投资基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无出现重大违法违规或违反基金合同的行为，无损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

报告期，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合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

回顾上半年债券市场行情，债券收益率整体震荡下行。年初市场流动性极其宽松，债券收益率延续去年底的走势继续往下，短端收益率在1月中达到年内低点；随着1月缴税大月对流动性的冲击及央行持续在公开市场回笼资金，1月底资金面极其紧张，各期限债券收益率迅速向上调整至年内高位；春节后，在股市调整、流动性中性偏松、政府债发行速度不及预期、机构欠配压力大等因素叠加下，债券收益率开启缓步下行行情，长端利率债收益率在5月底突破1月中旬时的前低，创上半年新低；随后在政府债供给放量、对季末流动性担忧、机构止盈情绪扰动下，收益率向上反弹；临近季末政府债发行缩量、央行呵护季末市场流动性下，债券收益率再次向下。整个上半年，十年

期和一年期国开债收益率下行均约 4bp，收益率曲线仍较陡峭。

流动性层面，年初市场流动性极其宽松，DR001 加权利率一度低至 0.6%，市场对春节前流动性预期较为乐观，加杠杆情绪再起，但央行迟迟未推出跨春节流动性安排，反而持续在公开市场回笼流动性，叠加 1 月作为传统缴税大月，资金面在 1 月底急剧收紧，机构对流动性乐观预期转为谨慎；在就地过年取现减少及大额财政投放下，虽然央行在 2 月持续回笼流动性，但银行间市场资金面在春节前后仍较平稳；3 月以来至 6 月 24 日以前，央行每日在公开市场开展 100 亿 7 天逆回购操作，6 月 24 日及季末前几个工作日每日开展 300 亿 7 天逆回购操作维护半年末流动性平稳；1 月和 4 月 MLF 操作在对冲到期 MLF 和 TMLF 后小幅净回笼，其余时间均为等额续作，虽然央行在公开市场操作力度不大，但资金面在缴税、月末等关键时点仍波动不大，且 4 月、5 月 R007 利率持续低于 2.2% 的政策利率。市场流动性超预期宽松的原因可能是在政府债发行量不及预期、地产和平台融资受限下，大量资金淤积在银行间市场；同时央行可能有通过再贷款再贴现向市场投放资金。

在银行间流动性极为宽松，一年期国股存单利率大幅低于 MLF 利率，市场收益率处于低位时，我们维持组合较低久期和杠杆；在月末、季末由于流动性小幅收紧，短端利率冲高时，我们加大对同业存款和存单的配置力度；同时严控投资标的信用风险和流动性风险；精选部分收益率相对较高、资质较好的 ABS 和信用债进行配置，在回购利率受缴税、季末等时点冲击小幅冲高时，加大了逆回购配置比例，保持组合流动性的同时锁定收益；根据对市场流动性的判断以及对持有人结构分析，严格遵守流动性新规要求，在保持组合流动性和安全性的前提下，取得了一定超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，基金 A 类份额本报告期份额净值收益率为 1.1393%，同期业绩比较基准收益率为 0.7438%；B 类份额本报告期份额净值收益率为 1.2599%，同期业绩比较基准收益率为 0.7438%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，从基本面来看，经济仍处修复中但动能放缓。具体来看，房地产调控趋严，居民购房热情仍高，地产销售数据仍较好，预计地产投资韧性犹存，但同比增速在基数效应及地产融资受限下缓步回落；前 6 个月的基建投资增速低于整体固定资产投资增速，在财政后置下，预计基建投资将得到支撑；在内外需求修复和工业企业利润增速处于高位下，制造业投资温和向上；出口在欧美疫苗接种率上升、海外经济持续复苏下仍表现较好，但 PMI 新出口订单已连续 3 个月处于收缩区间，下半年出口存下行隐忧；在防疫常态化措施下，消费将持续温和复苏，经济增速下行但仍有韧性。6 月 PPI 小幅下行至 8.8%，预计年内高点已过，CPI 仍较温和，关注 Taper 实施对国内货币政

策的影响。

流动性层面上，上半年政府债发行进度较慢，下半年发行压力仍较大，给资金面带来扰动；下半年 MLF 到期合计 4.15 万亿，到期规模相比上半年大幅增加，央行于 7 月 9 日宣布全面降准 0.5%，预计释放约 1 万亿长期资金，降准释放的资金一部分用于置换到期 MLF，一部分用于弥补 7 月税期高峰的流动性缺口。7 月 MLF 缩量 3000 亿、价格维持不变续作，关注 8 月到期 MLF 央行采取的对冲手段。在目前货币政策稳字当头、保持流动性合理充裕的态度下，预计资金面相比二季度大部分时间低于政策利率的情形小幅收敛，市场利率围绕政策利率运行，总体维持中性。

基于以上判断，我们认为 7 月初的全面降准操作打破了市场对下半年流动性可能较上半年收敛的一致预期，目前一年期国股存单利率已低于 MLF 利率 20bp 以上，假如 MLF 操作利率不调整，短端利率下行空间很小，甚至有上行风险，但上行空间也较为有限；长端来看，在经济复苏放缓、配置需求仍强及紧信用仍在推进下，当前经济基本面不支持收益率大幅上行，但在经济修复期大幅下行阻力也较大，预计呈现窄幅区间震荡行情，如因时点或事件冲击导致收益率较快上行时，或将提供较好的投资机会。我们将在缴税、季末等资金季节性紧张时点加大对高利率同业存单存款、长期限逆回购的配置，适度拉长组合久期和提升杠杆，精选资质较好、性价比较高的优质信用债进行配置，在确保组合良好流动性和安全性的前提下，力争有效控制并防范风险，竭力为持有人服务。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会由基金估值业务分管领导、督察长、基金估值核算负责人、基金会计、合规风控部人员及相关投研人员等组成。在特殊情况下，公司召集估值委员会会议，讨论和决策特殊估值事项，估值委员会集体决策，需到会的三分之二估值委员会成员表决通过。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理、投资经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行，一切以维护基金持有人利益为准则。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场债券品种的估值数据及交易所交易的债券品种的估值数据、流通受限股票流动性折扣。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内无应当说明的预警事项。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本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 1,715,516.32 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 124,662,130.03 元。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：金鹰货币市场证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	553,311,577.65	1,070,409,940.75
结算备付金		-	10,651,592.89
存出保证金		-	5,865.57
交易性金融资产	6.4.7.2	7,542,652,639.16	6,458,369,690.67
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		7,170,309,424.63	6,258,153,238.78
资产支持证券投资		372,343,214.53	200,216,451.89
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	3,134,814,578.07	4,038,313,532.15
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	43,574,385.94	38,218,854.40
应收股利		-	-
应收申购款		6,909,703.48	3,566,798.73
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		11,281,262,884.30	11,619,536,275.16
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2021 年 6 月 30 日**	**上年度末 2020 年 12 月 31 日**
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		204,988,780.00	454,433,099.17
应付证券清算款		206,489,120.92	99,912,123.87
应付赎回款		261,246.54	18,431.76
应付管理人报酬		2,728,671.32	2,408,498.78
应付托管费		826,870.08	729,848.08
应付销售服务费		110,448.65	110,391.11
应付交易费用	6.4.7.7	193,538.40	173,776.62
应交税费		207,471.04	185,373.48
应付利息		19,285.75	34,930.97

应付利润		662,726.52	1,032,800.83
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	201,291.86	284,300.00
负债合计		416,689,451.08	559,323,574.67
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	10,864,573,433.22	11,060,212,700.49
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		10,864,573,433.22	11,060,212,700.49
负债和所有者权益总计		11,281,262,884.30	11,619,536,275.16

注：截至 2021 年 6 月 30 日，本基金份额总额 10,864,573,433.22 份。本基金 A 类基金份额净值 1.0000 元，份额总额为 147,518,615.55 份；本基金 B 类基金份额净值 1.0000 元，份额总额为 10,717,054,817.67 份。

6.2 利润表

会计主体：金鹰货币市场证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		**152,056,706.91**	**129,472,894.20**
1.利息收入		147,964,320.97	126,839,242.55
其中：存款利息收入	6.4.7.11	13,356,182.22	14,284,978.94
债券利息收入		80,843,900.62	72,075,458.31
资产支持证券利息收入		7,407,830.42	1,906,415.27
买入返售金融资产收入		46,356,407.71	38,572,390.03
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,092,385.94	2,633,651.65
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	4,094,751.37	2,243,204.08
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-2,365.43	390,447.57
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	-	-
减：二、费用		**25,679,060.56**	**28,296,879.57**
1．管理人报酬		16,550,488.16	14,604,776.51

2．托管费		5,015,299.44	4,425,689.80
3．销售服务费		681,594.75	627,216.02
4．交易费用	6.4.7.19	-	-
5．利息支出		3,159,632.90	8,482,803.00
其中：卖出回购金融资产支出		3,159,632.90	8,482,803.00
6．税金及附加		121,915.27	11,908.32
7．其他费用	6.4.7.20	150,130.04	144,485.92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**126,377,646.35**	**101,176,014.63**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**126,377,646.35**	**101,176,014.63**

6.3 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	**本期** 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	11,060,212,700.49	-	11,060,212,700.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	126,377,646.35	126,377,646.35
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）	-195,639,267.27	-	-195,639,267.27
其中：1.基金申购款	14,659,890,437.31	-	14,659,890,437.31
2.基金赎回款	-14,855,529,704.58	-	-14,855,529,704.58
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）	-	-126,377,646.35	-126,377,646.35
五、期末所有者权益（基金净值）	10,864,573,433.22	-	10,864,573,433.22
项目	**上年度可比期间** 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）	8,062,324,577.93	-	8,062,324,577.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	101,176,014.63	101,176,014.63
三、本期基金份额交易产生	-237,704,803.59	-	-237,704,803.59

的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	10,544,048,590.68	-	10,544,048,590.68
2.基金赎回款	-10,781,753,394.27	-	-10,781,753,394.27
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）	-	-101,176,014.63	-101,176,014.63
五、期末所有者权益（基金净值）	7,824,619,774.34	-	7,824,619,774.34

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：姚文强，会计机构负责人：董霞

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日起至 2021 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会计报表一致。

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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	3,311,577.65
定期存款	550,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	270,000,000.00
存款期限 3 个月以上	280,000,000.00
其他存款	-
合计	553,311,577.65

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 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	58,956,025.77	58,978,814.00	22,788.23	0.0002
	银行间市场	7,111,353,398.86	7,117,985,000.00	6,631,601.14	0.0610
	合计	7,170,309,424.63	7,176,963,814.00	6,654,389.37	0.0612
资产支持证券		372,343,214.53	372,543,100.00	199,885.47	0.0018
合计		7,542,652,639.16	7,549,506,914.00	6,854,274.84	0.0631

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期内未投资衍生金融资产/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 2021 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	152,000,000.00	-
银行间市场	2,982,814,578.07	-
合计	3,134,814,578.07	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	420.96
应收定期存款利息	3,216,514.15
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	35,196,650.71
应收资产支持证券利息	1,664,127.05
应收买入返售证券利息	3,496,673.07
应收申购款利息	-
其他	-
合计	43,574,385.94

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 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	193,538.40
合计	193,538.40

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	169.00
其他应付款	10,000.00
审计费用	22,315.49
银行间帐户维护费	9,300.00
信息披露费	159,507.37
合计	201,291.86

6.4.7.9 实收基金

金鹰货币 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	194,131,063.42	194,131,063.42
本期申购	401,623,902.88	401,623,902.88
本期赎回（以“-”号填列）	-448,236,350.75	-448,236,350.75
本期末	147,518,615.55	147,518,615.55

金鹰货币 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,866,081,637.07	10,866,081,637.07
本期申购	14,258,266,534.43	14,258,266,534.43
本期赎回（以“-”号填列）	-14,407,293,353.83	-14,407,293,353.83
本期末	10,717,054,817.67	10,717,054,817.67

注：表内各级基金的申购份额包含因份额升降级导致的强制调增份额,赎回份额包含因份额升降级导致的强制调减份额。

6.4.7.10 未分配利润

金鹰货币 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	-	-	-
本期利润	1,715,516.32	-	1,715,516.32
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	-1,715,516.32	-	-1,715,516.32
本期末	-	-	-

金鹰货币 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	-	-	-
本期利润	124,662,130.03	-	124,662,130.03
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	-124,662,130.03	-	-124,662,130.03
本期末	-	-	-

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

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,962.44
定期存款利息收入	12,974,279.04
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	378,907.43
其他	33.31
合计	13,356,182.22

6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

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 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	8,695,504,309.24
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	8,628,236,996.37
减：应收利息总额	63,172,561.50
买卖债券差价收入	4,094,751.37

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	377,268,855.00
减：卖出资产支持证券成本总额	367,522,765.43
减：应收利息总额	9,748,455.00
资产支持证券投资收益	-2,365.43

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

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.19 交易费用

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。

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 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	22,315.49

信息披露费	59,507.37
汇划手续费	50,847.18
帐户维护费	17,460.00
合计	150,130.04

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需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、销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
广州金鹰资产管理有限公司	基金管理人子公司

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未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

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 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	16,550,488.16	14,604,776.51
其中：支付销售机构的客户维护费	585,097.34	156,343.11

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,015,299.44	4,425,689.80

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。

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 2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	金鹰货币 A	金鹰货币 B	合计
中国建设银行股份有限公司	37,664.68	234.08	37,898.76
金鹰基金管理有限公司	26,851.14	437,733.88	464,585.02
合计	64,515.82	437,967.96	502,483.78

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	金鹰货币A	金鹰货币B	合计
中国建设银行股份有限公司	29,088.04	19.18	29,107.22
金鹰基金管理有限公司	31,780.24	430,750.92	462,531.16
合计	60,868.28	430,770.10	491,638.38

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。

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

份额单位：份

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	金鹰货币A	金鹰货币B	金鹰货币A	金鹰货币B
基金合同生效日（2012年12月7日）持有的基金份额	0.00	0.00	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00	42,540,391.69	0.00	132,678,575.30
报告期间申购/买入总份额	0.00	30,186,544.59	0.00	1,091,097.93
报告期间因拆分变	0.00	0.00	0.00	0.00

动份额				
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	59,780,000.00	0.00	70,000,000.00
报告期末持有的基金份额	0.00	12,946,936.28	0.00	63,769,673.23
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.12%	0.00%	0.83%

注：报告期申购总份额中包含了当期因分红收益变动增加的份额。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

金鹰货币 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020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
广州金鹰资产管理有限公司	0.00	0.00%	133,371.99	0.07%

金鹰货币 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020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
广州金鹰资产管理有限公司	82,537,937.95	0.77%	0.00	0.00%

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	3,311,577.65	2,962.44	2,077,296.77	35,193.99

注：1、本基金清算备付金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算公司等结算账户；

2、2021 年 6 月 30 日清算备付金期末余额 0.00 元，清算备付金利息收入 378,907.43 元；2020 年 6 月 30 日清算备付金期末余额 1,742,138.63 元，清算备付金利息收入 2,659,453.68 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无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.10.7.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

本基金本报告期内及上年度可比期间未投资基金。

6.4.11 利润分配情况

金鹰货币 A

单位：人民币元

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
1,724,266.97	-	-8,750.65	1,715,516.32	-

金鹰货币 B

单位：人民币元

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
125,023,453.69	-	-361,323.66	124,662,130.03	-

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

6.4.12 期末（2021 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：资产支持证券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
189444	永安3A1	2021-06-04	2021-07-15	网下新券认购	100.00	100.00	120,000.00	12,000,000.00	12,000,000.00	-
189531	和熙5A1	2021-06-21	2021-07-05	网下新券认购	100.00	100.00	300,000.00	30,000,000.00	30,000,000.00	-
136193	晨煜2A1	2021-06-29	2021-07-23	网下新券认购	100.00	100.00	300,000.00	30,000,000.00	30,000,000.00	-

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，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 199,999,780.00 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
180313	18 进出 13	2021-07-01	100.27	2,062,000.00	206,760,261.26
合计				2,062,000.00	206,760,261.26

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，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证券款余额为 4,989,000.00 元，于 2021 年 7 月 7 日到期。该类交易要求本基金在回购期内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余额。

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的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	140,004,262.28	289,949,459.85
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	2,460,248,732.64	2,086,495,479.00
合计	2,600,252,994.92	2,376,444,938.85

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 2021年6月30日	上年度末 2020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 2021年6月30日	上年度末 2020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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	180,614,815.93	261,449,782.96
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	180,614,815.93	261,449,782.96

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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	372,343,214.53	200,216,451.89
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	372,343,214.53	200,216,451.89

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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	3,561,742,028.24	2,821,541,266.65
AAA 以下	277,487,189.98	128,249,527.51
未评级	0.00	0.00
合计	3,839,229,218.22	2,949,790,794.16

注：以上数据按照最新发行人评级填列。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自于投资品种流动性不足，导致金融资产不能在合理价格变现。本基金采用分散投资、监控流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时基金管理人通过分析持有人结构、申购赎回行为分析、变现比例、压力测试等方法评估组合的流动性风险。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	103,311,577.65	-	-	-	-	450,000,000.00	-	-	-	553,311,577.65

结算备付金	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	778,196,977.36	-	-	-	-	6,764,455,661.80	-	-	-	7,542,652,639.16
买入返售金融资产	3,134,814,578.07	-	-	-	-	-	-	-	-	3,134,814,578.07
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	43,574,385.94	43,574,385.94
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	6,909,703.48	6,909,703.48
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	4,016,323,133.08	-	-	-	-	7,214,455,661.80	-	-	50,484,089.42	11,281,262,884.30
负债										
短期借款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	204,988,780.00	-	-	-	-	-	-	-	-	204,988,780.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	206,489,120.92	206,489,120.92
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	261,246.54	261,246.54
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	2,728,671.32	2,728,671.32
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	826,870.08	826,870.08
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-	-	110,448.65	110,448.65
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	193,538.40	193,538.40
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	-	207,471.04	207,471.04
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-	19,285.75	19,285.75
应付利润	-	-	-	-	-	-	-	-	662,726.52	662,726.52

其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	201,291.86	201,291.86
负债总计	204,988,780.00	-	-	-	-	-	-	-	211,700,671.08	416,689,451.08
利率敏感度缺口	3,811,334,353.08	-	-	-	-	7,214,455,661.80	-	-	-161,216,581.66	10,864,573,433.22
上年度末 2020 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	409,940.75	-	-	-	-	1,070,000,000.00	-	-	-	1,070,409,940.75
结算备付金	10,651,592.89	-	-	-	-	-	-	-	-	10,651,592.89
存出保证金	5,865.57	-	-	-	-	-	-	-	-	5,865.57
交易性金融资产	299,620,609.78	-	-	-	-	6,158,749,080.89	-	-	-	6,458,369,690.67
买入返售金融资产	4,038,313,532.15	-	-	-	-	-	-	-	-	4,038,313,532.15
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	38,218,854.40	38,218,854.40
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	3,566,798.73	3,566,798.73
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	4,349,001,541.14	-	-	-	-	7,228,749,080.89	-	-	41,785,653.13	11,619,536,275.16
负债										
短期借款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	454,433,099.17	-	-	-	-	-	-	-	-	454,433,099.17

应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	99,912,123.87	99,912,123.87
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	18,431.76	18,431.76
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	2,408,498.78	2,408,498.78
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	729,848.08	729,848.08
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-	-	110,391.11	110,391.11
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	173,776.62	173,776.62
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	-	185,373.48	185,373.48
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-	34,930.97	34,930.97
应付利润	-	-	-	-	-	-	-	-	1,032,800.83	1,032,800.83
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	284,300.00	284,300.00
负债总计	454,433,099.17	-	-	-	-	-	-	-	104,890,475.50	559,323,574.67
利率敏感度缺口	3,894,568,441.97	-	-	-	-	7,228,749,080.89	-	-	-63,104,822.37	11,060,212,700.49

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的摊余成本，并按照金融资产及金融负债的剩余到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	利率上升 25 个基点	-5,920,185.32	-4,436,176.84
	利率下降 25 个基点	5,947,721.71	4,455,698.04

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外

的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于具有良好流动性的货币市场工具，不投资股票、权证等其他交易性金融资产，于本期末和上一年度末，无重大其他市场价格风险。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2021 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 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 2021 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 7,542,652,639.16 元。无属于第一层级和第三层级的金额。

(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	7,542,652,639.16	66.86
	其中：债券	7,170,309,424.63	63.56
	资产支持证券	372,343,214.53	3.30
2	买入返售金融资产	3,134,814,578.07	27.79
	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	553,311,577.65	4.90
4	其他各项资产	50,484,089.42	0.45
5	合计	11,281,262,884.30	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	3.63	
	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	204,988,780.00	1.89
	其中：买断式回购融资	-	-

注：上表中报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

本基金本报告期债券正回购的资金余额均未超过基金资产净值的 20%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	87
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	87
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	44

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内无投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30 天以内	31.61	3.79
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	16.40	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	25.36	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	2.30	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	27.71	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		103.37	3.79

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内不存在投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	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	720,811,931.64	6.63
	其中：政策性金融债	550,212,395.56	5.06
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	2,600,252,994.92	23.93
6	中期票据	10,015,279.85	0.09
7	同业存单	3,839,229,218.22	35.34
8	其他	-	-
9	合计	7,170,309,424.63	66.00
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	112009528	20 浦发银行 CD528	3,000,000.00	295,686,899.91	2.72
2	180313	18 进出 13	2,900,000.00	290,787,952.30	2.68
3	012101590	21 合建投 SCP002	2,000,000.00	200,048,599.32	1.84
4	012101675	21 湘高速 SCP003	2,000,000.00	199,916,934.93	1.84
5	012100977	21 万华化学 SCP002	2,000,000.00	199,875,023.08	1.84
6	112085172	20 重庆农村商行 CD176	2,000,000.00	199,420,210.20	1.84
7	112015522	20 民生银行 CD522	2,000,000.00	199,360,085.58	1.83
8	112111089	21 平安银行 CD089	2,000,000.00	196,136,729.87	1.81
9	112104014	21 中国银行 CD014	2,000,000.00	196,028,755.20	1.80
10	012100499	21 首开 SCP002	1,600,000.00	160,238,651.68	1.47

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	0.1016%
报告期内偏离度的最低值	0.0003%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0728%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内不存在负偏离度的绝对值达到 0.25%情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到 0.5%情况。

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	169881	光耀 03A	400,000.00	40,100,559.06	0.37
2	189531	和熙 5A1	300,000.00	30,000,000.00	0.28
3	136193	晨煜 2A1	300,000.00	30,000,000.00	0.28
4	189351	浩诚 12A1	220,000.00	22,000,000.00	0.20
5	179649	广益 4A1	300,000.00	15,832,992.14	0.15
6	179022	广益 1A1	300,000.00	15,546,000.00	0.14
7	137909	惠安 18A1	200,000.00	15,428,000.00	0.14
8	189306	和熙 3A1	150,000.00	15,000,000.00	0.14
9	179643	浩诚 3A1	300,000.00	14,670,000.00	0.14
10	179918	和熙 1A1	180,000.00	13,953,600.00	0.13

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上海浦东发展银行股份有限公司因未按规定开展代销业务，于 2021 年 4 月 30 日被中国银行保险监督管理委员会上海监管局公开处罚，责令改正、并处罚款 760 万元；因未按专营部门制规定开展同业业务等未依法履行其他职责等行为，于 2020 年 8 月 11 日被中国保险监督管理委员会上海保监局公开处罚，责令改正、并处罚款共计 2100 万元。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

本基金投资的前十名证券的发行主体之一的重庆农村商业银行股份有限公司因未严格监控贷款资金流向致部分贷款被土储机构使用等未依法履行其他职责行为，于 2020 年 9 月 10 日被中国银行业监督管理委员会重庆监管局公开处罚，罚款人民币 180 万元；因通过信托计划回购实现不良资产虚假转让出表等未依法履行其他职责等行为，于 2020 年 8 月 11 日被中国保险监督管理委员会重庆保监局公开处罚，罚款人民币 90 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民生银行股份有限公司因违规为房地产企业缴纳土地出让金提供融资，未依法履行其他职责等行为，于 2020 年 9 月 4 日被中国银行保险监督管理委员会公开处罚，没收违法所得 296.47 万元、罚款 10486.47 万元，罚没合计 10782.94 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利用来源于本行授信的固定资产贷款和黄金租赁融资的资金发放委托贷款等未依法履行其他职责行为，于 2021 年 6 月 8 日被中国银行保险监督管理委员会云南监管局公开处罚，罚款人民币 210 万元；因贷款资金用途管控不到位等未依法履行其他职责等行为，于 2020 年 10 月 27 日被中国银行保险监督管理委员会宁波监管局公开处罚，罚款人民币 100 万元。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

本基金投资的前十名证券的发行主体之一的中国银行股份有限公司因向未纳入预算的政府购买服务项目发放贷款等未依法履行其他职责行为，于 2021 年 5 月 21 日被中国银行保险监督管理委员会公开处罚，罚没 8761.355 万元；因“原油宝”产品风险事件相关违法违规行为，于 2020 年 12 月 5 日被中国银行保险监督管理委员会公开处罚，罚款 5050 万元。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额

1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	43,574,385.94
4	应收申购款	6,909,703.48
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	50,484,089.42

7.9.4 其他需说明的重要事项

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
金鹰货币 A	81,750	1,804.51	13,615,968.22	9.23%	133,902,647.33	90.77%
金鹰货币 B	88	121,784,713.84	10,702,050,940.93	99.86%	15,003,876.74	0.14%
合计	81,838	132,757.07	10,715,666,909.15	98.63%	148,906,524.07	1.37%

8.2 期末上市基金前十名持有人

本基金非上市基金。

8.3 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	保险类机构	600,000,000.00	5.52%
2	保险类机构	412,621,954.15	3.80%
3	保险类机构	410,739,193.43	3.78%
4	保险类机构	406,039,221.71	3.74%
5	保险类机构	405,080,856.24	3.73%
6	银行类机构	400,796,172.28	3.69%
7	保险类机构	400,175,379.02	3.68%
8	银行类机构	400,000,000.00	3.68%
9	银行类机构	360,406,466.58	3.32%
10	保险类机构	303,298,640.03	2.79%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	金鹰货币 A	3,975,473.63	2.69%
	金鹰货币 B	-	-
	合计	3,975,473.63	0.04%

8.5 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	金鹰货币 A	0~10
	金鹰货币 B	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	金鹰货币 A	10~50
	金鹰货币 B	0
	合计	10~50

8.6 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金非发起式基金。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	金鹰货币 A	金鹰货币 B
基金合同生效日（2012 年 12 月 7 日）基金份额总额	639,455,794.04	2,286,073,159.00
本报告期期初基金份额总额	194,131,063.42	10,866,081,637.07
本报告期基金总申购份额	401,623,902.88	14,258,266,534.43
减：本报告期基金总赎回份额	448,236,350.75	14,407,293,353.83
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	147,518,615.55	10,717,054,817.67

§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，本基金管理人副总经理、督察长、首席信息官等进行了调整。2021 年 2 月 8 日，徐娇娇女士离任督察长，由公司总经理姚文强先生代行督察长职务；2021 年 5 月 11 日，周蔚女士担任公司常务副总经理；2021 年 5 月 14 日，耿源先生担任公司副总经理；2021 年 7 月 28 日，刘盛先生担任公司督察长，并离任公司副总经理及首席信息官；2021 年 7 月 28 日，总经理姚文强先生兼任首席信息官，不再代行督察长职务。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及首席信息官，周蔚女士担任公司常务副总经理，耿源先生担任公司副总经理，刘盛先生担任公司督察长职务。

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	
东吴证券	2	-	-	-	-	-

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

本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单位作为本基金的专用交易单位。本基金专用交易单位的选择标准如下：

（1）经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

（2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

（3）具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

本基金专用交易单位的选择程序如下：

（1）本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单位的证券经营机构。

（2）基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单位租用协议。

10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东吴证券	161,983,244.95	100.00%	7,012,419,000.00	100.00%	-	-

10.9 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内未发生偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

10.10 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与信达证券费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2021-01-11
2	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	2021-01-14
3	金鹰货币市场证券投资基金 2020 年四季度报告	证监会规定媒介	2021-01-21
4	金鹰基金管理有限公司金鹰货币市场证券投资基金暂停大额申购（转换转入、定期定额投资）公告	证监会规定媒介	2021-02-05
5	金鹰基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证监会规定媒介	2021-02-08
6	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增玄元保险代理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	2021-03-08
7	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增大有期货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	2021-03-18
8	金鹰基金管理有限公司旗下全部基金年度报告提示性公告	证监会规定媒介	2021-03-30
9	金鹰货币市场证券投资基金 2020 年年度报告	证监会规定媒介	2021-03-30
10	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与天风证券费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2021-04-16

11	金鹰货币市场证券投资基金 2021 年一季度报告	证监会规定媒介	2021-04-21
12	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	2021-04-21
13	金鹰基金管理有限公司金鹰货币市场证券投资基金暂停大额申购（转换转入、定期定额投资）公告	证监会规定媒介	2021-04-27
14	金鹰基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证监会规定媒介	2021-05-11
15	金鹰基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证监会规定媒介	2021-05-14
16	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增中国人寿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	2021-05-19
17	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增意才基金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	2021-06-02
18	金鹰货币 A 基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2021-06-03
19	金鹰货币 B 基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2021-06-03
20	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金产品资料概要提示性公告	证监会规定媒介	2021-06-03
21	金鹰基金管理有限公司关于终止苏州财路基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证监会规定媒介	2021-06-07
22	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增北京广源达信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	2021-06-10

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货币市场证券投资基金发行及募集的文件。

2、《金鹰货币市场证券投资基金合同》。

3、《金鹰货币市场证券投资基金托管协议》。

4、金鹰基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程。

5、基金托管人业务资格批件和营业执照。

6、本报告期内在中国证监会指定媒介公开披露的基金份额净值、季度报告、年度报告及其他临时公告。

12.2 存放地点

广东省广州市天河区珠江新城珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

12.3 查阅方式

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

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

金鹰基金管理有限公司

二〇二一年八月二十八日