

金鹰货币市场证券投资基金管理有限公司 2018年度报告摘要

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
报告书出具日期：二〇一九年三月二十六日

§ 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。本基金报告已经本公司二〇一九年三月二十六日公告。基金托管人和基金管理人保证本报告的内容真实、准确和完整，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。
基金管理人过往业绩并不代表未来表现，投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读基金的招募说明书及基金更新。

本年度报告摘要披露的信息是年度报告正文的投资组合情况，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告期自2018年1月1日起至2018年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况
基金名称：金鹰货币
基金代码：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：19,406,301,047.76份

基金合同的存续期间：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：261,819,216.76份

2.2 基金产品说明
投资目标：在力求保持基金资产本金安全和资产高流动性的基础上，力争获得超越基准指数的稳定回报。

投资策略：本基金将根据宏观经济形势、政策环境、资金面、利率水平、流动性、风险收益特征等多方面的综合分析，通过类属资产配置、流动性管理策略、定期申购策略、类属资产配置策略、债券类资产配置策略、流动性管理策略、定期申购策略。

业绩比较基准：招银一年定期定开定期存款（一年定期存款利率×（1-利息税）+利息税）

风险收益特征：本基金为货币市场基金，属于货币型基金，风险收益特征与货币型基金相似。

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

信息披露义务人 联系电话 010-67056006 电子邮箱 cmalip@fund.jcb.com.cn 客户服务电话 4000136888, 020-36301680 传真 020-32328266

2.4 信息披露方式
登载基金半年度报告的管理人互联网网址 <http://www.gefund.com.cn>

基金年度报告备查地点 广州市天河区珠江新城珠江路20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

2010年 2011年 2012年

11,796,223.87 730,467,322.72 10,769,156.80

632,619,196.26 2,676,17451 183,963,389.61

2013年 2014年 2015年

11,796,223.87 39635% 40743%

4,3238% 2,4652% 2,7042%

2016年末 2017年末 2016年末

11,796,223.87 730,467,322.72 10,769,156.80

632,619,196.26 2,676,17451 183,963,389.61

2017年 2018年

11,796,223.87 39635% 40743%

3,9041% 4,0743%

4,3238% 2,4652% 2,7042%

2018年末 2017年末 2016年末

11,796,223.87 730,467,322.72 10,769,156.80

632,619,196.26 2,676,17451 183,963,389.61

注：1. 所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以附列示；
2. 本项所显示收益基于本期利润、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）除相关费用后的余额，货币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. 本基金收益分配以日结转份额。

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

3.2.1.1 货币资产

阶段 份额净值 收益率标准差(%) 份额净值 收益率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④
过去三个月 0.0723% 0.0011% 0.271% 0.0000% 0.0415% 0.0000% 0.0348% 0.0001%
过去六个月 1,693.00% 0.0014% 0.762% 0.0000% 0.0369% 0.0004%
过去一年 3,936.9% 0.0017% 1.500% 0.0000% 0.2435% 0.0007%
过去三年 11,880% 0.0020% 4,504.1% 0.0000% 0.6703% 0.0028%
过去五年 20,601% 0.0006% 9,652.02% 0.0017% 10,600.0% 0.0042%
自基金合同生效起至今 26,093.0% 0.0003% 12,799.0% 0.0019% 12,297.0% 0.0064%

注：1. 本基金收益分配是按日结转份额的。

3.2.2 基金合同生效以来基金累计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对比

3.2.2.1 货币资产

阶段 份额净值 收益率标准差(%) 份额净值 收益率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④
过去三个月 0.0723% 0.0011% 0.271% 0.0000% 0.0415% 0.0000% 0.0348% 0.0001%
过去六个月 1,693.00% 0.0014% 0.762% 0.0000% 0.0369% 0.0004%
过去一年 3,936.9% 0.0017% 1.500% 0.0000% 0.2435% 0.0007%
过去三年 11,880% 0.0020% 4,504.1% 0.0000% 0.6703% 0.0028%
过去五年 20,601% 0.0006% 9,652.02% 0.0017% 10,600.0% 0.0042%
自基金合同生效起至今 26,093.0% 0.0003% 12,799.0% 0.0019% 12,297.0% 0.0064%

注：1. 本基金收益分配是按日结转份额的。

3.2.3 对三年基金的利润分配情况

3.2.3.1 货币资产

报告期内，基金的利润分配情况如下表所示：

金额单位：人民币元

2012年12月7日至2018年12月31日

1. 金额货币A

金额单位：人民币元

2010年 2011年 2012年

11,796,223.87 730,467,322.72 10,769,156.80

632,619,196.26 2,676,17451 183,963,389.61

2013年 2014年 2015年

11,796,223.87 39635% 40743%

4,3238% 2,4652% 2,7042%

2016年末 2017年末 2016年末

11,796,223.87 730,467,322.72 10,769,156.80

632,619,196.26 2,676,17451 183,963,389.61

2017年 2018年

11,796,223.87 39635% 40743%

4,3238% 2,4652% 2,7042%

2018年末 2017年末 2016年末

11,796,223.87 730,467,322.72 10,769,156.80

632,619,196.26 2,676,17451 183,963,389.61

2. 金额货币B

金额单位：人民币元

2010年 2011年 2012年

11,796,223.87 730,467,322.72 10,769,156.80

632,619,196.26 2,676,17451 183,963,389.61

2013年 2014年 2015年

11,796,223.87 39635% 40743%

4,3238% 2,4652% 2,7042%

2016年末 2017年末 2016年末

11,796,223.87 730,467,322.72 10,769,156.80

632,619,196.26 2,676,17451 183,963,389.61

2017年 2018年

11,796,223.87 39635% 40743%

4,3238% 2,4652% 2,7042%

2018年末 2017年末 2016年末

11,796,223.87 730,467,322.72 10,769,156.80

632,619,196.26 2,676,17451 183,963,389.61

2. 金额货币B

金额单位：人民币元

2010年 2011年 2012年

11,796,223.87 730,467,322.72 10,769,156.80

632,619,196.26 2,676,17451 183,963,389.61

2013年 2014年 2015年

11,796,223.87 39635% 40743%

4,3238% 2,4652% 2,7042%

2016年末 2017年末 2016年末

11,796,223.87 730,467,322.72 10,769,156.80

632,619,196.26 2,676,17451 183,963,389.61

2. 金额货币B

金额单位：人民币元

2010年 2011年 2012年

11,796,223.87 730,467,322.72 10,769,156.80

632,619,196.26 2,676,17451 183,963,389.61

2013年 2014年 2015年

11,796,223.87 39635% 40743%

4,3238% 2,4652% 2,7042%

2016年末 2017年末 2016年末

11,796,223.87 730,467,322.72 10,769,156.80

632,619,196.26 2,676,17451 183,963,389.61

2. 金额货币B

金额单位：人民币元

2010年 2011年 2012年

11,796,223.87 730,467,322.72 10,769,156.80

632,619,196.26 2,676,17451 183,963,389.61

2013年 20