

**金鹰信息产业股票型证券投资基金**  
**2018 年第 4 季度报告**  
**2018 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：广州农村商业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年一月二十一日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人广州农村商业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 1 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 金鹰信息产业股票  |
| 基金主代码      | 003853  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2018 年 4 月 18 日   |
| 报告期末基金份额总额 | 44,576,831.36 份   |
| 投资目标       | 本基金主要投资于信息产业证券，在有效控制风险并保持良好流动性的前提下，通过积极主动的资产配置，力争使基金份额持有人获得超额收益与长期资本增值。                 |
| 投资策略       | 本基金将从宏观经济、财政货币政策、经济景气度和货币资金供求等多个维度进行综合分析，主动判断市场时机，在严格控制投资组合风险的前提下，进行积极灵活的资产配置，合理确定基金在股票 |

|                 |  |                 |
|-----------------|--|-----------------|
|                 | 类、债券类、现金类等大类资产上的投资比例，最大限度地提高基金资产的收益。     |                 |
| 业绩比较基准          | 中证 TMT 产业主题指数收益率×80%+中债总财富（总值）指数收益率×20%  |                 |
| 风险收益特征          | 本基金为股票型基金，其风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。 |                 |
| 基金管理人           | 金鹰基金管理有限公司                               |                 |
| 基金托管人           | 广州农村商业银行股份有限公司                           |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 金鹰信息产业股票 A                               | 金鹰信息产业股票 C      |
| 下属分级基金的交易代码     | 003853                                   | 005885          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 18,439,955.56 份                          | 26,136,875.80 份 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标         | 报告期<br>(2018 年 10 月 1 日-2018 年 12 月 31 日) |               |
|----------------|---|---------------|
|                | 金鹰信息产业股票 A                                | 金鹰信息产业股票 C    |
| 1.本期已实现收益      | 244,706.96                                | 348,677.81    |
| 2.本期利润         | 159,329.07                                | 628,107.42    |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0286                                    | 0.0657        |
| 4.期末基金资产净值     | 19,509,730.43                             | 27,820,439.22 |
| 5.期末基金份额净值     | 1.0580                                    | 1.0644        |

注：1、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；

2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

3、期末可供分配利润，指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

4、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。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

#### 1、金鹰信息产业股票 A：

| 阶段    | 净值增长率① | 净值增长率标准差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 | 8.43%  | 1.77%     | -10.36%    | 1.69%         | 18.79% | 0.08% |

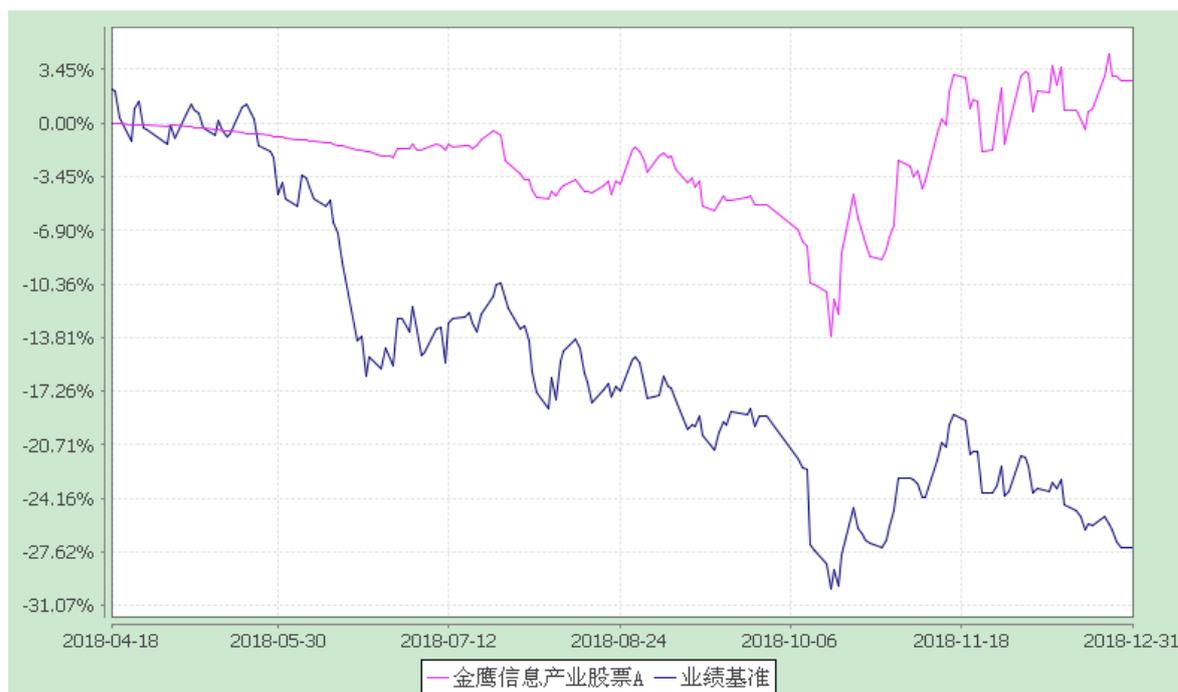
#### 2、金鹰信息产业股票 C：

| 阶段    | 净值增长率① | 净值增长率标准差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 | 8.08%  | 1.77%     | -10.36%    | 1.69%         | 18.44% | 0.08% |

### 3.2.2 自基金转型以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

金鹰信息产业股票型证券投资基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2018 年 4 月 18 日至 2018 年 12 月 31 日)

#### 1. 金鹰信息产业股票 A：

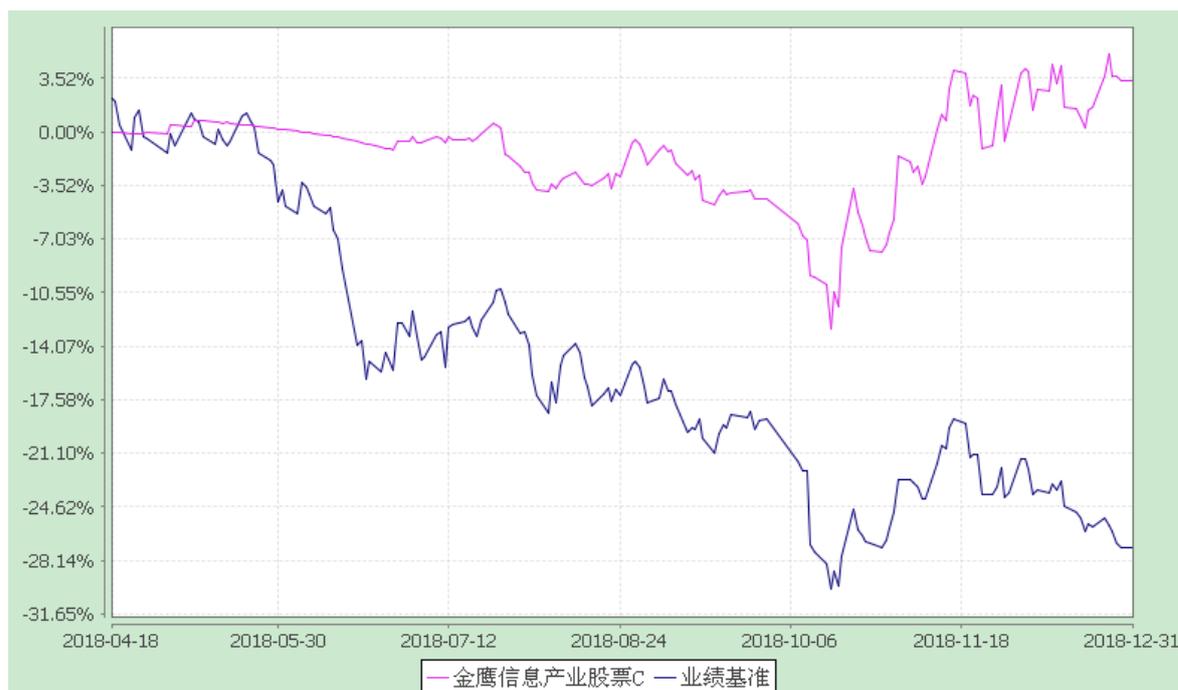


注：1、本基金由原金鹰添惠纯债债券型证券投资基金于 2018 年 4 月 18 日转型而来，截止报告期末，本基金合同生效未满一年；

2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关约定；

3、业绩比较基准：中证 TMT 产业主题指数收益率×80%+中债总财富（总值）指数×20%。

## 2. 金鹰信息产业股票 C:



注：1、本基金由原金鹰添惠纯债债券型证券投资基金于 2018 年 4 月 18 日转型而来，截止报告期末，本基金合同生效未满一年；

2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关约定；

3、业绩比较基准：中证 TMT 产业主题指数收益率×80%+中债总财富（总值）指数×20%。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务   | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|----|------|-------------|------|--------|--|
|    |      | 任职日期        | 离任日期 |        |  |
| 陈立 | 基金经理 | 2018-07-07  | -    | 11     | 陈立先生，复旦大学经济学硕士。曾任银华基金管理有限公司医药行业研究员，2009 年 6 月加盟金鹰基金管理有限公司，先后任行业研究员、非周期组组长、基金经理助理、投资经理。现任金鹰主题优势混合型证券投资基金、金鹰信息 |

|    |      |            |   |   |   |
|----|------|------------|---|---|---|
|    |      |            |   |   | 产业股票型证券投资基金、金鹰医疗健康产业股票型证券投资基金基金经理。                                      |
| 樊勇 | 基金经理 | 2018-10-12 | - | 5 | 樊勇先生，曾任广州证券股份有限公司资产管理部研究员，2015 年 1 月加入金鹰基金管理有限公司，现任金鹰信息产业股票型证券投资基金基金经理。 |

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 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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 公平交易专项说明

##### 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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2018 年第 4 季度，宏观经济增速继续下行。出口虽然有所增长，但很多订单是透支了明年需求，实际情况并不乐观。消费持续低迷，汽车销量出现了负增长，家电、手机等主要消费品都销售情况都不容乐观。企业利润持续下滑，中小企业对未来经济展望都比较悲观，社融需求增速持续下滑。

流动性方面，货币政策维持在较为宽松的基调，但资金并没有明显流向制造业，对经济的影响短期较为有限。

4 季度，市场继续出现了较大的下调，创业板和中小板指下跌了 11.39% 和 18.22%。TMT 主要指数也出现了较大下跌，通信下跌 5.51%，计算机下跌 14.31%，传媒下跌了 9.85%，电子元器件下跌了 14.88%。

本基金在 4 季度完成了建仓，将仓位提高了到了 80% 以上。重点布局了 5G、计算机等行业龙头。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 12 月 31 日，本基金 A 类份额净值为 1.0580 元，本报告期份额净值增长率为 8.43%，同期业绩比较基准增长率为-10.36%。C 类基金份额净值为 1.0644 元，本报告期份额净值增长率 8.08%，同期业绩比较基准增长率为-10.36%。

#### 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 2019 年 1 季度，国内宏观经济面临高度不确定性。出口方面，中美贸易争虽然有所缓和，但贸易摩擦预计将是长期反复的过程。消费方面，居民杠杆率过高，经济下降降低了工资收入，消费难有大的增长。政府现在实行较为积极的财政政策，但对经济有多大的影响还需要观察。流动性方面，货币政策维持在较为宽松的基调，但对经济的传导还需要一个过程，美国现在也处在加息过程中，政府也很难大幅放宽货币政策。

本基金将继续保持较谨慎的投资政策，重点布局 5G，光伏等成长板块，精选行业龙头进行布局。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金资产净值已发生连续超过 60 个工作日低于 5000 万元的情形，本基金管理人已按法规要求向证监会报送解决方案。

### §5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额(元)         | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|---------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 39,768,162.17 | 68.33        |
|    | 其中：股票             | 39,768,162.17 | 68.33        |
| 2  | 固定收益投资            | -             | -            |
|    | 其中：债券             | -             | -            |
|    | 资产支持证券            | -             | -            |
| 3  | 贵金属投资             | -             | -            |
| 4  | 金融衍生品投资           | -             | -            |
| 5  | 买入返售金融资产          | -             | -            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -             | -            |
| 6  | 银行存款和结算备付金合计      | 15,207,301.75 | 26.13        |
| 7  | 其他各项资产            | 3,221,359.88  | 5.54         |
| 8  | 合计                | 58,196,823.80 | 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、买入返售证券。

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|---------|--------------|
|----|------|---------|--------------|

|   |                  |               |       |
|---|------------------|---------------|-------|
| A | 农、林、牧、渔业         | -             | -     |
| B | 采矿业              | -             | -     |
| C | 制造业              | 22,929,131.01 | 48.45 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -     |
| E | 建筑业              | -             | -     |
| F | 批发和零售业           | -             | -     |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | -             | -     |
| H | 住宿和餐饮业           | -             | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 15,326,447.16 | 32.38 |
| J | 金融业              | -             | -     |
| K | 房地产业             | -             | -     |
| L | 租赁和商务服务业         | -             | -     |
| M | 科学研究和技术服务业       | -             | -     |
| N | 水利、环境和公共设施管理业    | -             | -     |
| O | 居民服务、修理和其他服务业    | -             | -     |
| P | 教育               | -             | -     |
| Q | 卫生和社会工作          | -             | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业        | 1,512,584.00  | 3.20  |
| S | 综合               | -             | -     |
|   | 合计               | 39,768,162.17 | 84.02 |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期内未通过港股通投资股票。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)   | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 600498 | 烽火通信 | 94,646  | 2,694,571.62 | 5.69         |
| 2  | 300124 | 汇川技术 | 128,900 | 2,596,046.00 | 5.48         |
| 3  | 002929 | 润建通信 | 78,900  | 2,576,874.00 | 5.44         |
| 4  | 300017 | 网宿科技 | 274,000 | 2,145,420.00 | 4.53         |
| 5  | 300513 | 恒泰实达 | 89,739  | 2,041,562.25 | 4.31         |
| 6  | 002093 | 国脉科技 | 266,400 | 1,942,056.00 | 4.10         |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 7  | 600845 | 宝信软件 | 91,599  | 1,909,839.15 | 4.04 |
| 8  | 600563 | 法拉电子 | 44,900  | 1,892,086.00 | 4.00 |
| 9  | 002544 | 杰赛科技 | 150,400 | 1,627,328.00 | 3.44 |
| 10 | 002792 | 通宇通讯 | 46,200  | 1,414,644.00 | 2.99 |

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期内未投资债券。

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期内未投资债券。

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期内未投资贵金属。

#### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期内未投资权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资股指期货。

##### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

##### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 报告期内基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

#### 5.11.3 其他各项资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 21,862.72    |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 912.61       |
| 5  | 应收申购款   | 3,198,584.55 |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 3,221,359.88 |

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目           | 金鹰信息产业股票A  | 金鹰信息产业股票C    |
|--------------|------------|--------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 381,994.04 | 2,026,886.85 |

|              |               |               |
|--------------|---------------|---------------|
| 报告期基金总申购份额   | 22,640,361.13 | 29,154,765.61 |
| 减：报告期基金总赎回份额 | 4,582,399.61  | 5,044,776.66  |
| 报告期基金拆分变动份额  | -             | -             |
| 本报告期末基金份额总额  | 18,439,955.56 | 26,136,875.80 |

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| 项目                       | 金鹰信息产业股票A | 金鹰信息产业股票C  |
|--------------------------|-----------|------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额         | -         | 981,546.92 |
| 报告期期间买入/申购总份额            | -         | 0.00       |
| 报告期期间卖出/赎回总份额            | -         | 0.00       |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | -         | 981,546.92 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | -         | 3.76       |

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 |                        |            |      |      | 报告期末持有基金情况 |       |
|-------|----------------|------------------------|------------|------|------|------------|-------|
|       | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额       | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额       | 份额占比  |
| 机构    | 1              | 2018年10月1日至2018年10月25  | 981,546.92 | -    | -    | 981,546.92 | 2.20% |

|    |   |  |            |              |   |              |        |
|----|---|--|------------|--------------|---|--------------|--------|
|    |   | 日  |            |              |   |              |        |
|    | 2 | 2018 年 10 月 1 日至 2018 年 10 月 25 日                                    | 981,546.92 | -            | - | 981,546.92   | 2.20%  |
| 个人 | 1 | 2018 年 10 月 23 日至 2018 年 10 月 25 日、2018 年 11 月 9 日至 2018 年 11 月 19 日 | 0.00       | 5,895,652.12 | - | 5,895,652.12 | 13.23% |

#### 产品特有风险

本基金在报告期内，存在报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情形，可能会存在以下风险：

- 1) 基金净值大幅波动的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，因巨额赎回、份额净值小数保留位数与方式、管理费及托管费等费用计提等原因，可能会导致基金份额净值出现大幅波动；
- 2) 巨额赎回的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能触发本基金巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额；
- 3) 流动性风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致本基金的流动性风险；
- 4) 基金提前终止、转型或与其他基金合并的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，可能导致本基金面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。
- 5) 基金规模过小导致的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。
- 6) 份额占比较高的投资者申购申请被拒绝的风险：当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金总份额的50%时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金总份额50%的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的50%，该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期，经基金管理人董事会审议通过，免去刘岩先生总经理、满黎先生副总经理职务，聘请刘志刚先生担任公司副总经理。自 2018 年 12 月 5 日起，公司董事长李兆廷先生代行总经理职务。上述事项已在证监会指定媒体披露。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准基金发行及募集的文件。
- 2、《金鹰信息产业股票型证券投资基金基金合同》。
- 3、《金鹰信息产业股票型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。

### 9.2 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

### 9.3 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  
二〇一九年一月二十一日