金鹰产业股分灵活配置混合型证券投资基金2019年第1季度报告

2019-04-15

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

报告日期：2019-04-20

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责任。

基金管理人中国光大银行股份有限公司复核了本报告的内容，并保证复核内容的真实性、准确性和完整性。

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载的财务指标、投资组合等数据截至2019年3月31日止的数据真实、准确、公允。

本报告中财务指标的计算方法，未经特别说明，均与基金合同、招募说明书一致。

本报告中财务数据及投资组合数据均为未经审计数据。

本报告中所载数据单位为人民币元，金额单位为元，数量单位为份，投资者在阅读本报告时应注意单位的换算。

本报告中所使用的数据来源于基金管理人。

本报告期内基金管理人的高级管理人员没有发生变动。

基金产品概况

基金简称	金鹰产业股分灵活
基金主代码	001566
交易代码	001566
基金运作方式	契约型开放式
成立日期	2015-08-20
报告期末基金份额总额	604,135,882.92
投资目标	本基金在有效控制投资风险的前提下通过灵活配置产业股票，获取超额收益的长期稳健回报。
投资策略	本基金将根据宏观经济形势、证券市场估值水平、市场流动性等因素，以及国内证券市场上可投资品种的特点，在股票、债券、现金等资产间进行灵活配置。本基金将根据产业发展趋势，重点投资于上市公司股票资产，以期获得较高的资本增值收益。在股票基金资产的配置上，本基金将根据宏观经济形势、证券市场估值水平、市场流动性等因素，以及国内证券市场上可投资品种的特点，通过自上而下的方法进行资产配置。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于较高预期风险和较高预期收益的证券投资基金，其预期风险和收益水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司

主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019-01-02 至 2019-03-31）
本期已实现盈利	22,989,985.98
本期利润	34,502,502.40
加权平均基金份额本期利润	0.0202
期末基金资产净值	292,339,455.39
期末基金份额净值	0.4840

注：1、本期已实现盈利指基金本期利润减去未实现估值增值。

2、本期利润为本期已实现盈利加上未实现估值增值。

3、期末可供出售利润、期末指益平准金及期末分配利润均为负数，以括号填列或以“-”号表示。

4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或赎回基金份额的费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

基金净值表现

本期末至最近一个完整会计年度的净值表现及同期业绩比较基准收益率的比较

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	27.78 %	1.48 %	17.17 %	0.92 %	10.61 %	0.55 %

自基金合同生效日本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

注：1、“过去五年数字”指从成立日期（2015-08-20）至报告期末（2019-03-31）。

2、业绩比较基准收益率=沪深300指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%。

其他指标

单位：人民币元

其他指标	报告期（2019-01-02至2019-03-31）
其他指标	报告期（2019-01-31）

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		
于翔勇	本基金的基金经理；公司权益投资部副总监	2015-08-18	2019-02-27	10	于翔勇先生，复旦大学金融学学士，经济学硕士学位，10年证券从业经验。曾任国泰君安证券股份有限公司，从事投资管理业务近三年，从事证券研究业务近三年，从事证券交易业务两年。2015年1月加入金鹰基金管理有限公司，现任权益投资部副总监。2015年2月至今担任金鹰产业股分灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年12月至今担任金鹰稳健成长混合型证券投资基金基金经理。2016年2月至今担任金鹰新兴产业股分灵活配置混合型证券投资基金基金经理。现任权益投资部副总监。
韩敬成	本基金的基金经理	2019-01-14	-	9	

注：1、首任基金经理的任期日期为基金合同的约定。

2、证券从业年限计算方法按照证券业协会规定：证券从业人员管理规定第五章第十条：“证券从业人员管理期限自证券从业资格取得之日起计算，证券从业资格取得之日为证券从业资格考试合格成绩公布之日。”

管理人对报告期内本基金运作遵守情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规以及其他有关规定，以及基金合同、招募说明书等有关法律文件的规定，勤勉尽责地管理和运用基金资产，严格控制风险因素，为基金的投资人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，没有损害基金持有人利益的行为，没有违规操作或违反基金合同的行为。

管理人对报告期内公平交易情况的专门说明

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》和公司内部关于交易制度、投资管理内控管理制度和风控管理方案，在投资管理过程中，投资决策环节和投资组合管理方案的制定、公司权益投资部门内部实行交易权分离制，严格执行投资决策、交易执行、风控监督三个环节相互独立的原则。公司在日常投资管理过程中，公司对投资决策、交易执行、风控监督等环节实行全程监控管理