金鹰元安混合型证券投资基金2019年第1季度报告

2019-04-19

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：广发银行股份有限公司

报告日期：2019-04-19

§1 重要提示
§2 基金简介
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况
§4 管理人报告
§5 托管人报告
§6 财务会计报告（未经审计）
§7 投资组合报告
§8 基金份额持有人户数及持有人结构情况
§9 开放式基金持有人大会决议
§10 重大事件揭示
§11 影响投资者决策的其他重要信息
§12 备查文件目录

§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和连带责任。

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年04月19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，但不保证投资一定盈利。

投资者应认真阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务数据和投资组合报告的内容摘自本基金的季度报告。

本报告财务数据2019年01月01日至2019年03月31日。

§2 基金简介

基金基本情况

基金名称	金鹰元安混合
基金简称	金鹰元安混合
基金主代码	000110
交易代码	000110
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2000-05-26
报告期末基金份额总额	19,494,194.29
投资目标	本基金在有效控制风险的前提下，力争获益水平较高的收益，以实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采取股票投资组合与固定收益投资组合，通过数量方法严格控制风险，并通过有效的资产配置策略，动态调整股票资产配置比例，在股票投资组合中采用风险资产组合管理方法，力争获取基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×20%+中债总指数（全价）收益率×80%
风险收益特征	本基金为较为稳健的投资品种，长期预期风险和收益水平低于股票型基金，高于货币型基金和债券型基金。
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	广发银行股份有限公司
下属分级基金的基本状况	金鹰元安混合A
下属分级基金的交易代码	000110
报告期末下属分级基金的份额总额	19,494,194.29

主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	主基金（元）	金鹰元安混合A（元）	
		2019-01-01 - 2019-03-31	2018-01-02 - 2018-03-31
本期总收益		1,711,303.37	137,032.81
本期利润		1,974,401.34	201,401.39
加权平均基金份额本期利润		0.1102	0.1343
期末基金资产净值		21,705,379.38	1,715,379.98
期末基金份额净值		1.1133	1.0993

注：1、本期已实现收益指本期利润减去本期公允价值变动损益；本期利润为扣减所得税后的金额。

2、本期利润加上期初可供分配利润余额为本期可供分配利润。

3、期末可供分配利润，期末期末可供分配利润减去期末应付利润后的余额。

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，计入费用后实际基金业绩收益水平要低于所列数字。

§3 基金净值表现

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

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	-0.31 %	0.59 %	6.35 %	0.39 %	-6.66 %	0.20 %

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：

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	-0.31 %	0.59 %	6.35 %	0.39 %	-6.66 %	0.20 %

本基金合同生效以来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：

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
过去一年	8.33 %	0.55 %	9.25 %	0.39 %	-0.92 %	0.16 %
自基金合同生效日起至今	11.33 %	0.55 %	9.25 %	0.39 %	2.08 %	0.16 %

注：1、业绩比较基准收益率=沪深300指数收益率×20%+中债总指数（全价）收益率×80%

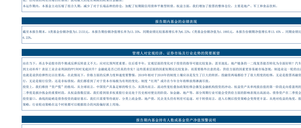
2、本基金的业绩比较基准是根据上述方法计算的。

金鹰元安混合累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势图

注：1、本基金合同生效日为2000年05月26日，图示日期为2017年06月06日至2019年03月31日。

2、按照基金合同规定，本基金投资组合建仓期为6个月，建仓期结束时各项投资比例均符合基金合同规定。

金鹰元安混合累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势图



注：1、本基金合同生效日为2000年05月26日，图示日期为2017年06月06日至2019年03月31日。

2、本基金合同规定的投资期为6个月，建仓期结束时各项投资比例均符合基金合同规定。

§4 管理人报告

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》和其他有关法律法规的规定，本基金《基金合同》和《招募说明书》的有关规定，勤勉尽责地管理和运用基金资产，严严格控制风险管理，在追求基金资产安全的前提下，为基金持有人谋取最大利益。在报告期内，基金运作基本合规，没有违反法律法规和《基金合同》的行为。

公平交易专门程序

1.公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证券投资基金管理公司公平交易制度等有关规定，和公司内部公平交易制度，报告期内投资管理等相关内部控制工作，本报告期内，公司未发生违反公平交易制度的情况。

报告期内，公司对投资决策委员会、交易部的监督管理机制，和投资决策委员会、交易部、风控稽核部等各部门的工作流程进行了全面完善和优化，并根据实际情况对公司内部的投资管理