

金鹰科技创新股票型证券投资基金2019年第1季度报告

2019-03-31

基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：2019-04-20

重要提示

基金管理人承诺：基金管理人承诺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。基金托管人承诺：基金托管人承诺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。基金管理人承诺：基金管理人承诺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。基金管理人承诺：基金管理人承诺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。

基金基本情况

项目	数值
基金简称	金鹰科技创新股票
场内简称	
基金代码	001167
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015-04-30
报告期末基金份额总额	859,081,876.53
投资目标	本基金在有效控制风险并保持良好流动性的前提下，重点投资于科技创新和创新的动力和支撑，具有核心科技或创新优势的优质上市公司，把握相关领域科技发展与创新所带来的投资机会，力争获得超越长期资本增值。
投资策略	本基金将结合对宏观经济形势、政策走势、证券市场环境等在内的因素的分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置策略，合理确定基金在股票、债券等各类资产上的投资比例，最大限度降低投资组合的风险，提高收益。通过“自上而下”及“自下而上”相结合的方法挖掘优质的上市公司，构建股票投资组合；1) 自上而下地分析行业的长期增长空间、竞争结构、增长节奏，潜在风险等方面，把握投资机会；2) 自下而上地分析企业的核心技术和创新优势、管理层、治理结构以及其提供的产品和服务是否契合科技创新的大趋势，对企业基本面和估值水平进行综合的研判，深度控制个股质量，并秉承稳健优先的原则，在保证投资低风险的基础上谨慎投资优质市场，力争获得良好的收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于证券投资基金中较高预期收益、较高预期风险的品种，其预期风险收益水平高于混合型基金、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	中国工商银行股份有限公司

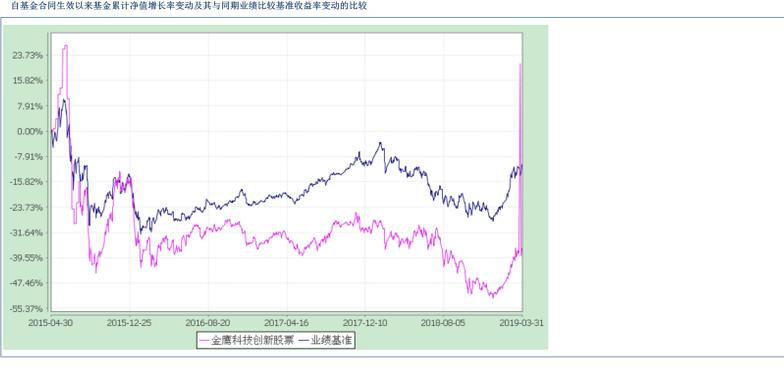
主要财务指标

主要财务指标	报告期(2019-01-01至2019-03-31)
本期已实现收益	-2,437,424.63
本期利润	138,516,999.54
加权平均基金份额本期利润	0.1409
期末基金资产净值	543,398,868.97
期末基金份额净值	0.633

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者(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。

基金净值表现

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	28.66%	1.54%	22.80%	1.24%	5.86%	0.30%



注：(1)截至本报告期末，各项投资比例符合基金合同约定。(2)业绩比较基准：沪深300指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%。

其他指标

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

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		
黄旭芳	本基金的基金经理	2017-09-19	-	12	黄旭芳女士，清华大学硕士研究生，历任天相投资顾问有限公司分析师，中航证券资产管理分公司投资主办，量化投资负责人，广州证券股份有限公司资产管理部投资主办，2015年8月加入金鹰基金管理有限公司，任指数及量化投资部数量策略研究员，现任指数及量化投资部基金经理。
樊勇	本基金的基金经理	2019-04-13	-	7	樊勇先生，曾任广州证券股份有限公司资产管理部研究员，2018年1月加入金鹰基金管理有限公司，现任权益投资部基金经理。
乔春	本基金的基金经理	2019-04-17	-	9	乔春先生，中南大学环境工程专业工学学士、南开大学金融学硕士，历任长城基金管理有限公司行业研究员、基金助理助理、基金经理等职务，2017年11月加入金鹰基金管理有限公司，现任权益投资部基金经理。

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颁布的《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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，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各项监管规定、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，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期，本基金管理人严格遵守法律法规及基金合同的规定，未发现任何违法违规及损害基金份额持有人利益的行为。

公平交易专项说明

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》和公司内部公平交易制度，各投资组合按照投资管理流程和流程独立决策，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。报告期内，公司连续四个季度期间内，不同时间窗口(日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合间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。

异常交易行为的专项说明
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8%的情况。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。

报告期内基金的投资策略和运作分析

在多数利好加持下，每年都会上的春季行情在今年演绎的愈加浓厚，各大指数上翘幅度和速度让市场瞩目，与历史上春季行情同样也很强劲的2013年相比，不同的是今年的结构性分化更加显著，券商、券商、白酒取得了明显的超额收益。我们在一季度不做方向性抉择，维持了去年以来的组合仓位和结构，配置上以医药和计算机为主，大众消费、高端制造、民生消费品为辅，由于延续了去年以来的高位，整体上没有踏空行情，但也没有太多超额收益。

报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，基金份额净值为0.633元，本报告期份额净值增长率为28.66%，同期业绩比较基准增长率为22.80%。

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

根据历史规律，市场在二季度大概率会回到企稳回调的考验，我们将在一季度全部调整后，比较各大行业的相对情况，对组合结构做出调整。

报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内无应当说明的预警事项。

投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益类投资	488,821,912.03	85.23
	其中：股票	488,821,912.03	85.23
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	84,445,874.14	14.72
7	其他资产	246,444.95	0.04
8	合计	573,514,231.12	100.00

注：其他资产包括：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。

报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	14,210,852.60	2.62
B	采矿业	-	-
C	制造业	308,454,338.46	56.76
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	16,714,807.74	3.08
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	97,046,814.81	17.88
J	金融业	134,343.00	0.02
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	19,724,250.00	3.63
R	文化、体育和娱乐业	32,536,505.42	5.99
S	综合	-	-
	合计	488,821,912.03	89.96

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	000661	长春高新	68,011	21,558,806.89	3.97
2	002563	森马服饰	1,650,009	19,783,607.91	3.64
3	300347	泰格医药	297,500	19,724,250.00	3.63
4	603805	珀莱雅	283,024	19,633,374.88	3.61
5	603899	晨光文具	525,054	19,426,998.00	3.58
6	002821	凯莱英	207,015	19,053,660.60	3.51
7	601799	宇通股份	305,000	18,330,500.00	3.37
8	300829	健帆生物	289,024	17,985,963.52	3.31
9	002410	广联达	600,000	17,886,000.00	3.29
10	300047	天富迪科	1,080,087	17,691,825.06	3.26

报告期末按品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	-	-

注：本基金本报告期末未投资债券。

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)

注：本基金本报告期末未投资债券。

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

注：本基金本报告期末未投资资产支持证券。

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

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)

注：本基金本报告期末未投资贵金属。

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

注：本基金本报告期末未投资权证。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

本基金投资股指期货的投资政策

无。

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本期国债期货投资政策
无。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

本期国债期货投资评价

无。

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况
本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现在监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库
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。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	150,025.57
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	15,570.56
5	应收申购款	80,848.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	246,444.95

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限证券。

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。

开放式基金份额变动

项目	数值
报告期末基金份额总额	1,128,507,556.32
报告期基金份额总额申购	16,941,219.97
减：报告期基金份额总额赎回	285,466,899.76
报告期基金份额总额净变动(份额减少以“-”填列)	-
报告期末基金份额总额	859,081,876.53

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

基金管理人持有本基金份额变动情况
注：无。

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
合计					

注：无。

报告期末发起式基金资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人自有资金	-	-	-	-	
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	
基金经理等人员	-	-	-	-	
基金管理人股东	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	-	-	-	-	

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比例达到或超过20%的时间区间			报告期末持有基金情况			
	序号	持有基金份额比例达到或超过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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-

影响投资者决策的其他重要信息
经广东省工商行政管理局核准，本基金管理人法定代表人已于2019年3月27日变更为刘志刚先生。

备查文件目录

- 中国证监会核准金鹰科技创新股票型证券投资基金发行及募集的文件。
- 《金鹰科技创新股票型证券投资基金基金合同》。
- 《金鹰科技创新股票型证券投资基金托管协议》。
- 金鹰基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程。
- 基金托管人业务资格批件和营业执照。

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

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：4006-135-8888或020-83961880。