

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。基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年4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，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不预示其未来表现，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。本报告自2019年3月1日起至3月31日止。

基金基本情况

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 数值 (Value). Rows include 基金名称 (金鹰策略配置混合), 场内简称, 基金代码 (E10008), 基金运作方式 (契约型开放式), 基金合同生效日 (2011-09-01), 报告期末基金份额总额 (47,982,005.57), 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准 (沪深300指数增长率×75%+中证全指指数增长率×25%), 风险收益特征, 基金管理人 (金鹰基金管理有限公司), 基金托管人 (中信银行股份有限公司).

主要财务指标

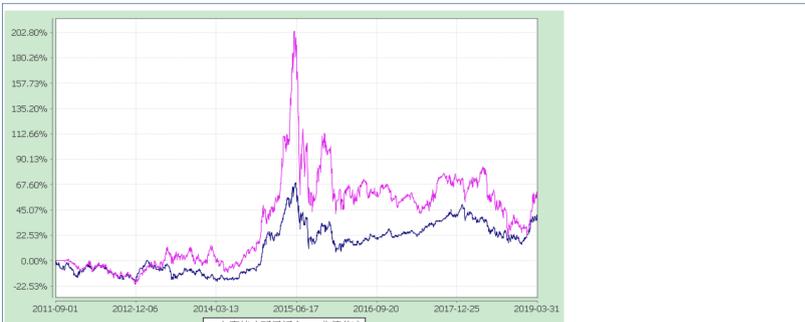
Table with 2 columns: 主要财务指标 and 报告期 (2019-01-01 至 2019-03-31). Rows include 本期已实现收益 (3,645,421.66), 本期利润 (10,560,550.98), 加权平均基金份额本期利润 (0.2255), 期末基金资产净值 (53,894,706.44), 期末基金份额净值 (1.1232).

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。

基金净值表现

Table with 7 columns: 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. Row: 过去三个月 (25.34%, 1.83%, 21.38%, 1.16%, 3.96%, 0.67%).

自基金合同生效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



注：1、本基金合同于2011年9月1日正式生效；2、截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同规定的各项比例；3、本基金业绩比较基准为：沪深300指数增长率×75%+中证全指指数增长率×25%。

其他指标

Table with 2 columns: 其他指标 and 报告期 (2019-01-01至2019-03-31). Rows include 其他指标 (空), 其他指标 (空).

基金经理（或基金经理小组）简介

Table with 6 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限 (任职日期, 离任日期), 证券从业年限, 说明. Row: 陈颖 (基金经理), 2017-09-19, 9, 陈颖先生，北京大学学士，中山大学工商管理硕士，曾任职于广东省电信规划设计院、中国惠普有限公司，历任深圳市瀚信资产管理有限公司研究主管等职，2012年9月加入金鹰基金管理有限公司，先后任研究员、研究小组组长、基金经理助理等，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信情况的说明

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，为基金份额持有人谋求最大利益。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，无损害基金份额持有人的行为。

公平交易专项说明

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流程和制度独立决策，并在获得投信信息、投资建议和实施投资决策方案等方面享有平等的机会。公司通过规范的投资交易流程、完善的权限管理机制、有效的风险控制制度，确保公平交易的实施。同时通过投信系统中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，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（3日内、5日内）公司管理的不同投资组合间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。

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5%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

回顾四季度，国内社融增速触底反弹，流动性出现明显改善，社会融资成本回落，市场对于经济增速在年内见底的预期较强，同时金融体系供给侧改革效果显现。国际上，中美贸易谈判进展较为顺利，美联储加息进程有所放缓。国内方面，全球经济复苏的疲软会制约货币政策紧缩的节奏，美联储加息预期的降低为全球货币政策提供了宽松的空间，也有利于国内维持宽松的货币政策。2019年一季度经历了一波报复性反弹后，市场信心得以恢复，但市场信心仍较为脆弱，预计未来指数可能进入高位盘整阶段。总体而言，二季度可能呈现结构性行情的特征。二季度本基金仍将维持积极的仓位策略，在选股上仍将以成长类和业绩反转型公司为主，重点配置TMT、医药、商贸零售、核电装备等行业配置。

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1.1232元，本报告期份额净值增长率为25.34%，同期业绩比较基准增长率为21.38%。

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年二季度，经济方面，随着减税降费、加大小微企业扶持等政策的落地，预计国内经济数据将呈现触底的迹象，而在中美贸易谈判取得突破的基础上，出口预计出现恢复性增长，同时政府前期逆周期调节的基建投资也将助力于经济的触底反弹。国外方面，全球经济复苏的疲软会制约货币政策紧缩的节奏，美联储加息预期的降低为全球货币政策提供了宽松的空间，也有利于国内维持宽松的货币政策。2019年一季度经历了一波报复性反弹后，市场信心得以恢复，但市场信心仍较为脆弱，预计未来指数可能进入高位盘整阶段。总体而言，二季度可能呈现结构性行情的特征。二季度本基金仍将维持积极的仓位策略，在选股上仍将以成长类和业绩反转型公司为主，重点配置TMT、医药、商贸零售、核电装备等相关板块。

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告解决方案。

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额 (元), 占基金总资产的比例 (%). Rows include 权益类投资 (51,065,238.53), 其中: 股票 (51,065,238.53), 固定收益投资, 其中: 债券, 资产支持证券, 贵金属投资, 金融衍生品投资, 买入返售金融资产, 其中: 买断式回购的买入返售金融资产, 银行存款和结算备付金合计 (5,537,425.02), 其他资产 (154,711.63), 合计 (56,757,375.18).

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股票投资组合

Table with 4 columns: 序号, 行业类别, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). Rows include A 农林牧渔, B 采矿业, C 制造业, 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, 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, S 综合, 合计 (51,065,238.53).

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

Table with 6 columns: 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 (%). Rows include 1 600729 重庆百货 (89,900, 3,342,519.18), 2 200043 星洲娱乐 (458,900, 3,221,478.00), 3 002364 中航电气 (278,900, 3,198,983.00), 4 200580 贝斯特 (175,000, 3,113,250.00), 5 603336 宏辉果蔬 (150,000, 2,890,500.00), 6 002366 台湾核电 (218,000, 2,851,440.00), 7 603959 百利科技 (140,000, 2,637,600.00), 8 002818 高森美 (100,000, 2,626,000.00), 9 600361 华联超市 (510,000, 2,340,900.00), 10 600759 中百集团 (320,000, 2,320,000.00).

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). Rows include 1 国债债券, 2 央行票据, 3 金融债, 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

Table with 5 columns: 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 (%). Rows include 1, 2, 3, 4, 5.

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

Table with 5 columns: 序号, 资产支持证券名称, 数量 (份), 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). Rows include 1, 2, 3, 4, 5.

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

Table with 5 columns: 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 (%). Rows include 1, 2, 3, 4, 5.

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名的前五名权证投资明细

Table with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量 (份), 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). Rows include 1, 2, 3, 4, 5.

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

Table with 6 columns: 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. Rows include 公允价值变动总额合计 (元), 股指期货投资本期收益 (元), 股指期货投资本期公允价值变动 (元).

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

Table with 6 columns: 代码, 名称, 持仓量 (买/卖), 合约市值 (元), 公允价值变动 (元), 风险指标说明. Rows include 公允价值变动总额合计 (元), 国债期货投资本期收益 (元), 国债期货投资本期公允价值变动 (元).

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。

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。

其他资产构成

Table with 4 columns: 序号, 名称, 金额 (元), 单位: 人民币元. Rows include 1 存出保证金 (63,782.11), 2 应收证券清算款, 3 应收股利, 4 应收利息 (2,387.85), 5 应收中购款 (88,541.67), 6 其他应收款, 7 待摊费用, 8 其他, 9 合计 (154,711.63).

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情况。

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，之和与合计项之间可能存在尾差。

开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 项目, 数值. Rows include 报告期初基金份额总额 (46,791,273.89), 报告期因基金总申购份额 (7,278,457.80), 减: 报告期因基金总赎回份额 (6,087,725.03), 报告期因基金分派变动份额 (份额减少以“-”填列), 报告期末基金份额总额 (47,982,005.57).

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

Table with 2 columns: 基金管理人持有本基金份额变动情况, 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细. Rows include 报告期初持有人的基金份额, 报告期间买入/申购总份额, 报告期间卖出/赎回总份额, 报告期末持有人的基金份额, 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例(N).

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table with 6 columns: 序号, 交易方式, 交易日期, 交易份额 (份), 交易金额 (元), 适用费率. Rows include 合计.

注：无。

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

Table with 6 columns: 项目, 持有份额总数, 持有份额占基金份额总额比例, 发起份额总数, 发起份额占基金份额总额比例, 发起份额承诺持有期限. Rows include 基金管理人固有资金, 基金管理人高级管理人员, 基金基金经理, 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

Table with 6 columns: 投资者类别, 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. Rows include 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

- 1、中国证监会批准基金发行及募集的文件；2、《金鹰策略配置混合型证券投资基金合同》；3、《金鹰策略配置混合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复、营业执照、公司章程；5、基金托管人业务资格批复和营业执照。

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。