

金鹰策略配置混合型证券投资基金
2019 年半年度报告
2019 年 6 月 30 日

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

报告送出日期：二〇一九年八月二十三日

1 重要提示及目录

1.1 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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	11
5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	34
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	40
7.7 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.....	40
7.8 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.....	40
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	40
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	40
7.11 本报告期投资基金情况.....	41
7.12 投资组合报告附注.....	41
8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42

8.2 期末上市基金前十名持有人.....	42
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	42
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况.....	42
9 开放式基金份额变动.....	42
10 重大事件揭示.....	43
10.1 基金份额持有人大会决议.....	43
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 其他重大事件.....	45
11 影响投资者决策的其他重要信息.....	46
11.1 影响投资者决策的其他重要信息.....	46
12 备查文件目录.....	46
12.1 备查文件目录.....	46
12.2 存放地点.....	46
12.3 查阅方式.....	46

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	金鹰策略配置混合型证券投资基金
基金简称	金鹰策略配置混合
基金主代码	210008
交易代码	210008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年9月1日
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
报告期末基金份额总额	45,606,523.71 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在对基本面进行深入分析的基础上，制定适当的投资策略，以策略指导投资运作，在充分控制风险的前提下，分享中国经济快速发展的成果以及企业经营绩效提升所带来的股权溢价，力争实现基金资产的长期可持续稳健增值。
投资策略	“防御”与“进取”的权衡与取舍是本基金进行大类资产配置、行业配置过程中的重要决策依据。通过对宏观经济所处投资时钟象限的判断、对股票市场与资金市场之间套利空间的测度，综合考察国内外宏观经济、财政政策与货币政策新动向、资本市场运行状况，对“防御”与“进取”目标适时、适度地有所侧重，将是本基金在投资策略上的现实选择。
业绩比较基准	沪深 300 指数增长率×75%+中证全债指数增长率×25%
风险收益特征	本基金为主动管理的混合型证券投资基金，属于证券投资基金中预期收益与风险较高的品种。一般情形下，其风险和预期收益均高于货币型基金、债券型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		金鹰基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	曾长兴	李修滨
	联系电话	020-38898996	4006800000
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	lixubian@citicbank.com
客户服务电话		4006135888,020-83936180	95558
传真		020-83282856	010-85230024
注册地址		广东省广州市南沙区滨海路 171号11楼自编1101之一J79	北京东城区朝阳门北大街9号

办公地址	广州市天河区珠江东路28号越秀金融大厦30层	北京东城区朝阳门北大街9号
邮政编码	510623	100010
法定代表人	刘志刚	李庆萍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gefund.com.cn
基金半年度报告备置地点	广东省广州市天河区珠江新城珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	金鹰基金管理有限公司	广东省广州市天河区珠江新城珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2019年1月1日至2019年6月30日）
本期已实现收益	3,859,885.92
本期利润	4,532,320.36
加权平均基金份额本期利润	0.0969
本期加权平均净值利润率	9.57%
本期基金份额净值增长率	11.01%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	-858,793.28
期末可供分配基金份额利润	-0.0188
期末基金资产净值	45,371,169.18
期末基金份额净值	0.9948
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	42.77%

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 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-0.21%	1.53%	4.19%	0.87%	-4.40%	0.66%
过去三个月	-11.43%	1.67%	-0.61%	1.14%	-10.82%	0.53%
过去六个月	11.01%	1.77%	20.63%	1.16%	-9.62%	0.61%
过去一年	-9.71%	1.73%	8.93%	1.14%	-18.64%	0.59%
过去三年	-15.53%	1.41%	19.70%	0.83%	-35.23%	0.58%
自基金合同生效起至今	42.77%	1.75%	39.46%	1.11%	3.31%	0.64%

注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数增长率×75%+中证全债指数增长率×25%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

金鹰策略配置混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2011 年 9 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日)



注：1、本基金合同于 2011 年 9 月 1 日正式生效；2、本报告期末，本基金的各项投资比例符合基金合同约定。3、本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数增长率×75%+中证全债指数增长率×25%。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基字[2002]97 号文批准，金鹰基金管理有限公司于 2002 年 12 月 25 日成立，注册资本 5.102 亿元人民币。2011 年 12 月公司获得特定客户资产管理计划业务资格，2013 年 7 月子公司——广州金鹰资产管理有限公司成立。

“以人为本、互信协作；创新谋变、挑战超越”是金鹰人的核心价值观。公司坚持价值投资为导向，着力打造高水准的投研团队，努力为投资者创造丰厚回报。截至报告期末，公司共有 46 只公募基金，管理规模 550.88 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈颖	本基金的基金	2017-09-1	-	9	陈颖先生，北京大学学士，中山大

	经理，公司权益投资部副总监	9			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。
樊勇	本基金的基金经理助理	2017-09-05	-	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，2015 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。

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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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及其各项实施准则、《金鹰策略配置混合型证券投资基金基金合同》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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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。公司通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现。同时通过投资交易系统内的公平交易功能执行交易，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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2019 年上半年，外部贸易谈判进展曲折反复，使得国内宏观经济调控的难度加大，政策在刺激需求和去杠杆之间摇摆，更多是相机抉择。一季度在宽松货币政策下，经济出现向好趋势，但楼市复苏使得货币政策在二季度出现转向，PMI 回落到荣枯线以下，工业增加值增速创多年新低，整体宏观经济仍在下行探底趋势中。

上半年市场表现方面，呈现先扬后抑的走势，上证、深证、中小板和创业板指数分别上涨 19.45%、26.78%、20.75% 和 20.87%，食品饮料、非银金融、农业和家电居前。

本基金上半年整体延续了前期配置思路，保持较高仓位，继续此前计算机、电子、医药、高端装备制造、商贸等行业配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值为 0.9948 元，本报告期份额净值增长率为 11.01%，同期业绩比较基准增长率为 20.63%。

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 年下半年，经济形势上，贸易争端使得全球主要经济体重新进入量化宽松期，美联储在 7 月底的降息预示着降息周期的开始，后期需要观察降息力度和进展。国内 7 月政治局会议确认了下半年经济下行压力加大，重提做好“六稳工作”，落实积极财政政策和稳健货币政策，同时坚决不进行房地产刺激。预计国内货币政策中性偏宽松，是否出现较大力度的措施将取决于三季度国内经济数据和贸易争端的进展。

上半年市场先扬后抑，尤其在二季度，受到贸易争端反复和流动性收紧的影响，市场进入震荡盘整区域。我们认为目前市场对利空预期反应相对较为充分，下半年在政策压制地产并托底实体经济发展的背景下，市场的风险偏好有望得以修复。

下半年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，重点配置电子、计算机、高端装备制造、医药、券商等相关板块。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会由基金估值业务分管领导、督察长、基金估值核算

负责人、基金会计、合规风控部人员及相关投研人员等组成。在特殊情况下，公司召集估值委员会会议，讨论和决策特殊估值事项，估值委员会集体决策，需到会的三分之二估值委员会成员表决通过。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理、投资经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行，一切以维护基金持有人利益为准则。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场债券品种的估值数据及交易所交易的债券品种的估值数据、流通受限股票流动性折扣。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对金鹰策略配置混合型证券投资基金 2019 年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，金鹰基金管理有限公司在金鹰策略配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，金鹰基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的 2019 年半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：金鹰策略配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	2,850,195.12	3,217,772.03
结算备付金		267,290.39	0.00
存出保证金		96,814.42	49,541.06
交易性金融资产	6.4.7.2	37,434,446.86	39,090,289.30
其中：股票投资		37,434,446.86	39,090,289.30
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		5,425,914.00	211,309.91
应收利息	6.4.7.5	1,596.93	1,669.63
应收股利		-	-
应收申购款		41,499.12	25,580.99
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		46,117,756.84	42,596,162.92
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-

卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		75,213.58	31,527.88
应付管理人报酬		56,537.90	54,939.46
应付托管费		9,423.02	9,156.55
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.6	163,536.32	86,270.96
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	441,876.84	485,113.09
负债合计		746,587.66	667,007.94
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.8	45,606,523.71	46,791,273.80
未分配利润	6.4.7.9	-235,354.53	-4,862,118.82
所有者权益合计		45,371,169.18	41,929,154.98
负债和所有者权益总计		46,117,756.84	42,596,162.92

注：截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.9948 元，基金份额总额为 45,606,523.71 份。

6.2 利润表

会计主体：金鹰策略配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		5,686,063.42	-3,533,334.61
1.利息收入		45,178.11	43,715.87
其中：存款利息收入	6.4.7.10	45,142.27	43,715.87
债券利息收入		35.84	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,936,631.70	-286,671.00
其中：股票投资收益	6.4.7.11	4,738,471.42	-475,491.00
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	7,983.32	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-

衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	190,176.96	188,820.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	672,434.44	-3,312,603.69
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	31,819.17	22,224.21
减：二、费用		1,153,743.06	847,982.83
1. 管理人报酬		350,105.07	408,181.59
2. 托管费		58,350.88	68,030.26
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	645,129.61	245,635.27
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.13	-
7. 其他费用	6.4.7.21	100,157.37	126,135.71
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,532,320.36	-4,381,317.44
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,532,320.36	-4,381,317.44

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金鹰策略配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	46,791,273.80	-4,862,118.82	41,929,154.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,532,320.36	4,532,320.36
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,184,750.09	94,443.93	-1,090,306.16
其中：1.基金申购款	13,340,699.44	1,007,790.35	14,348,489.79
2.基金赎回款	-14,525,449.53	-913,346.42	-15,438,795.95
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基	45,606,523.71	-235,354.53	45,371,169.18

项目	上年度可比期间		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	48,547,940.34	9,195,398.57	57,743,338.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-4,381,317.44	-4,381,317.44
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,260,188.25	988.94	-1,259,199.31
其中：1.基金申购款	15,353,498.34	3,147,232.87	18,500,731.21
2.基金赎回款	-16,613,686.59	-3,146,243.93	-19,759,930.52
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	47,287,752.09	4,815,070.07	52,102,822.16

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘志刚，主管会计工作负责人：刘志刚，会计机构负责人：谢文君

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

金鹰策略配置混合型证券投资基金(简称"本基金")，经中国证券监督管理委员会（简称"中国证监会"）证监许可[2011]970 号文《关于核准金鹰策略配置股票型证券投资基金募集的批复》、基金部函[2011]691 号文《关于金鹰策略配置股票型证券投资基金备案确认的函》批准，于 2011 年 9 月 1 日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金募集期间自 2011 年 7 月 20 日起至 2011 年 8 月 26 日止，认购金额及认购期银行利息合计 805,601,019.15 元于 2011 年 9 月 1 日划至托管银行账户，首次设立募集规模为 805,601,019.15 份基金份额。验资机构为立信会计师事务所。本基金的基金管理人为金鹰基金管理有限公司，基金托管人为中信银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则(以下简称“企业会计准则”)和中国证监会发

布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策与上年度会计报表一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1. 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税；2018 年 1 月 1 日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为，以

基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

2.对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

3.对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳，从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

4.对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5.对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日	
	活期存款	2,850,195.12
定期存款	-	
其中：存款期限 1 个月以内	-	
存款期限 1-3 个月	-	
存款期限 3 个月以上	-	
其他存款	-	
合计	2,850,195.12	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	40,374,545.90	37,434,446.86	-2,940,099.04
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券 交易所市场	-	-	-

	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		40,374,545.90	37,434,446.86	-2,940,099.04

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期内未投资金融衍生资产及负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	0.00	-

注：本基金报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期内未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	1,449.51
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	108.18
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-

其他	39.24
合计	1,596.93

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	163,536.32
银行间市场应付交易费用	-
合计	163,536.32

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	177.59
审计费用	42,396.69
预提信息披露费	324,302.56
应交税金-上交所债券	75,000.00
合计	441,876.84

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	46,791,273.80	46,791,273.80
本期申购	13,340,699.44	13,340,699.44
本期赎回（以“-”号填列）	-14,525,449.53	-14,525,449.53
本期末	45,606,523.71	45,606,523.71

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-4,702,546.68	-159,572.14	-4,862,118.82

本期利润	3,859,885.92	672,434.44	4,532,320.36
本期基金份额交易产生的变动数	-16,132.52	110,576.45	94,443.93
其中：基金申购款	-328,155.31	1,335,945.66	1,007,790.35
基金赎回款	312,022.79	-1,225,369.21	-913,346.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-858,793.28	623,438.75	-235,354.53

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	41,591.81
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,945.54
其他	604.92
合计	45,142.27

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	217,239,521.61
减：卖出股票成本总额	212,501,050.19
买卖股票差价收入	4,738,471.42

6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间未投资基金。

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	7,983.32
债券投资收益——赎回差价收入	-

债券投资收益——申购差价收入	-
合计	7,983.32

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	236,020.30
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	228,000.00
减：应收利息总额	36.98
买卖债券差价收入	7,983.32

6.4.7.15 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内未投资资产支持证券。

6.4.7.16 贵金属投资收益

本基金本报告期内未投资贵金属。

6.4.7.17 衍生工具收益

本基金本报告期内未投资衍生工具。

6.4.7.18 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	190,176.96
基金投资产生的股利收益	-
合计	190,176.96

6.4.7.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1.交易性金融资产	672,434.44
——股票投资	672,434.44

——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	672,434.44

6.4.7.20 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	29,320.99
转换费收入	2,498.18
合计	31,819.17

6.4.7.21 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	645,129.61
银行间市场交易费用	-
合计	645,129.61

注：本基金本报告期末未投资基金。

6.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	12,396.69
信息披露费	84,302.56
汇划手续费	3,458.12
合计	100,157.37

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1或有事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无重大需披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
金鹰基金管理有限公司	基金管理人、销售机构
中信银行股份有限公司	基金托管人

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金报告期及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金报告期及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金报告期及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。上述佣金按市场佣金率计算，以扣除中国证券登记结算公司收取的证管费、经手费和使用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	350,105.07	408,181.59
其中：支付销售机构的客户维护费	166,233.25	194,734.48

注：1、基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

2、基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	58,350.88	68,030.26

注：1、基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

2、基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付，若遇节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金报告期及上年度可比期间内没有应支付关联方的销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金报告期及上年度可比期间内无与关联方进行银行间同业市场的债券回购交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年6月30日		2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行股份有限公司	2,850,195.12	41,591.81	14,399,050.10	42,056.92

注：本基金 2019 年 6 月 30 日结算备付金期末余额 267,290.39 元，结算备付金利息收入 2,945.54 元；上年度可比期间期末结算备付金期末余额为 196,922.13 元，结算备付金利息收入 1,013.69 元。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金报告期及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明**

本基金报告期及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

6.4.10.7.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

本基金本报告期及上年可比期间均未投资基金。

6.4.11 利润分配情况

本基金报告期无利润分配情况。

6.4.12 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至报告期末 2019 年 6 月 30 日，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险等。基金成立以来，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，致力于内控机制的建立和完善，公司内部管理制度及业务规范流程的制定和完善，加强内部风险的控制与有效防范，以保证各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

为保证公司规范化运作，有效地防范和化解经营风险，确保基金和公司财务和其他信息真实、准确、完整、及时，从而最大程度地保护基金持有人的合法权益，本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了科学合理、控制严密、运行高效的各项管理制度：

(1) 风险管理控制制度

风险控制制度由总则、风险控制的目标和原则、风险控制的机构设置、风险控制的程序、风险类型的界定、风险控制的主要措施、风险控制的具体制度、风险控制制度的监督与评价等部分组成。

风险控制的具体制度主要包括投资风险管理制度、交易风险控制制度、财务风险控制制度、公司资产管理制度等业务风险控制制度，以及岗位分离制度、业务空间隔离制度、作业规则、岗位职责、反馈制度、资料保全制度、保密制度、员工行为守则等程序性风险管理制度。

(2) 投资管理制度

投资管理制度包括研究业务管理制度、投资决策管理制度、基金交易管理制度等。

制订研究业务管理制度的目的是保持研究工作的独立、客观。研究业务管理制度包括：建立严密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法；根据基金合同要求，在充分研究的基础上建立和维护投资对象备选库；建立研究与投资的业务交流制度，保持通畅的交流渠道；建立研究报告质量评价体系。

制订投资决策业务管理制度的目的是严格遵守法律法规的有关规定，确保基金的投资符合基金合同所规定的投资目标、投资范围、投资策略、投资组合和投资限制等要求。投资决策业务管理制

度包括投资决策授权制度；投资决策支持制度，重要投资要有详细的研究报告和风险分析支持；投资风险评 估与管理制度，在设定的风险权限额度内进行投资决策；投资管理业绩评价制度等。

制订基金交易管理制度的目的是保证基金投资交易的安全、有效、公平。基金交易管理制度包 括基金交易的集中交易制度；交易监测、预警、反馈机制；投资指令审核制度；投资指令公平分配 制度；交易记录保管制度；交易绩效评价制度等。

(3) 监察稽核制度

监察稽核制度包括检查公司各业务部门和工作人员是否遵守法律、法规、规章的有关规定；检 查公司各业务部门和工作人员对公司内部控制制度、各项管理制度、业务规章的执行情况；对公司 各部门作业流程的遵守合规性和有效性的检查、监督、评价及建议等。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出 现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用 等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基 金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不 得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因 此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以 控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年末 2018年12月31日
A-1	-	0.00
A-1 以下	-	0.00
未评级	-	0.00
合计	-	0.00

注：本统计数据未包含国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债、同业存单。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年末 2018年12月31日

A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年末 2018年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：以上数据按照最新发行人评级填列。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年末 2018年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：本统计数据未包含国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债、同业存单。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年末 2018年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年末 2018年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00

合计	0.00	0.00
----	------	------

注：以上数据按照最新发行人评级填列。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自投资于投资品种流动性不足，导致金融资产不能在合理价格变现。本基金采用分散投资、监控流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时基金管理人通过分析持有人结构、申购赎回行为分析、变现比例、压力测试等方法评估组合的流动性风险。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限资产投资比例等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间市场进行交易，除本报告所列示的期末本基金持有的流通受限证券暂时不能自由转让外，本基金持有的其余资产均能及时变现。评估结果显示本基金的组合持仓变现能力较好，流动性风险可控。

6.4.13.4 市场风险

市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月 30日	1个月 以内	1-3 个月	6个月 以内	3个月 -1年	6个月 -1年	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产										
银行存款	2,850,1	-	-	-	-	-	-	-	-	2,850,1

	95.12									95.12
结算备付金	267,290.39	-	-	-	-	-	-	-	-	267,290.39
存出保证金	96,814.42	-	-	-	-	-	-	-	-	96,814.42
交易性金融资产		-	-	-	-	-	-	37,434,446.86	-	37,434,446.86
买入返售金融资产		-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款		-	-	-	-	-	-	5,425,914.00	-	5,425,914.00
应收利息		-	-	-	-	-	-	1,596.93	-	1,596.93
应收股利		-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款		-	-	-	-	-	-	41,499.12	-	41,499.12
其他资产		-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	3,214,299.93	-	-	-	-	-	-	42,903,456.91	-	46,117,756.84
负债										
短期借款		-	-	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债		-	-	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款		-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款		-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款		-	-	-	-	-	-	75,213.58	-	75,213.58
应付管理人报酬		-	-	-	-	-	-	56,537.90	-	56,537.90
应付托管费		-	-	-	-	-	-	9,423.02	-	9,423.02
应付销售服务费		-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用		-	-	-	-	-	-	163,536.32	-	163,536.32
应交税费		-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付利息		-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付利润		-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他负债		-	-	-	-	-	-	441,876.84	-	441,876.84
负债总计		-	-	-	-	-	-	746,587.64	-	746,587.64

									6	.66
利率敏感度缺口	3,214,299.93	-	-	-	-	-	-	-	42,156,869.25	45,371,169.18
上年度末 2018 年 12 月 31 日	1 个月 以内	1-3 个月	6 个月 以内	3 个月 -1 年	6 个月 -1 年	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产										
银行存款	3,217,772.03	-	-	-	-	-	-	-	-	3,217,772.03
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	49,541.06	-	-	-	-	-	-	-	-	49,541.06
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	39,090,289.30	39,090,289.30
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	211,309.91	211,309.91
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	1,669.63	1,669.63
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	25,580.99	25,580.99
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	3,267,313.09	-	-	-	-	-	-	-	39,328,849.83	42,596,162.92
负债										
短期借款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	31,527.88	31,527.88
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	54,939.46	54,939.46
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	9,156.55	9,156.55
应付销售服	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

务费										
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	86,270.96	86,270.96
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	485,113.09	485,113.09
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	667,007.94	667,007.94
利率敏感度缺口	3,267,313.09	-	-	-	-	-	-	-	38,661,841.89	41,929,154.98

注：利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是债券投资。本基金管理人通过久期、凸性等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金报告期末未持有债券投资组合，不存在利率变动风险。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比	公允价值	占基金资产净值比例

		例 (%)		(%)
交易性金融资产—股票投资	37,434,446.86	82.51	39,090,289.30	93.23
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	37,434,446.86	82.51	39,090,289.30	93.23

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	市场其他变量保持不变，只有业绩比较基准所对应的市场组合价格发生合理、可能的变动；		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
	业绩比较基准变动+5%	2,577,090.86	2,585,309.06
	业绩比较基准变动-5%	-2,577,090.86	-2,585,309.06

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1. 公允价值

(1) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

(2) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层次可分为：

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 37,434,446.86 元。无属于第二层级和第三层级的金额。

(iii)公允价值所属层级间的重大变动

本基金本报告期内无公允价值所属层级间的重大变动。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

2. 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	37,434,446.86	81.17
	其中：股票	37,434,446.86	81.17
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,117,485.51	6.76
8	其他各项资产	5,565,824.47	12.07
9	合计	46,117,756.84	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、待摊费用。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-

B	采矿业	-	-
C	制造业	17,820,668.62	39.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,945,000.00	4.29
F	批发和零售业	6,221,326.24	13.71
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	9,371,692.00	20.66
J	金融业	2,075,760.00	4.58
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	37,434,446.86	82.51

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002364	中恒电气	290,900	2,839,184.00	6.26
2	600729	重庆百货	92,901	2,809,326.24	6.19
3	300418	昆仑万维	200,000	2,574,000.00	5.67
4	002399	海普瑞	120,900	2,537,691.00	5.59
5	300036	超图软件	154,200	2,279,076.00	5.02
6	601688	华泰证券	93,000	2,075,760.00	4.58
7	300691	联合光电	120,000	1,972,800.00	4.35
8	300229	拓尔思	185,600	1,956,224.00	4.31

9	601611	中国核建	250,000	1,945,000.00	4.29
10	002488	金固股份	230,000	1,915,900.00	4.22
11	603933	睿能科技	134,800	1,893,940.00	4.17
12	002366	台海核电	200,000	1,872,000.00	4.13
13	002264	新华都	300,000	1,764,000.00	3.89
14	600361	华联综超	400,000	1,648,000.00	3.63
15	300687	赛意信息	90,000	1,429,200.00	3.15
16	000777	中核科技	95,000	1,306,250.00	2.88
17	300007	汉威科技	100,000	1,269,000.00	2.80
18	002438	江苏神通	150,100	1,227,818.00	2.71
19	603308	应流股份	100,000	971,000.00	2.14
20	000555	神州信息	78,400	892,192.00	1.97
21	300043	星辉娱乐	50,000	241,000.00	0.53
22	300594	朗进科技	342	15,085.62	0.03

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300043	星辉娱乐	8,550,216.40	20.39
2	300691	联合光电	7,753,482.15	18.49
3	002399	海普瑞	5,654,231.20	13.49
4	002488	金固股份	5,574,406.11	13.29
5	000501	鄂武商 A	5,552,925.11	13.24
6	600643	爱建集团	5,369,213.00	12.81
7	300229	拓尔思	5,238,435.00	12.49
8	300006	莱美药业	5,228,673.00	12.47
9	300036	超图软件	5,012,443.00	11.95
10	601611	中国核建	4,609,639.19	10.99
11	300418	昆仑万维	4,517,626.91	10.77
12	300007	汉威科技	4,449,881.07	10.61
13	000563	陕国投 A	4,240,108.00	10.11
14	002241	歌尔股份	4,219,003.00	10.06
15	000681	视觉中国	4,160,565.00	9.92
16	603716	塞力斯	4,047,020.00	9.65
17	002380	科远智慧	3,813,586.24	9.10
18	603933	睿能科技	3,804,019.20	9.07
19	002366	台海核电	3,534,528.00	8.43
20	002364	中恒电气	3,500,450.07	8.35
21	600939	重庆建工	3,373,700.00	8.05

22	300580	贝斯特	3,322,986.00	7.93
23	601208	东材科技	3,273,964.00	7.81
24	600827	百联股份	3,121,122.00	7.44
25	000590	启迪古汉	3,058,871.67	7.30
26	600816	安信信托	2,991,066.36	7.13
27	000777	中核科技	2,952,254.30	7.04
28	002818	富森美	2,868,254.00	6.84
29	300115	长盈精密	2,756,606.00	6.57
30	300552	万集科技	2,728,153.00	6.51
31	300469	信息发展	2,727,840.40	6.51
32	300607	拓斯达	2,726,841.00	6.50
33	300427	红相股份	2,676,204.00	6.38
34	600335	国机汽车	2,665,775.00	6.36
35	600061	国投资本	2,644,243.00	6.31
36	603959	百利科技	2,593,593.00	6.19
37	300504	天邑股份	2,581,721.00	6.16
38	002161	远望谷	2,548,501.00	6.08
39	300134	大富科技	2,547,459.00	6.08
40	603336	宏辉果蔬	2,408,527.00	5.74
41	000759	中百集团	2,396,817.24	5.72
42	600439	瑞贝卡	2,310,094.00	5.51
43	002024	苏宁易购	2,144,149.00	5.11
44	600570	恒生电子	2,141,829.00	5.11
45	002618	丹邦科技	1,904,360.18	4.54
46	603005	晶方科技	1,788,502.00	4.27
47	601688	华泰证券	1,777,405.00	4.24
48	300373	扬杰科技	1,757,244.00	4.19
49	300687	赛意信息	1,720,762.50	4.10
50	002608	江苏国信	1,678,957.00	4.00
51	603377	东方时尚	1,659,392.20	3.96
52	002756	永兴特钢	1,639,427.00	3.91
53	000555	神州信息	1,570,974.00	3.75
54	002847	盐津铺子	1,396,586.00	3.33
55	002153	石基信息	1,381,238.62	3.29
56	002790	瑞尔特	1,377,296.00	3.28
57	002438	江苏神通	1,331,193.96	3.17
58	300113	顺网科技	1,317,564.00	3.14
59	600729	重庆百货	1,266,835.80	3.02
60	000597	东北制药	1,156,882.00	2.76
61	600754	锦江股份	1,141,093.00	2.72
62	600977	中国电影	1,120,153.00	2.67
63	000514	渝开发	1,077,939.22	2.57
64	002801	微光股份	1,068,347.00	2.55
65	603308	应流股份	1,062,748.00	2.53

66	600081	东风科技	1,038,203.00	2.48
67	002264	新华都	1,026,433.00	2.45
68	300426	唐德影视	1,004,621.87	2.40
69	300467	迅游科技	926,926.00	2.21
70	300480	光力科技	925,605.00	2.21
71	600136	当代明诚	908,849.00	2.17
72	300178	腾邦国际	894,029.96	2.13
73	002546	新联电子	854,825.00	2.04

注：该表的累计买入金额按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,未考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300043	星辉娱乐	9,877,105.00	23.56
2	300691	联合光电	6,715,905.80	16.02
3	000590	启迪古汉	6,596,264.02	15.73
4	603716	塞力斯	6,249,001.57	14.90
5	002399	海普瑞	5,951,321.30	14.19
6	600827	百联股份	5,653,979.33	13.48
7	000501	鄂武商 A	5,647,939.20	13.47
8	300006	莱美药业	5,574,549.80	13.30
9	300036	超图软件	5,312,469.00	12.67
10	603336	宏辉果蔬	5,293,081.90	12.62
11	600643	爱建集团	5,061,416.72	12.07
12	600570	恒生电子	4,956,077.00	11.82
13	000759	中百集团	4,563,742.00	10.88
14	000681	视觉中国	4,366,207.00	10.41
15	300226	上海钢联	4,282,765.00	10.21
16	002241	歌尔股份	3,875,818.00	9.24
17	002153	石基信息	3,850,282.45	9.18
18	002488	金固股份	3,679,984.00	8.78
19	000563	陕国投 A	3,644,796.00	8.69
20	300580	贝斯特	3,551,734.00	8.47
21	300007	汉威科技	3,527,357.00	8.41
22	002380	科远智慧	3,492,519.00	8.33
23	600939	重庆建工	3,069,260.00	7.32
24	601611	中国核建	3,032,159.00	7.23
25	601208	东材科技	3,019,275.98	7.20
26	300427	红相股份	2,997,056.00	7.15
27	002818	富森美	2,952,930.45	7.04

28	300229	拓尔思	2,937,590.00	7.01
29	600061	国投资本	2,916,589.99	6.96
30	300115	长盈精密	2,785,449.44	6.64
31	300607	拓斯达	2,735,477.00	6.52
32	002161	远望谷	2,697,797.95	6.43
33	600816	安信信托	2,688,846.80	6.41
34	600335	国机汽车	2,686,693.00	6.41
35	603959	百利科技	2,679,269.00	6.39
36	300134	大富科技	2,634,112.00	6.28
37	300504	天邑股份	2,623,398.52	6.26
38	300552	万集科技	2,552,036.00	6.09
39	300348	长亮科技	2,455,932.34	5.86
40	300469	信息发展	2,446,083.00	5.83
41	600439	瑞贝卡	2,318,518.00	5.53
42	002024	苏宁易购	2,249,779.00	5.37
43	600718	东软集团	2,213,109.00	5.28
44	002336	*ST 人乐	2,133,565.38	5.09
45	300373	扬杰科技	2,115,785.00	5.05
46	603933	睿能科技	1,979,824.40	4.72
47	002618	丹邦科技	1,918,349.00	4.58
48	600271	航天信息	1,863,785.00	4.45
49	603005	晶方科技	1,754,309.89	4.18
50	002608	江苏国信	1,707,072.51	4.07
51	603377	东方时尚	1,659,800.80	3.96
52	000777	中核科技	1,590,831.35	3.79
53	300418	昆仑万维	1,563,933.47	3.73
54	002756	永兴特钢	1,530,005.00	3.65
55	002264	新华都	1,472,875.00	3.51
56	002847	盐津铺子	1,447,298.00	3.45
57	002790	瑞尔特	1,329,456.80	3.17
58	300113	顺网科技	1,314,053.00	3.13
59	000597	东北制药	1,210,538.00	2.89
60	600977	中国电影	1,167,861.35	2.79
61	600754	锦江股份	1,108,464.00	2.64
62	002801	微光股份	1,069,458.60	2.55
63	600361	华联综超	1,061,496.00	2.53
64	600081	东风科技	1,007,493.00	2.40
65	600729	重庆百货	998,591.00	2.38
66	000514	渝开发	970,619.00	2.31
67	300426	唐德影视	960,200.00	2.29
68	300467	迅游科技	917,943.00	2.19
69	300480	光力科技	917,697.69	2.19
70	000666	经纬纺机	904,856.00	2.16
71	300178	腾邦国际	860,542.00	2.05

72	600136	当代明诚	857,203.00	2.04
73	002343	慈文传媒	840,000.00	2.00

注：该表的累计卖出金额按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,未考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	210,172,773.31
卖出股票的收入（成交）总额	217,239,521.61

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未投资债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期内未投资资产支持证券。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本报告期本基金未进行股指期货投资。

7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期本基金未进行国债期货投资。

7.10.2 本期国债期货投资评价

无。

7.11 本报告期投资基金情况**7.11.1 投资政策及风险说明**

无。

7.11.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

本基金本报告期内未投资基金。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	96,814.42
2	应收证券清算款	5,425,914.00
3	应收股利	-
4	应收利息	1,596.93
5	应收申购款	41,499.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,565,824.47

7.12.4 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末不存在流通受限股票情况。

7.12.5 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。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
3,733	12,217.12	2,643,210.21	5.80%	42,963,313.50	94.20%

8.2 期末上市基金前十名持有人

本基金非上市交易型基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	2,025.33	0.00%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金非发起式基金。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年9月1日）基金份额总额	805,601,019.15
--------------------------	----------------

本报告期期初基金份额总额	46,791,273.80
本报告期基金总申购份额	13,340,699.44
减：本报告期基金总赎回份额	14,525,449.53
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	45,606,523.71

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会，无会议决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、经本基金管理人第六届董事会第三十四次会议审议通过，报中国证券投资基金业协会、中国证券监督管理委员会广东监管局备案，并于 2019 年 3 月 5 日在证监会指定媒体披露，聘请刘志刚先生担任公司总经理，李兆廷先生不再代为履行金鹰基金管理有限公司总经理职责。

经广东省工商行政管理局核准，本基金管理人法定代表人于 2019 年 3 月 27 日由李兆廷先生变更为刘志刚先生。

2、本报告期内，经中信银行股份有限公司董事会会议审议通过，聘任方合英先生为本行行长，任职资格于 2019 年 3 月 29 日获中国银行保险监督管理委员会批复核准。孙德顺先生因年龄原因不再担任本行执行董事、行长等职务。根据工作需要，任命杨璋琪先生担任本行资产托管部副总经理，主持资产托管部相关工作。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金报告期内没有改变基金投资策略。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期末改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	1	294,306,728.14	68.91%	268,201.15	68.77%	-
华泰证券	1	91,864,503.81	21.51%	83,713.17	21.47%	-
国泰君安证券	1	36,354,624.40	8.51%	33,855.77	8.68%	-
国金证券	1	4,531,898.21	1.06%	4,220.52	1.08%	-

注：本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单位作为本基金的专用交易单位。本基金专用交易单位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

本基金专用交易单位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单位的证券经营机构。
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单位租用协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
广发证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	236,020.30	100.00%	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	金鹰基金管理有限公司关于旗下开放式基金资产净值等的公告	证监会指定媒体	2019-01-02
2	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与平安银行费率调整的公告	证监会指定媒体	2019-01-10
3	金鹰策略配置混合型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	证监会指定媒体	2019-01-21
4	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告	证监会指定媒体	2019-02-27
5	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与财通证券股份有限公司定投及费率优惠活动的公告	证监会指定媒体	2019-03-01
6	金鹰基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证监会指定媒体	2019-03-05
7	金鹰策略配置混合型证券投资基金 2018 年年度报告（摘要）	证监会指定媒体	2019-03-26
8	关于官网和网上交易系统维护暂停使用公告	证监会指定媒体	2019-03-28
9	金鹰基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告	证监会指定媒体	2019-03-28
10	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	证监会指定媒体	2019-03-29
11	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	证监会指定媒体	2019-03-30
12	金鹰基金管理有限公司关于新增阳光人寿保险股份有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务及费率优惠的公告	证监会指定媒体	2019-04-04
13	金鹰策略配置混合型证券投资基金更新的招募说明书全文 2019 年第 1 号	证监会指定媒体	2019-04-11
14	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票调整估值的公告	证监会指定媒体	2019-04-16
15	金鹰策略配置混合型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	证监会指定媒体	2019-04-20
16	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加天府银行手机银行渠道基金费率优惠活动的公告	证监会指定媒体	2019-05-06
17	金鹰基金管理有限公司关于董事变更的公告	证监会指定媒体	2019-06-20
18	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金参与科创板投资及相关风险揭示的公告	证监会指定媒体	2019-06-21

19	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票调整估值的公告	证监会指定媒体	2019-06-25
20	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国银行股份有限公司定投费率优惠活动的公告	证监会指定媒体	2019-06-27

注：相关信息披露文件请登录本基金管理人网站查询。

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 影响投资者决策的其他重要信息

无影响投资者决策的其他重要信息。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本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。
- 6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、季度报告、年度报告、更新的招募说明书及其他临时公告。

12.2 存放地点

广东省广州市天河区珠江新城珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

12.3 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

二〇一九年八月二十三日