

金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金

2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

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

送出日期：二〇二一年三月三十日

§ 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 29 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。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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.....	6
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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	12
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	16
4.10 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.....	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 审计报告	17
6.1 审计意见.....	17
6.2 形成审计意见的基础.....	17
6.3 其他信息.....	17
6.4 管理层对财务报表的责任.....	18
6.5 注册会计师的责任.....	18
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22
7.4 报表附注.....	24
§8 投资组合报告	58
8.1 期末基金资产组合情况.....	58
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	58
8.3 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.....	59

8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	62
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	69
8.6	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	69
8.7	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	69
8.8	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	69
8.9	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	69
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	69
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	69
8.12	本报告期投资基金情况	70
8.13	投资组合报告附注	70
§9	基金份额持有人信息	71
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	71
9.2	期末上市基金前十名持有人	71
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	71
9.4	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情况	71
9.5	发起式基金发起资金持有份额情况	72
§10	开放式基金份额变动	72
§11	重大事件揭示	72
11.1	基金份额持有人大会决议	72
11.2	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	72
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	72
11.4	基金投资策略的改变	72
11.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件	73
11.6	为基金进行审计的会计师事务所情况	73
11.7	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	73
11.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况	73
11.9	其他重大事件	75
§12	影响投资者决策的其他重要信息	78
12.1	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	78
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	79
§13	备查文件目录	79
13.1	备查文件目录	79
13.2	存放地点	79
13.3	查阅方式	79

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	金鹰元和混合	
基金主代码	002681	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 5 月 31 日	
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	
报告期末基金份额总额	54,247,720.09 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	金鹰元和混合 A	金鹰元和混合 C
下属分级基金的交易代码	002681	002682
报告期末下属分级基金的份额总额	28,194,658.99 份	26,053,061.10 份

2.2 基金产品说明

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，通过对股票、固定收益和现金类等资产的积极灵活配置，力争使基金份额持有人获得超额收益与长期资本增值。
投资策略	本基金将从宏观面、政策面、基本面和资金面四个维度进行综合分析，主动判断市场时机，在严格控制投资组合风险的前提下，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票类资产、固定收益类资产、现金类资产等各类资产类别上的投资比例，最大限度的提高收益。
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	本基金为灵活配置混合型基金，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低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	姚文强	郭明
	联系电话	020-83936180	010-66105799
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006135888	95588
传真		020-83282856	010-66105798
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	北京市西城区复兴门内大街55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	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		510623	100140
法定代表人		王铁	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gefund.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市天河区珠江东路 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
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京东长安街1号东方广场毕马威大楼8层
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2020 年		2019 年		2018 年 5 月 31 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日	
	金鹰元和混合 A	金鹰元和混合 C	金鹰元和混合 A	金鹰元和混合 C	金鹰元和混合 A	金鹰元和混合 C
本期已实现收益	31,660,777.76	12,440,149.83	12,196,337.28	5,900,179.14	-72,912,772.13	-2,336,531.65
本期利润	29,499,435.22	22,245,143.73	28,207,940.02	8,984,234.15	-72,769,480.86	-2,346,227.25
加权平均基金份额本期利润	0.3198	0.4535	0.0912	0.3124	-0.1033	-0.0991
本期加权平均净值利润率	23.90%	34.47%	9.92%	33.10%	-10.87%	-10.37%
本期基金份额净值增长率	72.37%	71.35%	21.28%	20.47%	-9.43%	-9.86%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
	金鹰元和混合 A	金鹰元和混合 C	金鹰元和混合 A	金鹰元和混合 C	金鹰元和混合 A	金鹰元和混合 C
期末可供分配利润	14,234,858.20	12,363,436.13	1,058,516.50	-140,606.08	-71,460,981.48	-2,080,271.65
期末可供分配基金份额利润	0.5049	0.4745	0.0104	-0.0032	-0.0918	-0.0977
期末基金资产净值	54,181,160.37	49,107,292.98	113,528,351.12	48,168,467.17	715,641,847.87	19,443,371.07
期末基金份额净值	1.9217	1.8849	1.1149	1.1000	0.9193	0.9131
3.1.3 累计	2020 年末		2019 年末		2018 年末	

期末指标	金鹰元和混合 A	金鹰元和混合 C	金鹰元和混合 A	金鹰元和混合 C	金鹰元和混合 A	金鹰元和混合 C
基金份额累计净值增长率	96.91%	91.29%	14.24%	11.63%	-5.80%	-7.34%

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、所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；

4、期末可供分配利润，采用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）。

5、本基金 2018 年 5 月 31 日转型后合同生效成立，上上年度可比期间 2018 年 5 月 31 日至 2018 年 12 月 31 日（下同）。

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

金鹰元和混合 A

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
过去三个月	37.88%	1.85%	8.59%	0.59%	29.29%	1.26%
过去六个月	39.67%	2.01%	14.97%	0.80%	24.70%	1.21%
过去一年	72.37%	2.29%	17.68%	0.85%	54.69%	1.44%
自基金合同生效起至今	89.33%	1.65%	30.68%	0.82%	58.65%	0.83%

注：1、截至本报告期末，各项投资比例符合基金合同的约定。

2、基金的业绩比较基准是：沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%。

金鹰元和混合 C

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
过去三个月	37.68%	1.85%	8.59%	0.59%	29.09%	1.26%

过去六个月	39.25%	2.01%	14.97%	0.80%	24.28%	1.21%
过去一年	71.35%	2.29%	17.68%	0.85%	53.67%	1.44%
自基金合同生效起至今	86.07%	1.65%	30.68%	0.82%	55.39%	0.83%

注：1、截至本报告期末，各项投资比例符合基金合同的约定。

2、基金的业绩比较基准是：沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%。

3.2.2 自基金转型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

金鹰元和灵活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

(2018 年 5 月 31 日至 2020 年 12 月 31 日)

金鹰元和混合 A



注：1、本基金由原金鹰元和保本混合型证券投资基金于 2018 年 5 月 31 日转型而来；

2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关约定；

3、业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数×40%。

金鹰元和混合 C



注：1、本基金由原金鹰元和保本混合型证券投资基金于 2018 年 5 月 31 日转型而来；

2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关约定；

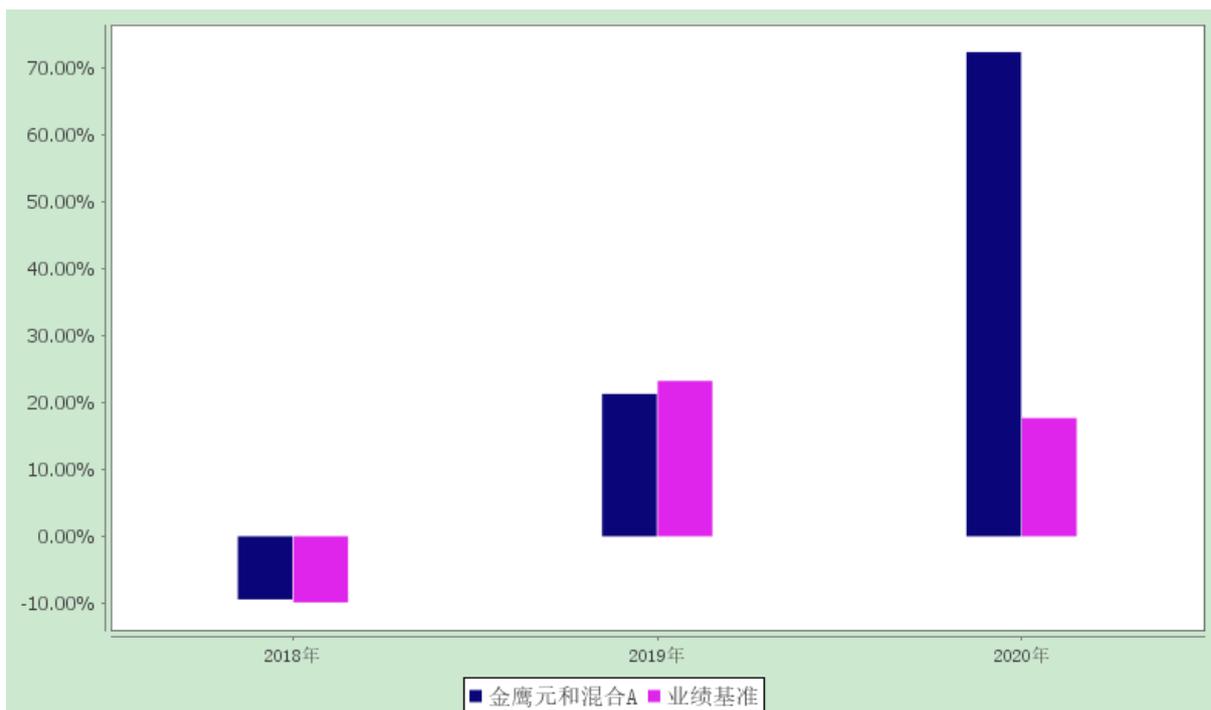
3、业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数×40%。

3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金

自基金转型以来基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图

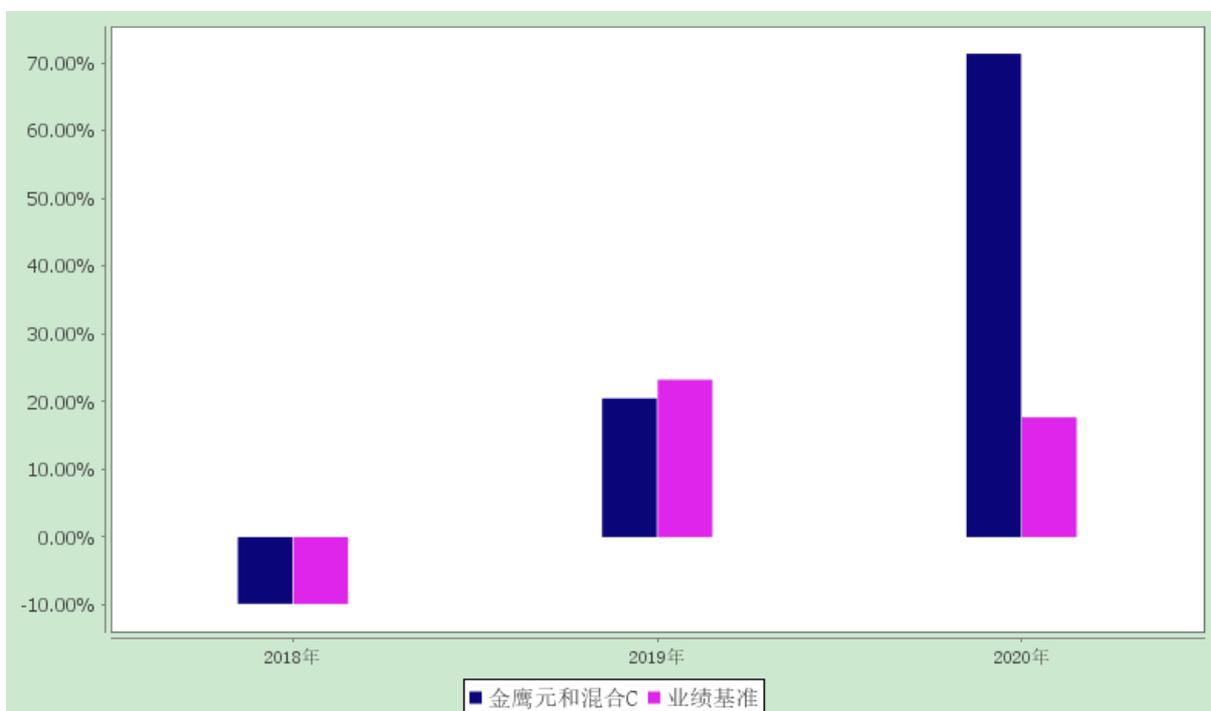
金鹰元和混合 A



注：1、截至本报告期末，各项投资比例符合基金合同的约定。

2、基金的业绩比较基准是：沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%。

金鹰元和混合 C



注：1、截至本报告期末，各项投资比例符合基金合同的约定。

2、基金的业绩比较基准是：沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金 2018 年 5 月 31 日转型后合同生效成立，截止本报告期末未进行利润分配。

§ 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。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。2015 年 12 月，获得受托管理保险资金投资管理资格。

“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。金鹰基金拥有一支经验丰富，风格多元的投资团队。

公司秉承开放、包容、多元的投资文化，采取基金经理负责制，将产品契约与基金经理风格有机结合，鼓励基金经理个人风格的充分展现，强化产品投资风格的稳定性，逐步形成了风险收益特征多元，投资研究体系有机互补的整体投研平台和基金产品线。截至报告期末，合计管理公募基金 47 支。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
李海	本基金的基金经理	2019-04-20	2020-11-18	12	李海先生，2008 年 10 月至 2009 年 6 月曾任太平洋证券股份有限公司研究员，2009 年 6 月至 2012 年 2 月曾任建信基金管理有限责任公司研究员，2012 年 2 月至 2016 年 4 月曾任民生加银基金管理有限公司高级研究员、基金经理等职务，2016 年 4 月至 2017 年 1 月曾任荣盛泰发投资基金管理有限公司副经理，2017 年 2 月至 2019 年 3 月曾任西藏尚易加资产管理有限公司股票投资总监。2019

					年 4 月加入金鹰基金管理有限公司。
倪超	本基金的基金经理，公司研究部副 总监	2020- 06-20	-	11	倪超先生，厦门大学硕士研究生。2009 年 6 月加盟金鹰基金管理有限公司，先后任行业研究员，消费品研究小组组长、基金经理助理。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《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，严格遵守本基金的基金合同、托管协议、招募说明书等法律文件的规定，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 公平交易制度和控制方法

为了保证本基金管理人管理的不同投资组合得到公平对待，本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，以及公司内控大纲的要求，制定了《金鹰基金管理有限公司公平交易管理规定》并严格执行，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。本基金管理人通过投资交易系统公平交易功能，对不同投资组合进行公平交易事前控制。同时，本基金管理人引入公平交易分析系统，定期或不定期对公司旗下投资组合在一定期间内买卖相同证券的情况进行监控和分析。

4.3.2 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。

报告期内，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

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。

4.3.3 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 2020 年，是极不平凡的一年，新冠肺炎疫情的来袭打乱了原有的节奏，中国率先经历了至暗时刻，后又迅速振作起来，展现了我们强大的社会组织能力，2020 年中国成为世界主要大国中唯一实现 GDP 正增长的国家。

2020 年一季度，疫情使全球经济衰退，国内率先控制住疫情。二季度，中国顺利复工复产而海外疫情持续扩散；三季度海外供需缺口扩大，很多中国企业抓住机会打开了海外市场；四季度随着优异疫苗数据的公布，全球经济修复的预期增强，低估值顺周期板块如钢铁、有色、化工等板块表现较好。疫情之下全球主要经济体的货币政策普遍宽松，流动性充裕带来的估值提升是权益资产上涨的主要动力。

权益市场表现上，A 股是全球表现最好的市场之一，上证综指上涨 13.87%，深成指上涨 38.73%，中小板指数上涨 43.91%，创业板指数上涨 64.96%，2020 年的 A 股市场也成为 2019 年后的又一大牛市。行业表现上，休闲服务、电气设备、食品饮料、国防军工、医药生物板块涨幅居前，采掘、地产、建筑装饰、通信、银行板块跌幅居前。牛股集中在白酒、光伏代表的新能源、新能源车和医疗设备这四大赛道上。

本基金综合行业短期景气度、长期的行业成长空间的角度主要配置了光伏、新能源车、消费医药、机械、化工等板块。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金报告期内 A 类份额净值为 1.9217 元，本报告期份额净值增长率为 72.37%，同期业绩比较基准增长率 17.68%；C 类基金份额净值为 1.8849 元，本报告期份额净值增长率 71.35%，同期业绩比较基准增长率为 17.68%。

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 2021 年，随着各个国家疫苗的持续接种，全球经济将延续复苏态势，美债收益率将跟随美国经济的修复逐步抬升，对全球的高估值风险资产形成压制。国内宏观政策方面稳字当头，保持连

续性、持续性和不转急弯。

同时我们观察到，市场经过 2020 年的修复，目前以新能源和部分消费为代表的部分蓝筹股估值较高，在流动性环境出现波动的情况下，市场可能出现较大幅度的波动。但从中长期而言，随着国内金融市场改革逐步深化，居民资产配置中金融资产比例仍将稳步提升，中国资产在全球的比较优势，将长期驱动市场中长期向上。

本基金在兼顾好公司、短期行业景气度和长期成长空间的背景下，主要布局以下几个行业：光伏、新能源车产业链和智能汽车产业链；自下而上地筛选医药消费公司；顺经济周期的化工、有色和机械；受益于经济复苏的银行、保险板块；低估值受益于疫苗持续接种和经济复苏的交运、旅游方向。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，监察稽核工作根据独立、客观、公正的原则，按照规定的权限和程序独立开展本基金运作的合规性监察，认真履行职责，通过材料审阅、监督监控、覆盖检查、重点抽查等多种方法开展工作，督促各项业务的合规运作，发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告，定期向公司董事会和监管部门出具监察稽核报告。

本报告期有关本基金的监察稽核内容包括投资、交易、研究、市场营销、信息披露等各项业务的每个环节以及信息技术、运营保障、行政管理等后台支持工作。监察结果显示，本报告期内公司对本基金的管理始终都能按照法律法规、基金合同、基金招募说明书的要求和公司制度的规定进行。本基金的投资决策、投资交易程序、投资权限等各方面均符合规定的要求；交易行为合法合规，未出现异常交易、操纵市场的现象；未发现内幕交易的情况；基金持有的证券符合规定的比例要求；基金专用交易席位年度交易量比例符合证监会的有关规定；相关的信息披露真实、完整、准确、及时；销售工作合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

本报告期，会计师事务所未对本基金出具非标准审计报告。

4.10 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

在本报告期内，本基金未出现持有人数或资产净值达到或低于预警线的情形。

§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

本报告期内，本基金托管人在对金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金的管理人——金鹰基金管理有限公司在金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对金鹰基金管理有限公司编制和披露的金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

毕马威华振审字第 2101746 号

金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“金鹰元和”）财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表、2020 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

6.1 审计意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了金鹰元和 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于金鹰元和，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 其他信息

金鹰元和管理人金鹰基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括金鹰元和 2020 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

6.4 管理层对财务报表的责任

基金管理人管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估金鹰元和的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非金鹰元和计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督金鹰元和的财务报告过程。

6.5 注册会计师的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对金鹰元和持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告

日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致金鹰元和不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙） 中国注册会计师

程海良 宋扬

中国北京东长安街1号东方广场毕马威大楼8层

2021年3月30日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2020年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	24,259,392.74	1,331,398.97
结算备付金		11,180.31	375,136.67
存出保证金		138,097.98	157,273.63
交易性金融资产	7.4.7.2	85,188,249.41	136,977,827.04
其中：股票投资		85,188,249.41	126,167,725.84
基金投资		-	-
债券投资		-	10,810,101.20
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	1,322.88	216,447.99
应收股利		-	-
应收申购款		775,010.18	24,541,833.71
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		110,373,253.50	163,599,918.01
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		5,055,461.54	-
应付赎回款		1,679,234.89	1,132,724.00
应付管理人报酬		98,318.56	213,905.67
应付托管费		13,109.14	28,520.74
应付销售服务费		16,855.89	25,679.31
应付交易费用	7.4.7.7	78,413.70	329,269.55
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	143,406.43	173,000.45
负债合计		7,084,800.15	1,903,099.72
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	54,247,720.09	145,620,289.94

未分配利润	7.4.7.10	49,040,733.26	16,076,528.35
所有者权益合计		103,288,453.35	161,696,818.29
负债和所有者权益总计		110,373,253.50	163,599,918.01

注：截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日，本基金基金份额净值为 1.904 元，基金份额总额为 54,247,720.09 份。

7.2 利润表

会计主体：金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		59,700,427.48	48,770,318.78
1.利息收入		224,021.70	2,950,599.01
其中：存款利息收入	7.4.7.11	91,918.01	746,879.94
债券利息收入		132,103.69	531,277.66
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	1,672,441.41
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		50,119,647.27	26,392,428.14
其中：股票投资收益	7.4.7.12	49,196,286.33	25,196,557.89
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	-2,244.17	-77,401.50
资产支持证券投资收益	7.4.7.15	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.16	-	-
衍生工具收益	7.4.7.17	-	-
股利收益	7.4.7.18	925,605.11	1,273,271.75
3.公允价值变动收益（损失以“-”号	7.4.7.19	7,643,651.36	19,095,657.75

填列)			
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.20	1,713,107.15	331,633.88
减: 二、费用		7,955,848.53	11,578,144.61
1. 管理人报酬		2,813,982.19	4,704,088.49
2. 托管费		375,197.60	627,211.80
3. 销售服务费		386,816.21	161,236.93
4. 交易费用	7.4.7.21	4,220,115.46	5,884,498.54
5. 利息支出		-	154.60
其中: 卖出回购金融资产支出		-	154.60
6. 税金及附加		0.65	-
7. 其他费用	7.4.7.22	159,736.42	200,954.25
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		51,744,578.95	37,192,174.17
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		51,744,578.95	37,192,174.17

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金

本报告期: 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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)	145,620,289.94	16,076,528.35	161,696,818.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	51,744,578.95	51,744,578.95
三、本期基金份额交易	-91,372,569.85	-18,780,374.04	-110,152,943.89

产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)			
其中: 1.基金申购款	384,783,203.58	147,536,681.57	532,319,885.15
2.基金赎回款	-476,155,773.43	-166,317,055.61	-642,472,829.04
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)	54,247,720.09	49,040,733.26	103,288,453.35
项目	上年度可比期间		
	2019年1月1日至2019年12月31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)	799,788,986.43	-64,703,767.49	735,085,218.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	37,192,174.17	37,192,174.17
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)	-654,168,696.49	43,588,121.67	-610,580,574.82
其中: 1.基金申购款	211,605,570.58	-7,210,516.28	204,395,054.30
2.基金赎回款	-865,774,267.07	50,798,637.95	-814,975,629.12
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	145,620,289.94	16,076,528.35	161,696,818.29

金净值)			
------	--	--	--

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：姚文强，主管会计工作负责人：刘盛，会计机构负责人：董霞

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金（以下简称本基金）由金鹰元和保本混合型证券投资基金第一个保本周期届满后转型而来。

金鹰元和保本混合型证券投资基金经中国证监会《关于核准金鹰元和保本混合型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2016]730 号）核准募集，基金管理人为金鹰基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

金鹰元和保本混合型证券投资基金自 2016 年 4 月 22 日至 2016 年 5 月 20 日进行公开募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理基金备案手续。经中国证监会书面确认，《金鹰元和保本混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 5 月 25 日生效。

金鹰元和保本混合型证券投资基金于 2018 年 5 月 25 日第一个保本周期到期，由于不符合保本基金存续条件，按照《金鹰元和保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，该基金保本周期到期后转型为非保本的混合型基金，名称相应变更为“金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金”。金鹰元和保本混合型证券投资基金的保本周期到期操作期间为保本周期到期日及之后 3 个工作日（含第 3 个工作日），即 2018 年 5 月 25 日至 2018 年 5 月 30 日。自 2018 年 5 月 31 日金鹰元和保本混合型证券投资基金正式转型为金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金，转型后的《金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自该日起生效。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会批准上市的股票）、债券（包括中小企业私募债）、中期票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金投资于股票资产的比例为基金资产的 0%-95%。每个交易日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金以及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则（以下简称“企业会计准则”）要求，并按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在会计核算和信息披露方面亦参考了中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及其发布的若干基金行业实务操作。

7.4.3 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及基金业协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 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策与上年度财务报表一致。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1. 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产包括股票投资、债券投资、资产支持证券和衍生工具投资等，其中股票投资、债券投资和资产支持证券在资产负债表中作为交易性金融资产列报，衍生工具投资在资产负债表中作为衍生金融资产列报。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

2. 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时全部划分为其他金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该等金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益；应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一的金融资产，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：(1)所转移金融资产的账面价值；(2)因转移而收到的对价。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。

1. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

(1) 股票投资

买入股票于交易日按股票的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

股票持有期间获得的股票股利(包括送红股和公积金转增股本)，于除息日按股权登记日持有的股数及送股或转增比例，计算确定增加的股票数量。

卖出股票于交易日确认股票投资收益。卖出股票按移动加权平均法结转成本。

(2) 债券投资

买入债券于交易日按债券的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益，上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

配售及认购新发行的分离交易可转换债券，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转换债券的认购成本进行分摊，确定应归属于债券部分的成本。

买入央行票据和零息债券视同到期一次还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率后，逐日确认债券利息收入。

卖出债券于交易日确认债券投资收益。卖出债券按移动加权平均法结转成本。

(3) 权证投资

买入权证于交易日按公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

获赠的权证(包括配股权证)，在除权日按照持有的股数及获赠比例，计算确定增加的权证数量，成本为零。

配售及认购新发行的分离交易可转换债券而取得的权证，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转换债券的认购成本进行分摊，确定应归属于权证部分的成本。

卖出权证于交易日确认权证投资收益。卖出权证的成本按移动加权平均法结转。

(4) 期货投资

期货投资于相关合同签署日以公允价值进行初始计量，并以公允价值进行后续计量，公允价值变动计入当期损益。因期货交易每日无负债结算确认的相关金融资产和金融负债，与相关的期货暂收暂付款之间抵销后的净额在资产负债表内列示。

(5) 资产支持证券

买入资产支持证券于交易日按资产支持证券的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益，上述公允价值不包含资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

卖出资产支持证券于交易日确认资产支持证券投资收益。卖出资产支持证券按移动加权平均法结转成本。

2. 贷款及应收款项

买入返售金融资产

买入返售金融资产为本基金按照返售协议约定先买入再按固定价格返售证券等金融资产所融出的资金。

买入返售金融资产按交易日应支付或实际支付的全部价款入账，相关交易费用计入初始确认金额。买入返售金融资产于返售日按账面余额结转。

3. 其他金融负债

卖出回购金融资产款

卖出回购金融资产款为本基金按照回购协议先卖出再按固定价格买入票据、证券等金融资产所融入的资金。

卖出回购金融资产款于交易日按照应收或实际收到的金额入账，相关交易费用计入初始确认金额。卖出回购金融资产款于回购日按账面余额结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负

债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

1. 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值；对于发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按照中国证监会或中国证券投资基金业协会的有关规定确定公允价值。

2. 对存在活跃市场的投资品种，如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

3. 当投资品种不再存在活跃市场，且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上，应采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和市价折扣法等。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

4. 对于交易所市场和银行间市场交易的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，采用第三方估值机构所提供的估值确定公允价值，另有规定的除外。

具体投资品种的估值方法如下：

(1) 股票投资

交易所上市流通的股票以其估值日在证券交易所挂牌的收盘价为公允价值。

对于长期停牌的股票，若其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，依据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期股票等流通受限股票，考虑估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值以及该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣的影响，采用市价折扣法确定公允价值。

首次公开发行但未上市的股票按采用估值技术确定的公允价值估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本计量。

(2) 债券投资

银行间和交易所市场上市交易的债券(另有规定除外)，采用第三方估值机构(中央国债登记结算公司或中证指数有限公司)提供的估值净价确定公允价值。

交易所市场上市交易的可转换债券按估值日收盘价减去收盘价中所含债券应收利息后的净价作为公允价值。

未上市或未挂牌转让的债券、以及在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(3) 权证投资

交易所上市流通的权证以其估值日在证券交易所上市的收盘价为公允价值。

首次公开发行但尚未上市的权证在上市交易前，采用估值技术确定公允价值，如估值技术难以可靠计量，则以成本计量。

配售及认购分离交易可转换债券所获得的权证自实际取得日至在交易所上市交易前，采用估值技术确定公允价值。如估值技术难以可靠计量，则按成本计量。

因持有股票而享有的配股权，以及停止交易但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

如有确凿证据表明按上述方法不能客观反映交易性金融工具的公允价值，基金管理人将根据具体情况与基金托管人商定后确定最能反映公允价值的价格。

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次的输入值确定公允价值计量层次。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。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金

份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并全额转入“未分配利润 / (累计亏损)”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

1. 利息收入

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

(2) 除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率后，逐日确认债券利息收入。

(3) 买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

(4) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提。

2. 投资收益

(1) 股票投资收益于交易日按卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

(2) 债券投资收益于交易日按卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

(3) 资产支持证券投资收益于交易日按卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

(4) 衍生工具投资收益于交易日按交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

(5) 股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

3. 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产/负债卖出或到期时转出计入投资收益。

7.4.4.10 费用的确认和计量

- 1、本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 $\times 1.20\%$ 的年费率逐日计提；
- 2、本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 $\times 0.20\%$ 的年费率逐日计提；
- 3、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.6% 年费率逐日计提；
- 4、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。
- 5、卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

- 1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10% ，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- 2、本基金收益分配方式：
 - (1) 保本周期内：仅采取现金分红一种收益分配方式，不进行红利再投资。本基金红利分配时发生的银行转账或其他手续费用由投资者承担，若投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将投资者的现金红利按除权后单位净值自动转为基金份额，由此获得的基金份额，视同申购，不适用于保本条款；
 - (2) 转型后：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。
- 3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- 4、本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可供分配利润可能有所不同。本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权；
- 5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。基金管理人在履行适当程序后，将对上述基金收益分配政策进行调整。

7.4.4.12分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

7.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1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。

7.4.5.2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。

7.4.5.3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。

7.4.6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；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。2018年1月1日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以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。对资管产品在2018年1月1日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。
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. 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得

税的应纳税所得额：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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。

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. 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

7. 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	24,259,392.74	1,331,398.97
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	24,259,392.74	1,331,398.97

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日

		成本	公允价值	公允价值变动
股票		58,341,781.80	85,188,249.41	26,846,467.61
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		58,341,781.80	85,188,249.41	26,846,467.61
项目		上年度末		
		2019 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		106,975,820.89	126,167,725.84	19,191,904.95
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	10,799,189.90	10,810,101.20	10,911.30
	银行间市场	-	-	-
	合计	10,799,189.90	10,810,101.20	10,911.30
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		117,775,010.79	136,977,827.04	19,202,816.25

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期内及上年度可比期间未投资金融衍生资产及负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期及上年度末均无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期及上年度均未进行买断式逆回购。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,255.78	2,552.57
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	5.00	168.80
应收债券利息	-	213,655.82
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	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	62.10	70.80
合计	1,322.88	216,447.99

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	78,413.70	329,269.55
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	78,413.70	329,269.55

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	190.90	0.45
应付证券出借违约金	-	-
应付转出补差费	215.53	-
审计费用	23,000.00	53,000.00
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00
合计	143,406.43	173,000.45

7.4.7.9 实收基金

金鹰元和混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2020年1月1日至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	101,831,172.42	101,831,172.42
本期申购	172,942,152.87	172,942,152.87
本期赎回（以“-”号填列）	-246,578,666.30	-246,578,666.30
本期末	28,194,658.99	28,194,658.99

金鹰元和混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2020年1月1日至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	43,789,117.52	43,789,117.52
本期申购	211,841,050.71	211,841,050.71
本期赎回（以“-”号填列）	-229,577,107.13	-229,577,107.13
本期末	26,053,061.10	26,053,061.10

7.4.7.10 未分配利润

金鹰元和混合 A

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	1,058,516.50	10,638,662.20	11,697,178.70
本期利润	31,660,777.76	-2,161,342.54	29,499,435.22
本期基金份额交易产生的变动数	-18,484,436.06	3,274,323.52	-15,210,112.54
其中：基金申购款	10,476,478.77	62,320,840.90	72,797,319.67
基金赎回款	-28,960,914.83	-59,046,517.38	-88,007,432.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,234,858.20	11,751,643.18	25,986,501.38

金鹰元和混合 C

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	-140,606.08	4,519,955.73	4,379,349.65
本期利润	12,440,149.83	9,804,993.90	22,245,143.73
本期基金份额交易产生的变动数	63,892.38	-3,634,153.88	-3,570,261.50
其中：基金申购款	12,369,210.56	62,370,151.34	74,739,361.90
基金赎回款	-12,305,318.18	-66,004,305.22	-78,309,623.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,363,436.13	10,690,795.75	23,054,231.88

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	69,289.98	566,227.82
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	17,757.63	168,320.23
其他	4,870.40	12,331.89
合计	91,918.01	746,879.94

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出股票成交总额	1,484,799,552.10	1,973,983,030.05
减：卖出股票成本总额	1,435,603,265.77	1,948,786,472.16
买卖股票差价收入	49,196,286.33	25,196,557.89

7.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间未投资基金。

7.4.7.14 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	16,651,987.90	51,884,091.23
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	16,183,872.60	50,211,021.50
减：应收利息总额	470,359.47	1,750,471.23
买卖债券差价收入	-2,244.17	-77,401.50

7.4.7.15 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间均未投资资产支持证券。

7.4.7.16 贵金属投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间均未投资贵金属。

7.4.7.17 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均未投资衍生工具。

7.4.7.18 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	925,605.11	1,273,271.75
其中：证券出借权益补偿收入	-	-

基金投资产生的股利收益	-	-
合计	925,605.11	1,273,271.75

7.4.7.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
1.交易性金融资产	7,643,651.36	19,095,657.75
——股票投资	7,654,562.66	19,199,724.95
——债券投资	-10,911.30	-104,067.20
——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	7,643,651.36	19,095,657.75

7.4.7.20 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
基金赎回费收入	1,706,273.80	331,524.29
转换费收入	6,833.35	109.59
合计	1,713,107.15	331,633.88

7.4.7.21 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日

交易所市场交易费用	4,220,115.46	5,884,623.54
银行间市场交易费用	-	-125.00
合计	4,220,115.46	5,884,498.54

7.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
审计费用	-5,000.00	37,100.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	7,536.42	6,654.25
帐户维护费	36,600.00	36,000.00
其他	600.00	1,200.00
合计	159,736.42	200,954.25

7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金并无需要作披露的或有事项。

7.4.8.2资产负债表日后事项

截止本财务报告批准报出日，本基金无需用披露的重大资产负债表日后事项。

7.4.9关联方关系

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
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
广州越秀金融控股集团股份有限公司	基金管理人股东
广州金鹰资产管理有限公司	基金管理人子公司
广州白云山医药集团股份有限公司	基金管理人股东
东旭集团有限公司	基金管理人股东

注：经基金管理人 2019 年第一次临时股东会审议通过，并经中国证券监督管理委员会批复核准（证监许可[2019]2306），基金管理人原股东中信证券华南股份有限公司(原广州证券股份有限公司)将其持有的本公司 24.01%股权转让给广州越秀金融控股集团股份有限公司。本次股权转让后，基金管理人股权结构变更为：东旭集团有限公司 66.19%，广州越秀金融控股集团股份有限公司 24.01%，广州白云山医药集团股份有限公司 9.80%。基金管理人已完成股权变更事项的工商变更登记。上述

事项已于 2020 年 1 月 4 日在证监会规定媒介披露。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总额的 比例
中信证券华南股份有限公司	-	-	295,412,590.65	7.37%

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方进行债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的 比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的 比例
中信证券华南股份有限公司	-	-	1,193,900,000.00	9.49%

注：本基金上年度可比期间未通过关联方进行债券回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日

	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
中信证券华南股份有 限公司	269,207.53	7.65%	-	-

注：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、经手费和适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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月 31日	2019年1月1日至2019年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,813,982.19	4,704,088.49
其中：支付销售机构的客户维护费	703,075.98	512,339.49

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月	2019年1月1日至2019年12月

	31日	31日
当期发生的基金应支付的托管费	375,197.60	627,211.80

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	金鹰元和混合 A	金鹰元和混合 C	合计
金鹰基金管理有限公司	-	112,947.87	112,947.87
工商银行股份有限公司	-	60,790.89	60,790.89
合计	-	173,738.76	173,738.76
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	金鹰元和混合 A	金鹰元和混合 C	合计
工商银行股份有限公司	-	77,254.78	77,254.78
金鹰基金管理有限公司	-	60,573.63	60,573.63
合计	-	137,828.41	137,828.41

注：本基金 C 类基金份额的销售服务年费 0.6% 的年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的 C 类基金份额的销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

C 类基金份额的销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支

取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（回购）交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未参与转融通出借业务。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未参与转融通出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.10.5.2 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

金鹰元和混合 A

本基金本报告期无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

金鹰元和混合 C

本基金本报告期无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.6 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	
	2020年1月1日至2020年12月31日		2019年1月1日至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	24,259,392.74	69,289.98	1,331,398.97	566,227.82

注：本基金清算备付金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算公司等结算账户；本报告期内清算备付金余额 11,180.31 元，清算备付金利息收入 17,757.63 元；上年度末清算备付金余额 375,136.67 元，清算备付金利息收入 168,320.23 元。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 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

本基金本报告期内及上年度可比期间未投资基金。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2020 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300860	锋尚文化	2020-08-06	2021-02-24	网下配售锁定	138.02	126.67	70.00	9,661.40	8,866.90	网下配售锁定
300869	康泰医学	2020-08-12	2021-02-24	网下配售锁定	10.16	110.88	862.00	8,757.92	95,578.56	网下配售锁定
300864	南大环境	2020-08-13	2021-02-24	网下配售锁定	71.71	90.85	95.00	6,812.45	8,630.75	网下配售锁定
688060	云涌科技	2020-07-03	2021-01-11	网下配售锁定	44.47	81.69	2,160.00	96,055.20	176,450.40	网下配售锁定
688330	宏力达	2020-09-28	2021-04-15	网下配售锁定	88.23	75.87	473.00	41,732.79	35,886.51	网下配售锁定
300887	谱尼	2020-09-09	2021-03-16	网下	44.47	74.52	109.00	4,847.23	8,122.68	网

	测试			配售 锁定						下 配 售 锁 定
601995	中金 公司	2020-10-22	2021-05-06	网下 配售 锁定	28.78	68.71	24,951.00	718,089.78	1,714,383.2 1	网 下 配 售 锁 定
300892	品渥 食品	2020-09-11	2021-03-24	网下 配售 锁定	26.66	60.01	162.00	4,318.92	9,721.62	网 下 配 售 锁 定
300861	美畅 股份	2020-08-06	2021-02-24	网下 配售 锁定	43.76	51.10	215.00	9,408.40	10,986.50	网 下 配 售 锁 定
300877	金春 股份	2020-08-17	2021-02-24	网下 配售 锁定	30.54	50.85	307.00	9,375.78	15,610.95	网 下 配 售 锁 定
300890	翔丰 华	2020-09-10	2021-03-17	网下 配售 锁定	14.69	48.85	286.00	4,201.34	13,971.10	网 下 配 售 锁 定
300878	维康 药业	2020-08-17	2021-02-24	网下 配售 锁定	41.34	48.72	229.00	9,466.86	11,156.88	网 下 配 售 锁 定
300886	华业 香料	2020-09-08	2021-03-16	网下 配售 锁定	18.59	45.67	147.00	2,732.73	6,713.49	网 下 配 售

										锁定
300895	铜牛信息	2020-09-17	2021-03-24	网下配售锁定	12.65	45.30	283.00	3,579.95	12,819.90	网下配售锁定
300868	杰美特	2020-08-12	2021-02-24	网下配售锁定	41.26	43.28	216.00	8,912.16	9,348.48	网下配售锁定
300873	海晨股份	2020-08-14	2021-02-24	网下配售锁定	30.72	41.32	238.00	7,311.36	9,834.16	网下配售锁定
300871	回盛生物	2020-08-13	2021-02-24	网下配售锁定	33.61	38.70	336.00	11,292.96	13,003.20	网下配售锁定
300872	天阳科技	2020-08-14	2021-02-24	网下配售锁定	21.34	37.84	373.00	7,959.82	14,114.32	网下配售锁定
300876	蒙泰高新	2020-08-14	2021-02-24	网下配售锁定	20.09	36.62	350.00	7,031.50	12,817.00	网下配售锁定
300893	松原股份	2020-09-17	2021-03-24	网下配售锁定	13.47	35.08	276.00	3,717.72	9,682.08	网下配售锁定
300881	盛德	2020-08-25	2021-03-01	网下	14.17	32.31	291.00	4,123.47	9,402.21	网

	鑫泰			配售 锁定						下 配 售 锁 定
300889	爱克 股份	2020-09-09	2021-03-16	网下 配售 锁定	27.97	30.12	214.00	5,985.58	6,445.68	网 下 配 售 锁 定
300879	大叶 股份	2020-08-25	2021-03-01	网下 配售 锁定	10.58	27.12	466.00	4,930.28	12,637.92	网 下 配 售 锁 定
300882	万胜 智能	2020-08-27	2021-03-10	网下 配售 锁定	10.33	25.79	440.00	4,545.20	11,347.60	网 下 配 售 锁 定
605277	新亚 电子	2020-12-25	2021-01-06	网下 新股 申购	16.95	16.95	507.00	8,593.65	8,593.65	网 下 新 股 待 上 市
300891	惠云 钛业	2020-09-10	2021-03-17	网下 配售 锁定	3.64	16.40	1,143.00	4,160.52	18,745.20	网 下 配 售 锁 定
003031	中瓷 电子	2020-12-24	2021-01-04	网下 新股 申购	15.27	15.27	387.00	5,909.49	5,909.49	网 下 新 股 待 上 市
003030	祖名 股份	2020-12-25	2021-01-06	网下 新股	15.18	15.18	480.00	7,286.40	7,286.40	网 下

				申购						新股待上市
688585	上纬新材	2020-09-21	2021-03-29	网下配售锁定	2.49	12.51	4,922.00	12,255.78	61,574.22	网下配售锁定

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期内及上年度可比期间未参与转融通出借业务。

7.4.13 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。

7.4.13.1 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；对公司各部门业务流程的遵守合规性和有效性的检查、监督、评价及建议等。

7.4.13.2 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。

7.4.13.2.1 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 2020年12月31日	上年度末 2019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：本统计数据未包含国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债和同业存单。

7.4.13.2.2 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 2020年12月31日	上年度末 2019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

7.4.13.2.3 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 2020年12月31日	上年度末 2019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

7.4.13.2.4 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 2020年12月31日	上年度末 2019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、地方政府债和同业存单。

7.4.13.2.5 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 2020年12月31日	上年度末 2019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

7.4.13.2.6 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 2020年12月31日	上年度末 2019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

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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进行管理，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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020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	24,259,392.74	-	-	-	-	-	-	-	-	24,259,392.74
结算备付金	11,180.31	-	-	-	-	-	-	-	-	11,180.31
存出保证金	138,097.98	-	-	-	-	-	-	-	-	138,097.98
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	85,188,249.41	85,188,249.41
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	1,322.88	1,322.88
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	775,010.18	775,010.18
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	24,408,671.03	-	-	-	-	-	-	-	85,964,582.47	110,373,253.50
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	-	-	-	-	-	-	-	-	5,055.46	5,055.46	
									1.54	1.54	
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	1,679.23	1,679.23	
									4.89	4.89	
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	98,318.56	98,318.56	
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	13,109.14	13,109.14	
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-	-	16,855.89	16,855.89	
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	78,413.70	78,413.70	
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
应付利润	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	143,406.43	143,406.43	
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	7,084.80	7,084.80	
									0.15	0.15	
利率敏感度缺口	24,408.67								78,879.78	103,288.45	
	71.03								82.32	453.35	
上年度末	1 个月	1-3	6 个月	3 个月	6 个月	1 年以	1-5 年	5 年以	不计息	合计	
2019 年 12 月 31 日	以内	个月	以内	-1 年	-1 年	内		上			
资产											
银行存款	1,331,398.97	-	-	-	-	-	-	-	-	1,331,398.97	
结算备付金	375,136.67	-	-	-	-	-	-	-	-	375,136.67	
存出保证金	157,273.63	-	-	-	-	-	-	-	-	157,273.63	
交易性金融资产	7,504,500.00	-	-	-	-	3,305,601.20	-	-	126,167.725.84	136,977,827.04	
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	-216,447.	216,447.	

									99	99
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	24,541,833.71	24,541,833.71
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	9,368,309.27	-	-	-	-	3,305,601.20	-	-	150,926,007.54	163,599,918.01
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	-	-	-	-	-	-	-	-	1,132,724.00	1,132,724.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	213,905.67	213,905.67
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	28,520.74	28,520.74
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-	-	25,679.31	25,679.31
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	329,269.55	329,269.55
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	173,000.45	173,000.45
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	1,903,099.72	1,903,099.72
利率敏感度缺口	9,368,309.27	-	-	-	-	3,305,601.20	-	-	149,022,907.82	161,696,818.29

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他变量不变，只有利率变动通过债券公允价值变动对基金资产净值产生影响。		
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 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	利率上升 25 个基点	-	-5,633.93
	利率下降 25 个基点	-	5,661.91

注：本基金本年度末未持有债券投资组合。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	85,188,249.41	82.48	126,167,725.84	78.03
交易性金融资产—债券投资	-	-	10,810,101.20	6.69
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	85,188,249.41	82.48	136,977,827.04	84.71

注：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，主要涉及股票、可转债、可交换债、权证等交易性金

融资产。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

金鹰元和混合 A

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 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	业绩比较基准变动+5%	5,107,465.73	6,567,899.64
业绩比较基准变动-5%	-5,107,465.73	-6,567,899.64	

金鹰元和混合 C

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 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	业绩比较基准变动+5%	4,629,736.76	2,787,932.29
业绩比较基准变动-5%	-4,629,736.76	-2,787,932.29	

7.4.14 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 2020 年 12 月 31 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 82,848,608.35 元，第二层级的余额为 2,339,641.06 元，无属于第三层级的金额。

于 2019 年 12 月 31 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 118,232,702.37 元，第二层级的余额为 18,745,124.67 元，无属于第三层级的金额。

(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。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	85,188,249.41	77.18
	其中：股票	85,188,249.41	77.18
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	24,270,573.05	21.99
8	其他各项资产	914,431.04	0.83
9	合计	110,373,253.50	100.00

注：其他各项资产包括：存出保证金、应收利息（股利）、应收证券清算款、应收申购款、待摊费用、其他应收款。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
----	------	---------	---------------

A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	83,058,716.44	80.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,465.06	0.02
E	建筑业	12,541.34	0.01
F	批发和零售业	47,089.83	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	9,834.16	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	274,245.40	0.27
J	金融业	1,723,081.21	1.67
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	21,560.12	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	13,848.95	0.01
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	8,866.90	0.01
S	综合	-	-
	合计	85,188,249.41	82.48

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期内未投资港股通股票。

8.3 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	300274	阳光电源	110,306	7,972,917.68	7.72
2	002812	恩捷股份	46,700	6,621,126.00	6.41
3	601012	隆基股份	67,500	6,223,500.00	6.03

4	002459	晶澳科技	143,600	5,847,392.00	5.66
5	300750	宁德时代	16,300	5,723,093.00	5.54
6	002594	比亚迪	29,000	5,634,700.00	5.46
7	000568	泸州老窖	24,900	5,631,384.00	5.45
8	002709	天赐材料	52,400	5,439,120.00	5.27
9	688005	容百科技	99,858	5,146,681.32	4.98
10	300207	欣旺达	166,700	5,119,357.00	4.96
11	600519	贵州茅台	2,400	4,795,200.00	4.64
12	300769	德方纳米	25,800	4,313,760.00	4.18
13	603915	国茂股份	147,400	3,917,892.00	3.79
14	002340	格林美	451,800	3,158,082.00	3.06
15	600089	特变电工	310,700	3,153,605.00	3.05
16	600176	中国巨石	157,100	3,135,716.00	3.04
17	601995	中金公司	24,951	1,714,383.21	1.66
18	688060	云涌科技	2,160	176,450.40	0.17
19	688595	芯海科技	1,595	103,467.65	0.10
20	300869	康泰医学	862	95,578.56	0.09
21	605111	新洁能	435	85,059.90	0.08
22	605358	立昂微	693	83,437.20	0.08
23	688585	上纬新材	4,922	61,574.22	0.06
24	003009	中天火箭	623	45,416.70	0.04
25	605338	巴比食品	1,012	38,213.12	0.04
26	688330	宏力达	473	35,886.51	0.03
27	003022	联泓新科	2,304	35,665.92	0.03
28	003012	东鹏控股	2,278	32,803.20	0.03
29	003021	兆威机电	425	30,226.00	0.03
30	605136	丽人丽妆	867	24,510.09	0.02
31	601686	友发集团	1,899	23,509.62	0.02
32	605068	明新旭腾	641	21,095.31	0.02
33	003005	竞业达	412	20,406.36	0.02
34	605336	帅丰电器	701	19,880.36	0.02
35	605099	共创草坪	624	19,375.20	0.02
36	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.02
37	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.02
38	605169	洪通燃气	731	18,465.06	0.02
39	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.02
40	003010	若羽臣	562	17,837.88	0.02
41	003006	百亚股份	704	17,705.60	0.02
42	605186	健麾信息	626	17,609.38	0.02
43	003015	日久光电	1,128	16,818.48	0.02
44	003016	欣贺股份	1,681	15,784.59	0.02
45	688012	中微公司	100	15,759.00	0.02
46	300877	金春股份	307	15,610.95	0.02
47	605177	东亚药业	439	15,584.50	0.02

48	605500	森林包装	762	14,980.92	0.01
49	605377	华旺科技	750	14,977.50	0.01
50	300122	智飞生物	100	14,791.00	0.01
51	605007	五洲特纸	598	14,465.62	0.01
52	300872	天阳科技	373	14,114.32	0.01
53	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.01
54	003013	地铁设计	724	13,437.44	0.01
55	605058	澳弘电子	548	13,168.44	0.01
56	300871	回盛生物	336	13,003.20	0.01
57	003020	立方制药	374	12,858.12	0.01
58	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.01
59	300876	蒙泰高新	350	12,817.00	0.01
60	003018	金富科技	1,027	12,806.69	0.01
61	300879	大叶股份	466	12,637.92	0.01
62	605183	确成股份	741	12,567.36	0.01
63	003001	中岩大地	406	12,541.34	0.01
64	002998	优彩资源	1,353	12,528.78	0.01
65	605258	协和电子	340	12,420.20	0.01
66	605179	一鸣食品	699	12,344.34	0.01
67	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.01
68	003023	彩虹集团	296	11,262.80	0.01
69	300878	维康药业	229	11,156.88	0.01
70	300861	美畅股份	215	10,986.50	0.01
71	003025	思进智能	304	10,728.16	0.01
72	605155	西大门	350	10,668.00	0.01
73	605018	长华股份	840	10,416.00	0.01
74	003004	声迅股份	306	9,984.78	0.01
75	300873	海晨股份	238	9,834.16	0.01
76	300892	品渥食品	162	9,721.62	0.01
77	300893	松原股份	276	9,682.08	0.01
78	300881	盛德鑫泰	291	9,402.21	0.01
79	300868	杰美特	216	9,348.48	0.01
80	605299	舒华体育	738	9,335.70	0.01
81	300860	锋尚文化	70	8,866.90	0.01
82	601318	中国平安	100	8,698.00	0.01
83	300864	南大环境	95	8,630.75	0.01
84	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.01
85	300887	谱尼测试	109	8,122.68	0.01
86	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.01
87	300886	华业香料	147	6,713.49	0.01
88	300889	爱克股份	214	6,445.68	0.01
89	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.01
90	003027	同兴环保	130	5,218.20	0.01
91	688088	虹软科技	56	3,915.52	0.00

92	002241	歌尔股份	100	3,732.00	0.00
93	603960	克来机电	40	1,878.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	300782	卓胜微	34,691,243.86	21.45
2	300661	圣邦股份	31,740,562.14	19.63
3	002007	华兰生物	27,064,599.98	16.74
4	603019	中科曙光	24,926,009.16	15.42
5	688058	宝兰德	23,396,935.83	14.47
6	002460	赣锋锂业	20,569,257.34	12.72
7	300482	万孚生物	20,379,500.60	12.60
8	000799	酒鬼酒	19,445,549.75	12.03
9	603258	电魂网络	18,529,095.00	11.46
10	002131	利欧股份	17,898,266.30	11.07
11	002475	立讯精密	17,689,953.00	10.94
12	002850	科达利	17,190,387.52	10.63
13	300677	英科医疗	15,411,466.02	9.53
14	688111	金山办公	15,216,951.03	9.41
15	603986	兆易创新	14,992,357.00	9.27
16	300750	宁德时代	14,849,093.04	9.18
17	300171	东富龙	14,656,518.00	9.06
18	603456	九洲药业	14,551,471.00	9.00
19	601865	福莱特	14,442,651.18	8.93
20	688023	安恒信息	14,316,200.89	8.85
21	688021	奥福环保	14,219,657.05	8.79
22	603236	移远通信	13,148,388.00	8.13
23	600519	贵州茅台	13,050,810.75	8.07
24	300601	康泰生物	13,041,198.35	8.07
25	688018	乐鑫科技	12,576,206.99	7.78
26	300014	亿纬锂能	12,235,834.97	7.57
27	002065	东华软件	11,865,763.00	7.34
28	300676	华大基因	11,809,739.00	7.30
29	300816	艾可蓝	11,759,355.00	7.27
30	002126	银轮股份	11,707,254.00	7.24
31	300433	蓝思科技	11,699,281.87	7.24
32	300529	健帆生物	11,694,633.40	7.23

33	002916	深南电路	11,331,685.00	7.01
34	601689	拓普集团	11,298,768.52	6.99
35	002156	通富微电	11,165,974.48	6.91
36	000596	古井贡酒	11,067,307.22	6.84
37	002384	东山精密	10,996,747.00	6.80
38	600038	中直股份	10,904,821.84	6.74
39	002635	安洁科技	10,865,213.05	6.72
40	300679	电连技术	10,405,148.00	6.43
41	002241	歌尔股份	10,398,703.00	6.43
42	603501	韦尔股份	10,393,784.90	6.43
43	002456	欧菲光	10,365,238.62	6.41
44	002920	德赛西威	10,108,783.48	6.25
45	300590	移为通信	9,689,484.00	5.99
46	002912	中新赛克	9,549,175.72	5.91
47	300454	深信服	9,539,250.00	5.90
48	603538	美诺华	9,491,982.00	5.87
49	603005	晶方科技	9,462,097.00	5.85
50	688288	鸿泉物联	9,454,892.58	5.85
51	300659	中孚信息	9,247,960.00	5.72
52	300724	捷佳伟创	9,219,886.00	5.70
53	002497	雅化集团	9,135,579.00	5.65
54	002212	天融信	8,917,083.00	5.51
55	300503	昊志机电	8,843,181.90	5.47
56	300598	诚迈科技	8,790,661.60	5.44
57	002371	北方华创	8,680,726.00	5.37
58	688116	天奈科技	8,584,686.73	5.31
59	300379	东方通	8,489,399.00	5.25
60	688019	安集科技	8,387,835.27	5.19
61	002239	奥特佳	8,309,758.00	5.14
62	000756	新华制药	8,272,276.92	5.12
63	300682	朗新科技	8,229,397.00	5.09
64	300832	新产业	8,122,101.98	5.02
65	603697	有友食品	7,945,772.00	4.91
66	601696	中银证券	7,825,277.31	4.84
67	002332	仙琚制药	7,544,745.50	4.67
68	000786	北新建材	7,405,187.00	4.58
69	002317	众生药业	7,369,564.00	4.56
70	300246	宝莱特	7,203,141.40	4.45
71	300674	宇信科技	7,144,357.00	4.42
72	600298	安琪酵母	7,104,707.00	4.39
73	000034	神州数码	6,977,220.00	4.32
74	603290	斯达半导	6,972,329.44	4.31
75	600055	万东医疗	6,859,928.20	4.24
76	688008	澜起科技	6,853,651.47	4.24

77	688166	博瑞医药	6,797,766.42	4.20
78	000568	泸州老窖	6,656,893.00	4.12
79	000830	鲁西化工	6,624,992.00	4.10
80	002812	恩捷股份	6,571,673.00	4.06
81	688037	芯源微	6,509,306.81	4.03
82	600176	中国巨石	6,502,619.98	4.02
83	300856	科思股份	6,453,609.52	3.99
84	300274	阳光电源	6,164,515.88	3.81
85	000516	国际医学	6,003,176.50	3.71
86	603305	旭升股份	5,981,500.56	3.70
87	300207	欣旺达	5,969,841.13	3.69
88	601012	隆基股份	5,727,949.00	3.54
89	000988	华工科技	5,719,238.00	3.54
90	300348	长亮科技	5,715,737.00	3.53
91	603920	世运电路	5,708,424.00	3.53
92	002821	凯莱英	5,689,587.00	3.52
93	002594	比亚迪	5,581,707.00	3.45
94	603809	豪能股份	5,514,292.12	3.41
95	002897	意华股份	5,513,695.20	3.41
96	000802	北京文化	5,509,032.00	3.41
97	000063	中兴通讯	5,504,570.00	3.40
98	600079	人福医药	5,496,564.00	3.40
99	002810	山东赫达	5,476,147.00	3.39
100	603915	国茂股份	5,427,019.91	3.36
101	600521	华海药业	5,350,226.00	3.31
102	300142	沃森生物	5,346,438.00	3.31
103	603608	天创时尚	5,303,680.00	3.28
104	002605	姚记科技	5,287,601.00	3.27
105	603008	喜临门	5,273,243.85	3.26
106	002970	锐明技术	5,242,891.00	3.24
107	300136	信维通信	5,234,909.00	3.24
108	603960	克来机电	5,185,085.45	3.21
109	603906	龙蟠科技	5,175,449.60	3.20
110	600196	复星医药	5,154,174.00	3.19
111	002717	岭南股份	5,143,437.00	3.18
112	002949	华阳国际	5,025,616.00	3.11
113	300085	银之杰	4,992,055.27	3.09
114	300501	海顺新材	4,935,342.98	3.05
115	688005	容百科技	4,808,234.76	2.97
116	300088	长信科技	4,726,102.00	2.92
117	603516	淳中科技	4,523,279.90	2.80
118	300346	南大光电	4,514,473.00	2.79
119	603317	天味食品	4,475,729.00	2.77
120	688122	西部超导	4,337,406.40	2.68

121	603026	石大胜华	4,332,606.00	2.68
122	300767	震安科技	4,321,390.00	2.67
123	002459	晶澳科技	4,295,771.00	2.66
124	688123	聚辰股份	4,231,131.61	2.62
125	600030	中信证券	4,208,464.00	2.60
126	300624	万兴科技	4,142,876.00	2.56
127	603369	今世缘	4,137,293.50	2.56
128	002683	宏大爆破	4,130,472.00	2.55
129	300033	同花顺	4,092,846.00	2.53
130	603995	甬金股份	4,057,167.40	2.51
131	600480	凌云股份	4,033,173.56	2.49
132	688298	东方生物	3,935,838.24	2.43
133	002236	大华股份	3,935,378.00	2.43
134	688012	中微公司	3,877,663.30	2.40
135	300463	迈克生物	3,808,429.00	2.36
136	603363	傲农生物	3,646,078.00	2.25
137	002714	牧原股份	3,638,554.00	2.25
138	603392	万泰生物	3,620,197.75	2.24
139	600546	山煤国际	3,510,994.00	2.17
140	300740	御家汇	3,437,101.90	2.13
141	688318	财富趋势	3,435,320.47	2.12
142	600703	三安光电	3,434,351.00	2.12
143	300769	德方纳米	3,385,620.40	2.09
144	603919	金徽酒	3,368,112.70	2.08
145	002026	山东威达	3,358,960.93	2.08
146	002709	天赐材料	3,340,593.40	2.07

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	300661	圣邦股份	38,505,978.54	23.81
2	603986	兆易创新	31,169,275.20	19.28
3	300598	诚迈科技	30,865,666.40	19.09
4	300782	卓胜微	29,756,872.70	18.40
5	002007	华兰生物	28,587,593.09	17.68
6	002371	北方华创	27,234,911.69	16.84
7	002475	立讯精密	25,288,755.12	15.64
8	603019	中科曙光	25,256,047.23	15.62
9	000799	酒鬼酒	24,506,684.51	15.16
10	300750	宁德时代	23,683,651.20	14.65

11	688111	金山办公	22,037,763.61	13.63
12	002460	赣锋锂业	21,824,947.11	13.50
13	603501	韦尔股份	21,486,176.00	13.29
14	300482	万孚生物	20,420,739.58	12.63
15	603258	电魂网络	19,043,936.38	11.78
16	688058	宝兰德	18,923,213.58	11.70
17	300601	康泰生物	18,685,970.09	11.56
18	002850	科达利	17,751,171.50	10.98
19	300677	英科医疗	17,722,751.15	10.96
20	002131	利欧股份	16,443,588.43	10.17
21	688021	奥福环保	15,981,636.40	9.88
22	688023	安恒信息	15,775,464.46	9.76
23	300433	蓝思科技	15,594,777.11	9.64
24	300171	东富龙	15,241,327.56	9.43
25	601865	福莱特	15,127,970.46	9.36
26	603005	晶方科技	14,035,334.00	8.68
27	300014	亿纬锂能	13,894,107.77	8.59
28	603456	九洲药业	13,730,118.00	8.49
29	300816	艾可蓝	13,675,284.00	8.46
30	002126	银轮股份	13,545,996.90	8.38
31	002156	通富微电	13,098,066.90	8.10
32	002456	欧菲光	13,090,309.27	8.10
33	603236	移远通信	12,789,598.00	7.91
34	688018	乐鑫科技	12,288,979.92	7.60
35	300676	华大基因	12,152,813.00	7.52
36	600640	号百控股	11,945,628.00	7.39
37	300529	健帆生物	11,924,369.32	7.37
38	600519	贵州茅台	11,704,278.00	7.24
39	601689	拓普集团	11,703,053.40	7.24
40	600703	三安光电	11,553,977.64	7.15
41	000596	古井贡酒	11,406,485.20	7.05
42	002920	德赛西威	11,152,445.80	6.90
43	002065	东华软件	10,822,288.00	6.69
44	002384	东山精密	10,740,506.89	6.64
45	002912	中新赛克	10,271,913.49	6.35
46	600038	中直股份	10,030,319.00	6.20
47	688019	安集科技	9,645,353.99	5.97
48	002497	雅化集团	9,274,283.68	5.74
49	002241	歌尔股份	8,762,960.00	5.42
50	300503	昊志机电	8,713,889.97	5.39
51	688012	中微公司	8,713,724.27	5.39
52	002635	安洁科技	8,698,777.40	5.38
53	002916	深南电路	8,634,163.00	5.34
54	300679	电连技术	8,379,858.36	5.18

55	300659	中孚信息	8,358,134.16	5.17
56	603538	美诺华	8,064,396.00	4.99
57	300832	新产业	7,873,516.00	4.87
58	603697	有友食品	7,862,251.00	4.86
59	688288	鸿泉物联	7,731,206.71	4.78
60	600055	万东医疗	7,585,427.00	4.69
61	300454	深信服	7,571,521.00	4.68
62	601696	中银证券	7,554,106.26	4.67
63	002332	仙琚制药	7,532,144.00	4.66
64	000756	新华制药	7,530,550.72	4.66
65	300246	宝莱特	7,484,163.00	4.63
66	600298	安琪酵母	7,459,586.92	4.61
67	300379	东方通	7,397,277.00	4.57
68	002317	众生药业	7,279,219.42	4.50
69	000786	北新建材	7,169,583.00	4.43
70	002605	姚记科技	7,162,410.00	4.43
71	300724	捷佳伟创	6,985,957.00	4.32
72	300033	同花顺	6,968,478.82	4.31
73	300590	移为通信	6,777,022.74	4.19
74	300674	宇信科技	6,752,711.00	4.18
75	002239	奥特佳	6,647,230.00	4.11
76	002212	天融信	6,614,834.00	4.09
77	300682	朗新科技	6,608,091.00	4.09
78	688116	天奈科技	6,462,634.55	4.00
79	603305	旭升股份	6,441,730.00	3.98
80	603290	斯达半导	6,404,219.15	3.96
81	300142	沃森生物	6,356,892.00	3.93
82	000034	神州数码	6,188,113.00	3.83
83	300856	科思股份	6,077,347.38	3.76
84	600570	恒生电子	6,006,798.18	3.71
85	000516	国际医学	5,979,051.12	3.70
86	688037	芯源微	5,884,941.78	3.64
87	000830	鲁西化工	5,796,195.00	3.58
88	600196	复星医药	5,791,521.00	3.58
89	300348	长亮科技	5,538,282.00	3.43
90	300085	银之杰	5,465,294.00	3.38
91	600079	人福医药	5,446,579.00	3.37
92	688008	澜起科技	5,390,232.08	3.33
93	002970	锐明技术	5,383,435.90	3.33
94	688166	博瑞医药	5,357,682.64	3.31
95	002810	山东赫达	5,350,057.40	3.31
96	300501	海顺新材	5,317,891.31	3.29
97	603809	豪能股份	5,305,865.00	3.28
98	002821	凯莱英	5,296,271.00	3.28

99	603920	世运电路	5,244,940.00	3.24
100	603906	龙蟠科技	5,227,337.80	3.23
101	603008	喜临门	5,181,763.10	3.20
102	002717	岭南股份	5,153,425.15	3.19
103	300274	阳光电源	5,146,565.69	3.18
104	603659	璞泰来	5,135,955.00	3.18
105	600521	华海药业	5,000,692.49	3.09
106	000063	中兴通讯	4,949,654.00	3.06
107	000988	华工科技	4,944,487.00	3.06
108	603608	天创时尚	4,932,351.40	3.05
109	600176	中国巨石	4,919,919.56	3.04
110	000802	北京文化	4,847,306.00	3.00
111	002897	意华股份	4,648,805.80	2.88
112	002949	华阳国际	4,634,872.00	2.87
113	002594	比亚迪	4,584,555.00	2.84
114	300088	长信科技	4,281,528.00	2.65
115	603960	克来机电	4,280,574.26	2.65
116	600546	山煤国际	4,126,470.00	2.55
117	300767	震安科技	4,090,073.00	2.53
118	603392	万泰生物	4,063,138.35	2.51
119	603317	天味食品	4,047,292.20	2.50
120	300136	信维通信	4,019,608.00	2.49
121	603516	淳中科技	3,961,701.60	2.45
122	002236	大华股份	3,910,576.28	2.42
123	603026	石大胜华	3,906,970.00	2.42
124	300463	迈克生物	3,901,375.00	2.41
125	688122	西部超导	3,882,683.91	2.40
126	688981	中芯国际	3,877,587.52	2.40
127	603995	甬金股份	3,859,290.06	2.39
128	002683	宏大爆破	3,850,466.00	2.38
129	603369	今世缘	3,789,972.80	2.34
130	688123	聚辰股份	3,746,662.73	2.32
131	688298	东方生物	3,746,308.31	2.32
132	000568	泸州老窖	3,715,629.00	2.30
133	600885	宏发股份	3,713,038.20	2.30
134	300346	南大光电	3,705,338.00	2.29
135	601658	邮储银行	3,680,190.36	2.28
136	002026	山东威达	3,622,564.00	2.24
137	300624	万兴科技	3,597,595.00	2.22
138	600480	凌云股份	3,574,823.40	2.21
139	600030	中信证券	3,537,627.00	2.19
140	002714	牧原股份	3,534,224.00	2.19
141	603919	金徽酒	3,341,891.09	2.07
142	603363	傲农生物	3,316,845.00	2.05

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,386,969,226.68
卖出股票收入（成交）总额	1,484,799,552.10

8.5 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持有债券。

8.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期内未投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.11.1 本期国债期货投资政策**

无。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

8.12 本报告期投资基金情况

8.12.1 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。

8.13 投资组合报告附注

8.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体之一的宁波容百科技新能源公司因未及时披露重大事项等行为，于 2020 年 4 月 13 日被中国证券监督管理委员会采取 1 年内不接受发行人公开发行证券相关文件的行政监督管理措施。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

8.13.2 报告期内基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.13.3 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	138,097.98
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,322.88
5	应收申购款	775,010.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	914,431.04

8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.13.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
金鹰元和混合 A	5,423	5,199.09	0.00	0.00%	28,194,658.99	100.00%
金鹰元和混合 C	5,479	4,755.08	632.27	0.00%	26,052,428.83	100.00%
合计	10,902	4,975.94	632.27	0.00%	54,247,087.82	100.00%

9.2 期末上市基金前十名持有人

本基金非上市基金。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	金鹰元和混合 A	0.00	0.00%
	金鹰元和混合 C	7,428.32	0.03%
	合计	7,428.32	0.01%

9.4 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情况

项目	份额级别	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	金鹰元和混合 A	0
	金鹰元和混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	金鹰元和混合 A	0
	金鹰元和混合 C	0

	合计	0
--	----	---

9.5 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金非发起式基金。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	金鹰元和混合 A	金鹰元和混合 C
本报告期期初基金份额总额	101,831,172.42	43,789,117.52
本报告期基金总申购份额	172,942,152.87	211,841,050.71
减：本报告期基金总赎回份额	246,578,666.30	229,577,107.13
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	28,194,658.99	26,053,061.10

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 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、本报告期，本基金管理人董事长、法定代表人、总经理、副总经理发生变动。2021 年 2 月 8 日，公司原督察长徐娇娇女士离任督察长，由公司总经理姚文强先生代行督察长职务。截至报告日，王铁先生担任公司董事长、法定代表人，姚文强先生担任公司总经理并代行督察长职务，刘盛先生担任公司副总经理及首席信息官职务。

2、本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 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。

11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金报告期内未持有基金。

11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金审计的会计师事务所为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），已为本基金提供 2 年审计服务。

本报告期内实际应支付会计师事务所的审计费为 23000 元。

11.7 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，基金管理人收到中国证券监督管理委员会广东监管局出具的行政监管措施，对公司提出整改要求，公司已按要求进行了整改。

本报告期内，未发现托管人及其高级管理人员存在受稽查或处罚的情况。

11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.8.1 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	
长江证券	1	416,829,305.59	14.58%	379,855.69	15.56%	-
天风证券	3	391,336,039.41	13.69%	356,625.12	14.61%	-
华融证券	4	312,415,549.94	10.93%	284,704.52	11.66%	-
五矿证券	2	268,146,853.26	9.38%	190,733.39	7.81%	-
新时代证券	3	178,812,203.47	6.26%	127,189.26	5.21%	-
东兴证券	2	144,963,739.60	5.07%	132,102.32	5.41%	-
华安证券	1	131,324,227.33	4.59%	93,410.83	3.83%	-
国金证券	1	124,732,791.40	4.36%	113,670.56	4.66%	-
申万宏源证券	2	115,277,904.91	4.03%	105,053.06	4.30%	-
国盛证券	2	114,296,661.92	4.00%	104,157.92	4.27%	-
国联证券	1	102,638,442.19	3.59%	73,007.49	2.99%	-
方正证券	2	99,929,653.63	3.50%	91,066.43	3.73%	-
东北证券	3	86,066,695.33	3.01%	78,432.72	3.21%	-
安信证券	2	84,637,568.83	2.96%	60,202.92	2.47%	-
东吴证券	2	84,561,549.66	2.96%	77,064.42	3.16%	-
民生证券	6	63,294,990.85	2.21%	57,680.57	2.36%	-
兴业证券	1	60,518,026.84	2.12%	55,150.15	2.26%	-

中信建投证券	3	24,680,279.00	0.86%	22,491.12	0.92%	-
开源证券	2	21,498,164.83	0.75%	15,291.49	0.63%	-
银河证券	2	12,792,404.00	0.45%	9,099.47	0.37%	-
西部证券	1	10,937,678.28	0.38%	7,780.05	0.32%	-
信达证券	2	5,641,587.69	0.20%	4,012.90	0.16%	-
首创证券	1	3,193,440.00	0.11%	2,271.62	0.09%	-

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；能根据基金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。

11.8.2 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
长江证券	4,525,215.80	83.21%	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	913,318.90	16.79%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

东北证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-

11.9 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基金参加中国工商银行 AI 投服务基金申购费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2020-01-02
2	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	证监会规定媒介	2020-01-02
3	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金参加中国工商银行“2020 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	证监会规定媒介	2020-01-02
4	金鹰基金高级管理人员变更公告	证监会规定媒介	2020-01-04
5	金鹰基金管理有限公司关于公司股权变更的公告	证监会规定媒介	2020-01-04
6	金鹰基金高级管理人员变更公告	证监会规定媒介	2020-01-04
7	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与万家财富基金销售(天津)有限公司定投及费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2020-01-09
8	金鹰基金改聘会计师事务所公告	证监会规定媒介	2020-01-14
9	金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金 2019 年四季度报告	证监会规定媒介	2020-01-21
10	金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金恢复（大额）申购（转换转入、赎回、转换转出、定期定额投资）公告	证监会规定媒介	2020-01-23
11	金鹰基金管理有限公司关于调整旗下基金产品 2020 年春节假期相关安排的提示性公告	证监会规定媒介	2020-01-30
12	金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金托管协议更新	证监会规定媒介	2020-02-17
13	金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金招募说明书摘要更新	证监会规定媒介	2020-02-17
14	金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金基金	证监会规定媒介	2020-02-17

	合同更新		
15	金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新	证监会规定媒介	2020-02-17
16	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订基金合同、托管协议的提示性公告	证监会规定媒介	2020-02-17
17	金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金修改基金合同的公告	证监会规定媒介	2020-02-17
18	金鹰基金管理有限公司关于董事变更的公告	证监会规定媒介	2020-03-11
19	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	证监会规定媒介	2020-03-13
20	金鹰基金管理有限公司关于董事会成员变更的公告	证监会规定媒介	2020-03-13
21	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	证监会规定媒介	2020-03-17
22	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国国际期货股份有限公司定投及费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2020-03-18
23	金鹰基金管理有限公司关于延期披露旗下基金 2019 年年度报告的公告	证监会规定媒介	2020-03-27
24	金鹰基金行业高级管理人员变更公告	证监会规定媒介	2020-03-28
25	金鹰基金管理有限公司关于网上交易系统升级暂停服务的公告	证监会规定媒介	2020-04-11
26	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	证监会规定媒介	2020-04-17
27	金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金 2020 年一季度报告	证监会规定媒介	2020-04-21
28	金鹰基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	证监会规定媒介	2020-04-21
29	金鹰基金管理有限公司董事长变更公告	证监会规定媒介	2020-04-24
30	金鹰基金管理有限公司关于新增中信证券华南股份有限公司为本公司旗下部分基金代销机构的公告	证监会规定媒介	2020-04-30
31	金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金 2019 年年度报告	证监会规定媒介	2020-04-30
32	金鹰关于公司法定代表人变更公告	证监会规定媒介	2020-05-06
33	金鹰关于网上交易系统升级暂停服务的公告	证监会规定媒介	2020-05-08
34	金鹰基金关于终止泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理相关销售业务的公告	证监会规定媒介	2020-05-11
35	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增深圳腾元基金销售有限公司为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	证监会规定媒介	2020-05-27
36	金鹰基金管理有限公司关于网上交易系统升级暂停服务的公告	证监会规定媒介	2020-05-29

37	金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	证监会规定媒介	2020-06-20
38	金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新	证监会规定媒介	2020-06-22
39	金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金招募说明书摘要更新	证监会规定媒介	2020-06-22
40	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定投手续费率优惠的公告	证监会规定媒介	2020-07-01
41	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增泛华普益基金销售有限公司为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	证监会规定媒介	2020-07-01
42	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	证监会规定媒介	2020-07-18
43	金鹰基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	证监会规定媒介	2020-07-18
44	金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金 2020 年二季度报告	证监会规定媒介	2020-07-18
45	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中信银行股份有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2020-08-03
46	金鹰基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新身份证件或者身份证明文件的公告	证监会规定媒介	2020-08-25
47	金鹰基金管理有限公司旗下全部基金产品资料概要提示性公告	证监会规定媒介	2020-08-27
48	金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要	证监会规定媒介	2020-08-27
49	金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金 2020 年中期报告	证监会规定媒介	2020-08-29
50	金鹰基金管理有限公司关于网上交易邮政储蓄银行支付渠道暂停服务的公告	证监会规定媒介	2020-09-02
51	金鹰基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	证监会规定媒介	2020-10-27
52	金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金 2020 年三季度报告	证监会规定媒介	2020-10-27
53	金鹰基金管理有限公司关于网上直销平台开通建设银行快捷支付业务的公告	证监会规定媒介	2020-10-29
54	金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	证监会规定媒介	2020-11-18
55	金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新	证监会规定媒介	2020-11-19
56	金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2020-11-20
57	金鹰基金管理有限公司关于董事变更的公告	证监会规定媒介	2020-11-27

58	金鹰基金管理有限公司直销中心电话号码变更的通知	证监会规定媒介	2020-11-30
59	金鹰基金关于终止深圳盈信基金销售有限公司等公司办理旗下基金销售业务及提醒投资者及时办理转托管的提示性公告	证监会规定媒介	2020-12-25
60	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金参与工商银行“2021 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	证监会规定媒介	2020-12-31
61	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金参与工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2020-12-31
62	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金参与工商银行 AI 投服基金申购费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2020-12-31
63	金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新	证监会规定媒介	2020-12-31

注：相关信息披露文件请登录本基金管理人网站查询。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过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	1	2020年8月21日至 2020年9月9日	0.00	22,943,785. 85	22,943,785. 85	0.00	0.00%
个人	1	2020年10月26日至 2020年11月23日	0.00	12,554,300. 06	12,554,300. 06	0.00	0.00%
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内，存在报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情形，可能会存在以下风险：</p> <p>1) 基金净值大幅波动的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，因巨额赎回、份额净值小数保留位数与方式、管理费及托管费等费用计提等原因，可能会导致基金份额净值出现大幅波动；</p> <p>2) 巨额赎回的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能触发本基金巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额；</p> <p>3) 流动性风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致本基金的流动性风险；</p> <p>4) 基金提前终止、转型或与其他基金合并的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，可能导致本基金面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

- 5) 基金规模过小导致的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。
- 6) 份额占比较高的投资者申购申请被拒绝的风险：当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金总份额的50%时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金总份额50%的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的50%，该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 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、《金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、《金鹰元和灵活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、中期报告、更新的招募说明书及其他临时公告。

13.2 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

13.3 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

二〇二一年三月三十日