

# 金鹰鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金

## 2021 年中期报告

### 2021 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：交通银行股份有限公司

送出日期：二〇二一年八月二十八日

## § 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。本中期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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 27 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 2021 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
1.2 目录	3
§ 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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
7.6 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	46
7.7 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	47
7.8 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	47
7.9 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	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47

7.12 本报告期投资基金情况 .....	48
7.13 投资组合报告附注 .....	48
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>49</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	49
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	50
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 .....	50
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	50
§9 开放式基金份额变动 .....	50
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>51</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	51
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 .....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	51
10.4 基金投资策略的改变 .....	51
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	51
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	51
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	52
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	52
10.9 其他重大事件 .....	55
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>56</b>
11.1 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 .....	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	57
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>57</b>
12.1 备查文件目录 .....	57
12.2 存放地点 .....	58
12.3 查阅方式 .....	58

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	金鹰鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	金鹰鑫瑞混合	
基金主代码	003502	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 12 月 6 日	
基金管理人	金鹰基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	355,990,894.60 份	
下属分级基金的基金简称	金鹰鑫瑞混合 A	金鹰鑫瑞混合 C
下属分级基金的交易代码	003502	003503
报告期末下属分级基金的份额总额	158,985,695.00 份	197,005,199.60 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险并保持良好流动性的前提下，通过精选股票、债券等投资标的，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。通过“自上而下”及“自下而上”相结合的方法挖掘优质的上市公司，构建股票投资组合；以经济基本面变化趋势分析为基础，结合货币、财政宏观政策，以及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，判断利率和债券市场走势；运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略等多种积极管理策略，深入研究挖掘价值被低估的债券和市场投资机会，构建收益稳定、流动性良好的债券组合。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×40%+中证全债指数收益率×60%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，属于证券投资基金中预期较高风险、较高收益的品种，其预期收益和风险水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

### 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	交通银行股份有限公司
信息披露	姓名	刘盛	陆志俊

负责人	联系电话	020-83936180	95559
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		4006135888	95559
传真		020-83282856	021-62701216
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	中国（上海）自由贸易试验区 银城中路188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	中国（上海）长宁区仙霞路18 号
邮政编码		510623	200336
法定代表人		王铁	任德奇

## 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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.gefund.com.cn">http://www.gefund.com.cn</a>
基金中期报告备置地点	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（2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日）	
	金鹰鑫瑞混合 A	金鹰鑫瑞混合 C
本期已实现收益	7,607,125.23	12,921,031.81
本期利润	6,007,818.86	7,348,022.64
加权平均基金份额本期利润	0.0470	0.0351
本期加权平均净值利润率	3.68%	2.44%
本期基金份额净值增长率	3.99%	3.94%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
	金鹰鑫瑞混合 A	金鹰鑫瑞混合 C
期末可供分配利润	37,646,890.57	77,763,801.25
期末可供分配基金份额利润	0.2368	0.3947
期末基金资产净值	204,452,231.94	285,337,092.62
期末基金份额净值	1.2860	1.4484
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
	金鹰鑫瑞混合 A	金鹰鑫瑞混合 C
基金份额累计净值增长率	28.60%	44.84%

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

##### 金鹰鑫瑞混合 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
过去一个月	-0.09%	0.22%	-0.69%	0.33%	0.60%	-0.11%
过去三个月	1.60%	0.24%	2.24%	0.39%	-0.64%	-0.15%
过去六个月	3.99%	0.45%	1.73%	0.53%	2.26%	-0.08%
过去一年	9.66%	0.37%	11.94%	0.53%	-2.28%	-0.16%
过去三年	19.17%	0.22%	29.94%	0.54%	-10.77%	-0.32%
自基金合同生效起至今	28.60%	0.20%	33.18%	0.48%	-4.58%	-0.28%

##### 金鹰鑫瑞混合 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
过去一个月	-0.10%	0.22%	-0.69%	0.33%	0.59%	-0.11%
过去三个月	1.57%	0.24%	2.24%	0.39%	-0.67%	-0.15%
过去六个月	3.94%	0.45%	1.73%	0.53%	2.21%	-0.08%
过去一年	9.56%	0.37%	11.94%	0.53%	-2.38%	-0.16%

过去三年	18.77%	0.22%	29.94%	0.54%	-11.17%	-0.32%
自基金合同生效起至今	44.84%	0.46%	33.18%	0.48%	11.66%	-0.02%

注：本基金的业绩比较基准是：沪深 300 指数收益率 x40%+中证全债指数收益率 x60%。

### 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

金鹰鑫瑞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

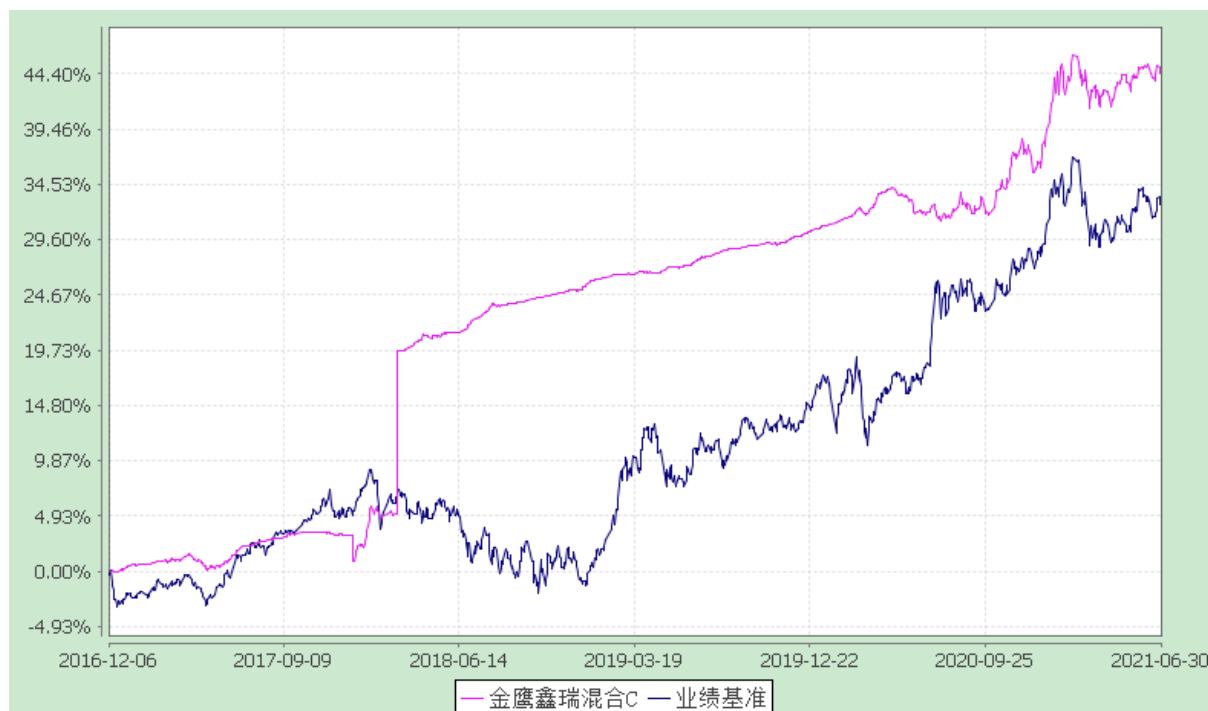
(2016 年 12 月 6 日至 2021 年 6 月 30 日)

金鹰鑫瑞混合 A



金鹰鑫瑞混合 C





注：1、本基金合同于 2016 年 12 月 6 日生效。2、本报告期末，本基金各项投资比例符合基金合同约定。3、本基金的业绩比较基准是：沪深 300 指数收益率 x40%+中证全债指数收益率 x60%。

## § 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人资格。

“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 50 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		
龙悦芳	本基金的基金经理，公司固定收益部副总监	2018-06-14	-	11	龙悦芳女士，曾任平安证券股份有限公司投资助理、交易员、投资经理等职务。2017年5月加入金鹰基金管理有限公司，现任固定收益部基金经理。
倪超	本基金的基金经理，公司权益研究部副总监	2020-09-25	-	12	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。
魏榆峻	本基金的基金经理助理	2019-10-22	-	7	魏榆峻先生，兰州大学金融学硕士，2017年4月加入金鹰基金管理有限公司，担任信用研究员、基金经理助理等职务。
李恒	本基金的基金经理助理	2021-05-24	-	5	李恒先生，北京大学物理专业博士，2016年7月加入金鹰基金管理有限公司，担任行业研究员职务。现任基金经理助理。
陈双双	本基金的基金经理助理	2021-05-06	-	5	陈双双女士，中南财经政法大学数量经济学硕士，2016年7月加入金鹰基金管理有限公司，担任债券交易员职务，现任固定收益部基金经理助理。

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、《金鹰鑫瑞灵活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中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 2021 年上半年，受出口增速维持高位、地产投资韧性仍在，消费缓慢复苏的支撑，经济基本面总体延续疫后复苏的趋势。国内进入“稳增长压力较小窗口期”，政策定调“疫后回归，控杠杆、调结构、跨周期”，严控房地产和地方隐性债务，财政后置地方债延缓发行。稳货币，紧信用带来狭义流动性超预期宽松。

债券市场行情方面，年初在市场流动性极其宽松的环境下，债券收益率延续去年底走势持续向下，1 月中到达低点后，受缴税期资金冲击银行未及时对冲的影响，资金价格飙升带动债券收益率快速向上调整，且短债调整幅度更大。但春节后，财政投放、地方债发行不及预期，机构配置偏谨慎，资金面转松且持续好于预期，社融增速快速回落，PPI 虽然持续走高，但央行表态通胀是输入性、结构性和暂时性的，维持货币政策中性，通胀对债市压制有限。资金面长时间平稳宽松带动债券收益率下行，且短端下行幅度大于长端，中高等级信用利差收窄。综观上半年，债券收益率整体震荡小幅下行，信用利差有所收窄。

股票市场方面，上半年上证综指上涨 3.40%，深成指上涨 5.36%，中小板指数上涨 3.66%，创业板指数则上涨了 17.22%。市场的焦点在于量价齐升周期板块，以及成长空间广阔、产业政策支持的高端制造业。行业表现上，钢铁、电新、化工、采掘、医药涨幅居前，非银、家电、农业、军工、传媒板块则跌幅居前。

上半年本基金继续股债混合操作，债券部分，一季度以中高等级信用债和存单配置为主，二季

度择机增加了中长久期利率债的配置。股票部分，本基金配置主要围绕沪深 300 里的成份股进行配置。行业层面重点配置了银行、地产、家电、电子和汽车等行业。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值为 1.2860 元，本报告期份额净值增长率为 3.99%，同期业绩比较基准增长率为 1.73%；C 类基金份额净值为 1.4484 元，本报告期份额净值增长率 3.94%，同期业绩比较基准增长率为 1.73%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，从基本面来看，经济复苏增速放缓。具体看，疫情反复扩散，消费恢复受阻。PMI 新出口订单指数连续 3 个月位于荣枯线以下。地产监管政策延续，受高基数和融资收紧的影响，地产投资或逐步回落。基建投资上半年表现平庸，财政后置或对下半年基建投资有支撑。通胀方面，PPI 维持高位。但由于需求疲弱，原材料价格向下游传到有限，短期 CPI 压力不大。

流动性层面上，货币政策维持中性，上半年，金融政策偏紧及财政后置导致实体信用收缩，狭义流动性偏宽松。下半年，财政发力或带来狭义流动性收敛。预计资金价格相比二季度小幅抬升，但市场利率整体围绕政策利率运行，上行幅度有限，总体维持中性。

政策方面，我们预计下半年维持货币政策稳中偏松、监管政策偏紧的组合。重点压制不合意领域的信用派生（如房地产和地方隐性债务），鼓励制造业中长期贷款和中小企业融资。政策重心由“逆周期”调节转向“跨周期”调节，着眼于解决长远问题，而不是短期问题。

跨周期调节下，经济波动会被熨平。相应的，收益率波动幅度也会变小，且会提前反应长远的预期。目前利率和中高等级信用债的绝对收益率处于 2010 年以来 25% 分位数以内，尽管绝对水平较低，但在资金相对宽松且刚兑打破，经济转型的大背景下有其合理性。利率提前反应了经济远期的变化。

基于以上分析，我们认为，下半年资金面或小幅收敛，短端下行空间有限。较陡的期限利差对长端有一定保护，且因为经济增长和通胀出现向下拐点，宏观环境对长债相对友好，期限利差会有所压缩。下半年在企业信贷需求下滑、居民按揭管控、非标到期量大、城投供给减少的影响下，银行配置压力可能依然较大。利率或维持低位震荡。真正的变盘要等待信用重新扩展或央行货币态度的转变。下半年本基金继续维持股债混合的操作。债券方面，依然以利率债和中高等级信用债为主。密切跟踪经济基本面、政策面及监管政策方面的变化，适时调整组合久期和杠杆。在确保组合良好流动性和安全性的前提下，力争有效控制并防范风险，竭力为持有人服务。权益配置方面，本基金将继续寻找长期空间大、短期景气度向上，同时估值和盈利增长匹配度较好的优质个股来构建本基

金的组合，努力为基金持有人获取中长期良好回报。

#### 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、基金事务部负责人、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

本报告期内无应当说明的预警事项。

### § 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

2021 年上半年度，基金托管人在金鹰鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，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、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2021 年上半年度，金鹰基金管理有限公司在金鹰鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本基金报告期内未进行利润分配。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2021 年上半年度，由金鹰基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关金鹰鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 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：金鹰鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	647,753.16	289,563.96
结算备付金		620,022.99	376,723.42
存出保证金		72,567.49	51,426.99
交易性金融资产	6.4.7.2	507,338,325.51	406,422,146.46
其中：股票投资		132,128,427.01	108,454,617.96
基金投资		-	-
债券投资		361,255,898.50	288,205,528.50
资产支持证券投资		13,954,000.00	9,762,000.00
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		17,683,000.42	13,449,584.24
应收利息	6.4.7.5	5,907,377.57	4,098,235.85
应收股利		-	-

应收申购款		80,951.14	39,708.76
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
<b>资产总计</b>		<b>532,349,998.28</b>	<b>424,727,389.68</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年6月30日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
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		25,259,000.00	45,654,871.42
应付证券清算款		16,257,831.59	13,426,079.16
应付赎回款		387,003.95	1,904,521.14
应付管理人报酬		244,216.03	208,894.43
应付托管费		40,702.67	34,815.74
应付销售服务费		23,772.67	27,547.64
应付交易费用	6.4.7.6	143,680.06	162,857.42
应交税费		4,631.62	5,205.63
应付利息		485.49	-6,352.79
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	199,349.64	160,000.78
负债合计		42,560,673.72	61,578,440.57
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.8	355,990,894.60	270,848,090.31
未分配利润	6.4.7.9	133,798,429.96	92,300,858.80
所有者权益合计		489,789,324.56	363,148,949.11
负债和所有者权益总计		532,349,998.28	424,727,389.68

注：截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.2860 元，A 类基金份额总额为 158,985,695.00 份；C 类基金份额净值为 1.4484 元，C 类基金份额总额为 197,005,199.60 份；基金份额总额为 355,990,894.60 份。

## 6.2 利润表

会计主体：金鹰鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年1月1日至 2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至 2020年6月30日
一、收入		<b>16,101,150.97</b>	<b>6,524,330.50</b>

1.利息收入		6,022,846.38	7,262,240.48
其中：存款利息收入	6.4.7.10	12,105.78	12,868.85
债券利息收入		5,293,791.72	6,563,599.55
资产支持证券利息收入		449,555.52	143,791.76
买入返售金融资产收入		267,393.36	541,980.32
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		17,228,750.38	765,260.97
其中：股票投资收益	6.4.7.11	13,985,425.94	63,059.83
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	1,383,409.86	423,886.14
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		1,859,914.58	278,315.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-7,172,315.54	-1,601,588.54
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	21,869.75	98,417.59
<b>减：二、费用</b>		<b>2,745,309.47</b>	<b>2,042,231.65</b>
1. 管理人报酬		1,380,305.60	1,167,089.47
2. 托管费		230,050.92	194,514.88
3. 销售服务费		149,862.37	131,553.37
4. 交易费用	6.4.7.17	503,724.22	73,746.12
5. 利息支出		369,964.17	367,418.18
其中：卖出回购金融资产支出		369,964.17	367,418.18
6. 税金及附加		2,847.61	436.09
7. 其他费用	6.4.7.18	108,554.58	107,473.54
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>13,355,841.50</b>	<b>4,482,098.85</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>13,355,841.50</b>	<b>4,482,098.85</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金鹰鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 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	270,848,090.31	92,300,858.80	363,148,949.11



金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	13,355,841.50	13,355,841.50
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)	85,142,804.29	28,141,729.66	113,284,533.95
其中: 1.基金申购款	216,108,755.23	81,534,310.90	297,643,066.13
2.基金赎回款	-130,965,950.94	-53,392,581.24	-184,358,532.18
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)	355,990,894.60	133,798,429.96	489,789,324.56
项目	上年度可比期间		
	2020年1月1日至2020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)	331,836,469.15	80,207,845.94	412,044,315.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,482,098.85	4,482,098.85
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)	-98,181,458.32	-20,945,133.46	-119,126,591.78
其中: 1.基金申购款	249,521,957.77	80,410,009.75	329,931,967.52
2.基金赎回款	-347,703,416.09	-101,355,143.21	-449,058,559.30
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)	233,655,010.83	63,744,811.33	297,399,822.16

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: 姚文强, 主管会计工作负责人: 姚文强, 会计机构负责人: 董霞

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

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、基金事务部负责人、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。

#### **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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日起至 2021 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、会计估计与最近一期年度报告一致。

#### **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**

本基金报告期内无需说明的重要会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金报告期内无会计估计变更。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金本报告期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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	647,753.16
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	647,753.16

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	120,145,357.61	132,128,427.01	11,983,069.40
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	118,048,890.39	118,583,498.50
	银行间市场	242,325,226.95	242,672,400.00
	合计	360,374,117.34	361,255,898.50
资产支持证券	14,018,000.00	13,954,000.00	-64,000.00
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	494,537,474.95	507,338,325.51	12,800,850.56

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期内未投资衍生金融资产/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

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无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 2021年6月30日
应收活期存款利息	82.20
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	279.00
应收债券利息	5,892,957.42
应收资产支持证券利息	14,026.25
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	32.70
合计	5,907,377.57

## 6.4.7.6 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	135,440.08
银行间市场应付交易费用	8,239.98
合计	143,680.06

## 6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	6.48
应付证券出借违约金	-
审计费用	19,835.79
预提信息披露费	179,507.37
合计	199,349.64

## 6.4.7.8 实收基金

## 金鹰鑫瑞混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	90,998,121.33	90,998,121.33
本期申购	81,627,549.64	81,627,549.64
本期赎回（以“-”号填列）	-13,639,975.97	-13,639,975.97
本期末	158,985,695.00	158,985,695.00

## 金鹰鑫瑞混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	179,849,968.98	179,849,968.98

本期申购	134,481,205.59	134,481,205.59
本期赎回（以“-”号填列）	-117,325,974.97	-117,325,974.97
本期末	197,005,199.60	197,005,199.60

## 6.4.7.9 未分配利润

## 金鹰鑫瑞混合 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	15,860,611.28	5,672,959.51	21,533,570.79
本期利润	7,607,125.23	-1,599,306.37	6,007,818.86
本期基金份额交易产生的变动数	14,179,154.06	3,745,993.23	17,925,147.29
其中：基金申购款	17,062,339.23	4,607,327.32	21,669,666.55
基金赎回款	-2,883,185.17	-861,334.09	-3,744,519.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	37,646,890.57	7,819,646.37	45,466,536.94

## 金鹰鑫瑞混合 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	58,454,004.17	12,313,283.84	70,767,288.01
本期利润	12,921,031.81	-5,573,009.17	7,348,022.64
本期基金份额交易产生的变动数	6,388,765.27	3,827,817.10	10,216,582.37
其中：基金申购款	48,084,522.37	11,780,121.98	59,864,644.35
基金赎回款	-41,695,757.10	-7,952,304.88	-49,648,061.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	77,763,801.25	10,568,091.77	88,331,893.02

## 6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	3,556.89
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	7,946.19
其他	602.70
合计	12,105.78

## 6.4.7.11 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	167,762,567.03
减：卖出股票成本总额	153,777,141.09
买卖股票差价收入	13,985,425.94

**6.4.7.12 基金投资收益**

本基金本报告期内未投资于基金。

**6.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	342,510,098.83
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	336,446,461.93
减：应收利息总额	4,680,227.04
买卖债券差价收入	1,383,409.86

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

本基金本报告期内未投资于贵金属。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

本基金本报告期内未投资于衍生工具。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,859,914.58
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	1,859,914.58

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	-7,172,315.54
——股票投资	-7,159,263.08
——债券投资	-187,052.46
——资产支持证券投资	174,000.00
——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	-7,172,315.54

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	21,727.86
转换费收入	141.89
合计	21,869.75

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	497,271.72
银行间市场交易费用	6,452.50
合计	503,724.22

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	10,611.42
帐户维护费	18,000.00
其他项目	600.00
合计	108,554.58

#### 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

截至资产负债表日，本基金无需作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截止本财务报告批准报出日，本基金无需作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

本报告期内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
交通银行股份有限公司	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度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行任何交易，无应支付关联方交易佣金。

##### 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 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,380,305.60	1,167,089.47
其中：支付销售机构的客户维护费	311,531.66	631,987.95

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.60% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

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，按月支付。

## 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	230,050.92	194,514.88

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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，按月支付。

## 6.4.10.2.3 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		
	2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	金鹰鑫瑞混合 A	金鹰鑫瑞混合 C	合计
交通银行股份有限公司	-	149.96	149.96
金鹰基金管理有限公司	-	41,855.57	41,855.57
合计	-	42,005.53	42,005.53
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020年1月1日至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	金鹰鑫瑞混合 A	金鹰鑫瑞混合 C	合计
交通银行股份有限公司	-	331.98	331.98
金鹰基金管理有限公司	-	70.68	70.68
合计	-	402.66	402.66

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费。

本基金销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.10% 年费率计提，销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

**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**

本基金本报告期及上年度可比期间均无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）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****金鹰鑫瑞混合 A**

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。

**金鹰鑫瑞混合 C**

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	
	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年1月1日至2020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
交通银行股份有限公司	647,753.16	3,556.89	520,346.93	4,184.64

注：1、本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息，在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示。

2、2020年6月30日清算备付金期末余额 34,602.23 元，当期清算备付金利息收入为 8,560.54 元；2021年6月30日清算备付金期末余额 620,022.99 元，当期清算备付金利息收入为 7,946.19 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均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。

**6.4.11 利润分配情况**

本基金报告期内未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2021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**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
688131	皓元医药	2021-06-01	2021-12-08	网下配售锁定	64.99	247.10	1,955.00	127,055.45	483,080.50	网下配售锁定
688601	力芯微	2021-06-18	2021-12-28	网下配售锁定	36.48	133.69	1,174.00	42,827.52	156,952.06	网下配售锁定
688665	四方光电	2021-02-02	2021-08-09	网下配售锁定	29.53	129.46	1,687.00	49,817.11	218,399.02	网下配售锁定
688667	菱电电控	2021-03-03	2021-09-13	网下配售锁定	75.42	103.88	1,191.00	89,825.22	123,721.08	网下配售锁定
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	网下配售锁定	28.77	99.85	240.00	6,904.80	23,964.00	网下配售锁定
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	网下配售锁定	48.59	90.39	288.00	13,993.92	26,032.32	网下配售锁定
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	网下配售锁定	33.22	87.50	463.00	15,380.86	40,512.50	网下配售锁定
688690	纳微科技	2021-06-16	2021-12-23	网下配售锁定	8.07	79.89	3,477.00	28,059.39	277,777.53	网下配售锁定
688314	康拓医疗	2021-05-11	2021-11-18	网下配售锁定	17.34	74.48	1,085.00	18,813.90	80,810.80	网下配售锁定
688613	奥精医疗	2021-05-13	2021-11-22	网下配售锁定	16.43	63.50	2,617.00	42,997.31	166,179.50	网下配售锁定
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	网下配售锁定	18.71	57.62	201.00	3,760.71	11,581.62	网下配售锁定
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	网下配售锁定	15.83	45.29	317.00	5,018.11	14,356.93	网下配售锁定
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	网下配售锁定	20.81	42.23	241.00	5,015.21	10,177.43	网下配售锁定

300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	网下配售锁定	9.19	40.38	329.00	3,023.51	13,285.02	网下配售锁定
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	网下新股申购	38.85	38.85	2,149.00	83,488.65	83,488.65	网下新股待上市
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	网下配售锁定	7.64	38.83	462.00	3,529.68	17,939.46	网下配售锁定
688689	银河微电	2021-01-15	2021-07-27	网下配售锁定	14.01	35.62	3,258.00	45,644.58	116,049.96	网下配售锁定
301011	华立科技	2021-06-09	2021-12-17	网下配售锁定	14.20	33.84	175.00	2,485.00	5,922.00	网下配售锁定
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	网下配售锁定	13.75	32.98	275.00	3,781.25	9,069.50	网下配售锁定
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	网下新股申购	31.56	31.56	349.00	11,014.44	11,014.44	网下新股待上市
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	网下配售锁定	14.79	30.57	264.00	3,904.56	8,070.48	网下配售锁定
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	网下配售锁定	13.39	30.10	217.00	2,905.63	6,531.70	网下配售锁定
688097	博众精工	2021-04-29	2021-11-12	网下配售锁定	11.27	28.01	3,983.00	44,888.41	111,563.83	网下配售锁定
688687	凯因科技	2021-01-29	2021-08-09	网下配售锁定	18.98	27.98	5,354.00	101,618.92	149,804.92	网下配售锁定
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	网下配售锁定	12.54	27.89	801.00	10,044.54	22,339.89	网下配售锁定
688319	欧林生物	2021-05-31	2021-12-08	网下配售锁定	9.88	27.34	3,412.00	33,710.56	93,284.08	网下配售锁定
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	网下配售锁定	11.72	27.08	340.00	3,984.80	9,207.20	网下配售锁定

300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	网下配售锁定	6.79	26.81	301.00	2,043.79	8,069.81	网下配售锁定
300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	网下配售锁定	13.06	26.51	254.00	3,317.24	6,733.54	网下配售锁定
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	网下配售锁定	12.85	25.80	371.00	4,767.35	9,571.80	网下配售锁定
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	网下配售锁定	14.72	23.32	191.00	2,811.52	4,454.12	网下配售锁定
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-07	网下配售锁定	10.76	22.20	359.00	3,862.84	7,969.80	网下配售锁定
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	网下新股申购	21.96	21.96	2,469.00	54,219.24	54,219.24	网下新股待上市
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	网下配售锁定	6.02	21.32	201.00	1,210.02	4,285.32	网下配售锁定
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	网下配售锁定	9.36	20.32	200.00	1,872.00	4,064.00	网下配售锁定
688195	腾景科技	2021-03-18	2021-09-27	网下配售锁定	13.60	19.87	2,693.00	36,624.80	53,509.91	网下配售锁定
300993	玉马遮阳	2021-05-17	2021-11-24	网下配售锁定	12.10	19.29	410.00	4,961.00	7,908.90	网下配售锁定
688079	美迪凯	2021-02-23	2021-09-02	网下配售锁定	10.19	18.40	10,622.00	108,238.18	195,444.80	网下配售锁定
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	网下配售锁定	7.83	17.61	218.00	1,706.94	3,838.98	网下配售锁定
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	网下配售锁定	5.29	14.44	303.00	1,602.87	4,375.32	网下配售锁定
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	网下配售锁定	4.94	13.05	928.00	4,584.32	12,110.40	网下配售锁定
300977	商络	2021-0	2021-1	网下	5.48	13.03	492.00	2,696.	6,410.	网下

5	电子	4-14	0-21	配售 锁定				16	76	配售 锁定
30102 0	密封 科技	2021-0 6-28	2022-0 1-06	网下 配售 锁定	10.64	10.64	421.00	4,479. 44	4,479. 44	网下 配售 锁定
30102 0	密封 科技	2021-0 6-28	2021-0 7-06	网下 新股 申购	10.64	10.64	3,789. 00	40,314 .96	40,314 .96	网下 新股 待上 市
30102 1	英诺 激光	2021-0 6-28	2021-0 7-06	网下 新股 申购	9.46	9.46	2,609. 00	24,681 .14	24,681 .14	网下 新股 待上 市
30102 1	英诺 激光	2021-0 6-28	2022-0 1-06	网下 配售 锁定	9.46	9.46	290.00	2,743. 40	2,743. 40	网下 配售 锁定
30101 7	漱玉 平民	2021-0 6-23	2022-0 1-05	网下 配售 锁定	8.86	8.86	555.00	4,917. 30	4,917. 30	网下 配售 锁定
30101 7	漱玉 平民	2021-0 6-23	2021-0 7-05	网下 新股 申购	8.86	8.86	4,995. 00	44,255 .70	44,255 .70	网下 新股 待上 市
68822 6	威腾 电气	2021-0 6-28	2021-0 7-07	网下 新股 申购	6.42	6.42	2,693. 00	17,289 .06	17,289 .06	网下 新股 待上 市
60516 2	新中 港	2021-0 6-29	2021-0 7-07	网下 新股 申购	6.07	6.07	1,377. 00	8,358. 39	8,358. 39	网下 新股 待上 市

**6.4.12.1.2 受限证券类别：债券**

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：张)	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注
11305 0	南银 转债	2021-0 6-17	2021-0 7-01	网下 新债 申购	100.00	100.00	1,430. 00	143,00 0.00	143,00 0.00	网下 新债 待上 市

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有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

本基金报告期末未持有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，本基金从事证券交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 25,259,000.00，于 2021 年 7 月 1 日到期 19,500,000.00；于 2021 年 7 月 2 日到期 1,019,000.00；于 2021 年 7 月 5 日到期 4,022,000.00；于 2021 年 7 月 7 日到期 500,000.00；于 2021 年 7 月 23 日到期 1,000.00；于 2021 年 8 月 11 日到期 202,000.00；于 2021 年 11 月 11 日到期 15,000.00。该类交易要求本基金在回购期内在新质押式回购下转入质押库的债券，按照证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	20,046,000.00	29,868,000.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	20,050,000.00	20,006,000.00
合计	40,096,000.00	49,874,000.00

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 2021年6月30日	上年度末 2020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 2021年6月30日	上年度末 2020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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	153,051,568.50	164,980,925.80
AAA 以下	10,068,000.00	23,075,569.50
未评级	0.00	0.00
合计	163,119,568.50	188,056,495.30

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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	13,954,000.00	9,762,000.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	13,954,000.00	9,762,000.00

#### 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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	40,790,400.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	40,790,400.00	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 2021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	647,753.16	-	-	-	-	-	-	-	-	647,753.16
结算备付金	620,022.99	-	-	-	-	-	-	-	-	620,022.99
存出保证金	72,567.49	-	-	-	-	-	-	-	-	72,567.49

交易性金融资产	-	-	-	-	197,487,330.00	157,231,265.00	20,491,303.50	132,128,427.01	507,338,325.51
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	17,683,000.42	17,683,000.42
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	5,907,377.57	5,907,377.57
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	80,951.14	80,951.14
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,340,343.64	-	-	-	197,487,330.00	157,231,265.00	20,491,303.50	155,799,756.14	532,349,998.28
负债									
短期借款	-	-	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	25,259,000.00	-	-	-	-	-	-	-	25,259,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	16,257,831.59	16,257,831.59
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	387,003.95	387,003.95
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	244,216.03	244,216.03
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	40,702.67	40,702.67
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-	23,772.67	23,772.67
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	143,680.06	143,680.06
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	4,631.62	4,631.62
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	485.49	485.49
应付利润	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	199,349.64	199,349.64
负债总计	25,259,000.00	-	-	-	-	-	-	17,301,673.72	42,560,673.72
利率敏感度缺口	-23,918,656.36	-	-	-	-197,487,330.00	-157,231,265.00	-20,491,303.50	-138,498,082.42	-489,789,324.56

上年度末 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	289,563.96	-	-	-	-	-	-	-	-	289,563.96
结算备付金	376,723.42	-	-	-	-	-	-	-	-	376,723.42
存出保证金	51,426.99	-	-	-	-	-	-	-	-	51,426.99
交易性金融资产	166,033.20	-	-	-	-	153,538,569.50	134,430,925.80	9,832,000.00	108,454,617.96	406,422,146.46
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	13,449,584.24	13,449,584.24
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	4,098,235.85	4,098,235.85
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	39,708.76	39,708.76
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	883,747.57	-	-	-	-	153,538,569.50	134,430,925.80	9,832,000.00	126,042,146.81	424,727,389.68
负债										
短期借款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	45,654,871.42	-	-	-	-	-	-	-	-	45,654,871.42
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	13,426,079.16	13,426,079.16
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	1,904,521.14	1,904,521.14
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	208,894.43	208,894.43
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	34,815.74	34,815.74
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-	-	27,547.64	27,547.64
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	162,857.42	162,857.42

应交税费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	5,205.63	5,205.63
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-6,352.79	-6,352.79
应付利润	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-	160,000.78	160,000.78
负债总计	45,654,871.42	-	-	-	-	-	-	-	-	15,923,569.15	61,578,440.57
利率敏感度缺口	-44,771,123.85	-	-	-	-	153,538,569.50	134,430,925.80	9,832,000.00	110,118,577.66	363,148,949.11	363,148,949.11

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的摊余成本，并按照金融资产及金融负债的剩余到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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	上年度末
		2021年6月30日	2020年12月31日
	利率上升 25 个基点	-1,441,629.45	-827,973.72
	利率下降 25 个基点	1,472,938.14	840,482.75

#### 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		上年度末	
	2021年6月30日		2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产净	公允价值	占基金资产净

		值比例 (%)		值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	132,128,427.01	26.98	108,454,617.96	29.87
交易性金融资产—债券投资	361,255,898.50	73.76	17,043,495.30	4.69
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
<b>合计</b>	<b>493,384,325.51</b>	<b>100.73</b>	<b>125,498,113.26</b>	<b>34.56</b>

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

##### 金鹰鑫瑞混合 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	上年度末
		2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
	业绩比较基准变动+5%	7,126,422.79	943,330.81
	业绩比较基准变动-5%	-7,126,422.79	-943,330.81

##### 金鹰鑫瑞混合 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	上年度末
		2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
	业绩比较基准变动+5%	9,958,100.42	2,094,586.68
	业绩比较基准变动-5%	-9,958,100.42	-2,094,586.68

#### 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 2021 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 131,114,873.00 元，第二层级的余额为 376,223,452.51 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。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	132,128,427.01	24.82
	其中：股票	132,128,427.01	24.82
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	375,209,898.50	70.48
	其中：债券	361,255,898.50	67.86
	资产支持证券	13,954,000.00	2.62
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	1,267,776.15	0.24
8	其他各项资产	23,743,896.62	4.46
9	合计	532,349,998.28	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 报告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

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	10,512.39	0.00
C	制造业	91,187,226.46	18.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	30,237.59	0.01
E	建筑业	47,544.03	0.01
F	批发和零售业	73,523.22	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	4,908,773.07	1.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	46,251.64	0.01
J	金融业	29,603,237.00	6.04
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	5,708,494.06	1.17
M	科学研究和技术服务业	483,080.50	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	13,285.02	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	16,262.03	0.00
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	132,128,427.01	26.98

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期内未投资港股通股票。

## 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	600885	宏发股份	151,102	9,474,095.40	1.93
2	002142	宁波银行	241,600	9,415,152.00	1.92
3	601636	旗滨集团	495,200	9,190,912.00	1.88
4	600660	福耀玻璃	155,400	8,679,090.00	1.77
5	601009	南京银行	741,400	7,799,528.00	1.59
6	002430	杭氧股份	219,900	7,606,341.00	1.55
7	002484	江海股份	480,000	7,430,400.00	1.52
8	000001	平安银行	322,600	7,297,212.00	1.49
9	300820	英杰电气	129,300	7,071,417.00	1.44
10	601238	广汽集团	516,100	6,683,495.00	1.36
11	603688	石英股份	250,800	5,893,800.00	1.20
12	000725	京东方A	933,800	5,826,912.00	1.19
13	600057	厦门象屿	910,800	5,692,500.00	1.16
14	603218	日月股份	205,200	5,556,816.00	1.13
15	002966	苏州银行	692,700	5,091,345.00	1.04
16	600690	海尔智家	190,600	4,938,446.00	1.01
17	300408	三环集团	116,100	4,924,962.00	1.01
18	001965	招商公路	676,026	4,880,907.72	1.00
19	000100	TCL 科技	614,700	4,702,455.00	0.96
20	688131	皓元医药	1,955	483,080.50	0.10
21	688276	百克生物	3,137	328,067.46	0.07
22	688690	纳微科技	3,477	277,777.53	0.06
23	688665	四方光电	1,687	218,399.02	0.04
24	688079	美迪凯	10,622	195,444.80	0.04
25	688613	奥精医疗	2,617	166,179.50	0.03
26	688601	力芯微	1,174	156,952.06	0.03
27	688687	凯因科技	5,354	149,804.92	0.03
28	688667	菱电电控	1,191	123,721.08	0.03
29	688689	银河微电	3,258	116,049.96	0.02
30	688097	博众精工	3,983	111,563.83	0.02
31	301016	雷尔伟	2,472	106,642.08	0.02
32	688319	欧林生物	3,412	93,284.08	0.02
33	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.02
34	688314	康拓医疗	1,085	80,810.80	0.02
35	300919	中伟股份	476	77,588.00	0.02
36	603529	爱玛科技	1,019	59,224.28	0.01
37	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
38	688195	腾景科技	2,693	53,509.91	0.01
39	688269	凯立新材	374	52,180.48	0.01
40	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
41	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01

42	300979	华利集团	463	40,512.50	0.01
43	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
44	300981	中红医疗	288	26,032.32	0.01
45	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
46	605080	浙江自然	374	23,487.20	0.00
47	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
48	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
49	001205	盛航股份	577	18,850.59	0.00
50	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
51	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
52	605368	蓝天燃气	1,204	17,217.20	0.00
53	003037	三和管桩	1,274	16,765.84	0.00
54	300909	汇创达	386	16,636.60	0.00
55	605098	行动教育	289	16,262.03	0.00
56	605196	华通线缆	1,172	16,079.84	0.00
57	605300	佳禾食品	576	16,012.80	0.00
58	603836	海程邦达	733	15,994.06	0.00
59	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
60	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
61	605016	百龙创园	445	14,222.20	0.00
62	605180	华生科技	384	14,208.00	0.00
63	605060	联德股份	883	13,933.74	0.00
64	688611	杭州柯林	281	13,794.29	0.00
65	605319	无锡振华	764	13,706.16	0.00
66	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
67	003030	祖名股份	480	13,516.80	0.00
68	605133	嵘泰股份	618	13,398.24	0.00
69	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
70	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
71	605286	同力日升	597	12,208.65	0.00
72	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
73	003036	泰坦股份	776	11,958.16	0.00
74	003042	中农联合	420	11,839.80	0.00
75	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
76	605228	神通科技	1,217	11,464.14	0.00
77	605303	园林股份	610	11,242.30	0.00
78	605488	福莱新材	416	11,103.04	0.00
79	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
80	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
81	605289	罗曼股份	379	10,930.36	0.00
82	605055	迎丰股份	1,146	10,909.92	0.00
83	605277	新亚电子	507	10,662.21	0.00
84	605259	绿田机械	295	10,516.75	0.00
85	605086	龙高股份	443	10,512.39	0.00

86	003038	鑫铂股份	383	10,463.56	0.00
87	605005	合兴股份	634	10,321.52	0.00
88	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
89	605189	富春染织	422	10,165.98	0.00
90	300922	天秦装备	287	9,996.21	0.00
91	003041	真爱美家	349	9,876.70	0.00
92	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
93	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
94	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
95	001202	炬申股份	459	9,014.76	0.00
96	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
97	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
98	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
99	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
100	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
101	605298	必得科技	391	7,847.37	0.00
102	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
103	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
104	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
105	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
106	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
107	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
108	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
109	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
110	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
111	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
112	300926	博俊科技	125	2,825.00	0.00

#### 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	000002	万科 A	23,132,651.00	6.37
2	001965	招商公路	10,280,210.31	2.83
3	000001	平安银行	10,061,315.04	2.77
4	601601	中国太保	8,262,605.01	2.28
5	601009	南京银行	7,464,008.00	2.06
6	000717	韶钢松山	7,461,775.00	2.05
7	300820	英杰电气	7,345,591.00	2.02

8	002484	江海股份	7,334,853.04	2.02
9	002430	杭氧股份	7,320,516.00	2.02
10	002966	苏州银行	7,174,760.28	1.98
11	000725	京东方 A	6,986,958.00	1.92
12	601238	广汽集团	6,843,687.00	1.88
13	000776	广发证券	6,518,669.00	1.80
14	000100	TCL 科技	6,421,064.00	1.77
15	002739	万达电影	6,292,143.62	1.73
16	603688	石英股份	5,893,032.50	1.62
17	603218	日月股份	5,874,325.00	1.62
18	600057	厦门象屿	5,826,668.00	1.60
19	300408	三环集团	4,889,758.00	1.35
20	601939	建设银行	4,883,122.00	1.34

## 7.4.2 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	000002	万 科 A	21,487,105.07	5.92
2	000333	美的集团	12,432,622.86	3.42
3	000100	TCL 科技	11,838,489.58	3.26
4	000001	平安银行	10,689,376.44	2.94
5	600031	三一重工	9,272,247.84	2.55
6	002352	顺丰控股	9,146,022.40	2.52
7	601318	中国平安	7,910,092.00	2.18
8	601636	旗滨集团	7,002,674.09	1.93
9	601601	中国太保	6,762,534.00	1.86
10	000717	韶钢松山	6,626,018.00	1.82
11	000776	广发证券	6,239,326.00	1.72
12	600690	海尔智家	6,213,963.72	1.71
13	001965	招商公路	5,308,006.96	1.46
14	002739	万达电影	4,793,778.00	1.32
15	601939	建设银行	4,500,755.00	1.24
16	601985	中国核电	4,355,961.00	1.20
17	002142	宁波银行	3,825,497.35	1.05
18	000157	中联重科	3,649,556.00	1.00
19	000698	沈阳化工	3,632,504.00	1.00
20	300224	正海磁材	2,692,489.00	0.74

## 7.4.3 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	184,610,213.22
卖出股票收入（成交）总额	167,762,567.03

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	268,350,930.00	54.79
	其中：政策性金融债	117,249,930.00	23.94
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	40,096,000.00	8.19
6	中期票据	10,068,000.00	2.06
7	可转债（可交换债）	1,950,568.50	0.40
8	同业存单	40,790,400.00	8.33
9	其他	-	-
10	合计	361,255,898.50	73.76

## 7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	150405	15 农发 05	400,000.00	41,020,000.00	8.38
2	112104008	21 中国银行 CD008	420,000.00	40,790,400.00	8.33
3	175345	20 平证 07	300,000.00	30,258,000.00	6.18
4	1822032	18 东风日产汽车债 02	200,000.00	20,204,000.00	4.13
5	1820086	18 厦门国际银行	200,000.00	20,180,000.00	4.12

**7.7 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**

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	179612	安慧 9A1	200,000.00	8,158,000.00	1.67
2	138628	惠安 3A3	100,000.00	5,796,000.00	1.18

注：本基金本报告期末仅持有 2 只资产支持证券。

**7.8 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。

**7.9 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。

**7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****7.10.1 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。

**7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

无。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.11.1 本期国债期货投资政策**

无。

**7.11.2 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。

**7.11.3 本期国债期货投资评价**

无。

## 7.12 本报告期投资基金情况

### 7.12.1 投资政策及风险说明

本基金本报告期内未投资于基金。

## 7.13 投资组合报告附注

7.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体之一的中国银行股份有限公司因向未纳入预算的政府购买服务项目发放贷款等未依法履行其他职责行为，于 2021 年 5 月 21 日被中国银行保险监督管理委员会公开处罚，罚没 8761.355 万元；因“原油宝”产品风险事件相关违法违规行为，于 2020 年 12 月 5 日被中国银行保险监督管理委员会公开处罚，罚款 5050 万元。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

本基金投资的前十名证券的发行主体之一的厦门国际银行股份有限公司因违规开展同业业务，于 2021 年 3 月 12 日被中国银行保险监督管理委员会厦门监管局公开处罚，处以七百八十万元罚款；因部分房地产开发贷款发放不合规，经营性物业抵押贷款发放不审慎，于 2021 年 1 月 19 日被中国银行保险监督管理委员会厦门监管局公开处罚，处以罚款八十万元。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

本基金投资的前十名证券的发行主体之一的广发证券股份有限公司因未勤勉尽责，尽职调查环节基本程序缺失，未依法履行其他职责等行为，于 2020 年 7 月 21 日被中国证券监督管理委员会广东监管局责令改正，暂停受理或办理业务。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

本基金投资的前十名证券的发行主体之一的海通证券股份有限公司因未按照审慎经营原则，有效控制和防范风险，未依法履行其他职责等行为，于 2021 年 3 月 31 日被中国证券监督管理委员会上海监管局处以暂停受理或办理业务。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

7.13.2 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。

7.13.3 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	72,567.49
2	应收证券清算款	17,683,000.42
3	应收股利	-
4	应收利息	5,907,377.57



5	应收申购款	80,951.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,743,896.62

#### 7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	132011	17 浙报 EB	1,460,265.00	0.30

注：本基金本报告期末仅持有 1 只处于转股期的可转换债券。

#### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

#### 7.13.6 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。

## § 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

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
金鹰鑫瑞混合 A	3,813	41,695.70	126,403,067.26	79.51%	32,582,627.74	20.49%
金鹰鑫瑞混合 C	8,067	24,421.12	145,445,038.89	73.83%	51,560,160.71	26.17%
合计	11,880	29,965.56	271,848,106.15	76.36%	84,142,788.45	23.64%

## 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	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	金鹰鑫瑞混合 A	41.13	0.00%
	金鹰鑫瑞混合 C	8.97	0.00%
	合计	50.10	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	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	金鹰鑫瑞混合 A	0
	金鹰鑫瑞混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	金鹰鑫瑞混合 A	0
	金鹰鑫瑞混合 C	0
	合计	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

项目	金鹰鑫瑞混合 A	金鹰鑫瑞混合 C
基金合同生效日（2016 年 12 月 6 日）基金份额总额	228,684,999.67	50,504,297.50
本报告期初基金份额总额	90,998,121.33	179,849,968.98
本报告期基金总申购份额	81,627,549.64	134,481,205.59
减：本报告期基金总赎回份额	13,639,975.97	117,325,974.97
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	158,985,695.00	197,005,199.60

## § 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、本报告期，本基金管理人副总经理、督察长、首席信息官等进行了调整。2021 年 2 月 8 日，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；2021 年 5 月 11 日，周蔚女士担任公司常务副总经理；2021 年 5 月 14 日，耿源先生担任公司副总经理；2021 年 7 月 28 日，刘盛先生担任公司督察长，并离任公司副总经理及首席信息官；2021 年 7 月 28 日，总经理姚文强先生兼任首席信息官，不再代行督察长职务。截至报告日，王铁先生担任公司法定代表人及董事长，姚文强先生担任公司总经理及首席信息官，周蔚女士担任公司常务副总经理，耿源先生担任公司副总经理，刘盛先生担任公司督察长职务。

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。

### 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

本基金于 2021 年 6 月 3 日修改基金投资范围，增加了存托凭证为投资标的，相应增加了存托凭证投资策略。详情请查阅基金法律文件。

### 10.5 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。

### 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期未改聘会计师事务所。

## 10.7 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、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。

## 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 10.8.1 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	
光大证券	1	128,787,361.96	37.22%	92,717.64	33.33%	-
华西证券	1	62,535,028.82	18.07%	44,481.78	15.99%	-
华创证券	2	61,691,611.17	17.83%	56,219.06	20.21%	-
国海证券	1	40,962,550.28	11.84%	37,328.13	13.42%	-
海通证券	3	21,471,308.54	6.20%	19,566.73	7.03%	-
中信建投证券	1	11,940,916.44	3.45%	10,881.94	3.91%	-
安信证券	1	10,073,094.44	2.91%	9,179.33	3.30%	-
银河证券	2	8,597,537.86	2.48%	7,836.39	2.82%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券	1	-	-	-	-	-
华泰联合证券	1	-	-	-	-	-
江南证券	2	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券（齐鲁）	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	3	-	-	-	-	-
兴安证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-

信达证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中信证券华南 (广证)	1	-	-	-	-	-
日信证券	2	-	-	-	-	-

注：1、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。

2、金鹰基金管理有限公司托管于交通银行的所有理财产品共用交易席位。

### 10.8.2 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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券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
光大证券	5,915,576.00	12.06%	259,493,000.00	31.62%	-	-
华西证券	10,049,000.00	20.49%	116,113,000.00	14.15%	-	-
华创证券	7,326,567.80	14.94%	192,100,000.00	23.41%	-	-

			00.00			
国海证券	12,930,678.30	26.37%	129,400,000.00	15.77%	-	-
海通证券	-	-	11,270,000.00	1.37%	-	-
中信建投证券	-	-	6,998,000.00	0.85%	-	-
安信证券	-	-	24,877,000.00	3.03%	-	-
银河证券	2,740,278.50	5.59%	80,300,000.00	9.79%	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	10,078,200.00	20.55%	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合证券	-	-	-	-	-	-
江南证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券（齐鲁）	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
兴安证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券华南（广证）	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-

## 10.9 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旗下部分基金产品资料概要提示性公告	证监会指定媒介	2021-01-12
2	金鹰鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金 A 类份额基金产品资料概要更新	证监会指定媒介	2021-01-12
3	金鹰鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金 C 类份额基金产品资料概要更新	证监会指定媒介	2021-01-12
4	金鹰基金管理有限公司关于董事变更的公告	证监会指定媒介	2021-01-14
5	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增海通证券为代销机构的公告	证监会指定媒介	2021-01-20
6	金鹰鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金 2020 年四季度报告	证监会指定媒介	2021-01-21
7	金鹰基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证监会指定媒介	2021-02-08
8	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增玄元保险代理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	证监会指定媒介	2021-03-08
9	金鹰基金管理有限公司旗下全部基金年度报告提示性公告	证监会指定媒介	2021-03-30
10	金鹰鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告	证监会指定媒介	2021-03-30
11	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增华鑫证券为代销机构的公告	证监会指定媒介	2021-04-07
12	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与天风证券费率优惠活动的公告	证监会指定媒介	2021-04-16
13	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	证监会指定媒介	2021-04-21
14	金鹰鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金 2021 年一季度报告	证监会指定媒介	2021-04-21
15	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增国盛证券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	证监会指定媒介	2021-04-28
16	金鹰基金管理有限公司关于增聘基金经理助理的公告 2	证监会指定媒介	2021-05-06
17	金鹰基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证监会指定媒介	2021-05-11
18	金鹰基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证监会指定媒介	2021-05-14
19	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增中国人寿为代销机构并开通基金转换、基金定投	证监会指定媒介	2021-05-19

	业务及费率优惠的公告		
20	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增意才基金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	证监会指定媒介	2021-06-02
21	金鹰鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金托管协议更新	证监会指定媒介	2021-06-03
22	金鹰鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金 A 类份额基金产品资料概要更新	证监会指定媒介	2021-06-03
23	金鹰鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金 C 类份额基金产品资料概要更新	证监会指定媒介	2021-06-03
24	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金招募说明书更新提示性公告	证监会指定媒介	2021-06-03
25	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金修订基金合同、托管协议的公告	证监会指定媒介	2021-06-03
26	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金产品资料概要提示性公告	证监会指定媒介	2021-06-03
27	金鹰鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金基金合同更新	证监会指定媒介	2021-06-03
28	金鹰鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新	证监会指定媒介	2021-06-03
29	金鹰基金管理有限公司关于终止苏州财路基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证监会指定媒介	2021-06-07
30	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增江海证券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	证监会指定媒介	2021-06-08
31	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增招赢通为代销机构的公告	证监会指定媒介	2021-06-09
32	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增北京广源达信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	证监会指定媒介	2021-06-10

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 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	2021年1月26日至 2021年1月28日	0.00	68,842,076. 28	0.00	68,842,076.2 8	19.34 %
	2	2021年4月26日至 2021年5月17日	0.00	68,842,076. 28	0.00	68,842,076.2 8	19.34 %
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> <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。</p> <p>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。</p>							

## 11.2 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、中国证监会注册的金鹰鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金发行及募集的文件。
- 2、《金鹰鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、《金鹰鑫瑞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媒介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

二〇二一年八月二十八日