

# 金鹰责任投资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：招商证券股份有限公司

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。

基金托管人招商证券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 3 月 16 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	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 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	13
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
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	16
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	45
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	45
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	45
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	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45

7.12 本报告期投资基金情况 .....	46
7.13 投资组合报告附注 .....	46
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>47</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	47
8.3 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 .....	47
§9 开放式基金份额变动 .....	48
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>48</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	48
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 .....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	48
10.4 基金投资策略的改变 .....	49
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	49
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	49
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 .....	49
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	49
10.9 其他重大事件 .....	50
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>51</b>
11.1 影响投资者决策的其他重要信息 .....	51
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>51</b>
12.1 备查文件目录 .....	51
12.2 存放地点 .....	52
12.3 查阅方式 .....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	金鹰责任投资混合型证券投资基金	
基金简称	金鹰责任投资混合	
基金主代码	011155	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 3 月 16 日	
基金管理人	金鹰基金管理有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	45,348,277.18 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	金鹰责任投资混合 A	金鹰责任投资混合 C
下属分级基金的交易代码	011155	011156
报告期末下属分级基金的份额总额	36,716,914.37 份	8,631,362.81 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将结合对宏观经济走势、政策走势、证券市场环境等因素的分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置，合理确定投资组合中各类资产的配置比例并根据市场环境变化动态调整，最大限度地降低投资组合的风险、提高收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70% + 中证港股通综合指数收益率×10% + 中债总财富（总值）指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。 本基金资产投资于港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。

### 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		招商证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘盛	韩鑫普
	联系电话	020-83936180	0755-82943666
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话	4006135888	95565	
传真	020-83282856	0755-82960794	
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	深圳市福田区福田街道福华一 路111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	深圳市福田区福田街道福华一 路111号	
邮政编码	510623	518000	
法定代表人	王铁	霍达	

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
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3月16日(基金合同生效日)至2021年6月30日)	
	金鹰责任投资混合 A	金鹰责任投资混合 C
本期已实现收益	192,329.00	-81,873.41
本期利润	4,289,283.44	760,020.92

加权平均基金份额本期利润	0.0781	0.0099
本期加权平均净值利润率	7.69%	0.98%
本期基金份额净值增长率	9.66%	9.38%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2021年6月30日)</b>	
	金鹰责任投资混合 A	金鹰责任投资混合 C
期末可供分配利润	187,701.52	21,532.15
期末可供分配基金份额利润	0.0051	0.0025
期末基金资产净值	40,263,772.36	9,440,985.90
期末基金份额净值	1.0966	1.0938
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2021年6月30日)</b>	
	金鹰责任投资混合 A	金鹰责任投资混合 C
基金份额累计净值增长率	9.66%	9.38%

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

##### 金鹰责任投资混合 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	4.25%	0.83%	-1.43%	0.61%	5.68%	0.22%
过去三个月	9.65%	0.56%	2.83%	0.75%	6.82%	-0.19%
自基金合同生效起至今	9.66%	0.51%	3.08%	0.80%	6.58%	-0.29%

##### 金鹰责任投资混合 C

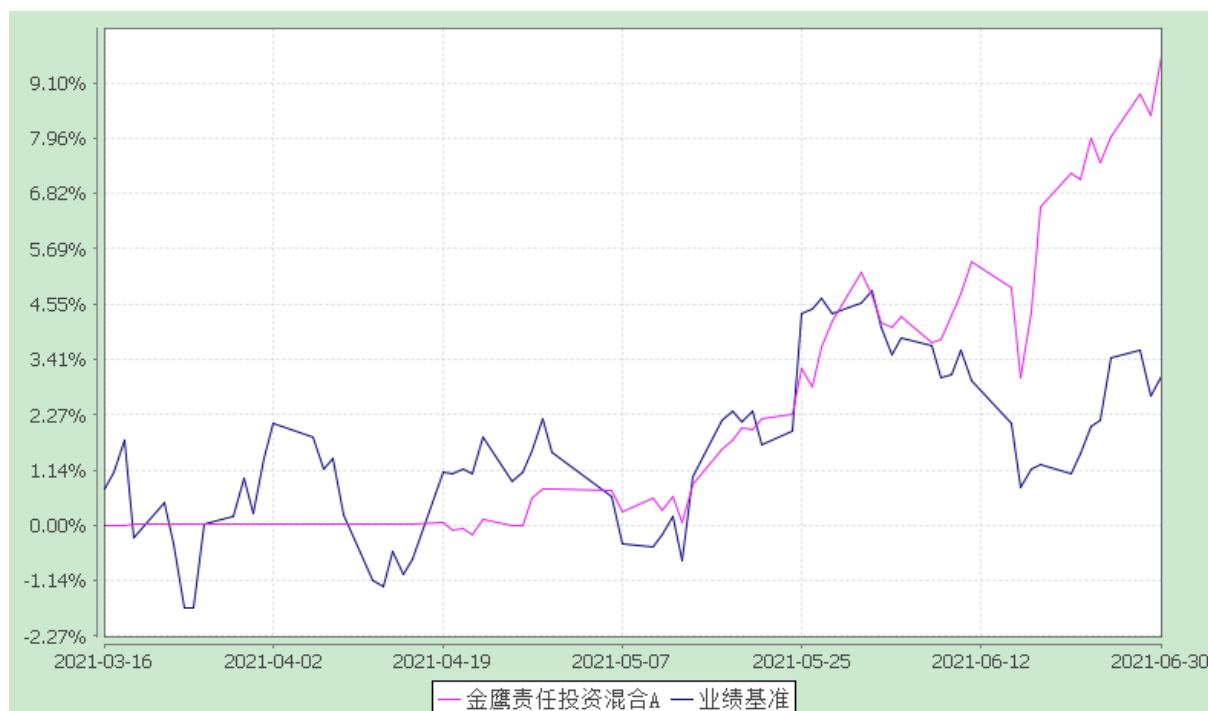
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	4.18%	0.83%	-1.43%	0.61%	5.61%	0.22%
过去三个月	9.40%	0.56%	2.83%	0.75%	6.57%	-0.19%
自基金合同生效起至今	9.38%	0.51%	3.08%	0.80%	6.30%	-0.29%

### 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

金鹰责任投资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

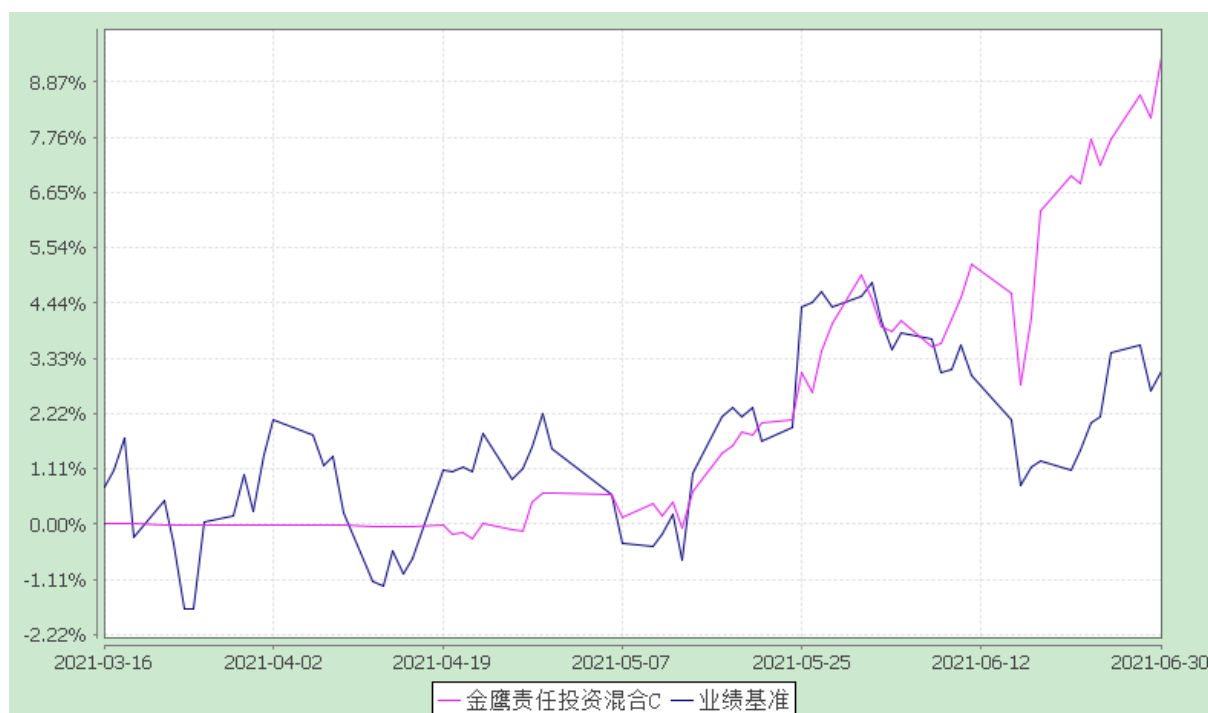
(2021 年 3 月 16 日至 2021 年 6 月 30 日)

金鹰责任投资混合 A



金鹰责任投资混合 C





注：1、本基金于 2021 年 3 月 16 日成立，目前仍在建仓期，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2、本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×70%+中证港股通综合指数收益率×10%+中债总财富（总值）指数收益率×20%

## § 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		
倪超	本基金的基金经理，公司权益研究部副总监	2021-03-16	-	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。
李恒	本基金的基金经理助理	2021-05-24	-	6	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。

#### 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、基金合同、基金招募说明书的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无出现重大违法违规或违反基金合同的行为，无损害基金持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现。同时通过投资交易系统内的公平交易功能执行交易，以尽可能确保公平对待各投资组合。

报告期，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未出现同日反向交易成交

较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2021 年上半年，国内宏观方面，延续经济复苏势头，景气达到相对高位水平；流动性上，信用收紧，而货币保持平稳。4-5 月份，经济复苏和流动性收紧预期背景下，权益市场的焦点在于顺周期板块，随后确认流动性好于预期且经济前瞻指标转弱后，市场关注点转为成长板块。海外方面，欧美经济加速复苏，就业情况改善，通胀攀升。流动性方面，美联储保持鸽派导向，流动性保持平稳，缓解市场悲观情绪。

国内市场综合表现方面，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。

本基金上半年保持较高仓位。配置进行了一定的调整，减持了顺周期方向和受成本影响较大的制造业，加配成长方向和最上游的资源方向。行业层面重点配置了电子、光伏、新能源车、化工、有色、机械等行业。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金报告期内 A 类份额净值为 1.0966 元，本报告期份额净值增长率 9.66%，同期业绩比较基准增长率为 3.08%；C 类基金份额净值为 1.0938 元，本报告期份额净值增长率 9.38%，同期业绩比较基准增长率为 3.08%。

#### 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 年下半年，全球经济整体复苏的力度和持续性尚需要观察，全球流动性的收缩预计是有序可控的。随着全球供应链的恢复，我们预计大宗商品价格上涨势头有望收敛，其带来的通胀压力也将有所减弱。而长期看，由于全球整体尚缺乏强有力的经济增长动能，维持较低增速概率大，全球中长期或仍将处于低利率环境。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，而中国经济质量也将持续提高，权益资本市场仍将是未来几年较好的投资标的，而兼具产业内生动力和国家政策扶持的科技、消费、先进制造等行业仍将可能是最受

益于权益资本市场飞速发展的行业。

政策方面，7月政治局会议已为下半年政策定调，预计流动性保持稳健，若经济下行压力增加，可能逐渐宽松。工业品价格上行风险会逐步下降。信用风险仍以点状暴露为主，对制造业上市公司整体影响不大，信用对基建投资、新能源汽车、半导体等高端制造业的支持增加。

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及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场债券品种的估值数据及交易所交易的债券品种的估值数据、流通受限股票流动性折扣。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

本报告期，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人复核审查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。

## § 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：金鹰责任投资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
资产：		
银行存款	6.4.7.1	19,090,231.24
结算备付金		121,071.58
存出保证金		126,040.13
交易性金融资产	6.4.7.2	30,410,326.29
其中：股票投资		30,410,326.29
基金投资		-
债券投资		-

资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		1,222,075.32
应收利息	6.4.7.5	10,903.99
应收股利		61,675.20
应收申购款		236,827.39
递延所得税资产		-
其他资产		-
<b>资产总计</b>		<b>51,279,151.14</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>
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债		-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		323,790.70
应付赎回款		1,047,544.64
应付管理人报酬		64,171.70
应付托管费		10,695.28
应付销售服务费		5,993.36
应付交易费用	6.4.7.6	63,722.73
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.7	58,474.47
负债合计		1,574,392.88
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.8	45,348,277.18
未分配利润	6.4.7.9	4,356,481.08
所有者权益合计		49,704,758.26
负债和所有者权益总计		51,279,151.14

注：1、本基金合同于 2021 年 3 月 16 日生效，无上年度末财务数据；

2、报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 45,348,277.18 份；其中金鹰责任投资混合 A 基金份额净值 1.0966 元，份额总额 36,716,914.37 份，金鹰责任投资混合 C 基金份额净值 1.0938 元，份额总额 8,631,362.81 份。

## 6.2 利润表

会计主体：金鹰责任投资混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 3 月 16 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 3 月 16 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>6,036,552.06</b>
1.利息收入		667,514.66
其中：存款利息收入	6.4.7.10	504,302.03
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		163,212.63
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		234,768.15
其中：股票投资收益	6.4.7.11	88,877.95
基金投资收益	6.4.7.12	-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-
股利收益	6.4.7.17	145,890.20
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	4,938,848.77
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	195,420.48
<b>减：二、费用</b>		<b>987,247.70</b>
1. 管理人报酬		557,463.87
2. 托管费		92,910.68
3. 销售服务费		168,206.43
4. 交易费用	6.4.7.20	113,406.75
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.21	55,259.97
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>5,049,304.36</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>5,049,304.36</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金鹰责任投资混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 3 月 16 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2021 年 3 月 16 日（基金合同生效日）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（基金净值）	292,888,948.85	-	292,888,948.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,049,304.36	5,049,304.36
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-247,540,671.67	-692,823.28	-248,233,494.95
其中：1.基金申购款	6,717,700.09	254,170.28	6,971,870.37
2.基金赎回款	-254,258,371.76	-946,993.56	-255,205,365.32
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）	45,348,277.18	4,356,481.08	49,704,758.26

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

金鹰责任投资混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2020]3688号《关于准予金鹰责任投资混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由金鹰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《金鹰责任投资混合型证券投资基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。经向中国证监会备案，基金合同于 2021 年 3 月 16 日正式生效。本基金为契约型，存续期限为不定期。基金管理人为金鹰基金管理有限公司，基金托管人为招商证



券股份有限公司。

本基金 2020 年 12 月 31 日至 2021 年 3 月 12 日期间向社会公开发行人募集，首次设立募集资金为人民币 292,888,948.85 元，其中金鹰责任投资混合型证券投资基金 A 为人民币 67,262,143.52 元，金鹰责任投资混合型证券投资基金 C 为人民币 225,626,805.33 元，于 2021 年 3 月 16 日划至托管银行账户，首次设立募集规模为 292,888,948.85 份基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《金鹰责任投资混合型证券投资基金合同》的有关规定，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（包括主板、中小板、创业板、存托凭证及其他中国证监会允许基金投资的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、次级债、永续债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（含协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金股票资产占基金资产的比例为 60%-95%（其中，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%），投资于本基金界定的“责任投资”主题相关证券资产的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后可调整上述投资品种的投资比例。本基金可根据法律法规的规定参与融资业务。

#### 6.4.2 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。

#### 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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 3 月 16 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 重要会计政策和会计估计**

##### **6.4.4.1 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。本基金本报告期间为 2021 年 3 月 16 日至 2021 年 6 月 30 日。

##### **6.4.4.2 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。

##### **6.4.4.3 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。

##### **6.4.4.4 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按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。

#### 6.4.4.5 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、首次公开发行时股票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。

#### 6.4.4.6 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。

#### 6.4.4.7 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。

#### 6.4.4.8 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)”。

#### 6.4.4.9 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。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

1、基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 的年费率逐日计提；

2、基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率逐日计提；

3、基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提，本基金 A 类基金份额不收取销售服务费；

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。

#### **6.4.4.11 基金的收益分配政策**

1、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

2、本基金收益分配方式分两种：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、基金收益分配后两类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的两类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、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### **6.4.4.12 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。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

#### **6.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教



育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1. 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税；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。

#### **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	19,090,231.24
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	19,090,231.24

#### 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	25,471,477.52	30,410,326.29	4,938,848.77
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	25,471,477.52	30,410,326.29	4,938,848.77

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期内未投资于衍生金融资产/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余额。

##### 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	10,614.45
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	54.40
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	235.14
合计	10,903.99

## 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	63,722.73
银行间市场应付交易费用	-
合计	63,722.73

## 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	3,614.50
应付证券出借违约金	-
审计费用	10,736.38
预提信息披露费	44,123.59
合计	58,474.47

## 6.4.7.8 实收基金

## 金鹰责任投资混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年3月16日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	67,262,143.52	67,262,143.52
本期申购	4,503,301.05	4,503,301.05
本期赎回（以“-”号填列）	-35,048,530.20	-35,048,530.20
本期末	36,716,914.37	36,716,914.37

## 金鹰责任投资混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年3月16日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	225,626,805.33	225,626,805.33
本期申购	2,214,399.04	2,214,399.04
本期赎回（以“-”号填列）	-219,209,841.56	-219,209,841.56
本期末	8,631,362.81	8,631,362.81

## 6.4.7.9 未分配利润

## 金鹰责任投资混合 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	192,329.00	4,096,954.44	4,289,283.44
本期基金份额交易产生的变动数	-4,627.48	-737,797.97	-742,425.45
其中：基金申购款	9,049.83	171,641.57	180,691.40
基金赎回款	-13,677.31	-909,439.54	-923,116.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	187,701.52	3,359,156.47	3,546,857.99

## 金鹰责任投资混合 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-81,873.41	841,894.33	760,020.92
本期基金份额交易产生的变动数	103,405.56	-53,803.39	49,602.17
其中：基金申购款	-3,808.42	77,287.30	73,478.88
基金赎回款	107,213.98	-131,090.69	-23,876.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	21,532.15	788,090.94	809,623.09

## 6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月16日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	活期存款利息收入	388,098.65

定期存款利息收入	111,875.56
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	4,297.54
其他	30.28
合计	504,302.03

#### 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3月16日（基金合同生效日）至2021年6月30日
卖出股票成交总额	22,546,591.65
减：卖出股票成本总额	22,457,713.70
买卖股票差价收入	88,877.95

#### 6.4.7.12 基金投资收益

本基金本报告期内未投资基金。

#### 6.4.7.13 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内未投资债券。

#### 6.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内未投资资产支持证券。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内未投资于贵金属。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内未投资于衍生金融工具。

#### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年3月16日（基金合同生效日）至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	145,890.20
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	145,890.20

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年3月16日（基金合同生效日）至2021年6月30日
1.交易性金融资产	4,938,848.77
——股票投资	4,938,848.77
——债券投资	-

——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	4,938,848.77

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年3月16日（基金合同生效日）至2021年6月30日
基金赎回费收入	195,419.33
转换费收入	1.15
合计	195,420.48

#### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年3月16日（基金合同生效日）至2021年6月30日
交易所市场交易费用	113,406.75
银行间市场交易费用	0.00
合计	113,406.75

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年3月16日（基金合同生效日）至2021年6月30日
审计费用	10,736.38
信息披露费	44,123.59
证券出借违约金	-
其他项目	400.00
合计	55,259.97

#### 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，本基金无须披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无重大须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
招商证券股份有限公司	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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年3月16日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	70,462,342.95	100.00%

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年3月16日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
招商证券	390,000,000.00	100.00%

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年3月16日（基金合同生效日）至2021年6月30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
招商证券	63,722.73	100.00%	-	-

#### 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3月16日（基金合同生效日）至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	557,463.87
其中：支付销售机构的客户维护费	133,920.57

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 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。

## 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2021年3月16日（基金合同生效日）至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	92,910.68

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

## 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3月16日（基金合同生效日）至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	金鹰责任投资混合 A	金鹰责任投资混合 C	合计
招商证券股份有限公司	-	84,954.69	84,954.69
金鹰基金管理有限公司	-	30,309.60	30,309.60



合计	-	115,264.29	115,264.29
----	---	------------	------------

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 0.80% 年费率计提，销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

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

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记结算机构，由登记结算机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 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

本基金本报告期没有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 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

##### 6.4.10.4.1 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

本基金本报告期未参与转融通出借业务。

##### 6.4.10.4.2 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

本基金本报告期未参与转融通出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 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

###### 金鹰责任投资混合 A

本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

###### 金鹰责任投资混合 C

本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.10.6 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	
	2021年3月16日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入

招商证券股份有限公司	19,090,231.24	388,098.65
------------	---------------	------------

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 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

本基金本报告期内未投资于基金。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本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

本基金本报告期末未持有流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金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

截至本报告期末 2021 年 06 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 06 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期内未参与转融通出借业务。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

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

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

为保证公司规范化运作，有效地防范和化解经营风险，确保基金和公司财务和其他信息真实、准确、完整、及时，从而最大程度地保护基金持有人的合法权益，本基金管理人奉行全面风险管理

体系的建设，建立了科学合理、控制严密、运行高效的各项管理制度：

#### 1、风险管理控制制度

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

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

#### 2、投资管理制度

投资管理制度包括研究业务管理制度、投资决策管理制度、基金交易管理制度等。

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

制订投资决策业务管理制度的目的是严格遵守法律法规的有关规定，确保基金的投资符合基金合同所规定的投资目标、投资范围、投资策略、投资组合和投资限制等要求。投资决策业务管理制度包括投资决策授权制度；投资决策支持制度，重要投资要有详细的研究报告和风险分析支持；投资风险评估与管理制度，在设定的风险权限额度内进行投资决策；投资管理业绩评价制度等。

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

#### 3、监察稽核制度

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

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级等级的证券，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
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

注：本统计数据未包含国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债、同业存单。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	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
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	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
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

注：本统计数据未包含国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债、同业存单。

#### 6.4.13.2.5 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
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

**6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	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所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

**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。基金管理人通过久期、凸度等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对利率风险进行管理。

#### 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	19,090,231.24	-	-	-	-	-	-	-	-	19,090,231.24
结算备付金	121,071.58	-	-	-	-	-	-	-	-	121,071.58
存出保证金	126,040.13	-	-	-	-	-	-	-	-	126,040.13
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	30,410,326.29	30,410,326.29
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	1,222,075.32	1,222,075.32
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	10,903.99	10,903.99
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	61,675.20	61,675.20
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	236,827.39	236,827.39
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	19,337,342.95	-	-	-	-	-	-	-	31,941,808.19	51,279,151.14
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	-	-	-	-	-	-	-	-	323,790.70	323,790.70
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	1,047,544.64	1,047,544.64
应付管理人	-	-	-	-	-	-	-	-	64,171.70	64,171.70

报酬										70
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	10,695.28	10,695.28
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-	-	5,993.36	5,993.36
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	63,722.73	63,722.73
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	58,474.47	58,474.47
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	1,574,392.88	1,574,392.88
利率敏感度缺口	19,337,342.95	-	-	-	-	-	-	-	30,367,415.31	49,704,758.26
负债										
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
利率敏感度缺口	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于 2021 年 3 月 16 日成立，无上年度末数据；本期末没有债券持仓。

#### 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 2021 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)

交易性金融资产—股票投资	30,410,326.29	61.18
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>30,410,326.29</b>	<b>61.18</b>

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。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

##### 金鹰责任投资混合 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 2021 年 6 月 30 日
	业绩比较基准变动+5%	488,139.73
	业绩比较基准变动-5%	-488,139.73

注：本基金于 2021 年 3 月 16 日成立，无上年度末数据

##### 金鹰责任投资混合 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 2021 年 6 月 30 日
	业绩比较基准变动+5%	114,507.99
	业绩比较基准变动-5%	-114,507.99

注：本基金于 2021 年 3 月 16 日成立，无上年度末数据

#### 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 30,410,326.29 元，无第二层级和第三层级余额。

(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	30,410,326.29	59.30
	其中：股票	30,410,326.29	59.30
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	19,211,302.82	37.46

8	其他各项资产	1,657,522.03	3.23
9	合计	51,279,151.14	100.00

## 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	-	-
C	制造业	16,314,864.22	32.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	2,608,772.40	5.25
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	18,923,636.62	38.07

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
信息技术	3,489,144.43	7.02
工业	2,096,766.71	4.22
医疗保健	1,015,969.68	2.04
金融	4,884,808.85	9.83

合计	11,486,689.67	23.11
----	---------------	-------

## 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	300035	中科电气	189,100	4,623,495.00	9.30
2	300316	晶盛机电	62,500	3,156,250.00	6.35
3	300059	东方财富	79,560	2,608,772.40	5.25
4	03908	中金公司	143,600	2,497,271.78	5.02
5	000725	京东方 A	397,000	2,477,280.00	4.98
6	01347	华虹半导体	68,000	2,427,343.78	4.88
7	00388	香港交易所	6,200	2,387,537.07	4.80
8	03898	中车时代电气	54,900	2,096,766.71	4.22
9	600885	宏发股份	30,100	1,887,270.00	3.80
10	603688	石英股份	64,900	1,525,150.00	3.07
11	300460	惠伦晶体	64,000	1,513,600.00	3.05
12	300382	斯莱克	73,600	1,101,792.00	2.22
13	02382	舜宇光学科技	5,200	1,061,800.65	2.14
14	01521	方达控股	148,000	1,015,969.68	2.04
15	001207	联科科技	563	18,640.93	0.04
16	001208	华菱线缆	1,473	11,386.29	0.02

## 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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300059	东方财富	3,199,660.95	6.44
2	000725	京东方 A	3,180,352.00	6.40
3	300035	中科电气	2,617,821.00	5.27
4	H03908	中金公司	2,535,793.70	5.10
5	H03898	中车时代电气	2,533,068.80	5.10
6	H01347	华虹半导体	2,452,485.34	4.93
7	H00388	香港交易所	2,404,423.75	4.84
8	600111	北方稀土	2,349,682.00	4.73
9	300316	晶盛机电	2,276,672.00	4.58

10	600219	南山铝业	1,924,285.00	3.87
11	600742	一汽富维	1,809,625.64	3.64
12	H01208	五矿资源	1,658,394.51	3.34
13	H01810	小米集团-W	1,650,665.28	3.32
14	600885	宏发股份	1,603,833.00	3.23
15	000059	华锦股份	1,589,467.00	3.20
16	H02333	长城汽车	1,556,391.98	3.13
17	603688	石英股份	1,493,231.00	3.00
18	002466	天齐锂业	1,481,040.00	2.98
19	300460	惠伦晶体	1,412,270.00	2.84
20	H00354	中国软件国际	1,201,359.76	2.42
21	H01776	广发证券	1,200,720.60	2.42
22	H02126	药明巨诺-B	1,002,751.62	2.02
23	300382	斯莱克	992,611.00	2.00

## 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600111	北方稀土	2,356,313.00	4.74
2	002466	天齐锂业	1,844,452.00	3.71
3	000059	华锦股份	1,790,095.00	3.60
4	600742	一汽富维	1,758,165.32	3.54
5	600219	南山铝业	1,707,948.00	3.44
6	H01810	小米集团-W	1,607,172.43	3.23
7	H01208	五矿资源	1,394,611.17	2.81
8	H02333	长城汽车	1,367,935.97	2.75
9	300059	东方财富	1,235,589.00	2.49
10	H00354	中国软件国际	1,189,239.76	2.39
11	H01776	广发证券	1,098,849.31	2.21
12	300035	中科电气	988,077.00	1.99
13	H02126	药明巨诺-B	969,472.93	1.95
14	H03898	中车时代电气	880,403.93	1.77
15	000888	峨眉山A	819,986.00	1.65
16	600110	诺德股份	528,874.00	1.06
17	300861	美畅股份	500,290.00	1.01
18	000725	京东方A	347,060.00	0.70
19	H03908	中金公司	146,159.03	0.29
20	H09966	康宁杰瑞制药-B	15,897.80	0.03

## 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	47,929,191.22
--------------	---------------

卖出股票收入（成交）总额	22,546,591.65
--------------	---------------

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期内未投资债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期内未投资债券。

#### 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

本基金本报告期内未投资资产支持证券。

#### 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于贵金属。

#### 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于权证。

#### 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 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。

##### 7.11.2 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本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.13.2 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。

### 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	126,040.13
2	应收证券清算款	1,222,075.32
3	应收股利	61,675.20
4	应收利息	10,903.99
5	应收申购款	236,827.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,657,522.03

### 7.13.4 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
金鹰责任投资混合 A	6,017	6,102.20	0.00	0.00%	36,716,914.37	100.00%
金鹰责任投资混合 C	634	13,614.14	0.00	0.00%	8,631,362.81	100.00%
合计	6,651	6,818.26	0.00	0.00%	45,348,277.18	100.00%

## 8.2 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	金鹰责任投资混合 A	3,016.59	0.01%
	金鹰责任投资混合 C	-	-
	合计	3,016.59	0.01%

## 8.3 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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	金鹰责任投资混合 A	0
	金鹰责任投资混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	金鹰责任投资混合 A	0
	金鹰责任投资混合 C	0
	合计	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	金鹰责任投资混合 A	金鹰责任投资混合 C
基金合同生效日（2021 年 3 月 16 日）基金份额总额	67,262,143.52	225,626,805.33
本报告期期初基金份额总额	67,262,143.52	225,626,805.33
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	4,503,301.05	2,214,399.04
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	35,048,530.20	219,209,841.56
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	36,716,914.37	8,631,362.81

## § 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 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、2021 年 5 月 4 日，本基金托管人招商证券股份有限公司聘牛中强、张志斌任托管部副总经理。

## 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、公募基金托管业务的诉讼。



#### 10.4 基金投资策略的改变

本基金报告期内没有改变基金投资策略。

#### 10.5 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	
招商证券	2	70,462,342.95	100.00%	63,722.73	100.00%	-

##### 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
招商证券	-	-	390,000,000.00	100.00%	-	-

## 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关于董事变更的公告	证监会指定媒介	2021-01-14
2	金鹰基金管理有限公司关于金鹰责任投资混合型证券投资基金新增代销机构的公告	证监会指定媒介	2021-01-18
3	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
4	金鹰基金管理有限公司关于金鹰责任投资混合型证券投资基金新增信达证券为代销机构的公告	证监会指定媒介	2021-02-25
5	金鹰基金管理有限公司关于金鹰责任投资混合型证券投资基金新增银河证券等为代销机构的公告	证监会指定媒介	2021-03-01
6	金鹰基金管理有限公司关于金鹰责任投资混合型证券投资基金新增华安证券为代销机构的公告	证监会指定媒介	2021-03-03
7	金鹰基金管理有限公司关于金鹰责任投资混合型证券投资基金新增代销机构的公告	证监会指定媒介	2021-03-04
8	金鹰基金管理有限公司关于金鹰责任投资混合型证券投资基金新增海通证券为代销机构的公告	证监会指定媒介	2021-03-05
9	金鹰基金管理有限公司关于金鹰责任投资混合型证券投资基金新增代销机构的公告	证监会指定媒介	2021-03-08
10	金鹰责任投资混合型证券投资基金基金提前结束募集的公告	证监会指定媒介	2021-03-10
11	金鹰基金管理有限公司关于金鹰责任投资混合型证券投资基金新增代销机构的公告	证监会指定媒介	2021-03-11
12	金鹰责任投资混合型证券投资基金基金合同生效公告	证监会规定媒介	2021-03-17
13	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金参与科创板投资及相关风险揭示的公告	证监会规定媒介	2021-03-25
14	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增财达证券为代销机构的公告	证监会规定媒介	2021-03-26
15	金鹰基金管理有限公司金鹰责任投资混合型证券投资基金基金开放日常申购(赎回、转换、定期定额投资)业务公告	证监会规定媒介	2021-04-13
16	金鹰基金管理有限公司新增爱建证券等为金鹰责任投资混合型证券投资基金代销机构的公告	证监会规定媒介	2021-04-14
17	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	证监会规定媒介	2021-04-16

18	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	证监会规定媒介	2021-04-28
19	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增恒泰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	证监会规定媒介	2021-05-06
20	金鹰基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证监会规定媒介	2021-05-11
21	金鹰基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证监会规定媒介	2021-05-14
22	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、基金定投业务及费率优惠的公告	证监会规定媒介	2021-05-19
23	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增西部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	证监会规定媒介	2021-05-25
24	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增中邮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	证监会规定媒介	2021-06-07
25	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增招商赢通为代销机构的公告	证监会规定媒介	2021-06-09
26	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	证监会规定媒介	2021-06-10
27	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	证监会规定媒介	2021-06-25

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 影响投资者决策的其他重要信息

无影响投资者决策的其它重大信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。
- 2、《金鹰责任投资混合型证券投资基金基金合同》。

- 3、《金鹰责任投资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、招募说明书、产品资料概要及其他临时公告。

## 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