

# 金鹰多元策略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：中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国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	7
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
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	11
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	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	17
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	40
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	40
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	40
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	40
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	40
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	40

7.12 本报告期投资基金情况.....	41
7.13 投资组合报告附注.....	41
<b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>42</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	42
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	43
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况.....	43
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>43</b>
<b>§ 10 重大事件揭示.....</b>	<b>43</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	43
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
10.4 基金投资策略的改变.....	44
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件.....	44
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	44
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.....	44
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
10.9 其他重大事件.....	45
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>47</b>
11.1 影响投资者决策的其他重要信息.....	47
<b>§ 12 备查文件目录.....</b>	<b>47</b>
12.1 备查文件目录.....	47
12.2 存放地点.....	47
12.3 查阅方式.....	47

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	金鹰多元策略灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	金鹰多元策略混合
基金主代码	002844
交易代码	002844
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年8月9日
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	31,235,994.92 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过灵活运用多种投资策略，充分挖掘和利用市场中潜在的投资机会，力争实现基金资产的稳健回报和长期增值。
投资策略	<p>(一) 资产配置策略</p> <p>本基金将从宏观面、政策面、基本面和资金面等多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、固定收益类资产等各类资产类别上的投资比例，大限度的提高收益。</p> <p>(二) 股票投资策略</p> <p>本基金根据不同市场环境灵活运用成长、主题、定向增发、动量、事件驱动等多种投资策略积极进行股票投资。本基金通过对以上策略的综合运用，力争实现基金资产的稳健增值。</p> <p>1、成长策略</p> <p>本基金所指的成长策略主要指本基金对新兴产业、行业景气度较高或处于上升阶段的转型行业及实现革新转型、持续增长的传统产业中具有成长风格的上市公司的投资策略。对于新兴行业和处于转型阶段的行业，重点投资能够体现行业发展方向、拥有关键技术、创新意识领先并已经形成明确盈利模式、预期利润及销售收入持续增长的上市公司。对于实现转型革新、持续增长的传统产业，通过关注产业增长的持续性、核心竞争力、发展战略布局以及市场增长空间等层面，重点投资具有清晰商业模式、业绩持续增长且具有不可复制性的上市公司。本基金将精选上述行业中代表性较强、成长性良好、估值具有吸引力，预期业绩持续增长的成长型个股进行投资。</p> <p>2、主题策略</p> <p>本基金所指的主题是指国内外实体经济、政府政策、科学技术、社会变迁、金融市场等层面已经发生或预期将发生的，将导致行业或企业竞争</p>

力提升、盈利水平改善的驱动因素，涵盖但不限于内需增长、消费提振与消费升级、经济与产业结构优化、投资结构与布局改善、社会保障与医疗改革、节能减排、环保、产业转移、产业链优化、新能源与新材料、技术革新、城镇化、资源要素改革、金融财税改革等所带来的投资主题。本基金将通过分析研究上述投资主题对经济结构、产业结构或商业运作模式的影响力量，发掘和把握投资主题；通过对投资主题的分析评估，明确投资主题所对应的行业及板块，从而确受益于上述相关主题的上市公司。同时，本基金将积极挖掘和研究新的投资主题，并对主题投资方向做出适时调整，从而准确把握新旧投资主题的转换时机，分享不同投资主题所伴随的投资机遇。

### 3、动量策略

本基金所指的动量策略是指市场在一定时期内呈现“强者恒强”的特征，通过买入过去一段时期的表现强势的个股以获得超越市场平均水平的收益的投资策略。本基金将综合分析各股票价格走势及价格动量特征，选择动量特征明显和价格趋势强劲的个股纳入投资组合。

### 4、定向增发策略

本基金所指的定向增发是指上市公司向特定投资者（包括大股东、机构投资者、自然人等）非公开发行股票再融资策略。上市公司通过定向增发进行融资进行项目投资、资产购买、拓展新业务、补充营运资本等，进而带动公司的长期成长及业绩提升。本基金将积极跟踪发布定向增发预案及实施定向增发的上市公司，对其进行综合的基本面分析。同时结合市场未来走势，从战略角度评估参与定向增发的预期中签情况、预期损益和风险水平，积极参与风险较低的定向增发项目。在定向增发股票锁定期结束后，本基金将根据对综合对股票内在投资价值和成长性的判断，结合对股票市场环境的分析，选择适当的时机卖出，以增强基金的收益。

### 5、事件驱动策略

本基金所指的事件驱动策略是指在提前挖掘和深入分析可能造成股价异常波动的事件基础上，通过充分把握交易时机获取超额投资回报的投资策略。本基金的事件驱动策略中涵盖的事件是指具有较明确的时间和内容，能够对部分投资者的投资行为产生一定的影响进而对股价走势产生影响的事件性因素，包括但不限于资产重组（重组、兼并、收购等）、股权变更、股权激励、管理层变动、控股股东更替、股份解禁、发布重大公告或推出新业务新产品、业绩预增等。事件驱动策略是一个系统的投资策略体系，通过分析特定事件对上市公司价值和股价表现的影响，寻求投资机会，获取由该事件带来的收益。

#### （三）存托凭证投资策略

本基金投资存托凭证的策略依照股票投资策略执行，选择投资价值高的存托凭证进行投资。

#### （四）债券投资策略

基金管理人将秉承稳健优先的原则，在保证投资低风险的基础上谨慎投资债券市场，力图获得良好的收益。本基金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，综合运用类属配置、久期配置、收益率曲线骑乘、套利等多种投资策略，构建收益稳定、

	<p>流动性良好的债券组合。</p> <p>(五) 中小企业私募债券投资策略</p> <p>本基金将运用基本面研究结合公司财务分析方法,对债券发行人信用风险进行分析和度量,选择风险与收益相匹配的更优品种进行投资。深入研究债券发行人基本面信息,分析企业的长期运作风险;对债券发行人进行财务风险评估;利用历史数据、市场价格以及资产质量等信息,估算私募债券发行人的违约率及违约损失率并考察债券发行人的增信措施。综合上述分析结果,确定信用利差的合理水平,利用市场的相对失衡,确定具有投资价值的债券品种。</p> <p>(六) 衍生品投资策略</p> <p>本基金的衍生品投资将严格遵守证监会及相关法律法规的约束,在充分评估衍生产品的风险和收益的基础上,谨慎地进行投资。本基金将合理利用股指期货、权证等衍生工具发掘可能的投资机会,稳健投资,实现基金资产的保值增值。</p> <p>(七) 资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将分析资产支持证券的资产特征,估计违约率和提前偿付比率,并利用收益率曲线和期权定价模型,对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于证券投资基金中较高预期收益、较高预期风险的品种,其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金、低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		金鹰基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘盛	许俊
	联系电话	020-83936180	010-66594319
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4006135888	95566
传真		020-83282856	010-66594942
注册地址		广东省广州市南沙区滨海路171号11楼自编1101之一J79	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		广州市天河区珠江东路28号越秀金融大厦30层	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		510623	100818
法定代表人		王铁	刘连舸

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.gefund.com.cn
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	广州市天河区珠江东路 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）
本期已实现收益	23,990,261.28
本期利润	14,909,410.96
加权平均基金份额本期利润	0.4076
本期加权平均净值利润率	19.72%
本期基金份额净值增长率	20.60%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	28,736,231.46
期末可供分配基金份额利润	0.9200
期末基金资产净值	72,827,873.59
期末基金份额净值	2.3315
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	133.15%

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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2、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、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）。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.62%	1.18%	-0.91%	0.41%	3.53%	0.77%
过去三个月	18.98%	1.18%	2.46%	0.49%	16.52%	0.69%
过去六个月	20.60%	1.47%	1.53%	0.66%	19.07%	0.81%
过去一年	52.63%	1.92%	14.21%	0.66%	38.42%	1.26%
过去三年	130.73%	1.82%	33.38%	0.68%	97.35%	1.14%
自基金合同生效起至今	133.15%	1.49%	41.63%	0.59%	91.52%	0.90%

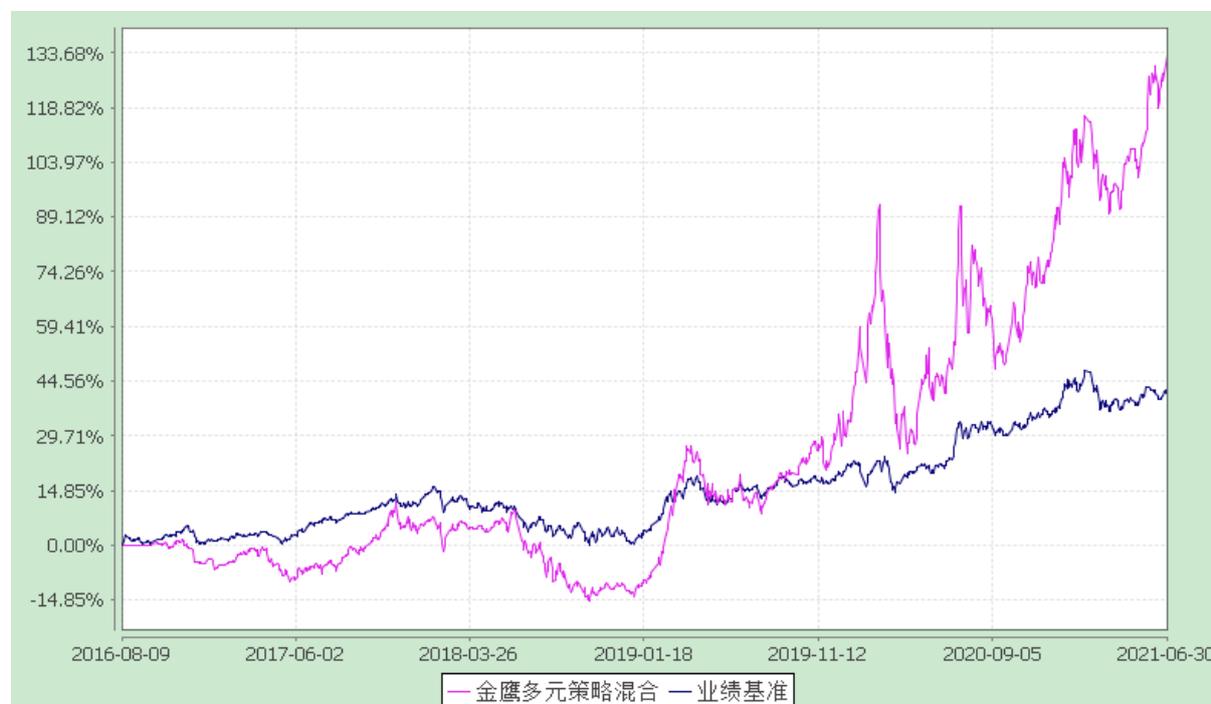
注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。

### 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

金鹰多元策略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 8 月 9 日至 2021 年 6 月 30 日)



注：（1）本基金合同 2016 年 8 月 9 日成立。（2）报告期末，本基金各项投资比例指标符合基金合同约定。（3）本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基字[2002]97 号文批准，金鹰基金管理有限公司于 2002 年 12 月 25 日成立。2011 年 12 月公司获得特定客户资产管理计划业务资格，2013 年 7 月子公司——广州金鹰资产管理有限公司成立。2015 年 12 月，获得受托管理保险资金投资管理资格。

“以人为本、互信协作；创新谋变、挑战超越”是金鹰人的核心价值观。公司坚持价值投资为导向，着力打造高水准的投研团队，努力为投资者创造丰厚回报。金鹰基金拥有一支经验丰富，风格多元的投资团队。

公司秉承开放、包容、多元的投资文化，采取基金经理负责制，将产品契约与基金经理风格有机结合，鼓励基金经理个人风格的充分展现，强化产品投资风格的稳定性，逐步形成了风险收益特征多元，投资研究体系有机互补的整体投研平台和基金产品线。截至报告期末，合计管理公募基金 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		
樊勇	本基金的基金经理	2020-06-20	-	9	樊勇先生，曾任广州证券股份有限公司资产管理部研究员，2015 年 1 月加入金鹰基金管理有限公司，现任权益投资部基金经理。
殷磊	本基金的基金经理助理	2020-11-25	-	11	殷磊先生，复旦大学企业管理专业硕士，2020 年 11 月加入金鹰基金管理有限公司，担任研究员职务。

注：1、任职日期和离任日期指公司公告聘任或解聘日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》和其他有关法律法规及其各项实施准则，严格遵守本基金的基金合同、托管协议、招募说明书等法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉

尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，基金运作合法合规，无出现重大违法违规或违反基金合同的行为，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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，宏观经济整体稳定，流动性较为宽松。上半年市场整体风格变化较大，年初，受到流动性收紧预期、上游原材料大幅涨价等因素影响，半导体、新能源等去年涨幅较大的板块，出现了较大的回调。而受益涨价的化工、煤炭、钢铁等板块表现较好。2 季度，随着经济持续恢复，中游企业盈利能力超预期。业绩突出的新能源汽车中游、半导体、光伏等板块出现了较大的涨幅。

本基金保持了中性仓位，整体配置较为均衡，重点布局了新能源、周期、计算机、化工等板块。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值为 2.3315 元，本报告期份额净值增长率为 20.60%，同期业绩比较基准收益率为 1.53%。

#### 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，流动性整体易松难紧。半导体、新能源汽车、光伏等板块业绩预计将可能保持高增长。计算机等板块经过近一年的调整，很多个股回到了合理估值，消费、医疗等板块也回调了较为合理区间。

本基金将保持稳健的投资策略，重点布局新能源汽车，计算机、化工等板块。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在金鹰多元策略灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 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：金鹰多元策略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	20,452,866.39	22,344,777.66
结算备付金		291,532.04	268,565.69
存出保证金		45,801.58	92,804.55

交易性金融资产	6.4.7.2	52,904,241.43	82,517,352.36
其中：股票投资		52,904,241.43	82,517,352.36
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		454,281.42	-
应收利息	6.4.7.5	1,895.51	2,363.64
应收股利		-	-
应收申购款		82,478.27	282,727.10
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		74,233,096.64	105,508,591.00
<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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,036.20	-
应付赎回款		1,107,112.54	3,381,897.75
应付管理人报酬		90,022.57	142,521.54
应付托管费		15,003.76	23,753.59
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	92,852.93	176,868.05
应交税费		-	0.19
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	99,195.05	83,436.64
负债合计		1,405,223.05	3,808,477.76
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	31,235,994.92	52,606,779.90
未分配利润	6.4.7.10	41,591,878.67	49,093,333.34
所有者权益合计		72,827,873.59	101,700,113.24
负债和所有者权益总计		74,233,096.64	105,508,591.00

注：截至本报告期末 2021 年 06 月 30 日，本基金份额净值为 2.3315 元，基金份额总额为 31,235,994.92 份。

## 6.2 利润表

会计主体：金鹰多元策略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
<b>一、收入</b>		<b>16,089,539.88</b>	<b>-6,749,665.27</b>
1.利息收入		61,195.18	72,270.25
其中：存款利息收入	6.4.7.11	38,871.03	27,705.54
债券利息收入		14,257.97	44,564.71
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		8,066.18	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		24,912,321.50	-16,412,160.88
其中：股票投资收益	6.4.7.12	24,642,379.03	-16,650,024.28
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	703.80	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.15	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.16	-	-
衍生工具收益	6.4.7.17	-	-
股利收益	6.4.7.18	269,238.67	237,863.40
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	-9,080,850.32	8,095,562.27
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	196,873.52	1,494,663.09
<b>减：二、费用</b>		<b>1,180,128.92</b>	<b>2,291,576.64</b>
1. 管理人报酬		565,239.17	770,799.72
2. 托管费		94,206.49	128,466.64
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.21	425,566.65	1,330,159.54
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	0.24
7. 其他费用	6.4.7.22	95,116.61	62,150.50
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>14,909,410.96</b>	<b>-9,041,241.91</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>14,909,410.96</b>	<b>-9,041,241.91</b>

## 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金鹰多元策略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（基金净值）	52,606,779.90	49,093,333.34	101,700,113.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,909,410.96	14,909,410.96
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）	-21,370,784.98	-22,410,865.63	-43,781,650.61
其中：1.基金申购款	14,826,929.74	16,062,189.86	30,889,119.60
2.基金赎回款	-36,197,714.72	-38,473,055.49	-74,670,770.21
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）	31,235,994.92	41,591,878.67	72,827,873.59
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）	32,733,813.97	9,652,677.02	42,386,490.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-9,041,241.91	-9,041,241.91
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）	46,540,666.92	41,213,683.69	87,754,350.61
其中：1.基金申购款	204,997,734.70	118,191,827.42	323,189,562.12
2.基金赎回款	-158,457,067.78	-76,978,143.73	-235,435,211.51
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）	79,274,480.89	41,825,118.80	121,099,599.69

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

金鹰多元策略灵活配置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【2016】1028 号《关于准予金鹰多元策略灵活配置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》、《证券投资基金运作管理办法》、《金鹰多元策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为契约型，存续期限为不定期。首次设立募集资金为 252,238,976.34 元，认购资金在募集期间产生的利息 99,323.55 元，合计为 252,338,299.89 元，按照每份基金份额面值人民币 1.00 元计算，折合基金份额为 252,338,299.89 份，经中审种环会计师事务所（特殊普通合伙）出具验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《金鹰多元策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 8 月 9 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 252,338,299.89 份。本基金的基金管理人为金鹰基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

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（含中小板、创业板、存托凭证以及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括但不限于国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、中小企业私募债）、资产支持证券、银行存款、债券回购、货币市场工具、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

### 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 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与上年度财务报表一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

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

1. 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税；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	20,452,866.39
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	20,452,866.39

##### 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	45,845,461.79	52,904,241.43	7,058,779.64
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		45,845,461.79	52,904,241.43	7,058,779.64

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/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	1,758.89
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	118.08
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	18.54
合计	1,895.51

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	92,852.93
银行间市场应付交易费用	-

合计	92,852.93
----	-----------

## 6.4.7.8 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	2,290.99
应付证券出借违约金	-
审计费用	37,396.69
预提信息披露费	59,507.37
合计	99,195.05

## 6.4.7.9 实收基金

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	52,606,779.90	52,606,779.90
本期申购	14,826,929.74	14,826,929.74
本期赎回（以“-”号填列）	-36,197,714.72	-36,197,714.72
本期末	31,235,994.92	31,235,994.92

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	15,213,483.03	33,879,850.31	49,093,333.34
本期利润	23,990,261.28	-9,080,850.32	14,909,410.96
本期基金份额交易产生的变动数	-10,467,512.85	-11,943,352.78	-22,410,865.63
其中：基金申购款	9,052,915.84	7,009,274.02	16,062,189.86
基金赎回款	-19,520,428.69	-18,952,626.80	-38,473,055.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	28,736,231.46	12,855,647.21	41,591,878.67

## 6.4.7.11 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	36,534.23
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	1,834.79
其他	502.01

合计	38,871.03
----	-----------

**6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	163,228,082.14
减：卖出股票成本总额	138,585,703.11
买卖股票差价收入	24,642,379.03

**6.4.7.13 基金投资收益**

本基金本报告期末投资基金。

**6.4.7.14 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 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	13,508,356.40
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	13,280,655.60
减：应收利息总额	226,997.00
买卖债券差价收入	703.80

**6.4.7.15 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.16 贵金属投资收益**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.17 衍生工具收益**

本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.18 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	269,238.67
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	269,238.67

**6.4.7.19 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	-9,080,850.32
——股票投资	-9,080,850.32
——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	-9,080,850.32

## 6.4.7.20 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	195,860.31
转换费收入	1,013.21
合计	196,873.52

## 6.4.7.21 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	425,566.65
银行间市场交易费用	-
合计	425,566.65

## 6.4.7.22 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	12,396.69
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	4,612.55
其他	600.00
帐户维护费	18,000.00

合计	95,116.61
----	-----------

#### 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，本基金并无需要作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需用披露的重大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
中国银行股份有限公司	基金托管人
广州金鹰资产管理有限公司	基金管理人子公司

#### 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均未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均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均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均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

##### 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	565,239.17	770,799.72

其中：支付销售机构的客户维护费	219,219.41	280,346.27
-----------------	------------	------------

注：1、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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 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	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	94,206.49	128,466.64

注：1、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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期内及上年度可比期间均无应支付关联方的销售服务费。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金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 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

本基金本报告期与上年度可比期间均无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。

##### 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

本基金本报告期与上年度可比期间均无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。

## 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。

## 6.4.10.5.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
广州金鹰资产管理有限公司	3,228,076.97	10.33%	3,228,076.97	6.14%

## 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		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
中国银行股份有限公司	20,452,866.39	36,534.23	4,583,326.29	22,283.73

注：本基金用于证券交易结算的资金通过“中国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，按银行同业利率或约定利率计息，在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示。2021年6月30日余额 291,532.04 元，利息收入 1,834.79 元；2020年6月30日余额 621,860.90 元，利息收入 4,959.36 元。

## 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均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 其他关联交易事项的说明

无。

## 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

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
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
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

## 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无持有暂时停牌等流通受限股票的情况。

## 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，本基金没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，本基金没有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

## 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证券出借业务。

## 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立，建立了科学合理、控制严密、运行高效的各项管理制度：

## 1、风险管理控制制度

风险控制制度由总则、风险控制的目标和原则、风险控制的机构设置、风险控制的程序、风险

类型的界定、风险控制的主要措施、风险控制的具体制度、风险控制制度的监督与评价等部分组成。

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

## 2、投资管理制度

投资管理制度包括研究业务管理制度、投资决策管理制度、基金交易管理制度等。

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

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

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

## 3、监察稽核制度

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

### 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。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估控制证券发行人的信用风险，建立了内部评级体系，通过内部评级与外部评级相结合的方法充分评估证券的风险。

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

注：本统计数据未包含国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债、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	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：本统计数据未包含国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债、同业存单。

## 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	0.00	0.00

AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：以上数据按照最新发行人评级填列。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自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。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

#### 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	20,452,866.39	-	-	-	-	-	-	-	-	20,452,866.39
结算备付金	291,532.04	-	-	-	-	-	-	-	-	291,532.04
存出保证金	45,801.58	-	-	-	-	-	-	-	-	45,801.58
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	52,904,241.43	52,904,241.43
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	454,281.42	454,281.42
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	1,895.51	1,895.51
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	82,478.27	82,478.27
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	20,790,200.01	-	-	-	-	-	-	-	53,442,896.63	74,233,096.64
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	-	-	-	-	-	-	-	-	1,036.20	1,036.20
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	1,107,112.54	1,107,112.54
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	90,022.57	90,022.57
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	15,003.76	15,003.76

											76
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	92,852.93	-	92,852.93
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	99,195.05	-	99,195.05
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	1,405,223.05	-	1,405,223.05
利率敏感缺口	20,790,200.01	-	-	-	-	-	-	-	52,037,673.58	-	72,827,873.59
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	22,344,777.66	-	-	-	-	-	-	-	-	-	22,344,777.66
结算备付金	268,565.69	-	-	-	-	-	-	-	-	-	268,565.69
存出保证金	92,804.55	-	-	-	-	-	-	-	-	-	92,804.55
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	82,517,352.36	-	82,517,352.36
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	2,363.64	-	2,363.64
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	282,727.10	-	282,727.10
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	22,706,147.90	-	-	-	-	-	-	-	82,802,443.10	-	105,508,591.00
负债											
短期借款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

负债										
卖出回购金 融资产款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清 算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	3,381,897 .75	3,381,8 97.75	
应付管理人 报酬	-	-	-	-	-	-	-	142,521.5 4	142,521 .54	
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	23,753.59	23,753. 59	
应付销售服 务费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
应付交易费 用	-	-	-	-	-	-	-	176,868.0 5	176,868 .05	
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	0.19	0.19	
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
应付利润	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	83,436.64	83,436. 64	
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	3,808,477 .76	3,808,4 77.76	
利率敏感度 缺口	22,706, 147.90	-	-	-	-	-	-	78,993,96 5.34	101,700 ,113.24	

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金报告期末及上年度末未持有债券投资组合

#### 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 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	52,904,241.43	72.64	82,517,352.36	81.14
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	52,904,241.43	72.64	82,517,352.36	81.14

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

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	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	业绩比较基准变动+5%	6,529,469.44	12,835,088.16
业绩比较基准变动-5%	-6,529,469.44	-12,835,088.16	

#### 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 52,886,695.29 元，第二层级的余额为 17,546.14 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	52,904,241.43	71.27
	其中：股票	52,904,241.43	71.27
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	20,744,398.43	27.94
8	其他各项资产	584,456.78	0.79
9	合计	74,233,096.64	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	0.01
C	制造业	41,086,317.05	56.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,662.00	0.01
E	建筑业	11,014.44	0.02
F	批发和零售业	8,900.72	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	9,014.76	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,561,757.44	10.38
J	金融业	4,186,527.10	5.75
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	9,273.50	0.01
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	16,262.03	0.02
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	52,904,241.43	72.64

### 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通过港股通投资股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300037	新宙邦	57,600	5,765,760.00	7.92
2	688005	容百科技	46,227	5,602,712.40	7.69
3	300750	宁德时代	7,100	3,797,080.00	5.21
4	002050	三花智控	144,800	3,472,304.00	4.77
5	002466	天齐锂业	55,700	3,454,514.00	4.74
6	002212	天融信	169,900	3,358,923.00	4.61
7	600690	海尔智家	107,200	2,777,552.00	3.81
8	002001	新和成	81,720	2,343,729.60	3.22
9	300059	东方财富	67,200	2,203,488.00	3.03
10	300369	绿盟科技	120,200	1,917,190.00	2.63
11	300769	德方纳米	8,800	1,818,872.00	2.50
12	600619	海立股份	128,000	1,361,920.00	1.87
13	600660	福耀玻璃	22,900	1,278,965.00	1.76
14	688157	松井股份	9,770	1,217,928.20	1.67
15	600346	恒力石化	45,000	1,180,800.00	1.62
16	300890	翔丰华	20,600	1,124,760.00	1.54
17	601689	拓普集团	29,000	1,085,470.00	1.49
18	300382	斯莱克	68,900	1,031,433.00	1.42
19	000783	长江证券	133,600	977,952.00	1.34
20	601658	邮储银行	193,300	970,366.00	1.33
21	002439	启明星辰	32,300	937,023.00	1.29
22	000422	湖北宜化	96,600	846,216.00	1.16
23	002206	海利得	115,400	716,634.00	0.98
24	688561	奇安信	7,654	706,540.74	0.97
25	002601	龙佰集团	20,400	705,432.00	0.97
26	300454	深信服	2,400	622,752.00	0.86
27	300274	阳光电源	4,300	494,758.00	0.68
28	600580	卧龙电驱	27,600	367,080.00	0.50
29	002508	老板电器	7,700	358,050.00	0.49
30	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.05
31	001207	联科科技	682	22,581.02	0.03
32	605080	浙江自然	355	22,294.00	0.03
33	300919	中伟股份	128	20,864.00	0.03
34	605305	中际联合	368	19,364.16	0.03
35	603511	爱慕股份	553	18,249.00	0.03
36	605098	行动教育	289	16,262.03	0.02
37	605196	华通线缆	1,172	16,079.84	0.02

38	605300	佳禾食品	576	16,012.80	0.02
39	605319	无锡振华	764	13,706.16	0.02
40	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.02
41	605180	华生科技	335	12,395.00	0.02
42	603171	税友股份	637	12,230.40	0.02
43	605016	百龙创园	373	11,921.08	0.02
44	605287	德才股份	349	11,014.44	0.02
45	300900	广联航空	287	10,728.06	0.01
46	605086	龙高股份	443	10,512.39	0.01
47	300911	亿田智能	147	10,184.16	0.01
48	605259	绿田机械	270	9,625.50	0.01
49	603836	海程邦达	425	9,273.50	0.01
50	300893	松原股份	414	9,240.48	0.01
51	001202	炬申股份	459	9,014.76	0.01
52	300892	品渥食品	194	8,900.72	0.01
53	605488	福莱新材	312	8,327.28	0.01
54	300909	汇创达	179	7,714.90	0.01
55	605189	富春染织	317	7,636.53	0.01
56	300918	南山智尚	705	7,339.05	0.01
57	300925	法本信息	270	7,098.30	0.01
58	300884	狄耐克	262	7,042.56	0.01
59	300922	天秦装备	194	6,757.02	0.01
60	300927	江天化学	217	6,531.70	0.01
61	300886	华业香料	191	6,194.13	0.01
62	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.01

#### 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	300059	东方财富	4,895,491.00	4.81
2	002466	天齐锂业	4,678,686.00	4.60
3	300037	新宙邦	4,148,143.00	4.08
4	600089	特变电工	3,599,137.59	3.54
5	603179	新泉股份	3,560,023.52	3.50
6	002439	启明星辰	3,462,665.09	3.40
7	002050	三花智控	3,281,101.00	3.23
8	002212	天融信	3,113,173.00	3.06
9	000807	云铝股份	3,096,477.00	3.04

10	002001	新和成	3,057,065.00	3.01
11	002812	恩捷股份	3,034,456.70	2.98
12	601111	中国国航	2,960,252.00	2.91
13	688005	容百科技	2,890,527.93	2.84
14	000977	浪潮信息	2,772,013.47	2.73
15	002850	科达利	2,724,750.00	2.68
16	300271	华宇软件	2,390,250.00	2.35
17	600893	航发动力	2,382,466.00	2.34
18	600660	福耀玻璃	2,095,468.00	2.06
19	300369	绿盟科技	2,069,017.00	2.03
20	603885	吉祥航空	2,051,258.60	2.02

## 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	688005	容百科技	6,819,923.21	6.71
2	600763	通策医疗	6,571,324.00	6.46
3	002850	科达利	6,466,425.00	6.36
4	000807	云铝股份	6,411,837.21	6.30
5	000568	泸州老窖	5,001,498.82	4.92
6	002352	顺丰控股	4,974,295.00	4.89
7	601899	紫金矿业	4,962,933.01	4.88
8	600089	特变电工	4,596,541.55	4.52
9	300750	宁德时代	4,104,994.00	4.04
10	603348	文灿股份	3,833,980.00	3.77
11	603501	韦尔股份	3,809,282.00	3.75
12	002475	立讯精密	3,792,294.82	3.73
13	603179	新泉股份	3,649,774.00	3.59
14	601012	隆基股份	3,616,115.00	3.56
15	300274	阳光电源	3,355,883.19	3.30
16	300035	中科电气	3,342,957.94	3.29
17	002709	天赐材料	3,285,672.00	3.23
18	002812	恩捷股份	3,261,315.00	3.21
19	601111	中国国航	3,154,581.00	3.10
20	603267	鸿远电子	2,995,537.00	2.95
21	603290	斯达半导	2,788,421.00	2.74
22	603876	鼎胜新材	2,697,690.00	2.65
23	000977	浪潮信息	2,673,604.52	2.63
24	300271	华宇软件	2,556,372.00	2.51
25	603885	吉祥航空	2,535,380.00	2.49
26	002439	启明星辰	2,517,629.00	2.48
27	300769	德方纳米	2,504,716.00	2.46

28	300059	东方财富	2,498,613.89	2.46
----	--------	------	--------------	------

#### 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	118,053,442.50
卖出股票收入（成交）总额	163,228,082.14

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 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

本基金本报告期末无股指期货持仓。

##### 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

本基金本报告期末无国债期货持仓。

#### 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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

本基金本报告期末投资基金。

### 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浙江三花智控股份有限公司因未及时披露公司重大事项，未依法履行其他职责等行为，于 2021 年 2 月 1 日被深圳证券交易所监管关注。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天齐锂业股份有限公司因信息披露虚假或严重误导性陈述，业绩预测结果不准确或不及时行为，于 2020 年 9 月 4 日被深圳证券交易所公开批评。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	45,801.58
2	应收证券清算款	454,281.42
3	应收股利	-
4	应收利息	1,895.51
5	应收申购款	82,478.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	584,456.78

#### 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债券投资。

#### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本期末前十名股票中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

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
9,598	3,254.43	3,228,076.97	10.33%	28,007,917.95	89.67%

#### 8.2 期末上市基金前十名持有人

本基金非上市交易型基金。

#### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	4,619.79	0.01%

## 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## 8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金非发起式基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年8月9日）基金份额总额	252,338,299.89
本报告期期初基金份额总额	52,606,779.90
本报告期基金总申购份额	14,826,929.74
减：本报告期基金总赎回份额	36,197,714.72
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	31,235,994.92

## § 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，无涉及托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 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	105,700,337.21	37.68%	96,323.59	40.57%	-
新时代证券	1	90,883,682.96	32.40%	64,645.55	27.23%	-
中信建投证券	2	68,125,838.90	24.29%	62,083.05	26.15%	-
安信证券	1	15,777,554.95	5.63%	14,377.65	6.06%	-

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

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

### 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	23,806,464.00	89.63%	38,300,000.00	84.18%	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	2,755,551.00	10.37%	7,200,000.00	15.82%	-	-

注：本基金专用交易单位的选择程序如下：

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

### 10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与信达证券费率优惠活动的公告	证监会指定媒介	2021-01-11
2	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
3	金鹰多元策略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
4	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

5	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
6	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
7	金鹰多元策略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
8	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
9	金鹰多元策略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
10	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
11	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
12	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
13	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	证监会指定媒介	2021-05-19
14	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
15	金鹰多元策略灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会指定媒介	2021-06-03
16	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
17	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
18	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
19	金鹰多元策略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
20	金鹰多元策略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
21	金鹰多元策略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	证监会指定媒介	2021-06-07
23	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
24	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增北	证监会指定媒介	2021-06-10

	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		
--	------------------------------------------	--	--

注：相关信息披露文件请登录本基金管理人网站查询。

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 影响投资者决策的其他重要信息

无影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会注册的金鹰多元策略灵活配置混合型证券投资基金发行及募集的文件。
- 2、《金鹰多元策略灵活配置混合型证券投资基金合同》。
- 3、《金鹰多元策略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、基金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新城珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅或按工本费购买复印件，也可登录本基金管理人网站查阅，本基金管理人网址：<http://www.gefund.com.cn>。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人客户服务中心，客户服务中心电话：4006-135-888 或 020-83936180。

金鹰基金管理有限公司

二〇二一年八月二十八日