

金鹰先进制造股票型证券投资基金（LOF）
（原金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）转型）

2022年第1季度报告

2022年3月31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

报告送出日期：二〇二二年四月二十二日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2022年4月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

自2022年1月11日起原金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）转型为金鹰先进制造股票型证券投资基金（LOF）。原金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）本报告期自2022年1月1日至2022年1月10日止，金鹰先进制造股票型证券投资基金（LOF）本报告期自2022年1月11日至2022年3月31日止。

§2 基金产品概况

2.1 金鹰先进制造股票型证券投资基金（LOF）

基金简称	金鹰先进制造股票（LOF）
场内简称	金鹰先进制造
基金主代码	162107
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年1月11日
报告期末基金份额总额	6,940,708.62份
投资目标	本基金主要投资于推动制造业升级和新兴产业发展所需的行业，通过精选股票和严格的风险控制，力争实现超过业绩比较基准的长期回报。
投资策略	本基金在主要投向于“先进制造”主题公司的前提

	<p>下，通过定量与定性相结合的方法精选具有核心竞争力、未来成长空间大、持续经营能力强的优质股票；“先进制造”主题相关行业是指推动制造业升级和新兴产业发展所需的行业，具有技术先进、知识密集、信息密集等特征，具备较高技术附加值、能够引领产业发展方向的产业。</p>	
业绩比较基准	<p>中证高端装备制造指数收益率*60%+中证港股通综合指数收益率*20%+中债总财富（总值）指数收益率*20%</p>	
风险收益特征	<p>本基金为股票型证券投资基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。</p> <p>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。</p>	
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	
下属两级基金的基金简称	金鹰先进制造股票（LOF）A	金鹰先进制造股票（LOF）C
下属两级基金的交易代码	162107	013479
报告期末下属两级基金	6,940,604.47 份	104.15 份

的份额总额		
-------	--	--

2.2 金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）

基金简称	金鹰量化精选股票（LOF）
场内简称	金鹰量化
基金主代码	162107
交易代码	162107
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年8月25日
报告期末基金份额总额	6,887,201.40份
投资目标	本基金运用多种量化模型方法，精选股票进行投资，力争有效控制风险的基础上，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金主要采用多种量化模型进行股票的选择。基于模型结果，基金管理人结合市场环境和股票特性，精选个股构建投资组合，以追求超越业绩比较基准表现的业绩水平。本基金采用的量化投资策略主要有：（1）多因子选股模型（2）事件驱动模型（3）行业轮动模型（4）评级反转策略。</p> <p>本基金投资于股票的资产占基金资产净值的比例为80%-95%，货币市场工具、现金、权证、资产支持证券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占基金资产净值的5%~20%，其中，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，权证投资的比例范围占基金资产净值的0%~3%。</p>
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，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混合型基金、债券型基金及货币市场基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

3.1.1 金鹰先进制造股票型证券投资基金（LOF）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2022年1月11日（基金合同生效日）-2022年3月31日)	
	金鹰先进制造股票（LOF） A	金鹰先进制造股票（LOF）C
1.本期已实现收益	-712,432.53	-11.01
2.本期利润	-1,376,365.92	-16.74
3.加权平均基金份额 本期利润	-0.2270	-0.1828
4.期末基金资产净值	6,225,971.45	93.26
5.期末基金份额净值	0.8970	0.8954

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、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；

4、本基金由金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）转型而来并增设 C 类份额类别，合同生效日为 2022 年 1 月 11 日（下同），本报告期的相关数据按实际存续期计算。

3.1.2 金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2022年1月1日-2022年1月10日)
1.本期已实现收益	6,795.10
2.本期利润	-193,609.40
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0279
4.期末基金资产净值	7,361,373.82
5.期末基金份额净值	1.0688

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、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 金鹰先进制造股票型证券投资基金（LOF）

（报告期：2022年1月11日-2022年3月31日）

3.2.1.1 本报告期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

1. 金鹰先进制造股票（LOF）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
自基金合同生效起至今	-16.07%	1.58%	-11.74%	1.46%	-4.33%	0.12%

注：1、本基金由原金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）于2022年1月11日转型而来，截止报告期末，本基金合同生效未满三个月；

2、业绩比较基准：中证高端装备制造指数收益率*60%+中证港股通综合指数收益率*20%+中债总财富（总值）指数收益率*20%。

2. 金鹰先进制造股票（LOF）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
自基金合同生效起至今	-16.22%	1.58%	-11.74%	1.46%	-4.48%	0.12%

注：1、本基金由原金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）于2022年1月11日转型而来，截止报告期末，本基金合同生效未满三个月；

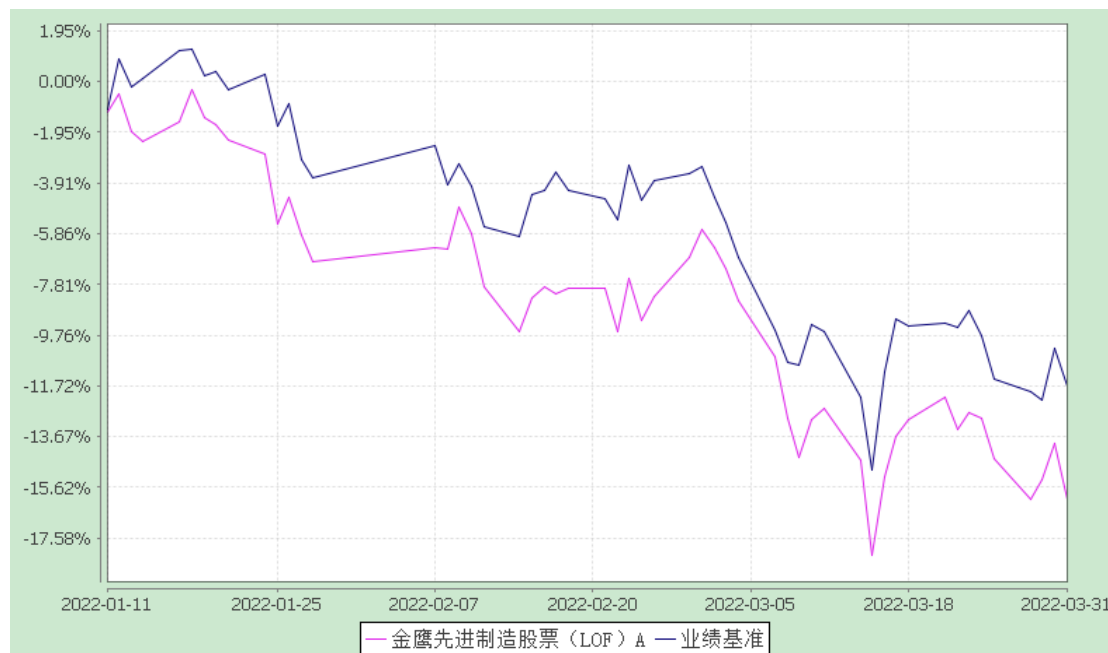
2、业绩比较基准：中证高端装备制造指数收益率*60%+中证港股通综合指数收益率*20%+中债总财富（总值）指数收益率*20%。

3.2.1.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

金鹰先进制造股票型证券投资基金（LOF）

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2022年1月11日至2022年3月31日)

1、金鹰先进制造股票（LOF）A

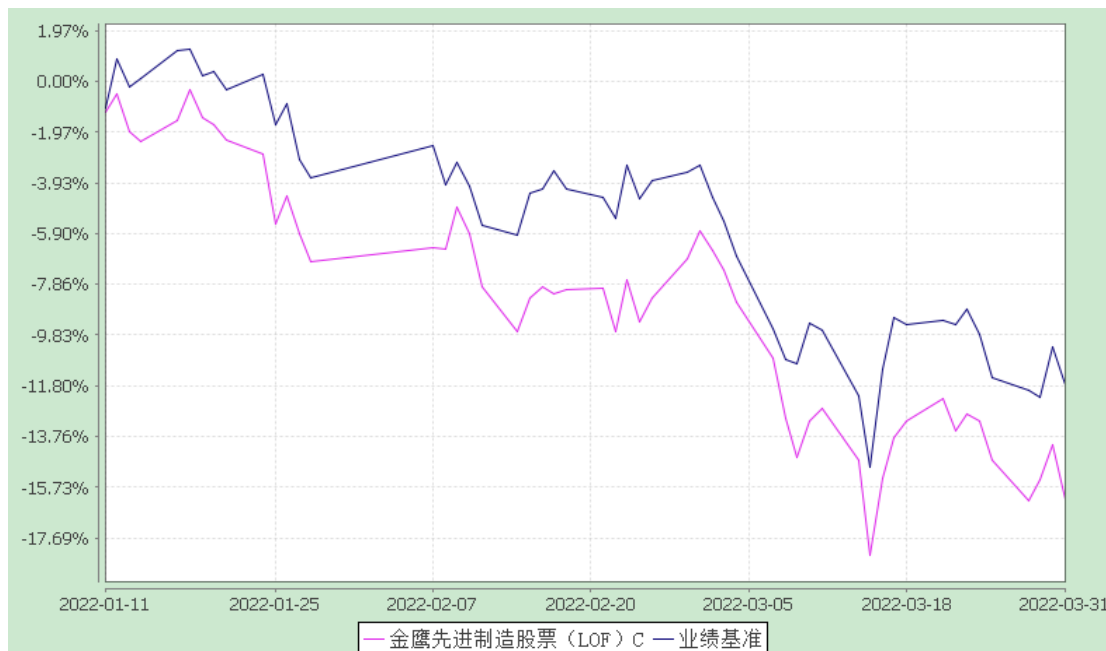


注：1、本基金由原金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）于2022年1月11日转型而来，本基金本报告期间为2022年1月11日至2022年3月31日；

截止报告期末，本基金合同生效未满三个月；

2、业绩比较基准：中证高端装备制造指数收益率*60%+中证港股通综合指数收益率*20%+中债总财富（总值）指数收益率*20%。

2、金鹰先进制造股票（LOF）C



注：1、本基金由原金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）于2022年1月11日转型而来，本基金本报告期间为2022年1月11日至2022年3月31日；截止报告期末，本基金合同生效未满三个月；

2、业绩比较基准：中证高端装备制造指数收益率*60%+中证港股通综合指数收益率*20%+中债总财富（总值）指数收益率*20%。

3.2.2 金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）

（报告期：2022年1月1日-2022年1月10日）

3.2.2.1 本报告期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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个	-2.55%	0.45%	-1.54%	0.53%	-1.01%	-0.08%

月						
过去六个月	1.85%	0.70%	-0.04%	0.63%	1.89%	0.07%
过去一年	13.15%	1.04%	-2.20%	0.80%	15.35%	0.24%
过去三年	49.00%	1.33%	23.62%	1.00%	25.38%	0.33%
过去五年	5.25%	1.34%	38.86%	0.98%	-33.61%	0.36%
自基金合同生效起至今	6.88%	1.30%	42.66%	0.93%	-35.78%	0.37%

注：1、本基金本报告期间为2022年1月1日至2022年1月10日。过去三个月时间段为：2022年1月1日-2022年1月10日；过去六个月时间段为：2021年10月1日-2022年1月10日；过去一年时间段为：2021年4月1日-2022年1月10日；过去三年时间段为：2019年4月1日-2022年1月10日；过去五年时间段为：2017年4月1日-2022年1月10日；

2、金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）自2022年1月11日起转型为金鹰先进制造股票型证券投资基金（LOF）；

3、转型前本基金的业绩比较基准是：沪深300指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%。

1.1.1.1 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

金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2016年8月25日至2022年1月10日)



注：1、本基金本报告期间为2022年1月1日至2022年1月10日；

2、金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）自2022年1月11日起转型为金鹰先进制造股票型证券投资基金（LOF）；

3、转型前本基金的业绩比较基准是：沪深300指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨刚	本基金的基金经理，公司权益研究部总经理	2020-12-29	-	26	杨刚先生，1996年7月至2001年4月就职于大鹏证券综合研究所，先后负责行业研究、宏观策略研究和协助研究所管理工作，历任高级研究员和部门主管；2001年5月至2009年3月就职于平安证券综合研究所，负责行业研究、宏观策略研究及研究管理，历任高级研究员、部门主管和副所长等职务；2009年4月至2010年4月就职于平安证券资产管理部，担任执行总经理。杨刚先生于2010年5月加入金鹰基金管理有限公司，担任研究发展部研究总监，2014年9月至2015年12月担任金鹰元安保本混合型证券投资基金基金经理，2014年11月至2015年12月担任金鹰核心资源股票型证券投资基金基金经理，现任

					权益研究部总经理、基金经理。
--	--	--	--	--	----------------

注：1、任职日期和离任日期指公司公告聘任或解聘日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会颁布的《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》和其他有关法律法规及其各项实施准则，严格遵守本基金基金合同等法律文件的规定，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 公平交易专项说明

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。

公司通过规范的投资交易流程、完善的权限管理机制、有效的交易控制制度，确保公平交易的实施。同时通过投资交易系统中的公平交易功能执行交易，不断强化事后监控分析，以尽可能确保公平对待各投资组合。

报告期，公司对不同时间窗下（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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年一季度，受美国货币政策进入疫后收缩期、俄乌冲突的黑天鹅爆发等国外不利因素，以及国内多地新冠疫情反复，稳增长力度暂低于预期等国内不

利因素的综合影响，A股出现较大幅度下跌。

具体看，一季度上证指数、创业板指分别出现10-20个点不等的较大程度回撤，电子、军工、电新、食品饮料等前期热门的赛道板块、机构重仓品种跌幅较大，煤炭、地产、银行、农业等受益于稳增长方向或供需格局相对较优及预期改善的方向表现较佳。

本基金因已在报告期内正式转型为先进制造方向基金，按照契约要求，基金组合相应做了较大程度的调整。在以先进制造为核心的行业配置上，我们同时兼顾了产品规模的实际考量，重点选择了国防军工板块作为最主要的配置方向。

当下，全球已进入百年未有之大变局，大国博弈风起云涌，地缘冲突此起彼伏。俄乌战事的“意外”爆发，于二战后大体经历过近80年历史罕见的较长和平生活尤其是经历过改革开放40余年和平发展的中国人民而言，无疑有极大的震撼和启示。富国更须强兵，经济的持续健康发展，社会生活的稳定和平，都要求有强大的国防实力来拱卫，国防安全已是当代中国完全绕不开且须抓紧严肃对待的优先度极高的重要关切。从相关上市公司业绩层面，我们也看到了军工板块正从传统意义上的典型主题类板块向有业绩有增长的质优方向切换。拉长时间段来看，这个板块将是 α 与 β 兼具的朝阳型行业。

具体的细分方向上，我们目前重点关注了飞机、导弹等未来数年可能有业绩持续高增长的确定性板块，同时，结合板块估值、一季度预期高增、后续的国企改革及股权激励可能等，做了多角度的综合考量和仓位平衡。

一季度，军工行业尚处于左侧布局阶段。本产品在短期内的较快换仓和集中配置，及由于短期风险偏好的极度摆动造成的市场较大波动，的确带来了产品净值的一定回撤。预计在二季度以后，随着利率走向对股市敏感性影响的渐趋钝化，A股投资者风险偏好的逐渐修复，以及军工优质企业预期将不断验证的持续高增长和较好盈利表现，A股军工行业的价值洼地优势，有望被市场重新认识和准确定价。军工行业的投资，也将逐步进入右侧阶段。

后续，基金经理将密切关注重要持仓品种的基本面变化及重要影响因素，适时优化组合，争取为投资者获得更多回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，金鹰先进制造股票型证券投资基金（LOF）A类份额净值

为0.8970元，本报告期（2022年1月11日至2022年3月31日）份额净值增长率为-16.07%，同期业绩比较基准增长率为-11.74%；C类基金份额净值为0.8954元，本报告期（2022年1月11日至2022年3月31日）份额净值增长率-16.22%，同期业绩比较基准增长率为-11.74%。

截至2022年1月10日，原金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）份额净值为1.0688元，本报告期（2022年1月1日至2022年1月10日）份额净值增长率为-2.55%，同期业绩比较基准增长率为-1.54%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金资产净值已发生连续超过20个工作日低于5000万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 金鹰先进制造股票型证券投资基金（LOF）

（报告期：2022年1月11日-2022年3月31日）

5.1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	5,838,307.00	88.08
	其中：股票	5,838,307.00	88.08
2	固定收益投资	43,583.21	0.66
	其中：债券	43,583.21	0.66
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	386,511.58	5.83
7	其他各项资产	360,160.66	5.43

8	合计	6,628,562.45	100.00
---	----	--------------	--------

注：其他资产包括：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。

5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.1.2.1 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	5,660,057.00	90.91
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	178,250.00	2.86
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	-	-
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	5,838,307.00	93.77

5.1.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

5.1.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.1.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600893	航发动力	8,600	386,140.00	6.20
2	605123	派克新材	3,100	377,394.00	6.06
3	600765	中航重机	8,700	373,143.00	5.99
4	603267	鸿远电子	2,900	372,534.00	5.98
5	002049	紫光国微	1,800	368,172.00	5.91
6	300593	新雷能	8,000	366,800.00	5.89
7	000768	中航西飞	12,600	362,754.00	5.83
8	600038	中直股份	6,900	351,210.00	5.64
9	600862	中航高科	8,600	193,500.00	3.11
10	300777	中简科技	3,700	190,365.00	3.06

5.1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	43,583.21	0.70
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	43,583.21	0.70

5.1.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019658	21 国债 10	430.00	43,583.21	0.70

注：本基金本报告期末仅持有一只债券。

5.1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.1.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.1.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.1.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.1.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.1.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.1.11 投资组合报告附注

5.1.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期末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。

5.1.11.2 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。

5.1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,009.97
2	应收证券清算款	333,336.89
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	20,813.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	360,160.66

5.1.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.1.11.5 报告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中不存在流通受限股票。

5.1.11.6 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。

5.2 金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）

（报告期：2022年1月1日-2022年1月10日）

5.2.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	6,810,601.00	91.25
	其中：股票	6,810,601.00	91.25
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-

3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	519,845.24	6.97
7	其他各项资产	133,073.87	1.78
8	合计	7,463,520.11	100.00

注：其他资产包括：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。

5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.1 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	2,916,006.00	39.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	680,336.00	9.24
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	584,307.00	7.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	746,512.00	10.14
J	金融业	1,768,015.00	24.02
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	115,425.00	1.57
S	综合	-	-
	合计	6,810,601.00	92.52

5.2.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

5.2.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.2.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601658	邮储银行	118,600	664,160.00	9.02
2	601919	中远海控	32,300	584,307.00	7.94
3	300059	东方财富	13,300	445,949.00	6.06
4	600893	航发动力	7,500	416,925.00	5.66
5	600905	三峡能源	58,900	414,656.00	5.63
6	002304	洋河股份	2,500	410,375.00	5.57
7	601878	浙商证券	31,600	404,796.00	5.50
8	600570	恒生电子	6,400	377,472.00	5.13
9	002990	盛视科技	11,200	369,040.00	5.01
10	605499	东鹏饮料	2,000	349,800.00	4.75

5.2.4 报告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。

5.2.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.2.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明

细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.2.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.2.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.2.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.2.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.2.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.2.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.2.11 投资组合报告附注

5.2.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体之一的中国邮政储蓄银行股份有限公司因违反账户管理相关规定等未依法履行其他职责的行为，于2021年8月20日被中国人民银行予以公开处罚、公开批评，警告及并处罚款600万元；因违规向部分客户收取唯一账户年费和小额账户管理费等未依法履行其他职责的行为，于2021年7月5日被中国银行保险监督管理委员会予以公开处罚，没收违法所得11.401116万元，罚款437.677425万元，罚没合计449.078541万元；因同业投资业务接受第三方金融机构信用担保等未依法履行其他职责的行为，于2021年1月8日被中国银行保险监督管理委员会予以公开处罚，罚款4550万元。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

5.2.11.2 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。

5.2.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	7,116.43

2	应收证券清算款	125,957.44
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	133,073.87

5.2.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.2.11.5 报告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中不存在流通受限股票。

5.2.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

6.1 金鹰先进制造股票型证券投资基金（LOF）

单位：份

项目	金鹰先进制造股票 (LOF) A	金鹰先进制造股票 (LOF) C
基金合同生效日基金份额总额	6,887,201.40	-
本报告期期初基金份额总额	6,887,201.40	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	427,411.05	104.15
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	374,007.98	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填	-	-

列)		
本报告期末基金份额总额	6,940,604.47	104.15

注：本基金由金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）转型而来并增设C类份额类别，合同生效日为2022年1月11日（下同），本报告期的相关数据按实际存续期计算。

6.2 金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）

单位：份

本报告期初基金份额总额	7,044,051.50
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	156,850.10
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	6,887,201.40

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 金鹰先进制造股票型证券投资基金（LOF）

7.1.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.1.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无交易。

7.2 金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）

7.2.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无交易。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

8.1 金鹰先进制造股票型证券投资基金（LOF）

本基金非发起式基金。

8.2 金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）

本基金非发起式基金。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 金鹰先进制造股票型证券投资基金（LOF）

9.1.1 影响投资者决策的其他重要信息

无。

9.2 金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）

9.2.1 影响投资者决策的其他重要信息

金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）于2021年11月29日至2021年12月28日以通讯方式召开基金份额持有人大会，并于2021年12月29日通过了基金转型有关事项，金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）于2022年1月11日正式转型为金鹰先进制造股票型证券投资基金（LOF），并新增C类基金份额。《金鹰先进制造股票型证券投资基金（LOF）基金合同》、《金鹰先进制造股票型证券投资基金（LOF）托管协议》自2022年1月11日起生效，《金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）基金合同》、《金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）托管协议》自同日起失效。欲了解相关详情，请查阅金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）相关公告及金鹰先进制造股票型证券投资基金（LOF）相关法律文件。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）变更注册的文件。
- 2、《金鹰先进制造股票型证券投资基金（LOF）基金合同》。
- 3、《金鹰先进制造股票型证券投资基金（LOF）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。

10.2 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

10.3 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
二〇二二年四月二十二日