

目录全部展开 目录全部收缩
一、重要提示
二、基金产品概况
三、基金基本情况
四、主要财务指标和基金净值表现
五、基金业绩比较基准
六、基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
七、其他指标
八、管理人报告
九、公平交易专项说明
十、投资组合报告
十一、其他重要事项

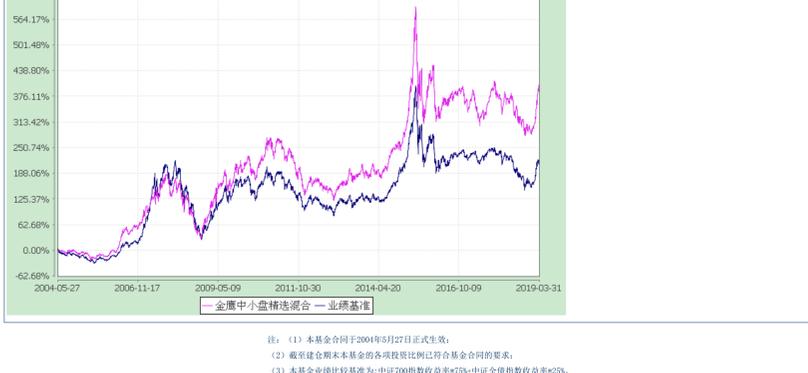
重要提示
基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年4月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。
基金的过往业绩并不预示其未来表现，投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告自2019年1月1日起至3月31日止。

基金基本情况
项目 数值
基金简称 金鹰中小盘精选混合
场内简称
基金代码 062102
基金运作方式 契约开放式
基金合同生效日 2004-05-27
报告期末基金份额总额 373,500,511.44
投资目标 本基金投资于较高成长性和良好基本面的中小盘股票，通过积极的投资组合管理，在控制风险的前提下谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略 本基金采取主动的股票投资策略，在专业化研究的基础上，将系统的选股方法与积极的投资操作相结合，选择具有较高成长性、基本面良好的股票构建投资组合，把握投资机会，实现收益。债券投资策略：本基金采取稳健的固定收益投资策略，根据对利率、收益率走势的预测，考虑债券信用等级、期限、品种、流动性等因素，根据修正久期、凸性等指标，构建债券组合。
业绩比较基准 中证700指数收益率\*75%+中证全债指数收益率\*25%
风险收益特征 本基金属于风险水平适中、预期收益较高的证券投资基金品种。
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

主要财务指标
主要财务指标 报告期(2019-01-01至2019-03-31)
本期已实现收益 26,221,808.74
本期利润 94,079,228.24
加权平均基金份额本期利润 0.2458
期末基金资产净值 405,583,466.48
期末基金份额净值 1.0859

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据。

基金净值表现
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
过去三个月 29.30% 1.04% 24.79% 1.28% 4.60% -0.22%



其他指标
其他指标 报告期(2019-01-01至2019-03-31)
其他指标 报告期(2019-03-31)

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
于利强 本基金的基金经理、公司权益投资部副总监 2015-01-15 - 10 于利强先生，复旦大学金融学学士，历任安永华明会计师事务所审计师，华泰投资管理有限公司风险投资经理，2009年加入鹏华基金管理有限公司，历任旅游、地产、中小盘行业研究员和鹏华中小盘基金经理助理，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。

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。

管理人对报告期内本基金运作遵信情况的说明

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细则、本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。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。

公平交易专项说明

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流程和程序独立决策，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，完善的权限管理制度、有效的风险控制制度，确保公平交易的实施，同时通过投资交易系统集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间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。

异常交易行为的专项说明

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，未发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。
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。

报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾1季度，外需中美贸易谈判进展顺利，美联储加息进程超预期提前结束，内部社融增速触底回升，资金价格有所回落，流动性明显改善，整体经济预期较2018年4季度显著改善。
股票市场上，监管层面对市场化导向激活了市场活力，风险偏好有所上升，叠加流动性改善，推动市场成交量放大，指数全线上涨，上证、深证、中小板和创业板指数分别上涨23.93%、36.84%、35.66%和33.43%，计算机、券商、食品饮料和非金融涨幅居前，本基金重点配置了食品、计算机、电子和早期期的房地产等行业。

报告期内基金的投资业绩表现

截至本报告期末，基金份额净值为1.0859元，本报告期份额净值增长率为29.30%，同期业绩比较基准收益率为24.70%。

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2季度，宏观经济见底回升的预期进入验证阶段，新一轮减税降费于2季度启动，有利于企业盈利回升，预计由流动性和风险偏好改善所推动的估值修复行情将告一段落，本基金将保持中性偏高位，重点挖掘行业景气度回升和公司盈利能力回升的标的。

报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内无应当说明的预警事项。

投资组合报告

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 权益类投资 276,112,587.48 67.49
其中：股票 276,112,587.48 67.49
2 固定收益投资 95,541,000.00 23.35
其中：债券 95,541,000.00 23.35
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 29,258,728.12 7.15
7 其他资产 8,207,960.75 2.01
8 合计 409,120,276.35 100.00

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。

报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末按行业分类的境内股票投资组合
序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
A 农林牧渔 - -
B 采矿业 - -
C 制造业 151,129,949.57 37.26
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 20,307,192.28 4.94
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 信息技术、软件和信息技术服务业 50,368,608.68 12.42
J 金融业 134,343.00 0.03
K 房地产业 36,600,079.95 9.02
L 租赁和商务服务业 5,517,144.00 1.36
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 12,325,272.00 3.04
S 综合 - -
合计 276,112,587.48 68.08

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 601155 新城控股 810,633 36,600,079.95 9.02
2 603711 德玛酷 1,122,229 35,798,816.00 8.83
3 603517 绝味食品 660,106 32,490,417.32 8.01
4 600881 百川能源 1,822,583 20,057,192.28 4.94
5 000271 宇信软件 873,496 18,579,259.92 4.58
6 000811 泳轮环境 1,405,500 12,818,160.00 3.16
7 002174 游族网络 532,577 12,675,332.60 3.13
8 002014 永新股份 1,574,000 12,497,560.00 3.08
9 600977 中国电影 693,600 12,325,272.00 3.04
10 300339 润和软件 916,800 11,854,224.00 2.92

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 15,477,000.00 3.82
2 央行票据 - -
3 金融债券 80,064,000.00 19.74
其中：政策性金融债 80,064,000.00 19.74
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 95,541,000.00 23.56

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 180410 8名发10 800,000.00 80,064,000.00 19.74
2 181007 21国债07 150,000.00 15,477,000.00 3.82

注：本基金本报告期末仅持有两只债券。

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

注：本基金本报告期末未投资资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未投资贵金属。

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

注：本基金本报告期末未投资权证。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险说明
公允价值变动总额合计(元) -
股指期货投资本期收益(元) -
股指期货投资本期公允价值变动(元) -

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

本基金投资股指期货的投资政策

无。

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本期国债期货投资政策

无。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险指标说明
公允价值变动总额合计(元) -
国债期货投资本期收益(元) -
国债期货投资本期公允价值变动(元) -

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

本期国债期货投资评价

无。

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况

本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内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。

申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

其他资产构成

序号 名称 金额(元)
1 存出保证金 228,190.04
2 应收证券清算款 6,477,495.33
3 应收利息 -
4 应收股利 908,146.19
5 应收申购款 596,129.19
6 其他应收款 -
7 其他 -
8 其他 -
9 合计 8,207,960.75

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

投资组合报告附注的其他文本描述部分

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。

开放式基金份额变动

项目 数值
报告期期初基金份额总额 384,215,588.04
报告期期间基金申购份额 11,113,780.81
减：报告期期间基金赎回份额 21,819,852.40
报告期期间基金净申购份额(份额减少以“-”填列) 1,507,716.45
报告期末基金份额总额 373,500,511.44

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

基金管理人持有本基金份额变动情况

项目 基金份额
报告期初管理人持有的基金份额 -
报告期期间买入/申购总份额 -
报告期期间卖出/赎回总份额 -
报告期末管理人持有的基金份额 -
报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例(N) -

注：无。

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号 交易方式 交易日期 交易份额(份) 交易金额(元) 适用费率
合计

注：无。

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目 持有份额总数 持有份额占基金总份额比例 发起份额总数 发起份额占基金总份额比例 发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金 - % - % -
基金管理人高级管理人员 - % - % -
基金基金经理 - % - % -
基金管理人股东 - % - % -
其他 - % - % -
合计 - % - % -

报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别 序号 持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间 期初份额 申购份额 赎回份额 报告期末持有份额 份额占比
机构 - - - - - -
个人 - - - - - -
- 产品特有风险 - - - - - -

影响投资者决策的其他重要信息

经广东省工商行政管理局核准，本基金管理人法定代表人已于2019年3月27日变更为刘志刚先生。

备查文件目录

- 1、中国证监会批准金鹰中小盘精选证券投资基金发行及募集的文件。
2、《金鹰中小盘精选证券投资基金合同》。
3、《金鹰中小盘精选证券投资基金托管协议》。
4、基金基金管理人批准成立批件、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。

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

查阅方式

投资者可在营业时间免费查询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：4006-135-8888/020-83906180。