

**金鹰元安混合型证券投资基金**  
**2019 年半年度报告**  
**2019 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：广发银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年八月二十三日

## 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。本半年度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。

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 22 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 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>2 基金简介</b> .....	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
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>4 管理人报告</b> .....	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遵规守信情况的说明.....	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.....	10
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.....	11
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
<b>5 托管人报告</b> .....	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	12
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.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
<b>7 投资组合报告</b> .....	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
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.....	44
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.....	44
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.....	44
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.....	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	44
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.....	45
7.13 投资组合报告附注.....	45
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	46

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	46
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	46
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 .....	47
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	47
<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>47</b>
<b>10 重大事件揭示</b> .....	<b>47</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	47
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 .....	47
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 .....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	48
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	48
10.8 其他重大事件 .....	49
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>50</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 .....	50
11.2 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	金鹰元安混合型证券投资基金	
基金简称	金鹰元安混合	
基金主代码	000110	
交易代码	000110	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 6 月 6 日	
基金管理人	金鹰基金管理有限公司	
基金托管人	广发银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	256,560,881.51 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	金鹰元安混合 A	金鹰元安混合 C
下属分级基金的交易代码	000110	002513
报告期末下属分级基金的份额总额	250,521,952.92 份	6,038,928.59 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制风险的前提下,力争使基金份额持有人获得超额收益与长期资本增值。
投资策略	本基金在投资组合管理过程中采取主动投资方法,通过数量化方法严格控制风险,并通过有效的资产配置策略,动态调整安全资产和风险资产的投资比例,注重风险与收益的平衡,力争实现基金资产长期稳健增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×20%+中债总财富(总值)指数收益率×80%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金,其预期收益和风险水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		金鹰基金管理有限公司	广发银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	曾长兴	戴辉
	联系电话	020-38898996	010-65169958
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	daihui@cgbchina.com.cn
客户服务电话		4006135888,020-83936180	400-830-8003
传真		020-83282856	020-65169555
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	广东省广州市越秀区东风东路 713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	北京市西城区菜市口大街1号院2号楼信托大厦
邮政编码	510623	100053
法定代表人	刘志刚	王滨

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金半年度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>
基金半年度报告备置地点	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（2019年1月1日至2019年6月30日）	
	金鹰元安混合 A	金鹰元安混合 C
本期已实现收益	2,457,235.06	194,164.27
本期利润	4,947,220.40	258,281.67
加权平均基金份额本期利润	0.0679	0.0912
本期加权平均净值利润率	5.81%	8.02%
本期基金份额净值增长率	10.33%	10.50%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
	金鹰元安混合 A	金鹰元安混合 C
期末可供分配利润	79,868,444.71	806,763.79
期末可供分配基金份额利润	0.3188	0.1336
期末基金资产净值	295,864,395.98	6,990,388.33
期末基金份额净值	1.1810	1.1576
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)	
	金鹰元安混合 A	金鹰元安混合 C
基金份额累计净值增长率	12.93%	16.44%

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

金鹰元安混合 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	1.33%	0.23%	1.59%	0.21%	-0.26%	0.02%
过去三个月	-2.66%	0.55%	0.18%	0.28%	-2.84%	0.27%
过去六个月	10.33%	0.64%	6.42%	0.29%	3.91%	0.35%
过去一年	10.80%	0.55%	7.12%	0.29%	3.68%	0.26%
自基金合同生效起至今	12.93%	0.41%	12.18%	0.24%	0.75%	0.17%

金鹰元安混合 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	1.33%	0.23%	1.59%	0.21%	-0.26%	0.02%
过去三个月	-2.60%	0.55%	0.18%	0.28%	-2.78%	0.27%
过去六个月	10.50%	0.64%	6.42%	0.29%	4.08%	0.35%
过去一年	14.39%	0.60%	7.12%	0.29%	7.27%	0.31%
自基金合同生效起至今	16.44%	0.44%	12.18%	0.24%	4.26%	0.20%

注：本基金的业绩比较基准是：沪深 300 指数收益率×20%+中债总财富(总值)指数收益率×80%。

#### 3.2.2 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

金鹰元安混合型证券投资基金

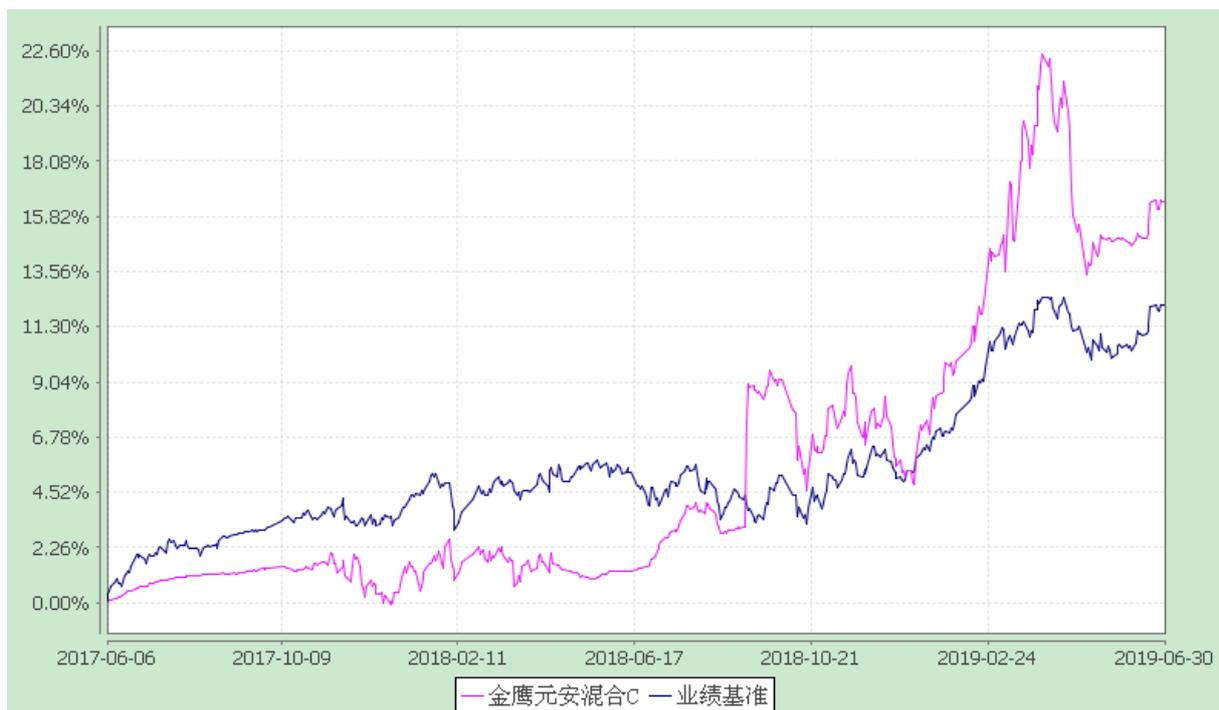
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017 年 6 月 6 日至 2019 年 6 月 30 日)

金鹰元安混合 A



### 金鹰元安混合 C



注：（1）截至本报告期末，各项投资比例符合基金合同的约定。

（2）本基金的业绩比较基准是：沪深 300 指数收益率×20%+中债总财富(总值)指数收益率×80%。

## 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，注册资本 5.102 亿元人民币。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。

“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。截至报告期末，公司共有 46 只公募基金，管理规模 550.88 亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
汪伟	本基金的基金经理	2017-09-08	2019-04-13	6	汪伟先生，2013 年 7 月至 2014 年 9 月曾任广州证券股份有限公司交易员、投资经理等职务，2014 年 9 月至 2016 年 2 月曾任金鹰基金管理有限公司交易主管，2016 年 3 月至 2017 年 7 月曾任广东南粤银行股份有限公司交易员、宏观分析师等职务，2017 年 7 月加入金鹰基金管理有限公司。
林龙军	本基金的基金经理，公司绝对收益投资部总监	2018-05-17	-	11	林龙军先生，曾任兴全基金管理有限公司产品经理、研究员、基金经理助理、投资经理兼固收投委会委员等职务。2018 年 3 月加入金鹰基金管理有限公司，现任绝对收益投资部基金经理。
吴德瑄	本基金的基金经理	2017-09-30	2019-04-13	7	吴德瑄先生，曾任广州证券股份有限公司研究员。2015 年 1 月加入金鹰基金管理有限公司，任研究部研究员、基金经理助理、基金经理职务。现任权益投资部基金经理。
杨晓斌	本基金的基金经理	2019-06-26	-	8	杨晓斌先生，曾任银华基金管理有限公司研究员、首席宏观分析师、投资经理等职务。2018 年 2 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《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、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，基金运作基本合法合规，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

2019 年上半年大类资产走势经历了从逐险到避险的切换，波动率总体上升，因而主要资产在不同阶段呈现出不同的机会。背后主要的宏观演绎是从衰退预期到滞胀预期的变化，因而总体而言，一季度风险资产的机会好于二季度，避险资产尤其是贵金属的机会二季度好于一季度。债券资产尤其是国内债券资产整体比较纠结，相对难以把握。从全年角度，一季度的资产配置情况基本已经决

定了全年的收益分位和绝对收益水平的高低。上半年，我们的组合里重配了转债资产，用以应对债市未落股市未起的资产局面和库存向下货币摇摆的宏观局面。同时，在债券上我们采用短久期信用+长久期利率的哑铃策略，在不同时点对于久期的调整存在较大的波动。在权益上，我们相对去年增加了权益的平均仓位，并在 6 月底一定程度做了风格上的切换。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值为 1.1810 元，本报告期份额净值增长率为 10.33%，同期业绩比较基准增长率为 6.42%；C 类基金份额净值为 1.1576 元，本报告期份额净值增长率 10.50%，同期业绩比较基准增长率为 6.42%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，二季度滞涨的格局会得到改善，国内的权益市场和固收市场都存在相比二季度有不同程度的机会。信用二元化的出现，我们会在下半年把投资研究重心放在长端利率品上，从容但不麻木，积极但不冒进。对于转债而言，会更多运用自下而上的手法，严格控制总体仓位。权益层面，鉴于决策层对于地产的态度，结合成长行业的相对业绩表现，我们认为下半年成长行情是值得期待的。汽车、新能源、新能源汽车、电子等行业我们会花更多精力去跟踪。

#### 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

报告期内，本基金资产净值已发生连续超过 60 个工作日低于 5000 万元的情形，本基金管理人已按法规要求向证监会报送解决方案。

### 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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，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：金鹰元安混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	3,467,628.37	53,158.24
结算备付金		445,084.01	101,703.47

存出保证金		41,850.42	223,122.92
交易性金融资产	6.4.7.2	274,696,584.23	19,097,814.39
其中：股票投资		58,407,934.91	5,586,353.87
基金投资		-	-
债券投资		216,288,649.32	13,511,460.52
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	25,000,000.00	-
应收证券清算款		965,315.05	-
应收利息	6.4.7.5	1,345,621.51	128,708.55
应收股利		-	-
应收申购款		154,341.30	6,550.38
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		306,116,424.89	19,611,057.95
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		-	-
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		-	1,400,000.00
应付证券清算款		2,255,272.10	-
应付赎回款		425,649.40	117,804.24
应付管理人报酬		147,535.71	9,335.47
应付托管费		49,178.59	3,111.83
应付销售服务费		522.08	240.18
应付交易费用	6.4.7.7	96,589.04	13,198.30
应交税费		226.88	217.72
应付利息		-	1,424.56
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	286,666.78	475,320.39
负债合计		3,261,640.58	2,020,652.69
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	205,382,916.73	13,616,488.24
未分配利润	6.4.7.10	97,471,867.58	3,973,917.02
所有者权益合计		302,854,784.31	17,590,405.26
负债和所有者权益总计		306,116,424.89	19,611,057.95

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，本基金份额总额 256,560,881.51 份。本基金 A 类份额净值 1.1810 元，份额总额 250,521,952.92 份；本基金 C 类份额净值 1.1576 元，份额总额 6,038,928.59 份。

## 6.2 利润表

会计主体：金鹰元安混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>5,784,253.72</b>	<b>10,659,537.10</b>
1.利息收入		1,029,373.26	9,978,937.57
其中：存款利息收入	6.4.7.11	26,609.59	60,793.28
债券利息收入		989,499.10	9,493,394.41
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		13,264.57	424,749.88
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,173,269.48	-9,812,291.95
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,490,806.47	-8,582,273.84
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	166,750.51	-1,802,002.13
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	515,712.50	571,984.02
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	2,554,102.74	10,492,403.12
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	27,508.24	488.36
<b>减：二、费用</b>		<b>578,751.65</b>	<b>4,225,439.89</b>
1. 管理人报酬		254,596.38	1,621,962.33
2. 托管费		84,865.43	540,654.07
3. 销售服务费		1,577.40	263,053.82
4. 交易费用	6.4.7.21	203,675.26	642,273.55
5. 利息支出		3,751.27	942,224.03
其中：卖出回购金融资产支出		3,751.27	942,224.03
6. 税金及附加		175.74	21,623.37
7. 其他费用	6.4.7.22	30,110.17	193,648.72
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>5,205,502.07</b>	<b>6,434,097.21</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>5,205,502.07</b>	<b>6,434,097.21</b>

**6.3 所有者权益（基金净值）变动表**

会计主体：金鹰元安混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	13,616,488.24	3,973,917.02	17,590,405.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,205,502.07	5,205,502.07
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）	191,766,428.49	88,292,448.49	280,058,876.98
其中：1.基金申购款	198,725,284.55	90,258,726.81	288,984,011.36
2.基金赎回款	-6,958,856.06	-1,966,278.32	-8,925,134.38
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）	205,382,916.73	97,471,867.58	302,854,784.31
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	511,697,137.25	2,876,647.24	514,573,784.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,434,097.21	6,434,097.21
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）	-1,334,687.82	247,531.34	-1,087,156.48
其中：1.基金申购款	99,077,011.31	1,461,124.94	100,538,136.25
2.基金赎回款	-100,411,699.13	-1,213,593.60	-101,625,292.73
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）	510,362,449.43	9,558,275.79	519,920,725.22

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：刘志刚，主管会计工作负责人：刘志刚，会计机构负责人：谢文君

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

金鹰元安保本混合型证券投资基金(简称"本基金")，经中国证券监督管理委员会（简称"中国证监会"）基金部函[2013]361 号文《关于金鹰元安保本混合型证券投资基金备案确认的函》批准，于 2013 年 5 月 20 日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为 257,736,730.13 份基金份额。本基金的基金管理人为金鹰基金管理有限公司，基金托管人为广发银行股份有限公司。根据本基金合同约定，本基金自 2017 年 6 月 6 日起转型为非保本基金，名称变更为金鹰元安混合型证券投资基金。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则(以下简称“企业会计准则”)和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日起至 2019 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会计报表一致。

### 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; 2018 年 1 月 1 日起, 公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为, 以基金管理人为增值税纳税人, 暂适用简易计税方法, 按照 3% 的征收率缴纳增值税。

2. 对证券投资基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不缴纳企业所得税。

3. 对基金取得的股票股息、红利收入, 由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳, 从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的, 暂减按 50% 计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

4. 对基金取得的债券利息收入, 由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税, 暂不缴纳企业所得税。

5. 对于基金从事 A 股买卖, 出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税, 对受让方不再缴纳印花税。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2019 年 6 月 30 日
活期存款	3,467,628.37
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	3,467,628.37

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	56,320,501.01	58,407,934.91	2,087,433.90
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	7,204,302.65	58,846.67
	银行间市场	208,827,740.00	197,760.00
	合计	216,032,042.65	256,606.67
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	272,352,543.66	274,696,584.23	2,344,040.57

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期内未投资衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	25,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	25,000,000.00	-

##### 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 2019年6月30日
应收活期存款利息	489.97
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	180.27
应收债券利息	1,344,934.26
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	-
其他	17.01
合计	1,345,621.51

#### 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 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	95,301.54
银行间市场应付交易费用	1,287.50
合计	96,589.04

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	12.81
预提审计费用	65,396.69
预提信息披露费	219,113.48
应交税金-上海债券	2,143.80
合计	286,666.78

**6.4.7.9 实收基金**

金鹰元安混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	14,043,617.69	11,175,079.45
本期申购	240,389,457.82	191,281,147.00
本期赎回（以“-”号填列）	-3,911,122.59	-3,112,238.31
本期末	250,521,952.92	199,343,988.14

金鹰元安混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	2,441,408.79	2,441,408.79
本期申购	7,444,137.55	7,444,137.55
本期赎回（以“-”号填列）	-3,846,617.75	-3,846,617.75
本期末	6,038,928.59	6,038,928.59

**6.4.7.10 未分配利润**

金鹰元安混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,987,580.69	870,179.33	3,857,760.02
本期利润	2,457,235.06	2,489,985.34	4,947,220.40
本期基金份额交易产生的变动数	74,423,628.96	13,291,798.46	87,715,427.42
其中：基金申购款	75,520,244.31	13,646,461.85	89,166,706.16
基金赎回款	-1,096,615.35	-354,663.39	-1,451,278.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	79,868,444.71	16,651,963.13	96,520,407.84

金鹰元安混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	68,295.20	47,861.80	116,157.00
本期利润	194,164.27	64,117.40	258,281.67
本期基金份额交易产生的变动数	544,304.32	32,716.75	577,021.07
其中：基金申购款	887,321.99	204,698.66	1,092,020.65
基金赎回款	-343,017.67	-171,981.91	-514,999.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	806,763.79	144,695.95	951,459.74

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	24,562.96
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	1,302.53
其他	744.10
合计	26,609.59

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	62,557,648.48
减：卖出股票成本总额	61,066,842.01
买卖股票差价收入	1,490,806.47

#### 6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

#### 6.4.7.14 债券投资收益

##### 6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	166,750.51

债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	166,750.51

**6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	74,022,130.74
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	73,602,368.58
减：应收利息总额	253,011.65
买卖债券差价收入	166,750.51

**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投资收益。

**6.4.7.18 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	515,712.50
基金投资产生的股利收益	-
合计	515,712.50

**6.4.7.19 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1.交易性金融资产	2,554,102.74
——股票投资	2,384,688.83
——债券投资	169,413.91

——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	2,554,102.74

#### 6.4.7.20 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	22,447.68
转换费收入	5,060.56
合计	27,508.24

#### 6.4.7.21 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	202,387.76
银行间市场交易费用	1,287.50
合计	203,675.26

#### 6.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	12,396.69
信息披露费	-886.52
帐户维护费	18,600.00
合计	30,110.17

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需作披露的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至资产负债表日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

**6.4.9 关联方关系****6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期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
广州证券股份有限公司	基金管理人股东
金鹰基金管理有限公司	基金管理人、销售机构
广发银行股份有限公司	基金托管人

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广州证券	174,061,382.70	100.00%	451,674,179.35	100.00%

**6.4.10.1.2 权证交易**

本基金本报告期及上年可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

**6.4.10.1.3 债券交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额	成交金额	占当期债券成交总额

		额的比例		额的比例
广州证券	41,997,843.34	100.00%	361,716,018.04	100.00%

#### 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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
广州证券	131,500,000.00	100.00%	2,739,380,000.00	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 2019年1月1日至2019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
广州证券	123,810.30	100.00%	95,301.54	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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
广州证券	321,274.10	100.00%	100,936.90	100.00%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除中国证券登记结算公司收取的证管费、经手费和使用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 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 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日

当期发生的基金应支付的管理费	254,596.38	1,621,962.33
其中：支付销售机构的客户维护费	26,557.90	17,271.53

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.6% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

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 2 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
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	84,865.43	540,654.07

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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 2 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

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2019年1月1日至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	金鹰元安混合 A	金鹰元安混合 C	合计
金鹰基金管理有限公司	-	107.54	107.54
合计	-	107.54	107.54
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2018年1月1日至2018年6月30日		

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	金鹰元安混合A	金鹰元安混合C	合计
金鹰基金管理有限公司	-	262,996.78	262,996.78
合计	-	262,996.78	262,996.78

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.1%。在通常情况下，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.1% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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提，按月支付，于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性划出，由基金管理人代收，基金管理人收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金行销广告费、促销活动费、基金份额持有人服务费等。

#### 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未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

金鹰元安混合 A

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

金鹰元安混合 C

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018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
广发银行股份有限公司	3,467,628.37	24,562.96	769,586.40	40,211.95

注：1、本基金清算备付金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算公司等结算账户；

2、2019 年 6 月 30 日清算备付金期末余额 445,084.01 元，清算备付金利息收入 1,302.53 元；2018 年 6 月 30 日清算备付金期末余额 6,743,464.75 元，清算备付金利息收入 182,21.29 元。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

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（2019 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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无暂时停牌的流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购，故不存在作为抵押的债券。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购。

#### 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；对公司各部门工作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 2019年6月30日	上年末 2018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 2019年6月30日	上年末 2018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 2019年6月30日	上年末 2018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 2019年6月30日	上年末 2018年12月31日
AAA	104,120.00	2,734,326.44
AAA 以下	2,076,705.22	6,209,481.58
未评级	0.00	0.00
合计	2,180,825.22	8,943,808.02

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 2019年6月30日	上年末 2018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 2019年6月30日	上年末 2018年12月31日
AAA	189,033,500.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	189,033,500.00	0.00

注：以上数据按照最新发行人评级填列。

**6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自于投资品种流动性不足，导致金融资产不能在合理价格变现。本基金采用分散投资、监控流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时基金管理人通过分析持有人结构、申购赎回行为分析、变现比例、压力测试等方法评估组合的流动性风险。

**6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限资产投资比例等流动性

指标进行持续的监测和分析。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间市场进行交易，除本报告所列示的期末本基金持有的流通受限证券暂时不能自由转让外，本基金持有的其余资产均能及时变现。评估结果显示本基金的组合持仓变现能力较好，流动性风险可控。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019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	3,467,628.37	-	-	-	-	-	-	-	-	3,467,628.37
结算备付金	445,084.01	-	-	-	-	-	-	-	-	445,084.01
存出保证金	41,850.42	-	-	-	-	-	-	-	-	41,850.42
交易性金融资产	-	-	-	-	-	211,434,340.00	208,800.00	4,645,509.32	58,407,934.91	274,696,584.23
买入返售金融资产	25,000,000.00	-	-	-	-	-	-	-	-	25,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	965,315.05	965,315.05
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	1,345,621.51	1,345,621.51
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	154,341.30	154,341.30
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

资产总计	28,954,562.80	-	-	-	-	211,434,340.00	208,800.00	4,645,509.32	60,873,212.77	306,116,424.89
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	-	-	-	-	-	-	-	-	2,255,272.10	2,255,272.10
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	425,649.40	425,649.40
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	147,535.71	147,535.71
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	49,178.59	49,178.59
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-	-	522.08	522.08
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	96,589.04	96,589.04
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	-	226.88	226.88
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	286,666.78	286,666.78
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	3,261,640.58	3,261,640.58
利率敏感度缺口	28,954,562.80	-	-	-	-	211,434,340.00	208,800.00	4,645,509.32	57,611,572.19	302,854,784.31
上年度末 2018 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	53,158.24	-	-	-	-	-	-	-	-	53,158.24
结算备付金	101,703.47	-	-	-	-	-	-	-	-	101,703.47
存出保证金	223,122.92	-	-	-	-	-	-	-	-	223,122.92
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,129,950.00	4,867.74	7,513,768.12	5,586,353.87	19,097,814.39

买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	128,708.55	128,708.55	
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	6,550.38	6,550.38	
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
资产总计	377,984.63	-	-	-	-	1,129,950.00	4,867,742.40	7,513,768.12	5,721,612.80	19,611,057.95
负债										
短期借款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
卖出回购金融资产款	1,400,000.00	-	-	-	-	-	-	-	-	1,400,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	117,804.24	117,804.24
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	9,335.47	9,335.47
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	3,111.83	3,111.83
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-	-	240.18	240.18
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	13,198.30	13,198.30
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	-	217.72	217.72
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-	1,424.56	1,424.56
应付利润	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	475,320.39	475,320.39
负债总计	1,400,000.00	-	-	-	-	-	-	-	620,652.69	2,020,652.69
利率敏感度缺口	-1,022,015.37	-	-	-	-	1,129,950.00	4,867,742.40	7,513,768.12	5,100,960.11	17,590,405.26

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

## 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他变量不变，只有利率变动通过债券公允价值变动对基金资产净值产生影响。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的	
		影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末
		2019 年 6 月 30 日	2018 年 12 月 31 日
	利率上升 25 个基点	-539,955.74	-142,903.56
	利率下降 25 个基点	539,955.74	142,903.56

## 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 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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	58,407,934.9 1	19.29	5,586,353.87	31.76
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	216,288,649. 32	71.42	13,511,460.52	76.81
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	274,696,584. 23	90.70	19,097,814.39	108.57

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

##### 金鹰元安混合 A

假设	市场其他变量保持不变，只有业绩比较基准所对应的市场组合价格发生合理、可能的变动；		
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 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
	业绩比较基准变动+5%	24,268,129.72	618,702.07
	业绩比较基准变动-5%	-24,268,129.72	-618,702.07

##### 金鹰元安混合 C

假设	市场其他变量保持不变，只有业绩比较基准所对应的市场组合价格发生合理、可能的变动；		
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 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
	业绩比较基准变动+5%	571,417.18	97,674.68
	业绩比较基准变动-5%	-571,417.18	-97,674.68

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 1. 公允价值

##### (1) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

##### (2) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层次可分为：

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

(ii)各层级金融工具公允价值

于 2019 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 59,476,640.13 元, 第二层级的余额为 215,219,944.10 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

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	58,407,934.91	19.08
	其中: 股票	58,407,934.91	19.08
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	216,288,649.32	70.66
	其中: 债券	216,288,649.32	70.66
	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	25,000,000.00	8.17
	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	3,912,712.38	1.28
8	其他各项资产	2,507,128.28	0.82
9	合计	306,116,424.89	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 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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,100,800.00	0.36
C	制造业	20,059,280.00	6.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,401,000.00	1.12
E	建筑业	1,035,000.00	0.34
F	批发和零售业	2,447,950.00	0.81
G	交通运输、仓储和邮政业	5,542,800.00	1.83
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,194,100.00	1.05
J	金融业	13,851,430.00	4.57
K	房地产业	4,697,124.91	1.55
L	租赁和商务服务业	1,329,750.00	0.44
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	1,748,700.00	0.58
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	58,407,934.91	19.29

### 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沪港通投资股票。

## 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	600900	长江电力	190,000	3,401,000.00	1.12

2	601318	中国平安	35,000	3,101,350.00	1.02
3	600377	宁沪高速	260,000	2,792,400.00	0.92
4	600036	招商银行	60,000	2,158,800.00	0.71
5	600383	金地集团	179,987	2,147,244.91	0.71
6	600104	上汽集团	80,000	2,040,000.00	0.67
7	600837	海通证券	142,000	2,014,980.00	0.67
8	600276	恒瑞医药	30,000	1,980,000.00	0.65
9	601688	华泰证券	80,000	1,785,600.00	0.59
10	601933	永辉超市	170,000	1,735,700.00	0.57
11	601012	隆基股份	70,000	1,617,700.00	0.53
12	600048	保利地产	120,000	1,531,200.00	0.51
13	600519	贵州茅台	1,500	1,476,000.00	0.49
14	600004	白云机场	80,000	1,456,000.00	0.48
15	601288	农业银行	400,000	1,440,000.00	0.48
16	600066	宇通客车	110,000	1,432,200.00	0.47
17	600030	中信证券	60,000	1,428,600.00	0.47
18	601888	中国国旅	15,000	1,329,750.00	0.44
19	601006	大秦铁路	160,000	1,294,400.00	0.43
20	600050	中国联通	200,000	1,232,000.00	0.41
21	002405	四维图新	75,000	1,207,500.00	0.40
22	601633	长城汽车	140,000	1,157,800.00	0.38
23	601857	中国石油	160,000	1,100,800.00	0.36
24	000651	格力电器	20,000	1,100,000.00	0.36
25	601601	中国太保	30,000	1,095,300.00	0.36
26	000063	中兴通讯	33,000	1,073,490.00	0.35
27	600585	海螺水泥	25,000	1,037,500.00	0.34
28	601668	中国建筑	180,000	1,035,000.00	0.34
29	300347	泰格医药	13,000	1,002,300.00	0.33
30	600887	伊利股份	30,000	1,002,300.00	0.33
31	600309	万华化学	20,000	855,800.00	0.28
32	000001	平安银行	60,000	826,800.00	0.27
33	300760	迈瑞医疗	5,000	816,000.00	0.27
34	601766	中国中车	100,000	809,000.00	0.27
35	601155	新城控股	20,000	796,200.00	0.26
36	600996	贵广网络	70,000	754,600.00	0.25
37	002044	美年健康	60,000	746,400.00	0.25
38	002727	一心堂	25,000	712,250.00	0.24
39	600690	海尔智家	40,000	691,600.00	0.23
40	600031	三一重工	50,000	654,000.00	0.22
41	002304	洋河股份	5,000	607,800.00	0.20
42	002050	三花智控	50,000	527,500.00	0.17
43	002812	恩捷股份	10,000	467,500.00	0.15
44	601877	正泰电器	16,000	369,440.00	0.12
45	300124	汇川技术	15,000	343,650.00	0.11

46	000002	万 科 A	8,000	222,480.00	0.07
----	--------	-------	-------	------------	------

#### 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	002405	四维图新	4,767,880.67	27.11
2	600837	海通证券	3,658,301.00	20.80
3	600900	长江电力	3,357,222.00	19.09
4	600383	金地集团	3,120,755.19	17.74
5	600104	上汽集团	2,990,799.00	17.00
6	600967	内蒙一机	2,921,353.52	16.61
7	601318	中国平安	2,813,305.00	15.99
8	600048	保利地产	2,770,824.07	15.75
9	600377	宁沪高速	2,756,820.00	15.67
10	601288	农业银行	2,664,000.00	15.14
11	300059	东方财富	2,310,650.00	13.14
12	600547	山东黄金	2,293,471.00	13.04
13	600030	中信证券	2,287,105.00	13.00
14	601988	中国银行	2,247,000.00	12.77
15	600036	招商银行	2,102,375.00	11.95
16	601012	隆基股份	2,085,357.00	11.86
17	601166	兴业银行	2,036,880.00	11.58
18	600801	华新水泥	2,010,496.00	11.43
19	601398	工商银行	2,007,000.00	11.41
20	600066	宇通客车	1,935,745.38	11.00
21	600276	恒瑞医药	1,872,733.00	10.65
22	000811	冰轮环境	1,867,704.00	10.62
23	000651	格力电器	1,692,815.00	9.62
24	601933	永辉超市	1,688,883.52	9.60
25	603711	香飘飘	1,688,400.00	9.60
26	601328	交通银行	1,542,500.00	8.77
27	601688	华泰证券	1,534,038.00	8.72
28	601155	新城控股	1,401,163.52	7.97
29	600519	贵州茅台	1,379,226.00	7.84
30	601006	大秦铁路	1,344,000.00	7.64
31	601939	建设银行	1,303,200.00	7.41
32	600004	白云机场	1,293,413.00	7.35
33	000063	中兴通讯	1,230,531.00	7.00
34	601888	中国国旅	1,215,000.00	6.91

35	600050	中国联通	1,208,000.00	6.87
36	601633	长城汽车	1,181,114.00	6.71
37	600760	中航沈飞	1,150,580.00	6.54
38	002236	大华股份	1,123,756.00	6.39
39	601857	中国石油	1,118,400.00	6.36
40	601601	中国太保	1,056,418.00	6.01
41	601668	中国建筑	1,034,078.00	5.88
42	300470	日机密封	1,019,240.44	5.79
43	600585	海螺水泥	978,353.00	5.56
44	600996	贵广网络	962,962.00	5.47
45	600887	伊利股份	943,266.00	5.36
46	603466	风语筑	909,338.00	5.17
47	000961	中南建设	861,414.00	4.90
48	002044	美年健康	851,472.00	4.84
49	601766	中国中车	808,800.00	4.60
50	600309	万华化学	808,189.00	4.59
51	000776	广发证券	790,200.00	4.49
52	300347	泰格医药	782,930.00	4.45
53	300751	迈为股份	740,878.00	4.21
54	002727	一心堂	740,083.00	4.21
55	000001	平安银行	736,200.00	4.19
56	002624	完美世界	719,202.00	4.09
57	000625	长安汽车	702,547.00	3.99
58	300760	迈瑞医疗	701,134.00	3.99
59	600466	蓝光发展	697,200.00	3.96
60	300750	宁德时代	684,427.00	3.89
61	002063	远光软件	682,500.00	3.88
62	600690	海尔智家	651,037.11	3.70
63	600031	三一重工	644,000.00	3.66
64	300113	顺网科技	626,420.00	3.56
65	600572	康恩贝	616,146.88	3.50
66	002304	洋河股份	608,776.00	3.46
67	603501	韦尔股份	582,798.00	3.31
68	002195	二三四五	571,983.92	3.25
69	002812	恩捷股份	556,616.00	3.16
70	001979	招商蛇口	554,250.00	3.15
71	600936	广西广电	536,777.00	3.05
72	002050	三花智控	518,218.00	2.95
73	000002	万 科 A	497,083.00	2.83
74	601877	正泰电器	450,400.00	2.56
75	002238	天威视讯	437,703.00	2.49
76	300124	汇川技术	423,897.00	2.41
77	300747	锐科激光	423,779.00	2.41
78	600325	XD 华发股	408,597.00	2.32

79	600131	岷江水电	407,550.00	2.32
80	300473	德尔股份	392,517.00	2.23
81	600703	三安光电	375,424.00	2.13

#### 7.4.2 累计卖出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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002405	四维图新	3,646,581.98	20.73
2	600967	内蒙一机	2,854,336.00	16.23
3	600547	山东黄金	2,743,564.00	15.60
4	300059	东方财富	2,359,713.00	13.41
5	603711	香飘飘	2,295,723.00	13.05
6	601988	中国银行	2,256,000.00	12.83
7	600801	华新水泥	2,121,567.60	12.06
8	601398	工商银行	2,061,500.00	11.72
9	601166	兴业银行	2,012,424.00	11.44
10	600837	海通证券	1,843,811.00	10.48
11	000811	冰轮环境	1,634,513.00	9.29
12	601328	交通银行	1,532,500.00	8.71
13	600048	保利地产	1,515,945.00	8.62
14	300470	日机密封	1,412,951.60	8.03
15	601939	建设银行	1,328,400.00	7.55
16	600030	中信证券	1,198,229.41	6.81
17	600760	中航沈飞	1,144,433.00	6.51
18	002236	大华股份	1,130,001.00	6.42
19	600104	上汽集团	1,129,025.00	6.42
20	601288	农业银行	1,086,000.00	6.17
21	603383	顶点软件	1,083,300.00	6.16
22	600383	金地集团	1,052,780.00	5.98
23	601225	陕西煤业	997,759.00	5.67
24	000961	中南建设	860,704.00	4.89
25	300751	迈为股份	840,997.00	4.78
26	000776	广发证券	837,600.00	4.76
27	002063	远光软件	835,048.00	4.75
28	000002	万科A	825,501.00	4.69
29	603466	风语筑	803,882.00	4.57
30	002624	完美世界	742,940.00	4.22
31	600466	蓝光发展	709,069.95	4.03
32	300750	宁德时代	701,786.00	3.99
33	000625	长安汽车	649,162.00	3.69
34	300473	德尔股份	643,666.00	3.66

35	300113	顺网科技	642,717.00	3.65
36	601155	新城控股	637,284.00	3.62
37	600936	广西广电	631,400.00	3.59
38	600572	康恩贝	588,900.00	3.35
39	002925	盈趣科技	563,384.00	3.20
40	000651	格力电器	563,053.00	3.20
41	002195	二三四五	562,100.00	3.20
42	603501	韦尔股份	559,449.00	3.18
43	001979	招商蛇口	522,813.00	2.97
44	601877	正泰电器	510,934.00	2.90
45	601012	隆基股份	490,312.00	2.79
46	600066	宇通客车	451,800.00	2.57
47	600996	贵广网络	428,172.00	2.43
48	300747	锐科激光	420,308.00	2.39
49	002238	天威视讯	419,805.00	2.39
50	002174	游族网络	404,360.00	2.30
51	600038	中直股份	401,009.00	2.28
52	600703	三安光电	400,200.00	2.28
53	600325	XD 华发股	394,000.00	2.24
54	300124	汇川技术	383,119.00	2.18
55	000063	中兴通讯	357,960.00	2.03
56	600131	岷江水电	351,500.00	2.00

#### 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

买入股票的成本（成交）总额	111,503,734.22
卖出股票的收入（成交）总额	62,557,648.48

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	916,600.00	0.30
2	央行票据	-	-
3	金融债券	24,157,724.10	7.98
	其中：政策性金融债	24,157,724.10	7.98
4	企业债券	1,112,120.00	0.37
5	企业短期融资券	-	-

6	中期票据	-	-
7	可转债	1,068,705.22	0.35
8	同业存单	189,033,500.00	62.42
9	其他	-	-
10	合计	216,288,649.32	71.42

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	111911067	19 平安银行 CD067	500,000.00	48,490,000.00	16.01
2	111914092	19 江苏银行 CD092	500,000.00	48,465,000.00	16.00
3	111921173	19 渤海银行 CD173	500,000.00	48,415,000.00	15.99
4	111907045	19 招商银行 CD045	450,000.00	43,663,500.00	14.42
5	190201	19 国开 01	200,000.00	19,992,000.00	6.60

#### 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

本基金本报告期内未投资股指期货。

##### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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

无。

**7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期内未投资国债期货。

**7.12 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	41,850.42
2	应收证券清算款	965,315.05
3	应收股利	-
4	应收利息	1,345,621.51
5	应收申购款	154,341.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,507,128.28

**7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	------	--------------

1	123011	德尔转债	964,025.22	0.32
2	132006	16 皖新 EB	104,680.00	0.03

### 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中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
金鹰元安混合 A	3,723	67,290.34	234,382,392.30	93.56%	16,139,560.62	6.44%
金鹰元安混合 C	609	9,916.14	612,477.03	10.14%	5,426,451.56	89.86%
合计	4,332	59,224.58	234,994,869.33	91.59%	21,566,012.18	8.41%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

本基金非上市基金。

金鹰元安混合 A

本基金非上市基金。

金鹰元安混合 C

本基金非上市基金。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	金鹰元安混合 A	0.00	0.00%
	金鹰元安混合 C	0.00	0.00%

	合计	0.00	0.00%
--	----	------	-------

**8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况**

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

**8.5 发起式基金发起资金持有份额情况**

本基金非发起式基金。

**9 开放式基金份额变动**

单位：份

项目	金鹰元安混合 A	金鹰元安混合 C
基金合同生效日（2017 年 6 月 6 日）基金份额总额	22,078,367.20	499,752,018.21
本报告期期初基金份额总额	14,043,617.69	2,441,408.79
本报告期基金总申购份额	240,389,457.82	7,444,137.55
减：本报告期基金总赎回份额	3,911,122.59	3,846,617.75
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	250,521,952.92	6,038,928.59

**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、经本基金管理人第六届董事会第三十四次会议审议通过，报中国证券投资基金业协会、中国证券监督管理委员会广东监管局备案，并于 2019 年 3 月 5 日在证监会指定媒体披露，聘请刘志刚先生担任公司总经理，李兆廷先生不再代为履行金鹰基金管理有限公司总经理职责。

经广东省工商行政管理局核准，本基金管理人法定代表人于 2019 年 3 月 27 日由李兆廷先生变更为刘志刚先生。

2、本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

**10.4 基金投资策略的改变**

本基金报告期内没有改变基金投资策略。

**10.5 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。

**10.6 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。

**10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况****10.7.1 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	
广州证券	2	174,061,382.70	100.00%	123,810.30	100.00%	-

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；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

本基金专用交易单位的选择程序如下：

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

**10.7.2 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		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
广州证券	41,997,843.34	100.00%	131,500,000.00	100.00%	-	-

### 10.8 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开放式基金资产净值等的公告	证监会指定媒体	2019-01-02
2	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与平安银行费率调整的公告	证监会指定媒体	2019-01-10
3	金鹰元安混合型证券投资基金更新招募说明书摘要 2018 年第 2 号	证监会指定媒体	2019-01-17
4	金鹰元安混合型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	证监会指定媒体	2019-01-21
5	金鹰基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证监会指定媒体	2019-03-05
6	金鹰基金管理有限公司关于新增众升财富(北京)基金销售有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投及费率优惠业务的公告	证监会指定媒体	2019-03-18
7	关于金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增华泰期货有限公司为代销机构的公告	证监会指定媒体	2019-03-22
8	金鹰元安混合型证券投资基金 2018 年年度报告(摘要)	证监会指定媒体	2019-03-26
9	关于官网和网上交易系统维护暂停使用公告	证监会指定媒体	2019-03-28
10	金鹰基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告	证监会指定媒体	2019-03-28
11	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	证监会指定媒体	2019-03-29
12	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	证监会指定媒体	2019-03-30
13	金鹰基金管理有限公司关于新增阳光人寿保险股份有限公司为本公司旗下部分基金代销	证监会指定媒体	2019-04-04

	机构并开通基金转换、基金定投业务及费率优惠的公告		
14	金鹰基金管理有限公司金鹰元安混合型证券投资基金基金经理变更公告	证监会指定媒体	2019-04-13
15	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票调整估值的公告	证监会指定媒体	2019-04-16
16	金鹰元安混合型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	证监会指定媒体	2019-04-20
17	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加天府银行手机银行渠道基金费率优惠活动的公告	证监会指定媒体	2019-05-06
18	金鹰基金管理有限公司关于新增江苏汇林保大基金销售有限公司为本公司旗下部分基金代销机构的公告	证监会指定媒体	2019-05-15
19	关于广发银行资产托管部办公地址变更的公告	证监会指定媒体	2019-05-16
20	金鹰基金管理有限公司金鹰元安混合型证券投资基金暂停大额申购（转换转入、定期定额投资）公告	证监会指定媒体	2019-05-20
21	金鹰基金管理有限公司关于新增华夏银行股份有限公司为金鹰元安混合型证券投资基金代销机构的公告	证监会指定媒体	2019-06-10
22	金鹰基金管理有限公司关于新增诺亚正行基金销售有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金定投及费率优惠的公告	证监会指定媒体	2019-06-13
23	金鹰基金管理有限公司关于董事变更的公告	证监会指定媒体	2019-06-20
24	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	证监会指定媒体	2019-06-21
25	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票调整估值的公告	证监会指定媒体	2019-06-25
26	金鹰基金管理有限公司金鹰元安混合型证券投资基金增聘基金经理的公告	证监会指定媒体	2019-06-26
27	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国银行股份有限公司定投费率优惠活动的公告	证监会指定媒体	2019-06-27

注：相关信息披露文件请登录本基金管理人网站查询。

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占

		到或者超过20%的时间区间					比
机构	1	2019年5月17日至 2019年6月30日	0.00	126,011,942 .09	-	126,011,942.0 9	49.12 %
	2	2019年5月17日至 2019年6月30日	0.00	75,393,248. 80	-	75,393,248.8 0	29.39 %
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内，存在报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情形，可能会存在以下风险：</p> <p>1) 基金净值大幅波动的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，因巨额赎回、份额净值小数保留位数与方式、管理费及托管费等费用计提等原因，可能会导致基金份额净值出现大幅波动；</p> <p>2) 巨额赎回的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能触发本基金巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额；</p> <p>3) 流动性风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致本基金的流动性风险；</p> <p>4) 基金提前终止、转型或与其他基金合并的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，可能导致本基金面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p> <p>5) 基金规模过小导致的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。</p> <p>6) 份额占比较高的投资者申购申请被拒绝的风险：当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金总份额的50%时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金总份额50%的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的50%，该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。</p>							

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无影响投资者决策的其他重要信息。

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。
- 2、《金鹰元安混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、《金鹰元安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报纸上公开披露的基金份额净值、季度报告、年度报告、更新

的招股说明书及其他临时公告。

## 12.2 存放地点

广东省广州市天河区珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

## 12.3 查阅方式

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

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

金鹰基金管理有限公司

二〇一九年八月二十三日