

# 金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金

## 2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 月 30 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：二〇二一年十月二十六日

## §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 2021 年 10 月 25 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。

本报告期自 2021 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	金鹰红利价值混合
基金主代码	210002
交易代码	210002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 12 月 4 日
报告期末基金份额总额	37,566,122.59 份
投资目标	本基金通过对分红能力良好且长期投资价值突出的优质股票投资，为基金资产获取稳定的当期收益和长期增值。
投资策略	本基金采取积极主动式投资管理，通过积极的资产配置策略，深入研究、调研基础上的主动性证券选择和市场时机选择，在合理控制投资风险的前提下，最大限度地获取投资收益。本基金主要投资于

	分红能力良好且长期价值突出的优质企业，股票资产占基金资产净值比例为 30%—80%；现金、债券资产、其他资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产净值的比例为 20%—70%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；权证投资占基金资产净值的比例不超过 3%。
业绩比较基准	中证红利指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。
风险收益特征	本基金风险收益特征从长期来看，其风险与预期收益高于债券型基金，低于股票型基金。
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

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2021 年 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	8,830,455.59
2.本期利润	7,512,902.24
3.加权平均基金份额本期利润	0.1972
4.期末基金资产净值	64,011,360.66
5.期末基金份额净值	1.7040

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额；

2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

3、期末可供分配利润，指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现

部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）；

4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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	12.91%	1.37%	1.80%	0.80%	11.11%	0.57%
过去六个月	33.49%	1.28%	6.27%	0.64%	27.22%	0.64%
过去一年	16.62%	1.28%	13.11%	0.62%	3.51%	0.66%
过去三年	59.33%	1.33%	23.45%	0.72%	35.88%	0.61%
过去五年	39.96%	1.23%	29.67%	0.64%	10.29%	0.59%
自基金合同生效起至今	307.25%	1.22%	151.88%	0.89%	155.37%	0.33%

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2008 年 12 月 4 日至 2021 年 9 月 30 日)



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）截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同规定的各项比例,股票资产占基金资产比例为30%—80%；现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为20%-70%。

（3）本基金的业绩比较基准为：中证红利指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。

## §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		
陈颖	本基金的基金经理, 公司权益投资部首席投资官	2020-04-28	-	11	陈颖先生, 北京大学学士, 中山大学工商管理硕士。曾任职于广东省电信规划设计院、中国惠普有限公司, 历任深圳市瀚信资产管理有限公司研究主管等职, 2012年9月加入金鹰基金管理有限公司, 先后任研究员、研究小组组

					长、基金经理助理等。现任权益投资部基金经理。
朱丹	本基金的基金经理	2021-08-06	-	14	朱丹女士，2006 年 4 月至 2007 年 4 月曾任晨星中国咨询公司研究员，2007 年 5 月至 2015 年 3 月曾任金鹰基金管理有限公司研究员、基金经理助理、基金经理，2015 年 3 月至 2021 年 3 月曾任融通基金管理有限公司基金经理，2021 年 4 月加入金鹰基金管理有限公司，任权益投研总监。

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、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，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无出现重大违法违规或违反基金合同的行为，无损害基金持有人利益的行为。

#### 4.3 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内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

三季度国内宏观方面，出口展示出较高的韧性；房地产方面，恒大事件以及信贷紧缩让国内房地产景气开发和销售都快速降温。三季度市场在 3400-3600 之间波动，能源革命成为市场的主线之一，新能源汽车和光伏板块表现较好。新旧能源的交替期，供给和需求的阶段性错配让煤炭供不应求，价格暴涨。此外，在“双控”政策的共同作用下，“限电”越演越烈，在电力稀缺的背景下，多种原材料上涨较大，受益于产品价格上涨的公司也是三季度市场的主线之一。

本基金认为新冠疫情引起的全社会应急阶段基本接近尾声，未来在疫苗和特效治疗药的作用下，社会经济秩序会逐渐恢复正常，本基金配置了在疫情中受损严重同时会受益于正常化的板块和公司。此外还配置了新能源汽车，汽车和汽车零配件板块。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，基金份额净值为 1.7040 元，本报告期份额净值增长率为 12.91%，同期业绩比较基准收益率为 1.80%。

#### 4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期无应预警说明事项。

## §5 投资组合报告

### 5.1 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	47,776,074.39	67.31
	其中：股票	47,776,074.39	67.31
2	固定收益投资	6,546,735.19	9.22

	其中：债券	6,546,735.19	9.22
	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	16,528,944.66	23.29
7	其他各项资产	129,232.62	0.18
8	合计	70,980,986.86	100.00

注：其他资产包括：存出保证金、应收利息、应收证券清算款、应收申购款、待摊费用、其他应收款。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 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	3,487,165.00	5.45
C	制造业	31,043,824.50	48.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	870,997.00	1.36
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	8,820,771.89	13.78
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	951,300.00	1.49
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	2,602,016.00	4.06
S	综合	-	-
	合计	47,776,074.39	74.64

### 5.2.2 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。

### 5.3 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

#### 5.3.1 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	300575	中旗股份	249,000	5,002,410.00	7.81
2	601111	中国国航	500,300	3,722,232.00	5.81
3	600029	南方航空	642,100	3,711,338.00	5.80
4	601238	广汽集团	197,100	2,972,268.00	4.64
5	300014	亿纬锂能	26,600	2,634,198.00	4.12
6	603730	岱美股份	165,000	2,630,100.00	4.11
7	300251	光线传媒	262,300	2,602,016.00	4.06
8	002597	金禾实业	65,900	2,594,483.00	4.05
9	600703	三安光电	62,100	1,967,949.00	3.07
10	002829	星网宇达	59,000	1,902,750.00	2.97

#### 5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

本基金本报告期末投资全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

### 5.4 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	-	-
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）	6,546,735.19	10.23
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,546,735.19	10.23

#### 5.5 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	123099	普利转债	21,190.00	2,676,297.00	4.18
2	113579	健友转债	17,290.00	2,260,840.40	3.53
3	128101	联创转债	6,491.00	958,655.79	1.50
4	113009	广汽转债	5,420.00	650,942.00	1.02

注：本基金本报告期末仅持有4只债券。

#### 5.6 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

本基金本报告期内未投资资产支持证券。

#### 5.7 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

本基金本报告期内未投资贵金属。

#### 5.8 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

本基金本报告期内未投资权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资股指期货。

##### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

5.11.2 本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。

### 5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	31,699.47
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	17,503.11
5	应收申购款	80,030.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	129,232.62

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113009	广汽转债	650,942.00	1.02
2	113579	健友转债	2,260,840.40	3.53
3	123099	普利转债	2,676,297.00	4.18
4	128101	联创转债	958,655.79	1.50

### 5.11.5 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情况。

### 5.11.6 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**

单位：份

本报告期期初基金份额总额	39,426,618.94
报告期期间基金总申购份额	9,991,779.77
减：报告期期间基金总赎回份额	11,852,276.12
报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	37,566,122.59

**§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况****7.1 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 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细**

无。

**§8 报告期末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 影响投资者决策的其他重要信息****9.1 影响投资者决策的其他重要信息**

无。

**§10 备查文件目录****10.1 备查文件目录**

- 1、中国证监会批准金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金发行及募集的文件。
- 2、《金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、《金鹰红利价值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。

### 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

二〇二一年十月二十六日