

# 金鹰鑫益灵活配置混合型证券投资基金

## 2022 年第 3 季度报告

2022 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年十月二十六日

## § 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 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 2022 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	金鹰鑫益混合
基金主代码	003484
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 11 月 16 日
报告期末基金份额总额	401,249,967.14 份
投资目标	本基金在严格控制风险并保持良好流动性的前提下，通过精选股票、债券等投资标的，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	本基金将从宏观面、政策面、基本面和资金面四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、现金类资产等各类资

	产类别上的投资比例，最大限度的提高收益。通过“自上而下”及“自下而上”相结合的方法挖掘优质的上市公司，构建股票投资组合；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；运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略等多种积极管理策略，深入研究挖掘价值被低估的债券和市场投资机会，构建收益稳定、流动性良好的债券组合。		
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	本基金为混合型证券投资基金，属于证券投资基金中预期较高风险、较高收益的品种，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。		
基金管理人	金鹰基金管理有限公司		
基金托管人	招商银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	金鹰鑫益混合 A	金鹰鑫益混合 C	金鹰鑫益混合 E
下属分级基金的交易代码	003484	003485	007233
报告期末下属分级基金的份额总额	31,107,999.00 份	147,752,088.93 份	222,389,879.21 份

### § 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 (2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日)		
	金鹰鑫益混合 A	金鹰鑫益混合 C	金鹰鑫益混合 E

1.本期已实现收益	671,655.68	709,877.56	3,951,875.07
2.本期利润	-488,851.27	-4,108,589.55	-3,287,309.31
3.加权平均基金份额 本期利润	-0.0148	-0.0395	-0.0144
4.期末基金资产净值	40,530,092.08	192,574,606.18	260,272,189.58
5.期末基金份额净值	1.3029	1.3034	1.1703

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 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

##### 金鹰鑫益混合 A

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	-1.21%	0.29%	-7.05%	0.44%	5.84%	-0.15%
过去六个月	1.98%	0.32%	-3.53%	0.59%	5.51%	-0.27%
过去一年	1.58%	0.31%	-8.98%	0.59%	10.56%	-0.28%
过去三年	23.15%	0.31%	8.39%	0.63%	14.76%	-0.32%
过去五年	31.88%	0.37%	15.60%	0.63%	16.28%	-0.26%
自基金合同生效起至今	36.52%	0.35%	21.41%	0.60%	15.11%	-0.25%

##### 金鹰鑫益混合 C

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	-1.24%	0.29%	-7.05%	0.44%	5.81%	-0.15%

月						
过去六个月	1.92%	0.32%	-3.53%	0.59%	5.45%	-0.27%
过去一年	1.47%	0.31%	-8.98%	0.59%	10.45%	-0.28%
过去三年	22.75%	0.31%	8.39%	0.63%	14.36%	-0.32%
过去五年	32.09%	0.37%	15.60%	0.63%	16.49%	-0.26%
自基金合同生效起至今	36.56%	0.35%	21.41%	0.60%	15.15%	-0.25%

### 金鹰鑫益混合 E

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	-1.32%	0.29%	-7.05%	0.44%	5.73%	-0.15%
过去六个月	1.77%	0.32%	-3.53%	0.59%	5.30%	-0.27%
过去一年	1.16%	0.31%	-8.98%	0.59%	10.14%	-0.28%
过去三年	21.67%	0.31%	8.39%	0.63%	13.28%	-0.32%
自基金合同生效起至今	22.71%	0.30%	6.47%	0.63%	16.24%	-0.33%

### 3.2.2 自基金转型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

金鹰鑫益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的历史走势对比图  
(2016 年 11 月 16 日至 2022 年 9 月 30 日)

金鹰鑫益混合 A



### 金鹰鑫益混合 C



### 金鹰鑫益混合 E



- 注：1、本基金 E 类份额自 2019 年 4 月 10 日起设立；
- 2、截至本报告期末，各项投资比例符合基金合同的约定；
- 3、本基金的业绩比较基准是：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		
林龙军	本基金的基金经理，公司总经理助理、绝对收益投资部总经理	2018-05-17	-	14	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。
孙倩倩	本基金的基金经理，公司绝对收益投资部副总经理	2020-09-09	-	11	孙倩倩女士，南开大学金融学硕士，曾任招商证券策略研究分析师、债券研究分析

					师,中欧基金管理有限公司基金经理等职,2018年7月加入金鹰基金管理有限公司,现任绝对收益投资部副总经理、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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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



市场在内忧外患之下仓皇下跌，各类指数均回归赔率舒适的区间，筹码结构得到一定程度的优化，风险偏好回落颇多。未来 1-2 个季度正是核实内忧外患会否转折的关键节点，地产政策何去何从、去全球化和强美元的冲击余波几何，都是决定风险偏好是否再度回升的关键因素。在不可超越的地理禀赋、勤劳的民族精神和厚积薄发的工程师红利之下，中国制造在成本、产业链等多方面的优势决定其有天然屏障且屏障正在强化，估值、筹码等消化至今，可能已经步入左侧深度布局区间。风格上，基于明年国内经济对内需贡献权重提升的诉求提升的判断，且基数均偏低，中大盘价值股胜率或高于过去 2 年。出口导向小盘股在海外能源危机下是否仍然享受国产替代红利，需要逐一甄别。整体上看，行业选择第一要素仍取决于景气变化。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，A 类基金份额净值为 1.3029 元，本报告期份额净值增长率为 -1.21%，同期业绩比较基准增长率为-7.05%；C 类基金份额净值为 1.3034 元，本报告期份额净值增长率为-1.24%，同期业绩比较基准增长率为-7.05%；E 类基金份额净值为 1.1703 元，本报告期份额净值增率为-1.32%，同期业绩比较基准增长率为-7.05%。

#### 4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内无应当说明的预警事项。

## § 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	42,557,592.19	7.13
	其中：股票	42,557,592.19	7.13
2	固定收益投资	525,368,671.40	88.03
	其中：债券	525,368,671.40	88.03
	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	7,868,641.79	1.32
7	其他资产	21,019,269.56	3.52
8	合计	596,814,174.94	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 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	4,563,500.00	0.92
C	制造业	23,128,052.58	4.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,940.85	0.00
E	建筑业	1,768,228.10	0.36
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	8,677,200.00	1.76
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	103,129.56	0.02
J	金融业	1,663,200.00	0.34
K	房地产业	2,626,500.00	0.53
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	13,841.10	0.00

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	42,557,592.19	8.63

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资的股票。

## 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	600009	上海机场	90,000	5,200,200.00	1.05
2	601615	明阳智能	100,000	2,413,000.00	0.49
3	300724	捷佳伟创	20,000	2,304,400.00	0.47
4	601111	中国国航	200,000	2,094,000.00	0.42
5	300750	宁德时代	5,000	2,004,450.00	0.41
6	003022	联泓新科	50,000	1,999,000.00	0.41
7	002507	涪陵榨菜	70,000	1,902,600.00	0.39
8	600256	广汇能源	150,000	1,842,000.00	0.37
9	000065	北方国际	200,000	1,762,000.00	0.36
10	002050	三花智控	70,000	1,722,000.00	0.35

## 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	26,352,859.46	5.34
2	央行票据	-	-
3	金融债券	223,662,343.56	45.33
	其中：政策性金融债	40,528,526.03	8.21
4	企业债券	50,604,793.98	10.26
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	40,805,036.17	8.27
7	可转债（可交换债）	90,593,963.10	18.36

8	同业存单	93,349,675.13	18.92
9	其他	-	-
10	合计	525,368,671.40	106.48

#### 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	149650	21 广发 16	400,000.00	41,331,901.37	8.38
2	163731	20 光证 G3	300,000.00	30,529,002.74	6.19
3	163774	20 中证 15	300,000.00	30,500,161.64	6.18
4	2020018	20 宁波银行 01	300,000.00	30,395,852.05	6.16
5	188713	21 保置 01	300,000.00	30,151,755.62	6.11

#### 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 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之一的宁波银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会宁波监管局的处罚。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上海浦东发展银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。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杭州银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会深圳监管局、中国人民银行杭州市中心支行的处罚。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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 本基金本报告期内投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

#### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	164,511.82
2	应收证券清算款	20,760,474.38
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	94,283.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,019,269.56

#### 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	110056	亨通转债	702,793.64	0.14
2	110059	浦发转债	2,151,024.66	0.44
3	110062	烽火转债	1,080,400.89	0.22
4	110067	华安转债	604,009.35	0.12

5	110072	广汇转债	3,910,168.09	0.79
6	110075	南航转债	8,471,577.19	1.72
7	110079	杭银转债	2,461,661.37	0.50
8	110085	通 22 转债	2,557,920.00	0.52
9	111000	起帆转债	255,077.49	0.05
10	113021	中信转债	5,522.18	0.00
11	113046	金田转债	344,265.50	0.07
12	113049	长汽转债	1,808,781.62	0.37
13	113052	兴业转债	1,598,877.95	0.32
14	113053	隆 22 转债	2,165,984.46	0.44
15	113056	重银转债	2,613,404.13	0.53
16	113525	台华转债	546,931.60	0.11
17	113563	柳药转债	1,658,332.19	0.34
18	113579	健友转债	100,200.40	0.02
19	113584	家悦转债	19,835.74	0.00
20	113605	大参转债	2,201,847.67	0.45
21	113623	凤 21 转债	1,098,028.77	0.22
22	113633	科沃转债	1,753,472.16	0.36
23	113641	华友转债	1,439,851.60	0.29
24	118003	华兴转债	2,461,224.11	0.50
25	123022	长信转债	804,226.03	0.16
26	123025	精测转债	786,663.61	0.16
27	123071	天能转债	1,490,036.99	0.30
28	123076	强力转债	1,532,585.64	0.31
29	123099	普利转债	1,687,773.44	0.34
30	123132	回盛转债	64,595.70	0.01
31	127016	鲁泰转债	208,997.08	0.04
32	127018	本钢转债	2,292,980.82	0.46
33	127025	冀东转债	19,619.88	0.00
34	127039	北港转债	364,296.51	0.07
35	127041	弘亚转债	1,645,247.26	0.33
36	127047	帝欧转债	839,973.69	0.17
37	128035	大族转债	6,498,067.40	1.32
38	128101	联创转债	1,053,183.27	0.21
39	128105	长集转债	1,130,797.36	0.23
40	128122	兴森转债	2,396,068.49	0.49
41	128136	立讯转债	649,545.89	0.13
42	128138	侨银转债	20,074.99	0.00
43	128142	新乳转债	911,391.38	0.18

## 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

项目	金鹰鑫益混合A	金鹰鑫益混合C	金鹰鑫益混合E
报告期期初基金份额总额	34,280,783.49	79,270,945.31	259,663,623.92
报告期期间基金总申购份额	1,277,521.77	78,286,600.63	21,776,670.21
减：报告期期间基金总赎回份额	4,450,306.26	9,805,457.01	59,050,414.92
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-
报告期期末基金份额总额	31,107,999.00	147,752,088.93	222,389,879.21

## § 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

单位：份

项目	金鹰鑫益混合 A	金鹰鑫益混合 C	金鹰鑫益混合 E
报告期期初管理人持有的本基金份额	1,864,389.87	0.00	0.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00	0.00	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00	0.00	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	1,864,389.87	0.00	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基金	5.99	0.00	0.00

总份额比例 (%)			
-----------	--	--	--

## 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、中国证监会注册的金鹰鑫益灵活配置混合型证券投资基金发行及募集的文件。
- 2、《金鹰鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、《金鹰鑫益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  
二〇二二年十月二十六日