

金鹰元禧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：中国工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。

基金托管人中国工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 | 金鹰元禧混合 |
| 基金主代码 | 210006 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2017 年 6 月 27 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 122,724,494.07 份 |
| 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。本基金采用固定比例组合保险策略（CPPI），该策略是国际通行的一种投资组合保险 |

| | | |
|-----------------|--|------------------------|
| | <p>策略。其基本原理是将基金资产按一定比例划分为安全资产和风险资产，其中安全资产将投资于各类债券及银行存款，以保证投资本金的安全性；而除安全资产外的风险资产主要投资于股票、权证登权益类资产，以提升基金投资者的收益。本基金综合考虑国内外政治经济环境、资本市场运行状况、固定收益类与权益类风险资产收益特征、基金净资产和价值底线等因素，结合资产配置研究结果和市场运行状态，动态调整安全资产和风险资产的配置比例，力争在确保本金安全的前提下，稳健获取投资收益。</p> | |
| 业绩比较基准 | <p>沪深 300 指数收益率×20%+中债总财富(总值)指数收益率×80%</p> | |
| 风险收益特征 | <p>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。</p> | |
| 基金管理人 | <p>金鹰基金管理有限公司</p> | |
| 基金托管人 | <p>中国工商银行股份有限公司</p> | |
| 下属分级基金的基金简称 | <p>金鹰元禧混合 A</p> | <p>金鹰元禧混合 C</p> |
| 下属分级基金的交易代码 | <p>210006</p> | <p>002425</p> |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | <p>82,378,437.20 份</p> | <p>40,346,056.87 份</p> |

§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) | |
|----------------|---|---------------|
| | 金鹰元禧混合 A | 金鹰元禧混合 C |
| 1.本期已实现收益 | 2,654,398.95 | 1,635,349.77 |
| 2.本期利润 | -4,320,584.24 | -2,956,238.82 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0393 | -0.0297 |
| 4.期末基金资产净值 | 116,004,315.69 | 56,706,676.34 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.4082 | 1.4055 |

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

1、金鹰元禧混合 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 | -3.00% | 0.27% | -2.00% | 0.18% | -1.00% | 0.09% |
| 过去六个月 | -0.71% | 0.33% | 0.03% | 0.24% | -0.74% | 0.09% |
| 过去一年 | -3.01% | 0.32% | -1.02% | 0.24% | -1.99% | 0.08% |
| 过去三年 | 23.03% | 0.33% | 12.02% | 0.25% | 11.01% | 0.08% |
| 过去五年 | 24.18% | 0.29% | 23.21% | 0.25% | 0.97% | 0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | 25.96% | 0.28% | 24.74% | 0.25% | 1.22% | 0.03% |

2、金鹰元禧混合 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 |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -3.02% | 0.27% | -2.00% | 0.18% | -1.02% | 0.09% |
| 过去六个月 | -0.76% | 0.33% | 0.03% | 0.24% | -0.79% | 0.09% |
| 过去一年 | -3.11% | 0.32% | -1.02% | 0.24% | -2.09% | 0.08% |
| 过去三年 | 22.64% | 0.33% | 12.02% | 0.25% | 10.62% | 0.08% |
| 过去五年 | 23.72% | 0.29% | 23.21% | 0.25% | 0.51% | 0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | 25.49% | 0.28% | 24.74% | 0.25% | 0.75% | 0.03% |

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

金鹰元禧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
(2017 年 6 月 27 日至 2022 年 9 月 30 日)

1. 金鹰元禧混合 A:



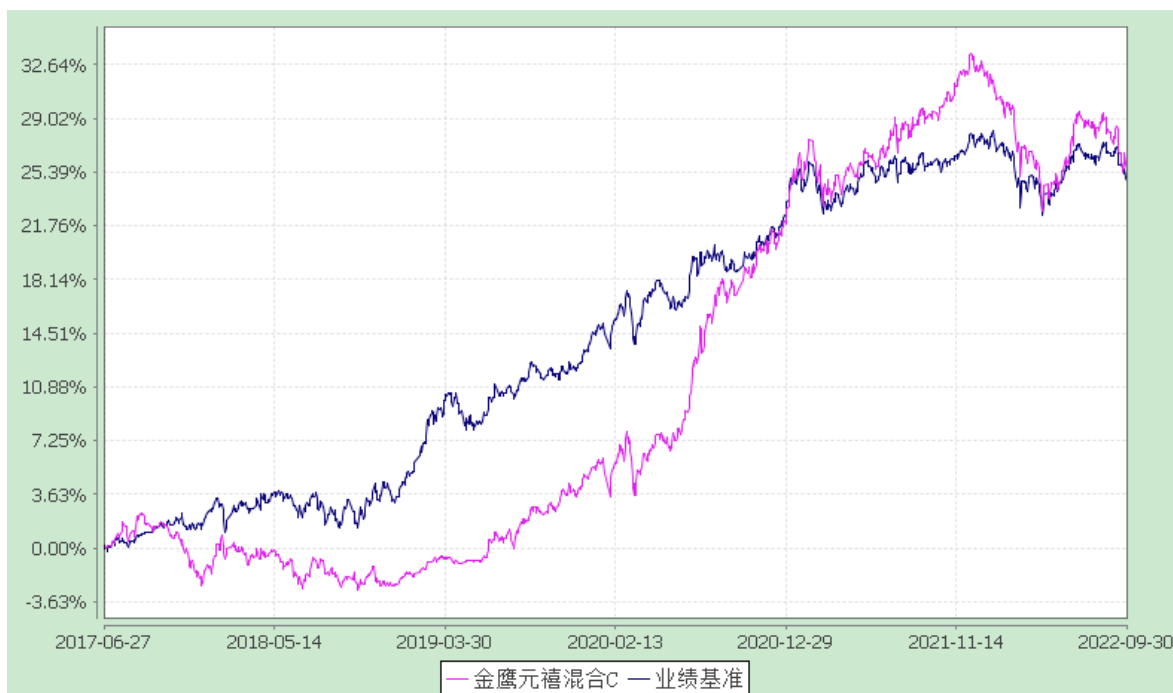
注：1、本基金由原金鹰保本混合型证券投资基金于 2017 年 6 月 27 日转型

而来；

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×20%+中债总财富(总值)指数收益率×80%。

2. 金鹰元禧混合 C:



注：1、本基金由原金鹰保本混合型证券投资基金于 2017 年 6 月 27 日转型而来；

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×20%+中债总财富(总值)指数收益率×80%。

§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 | | |
| 杨晓斌 | 本基 | 2019-06- | - | 11 | 杨晓斌先生，曾任银华基金管 |

| | | | | |
|--|--------------------|----|--|--|
| | 金的基金经理，公司权益投资部副总经理 | 26 | | 理股份有限公司研究员、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《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 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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 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

三季度以来国内经济在国内疫情持续反复、欧美通胀上行政策收紧、俄乌局势持续紧张的大环境下开始企稳略有回升，上市公司盈利除了上游以外，中下游多数行业盈利均有企稳或者改善。权益方面，我们延续之前拟定的策略，维持相对均衡的配置策略，基于政策托底，疫情恢复，经济企稳，配置消费品、金融、地产链和线下消费服务等行业；同时基于经济依然尚未明显复苏的判断，持有具备弱周期、高景气高成长的光伏、军工和锂电等领域。固收方面，我们认为随着疫情逐步恢复，政策逐步加码，基本面企稳的确定性在下半年将逐步加大，叠加温和通胀的作用，无风险利率将易上难下，信用利差有望温和回落，组合将维持短久期、高等级策略，组合久期维持在 1 年附近，核心持仓在 AAA 证券和金融公司债。

回顾三季度，尽管政策面趋于积极，流动性整体趋松，基本面底部企稳，但 A 股市场表现其实比较低于我们先前的预期。三季度我们持仓第一个链条主要受到疫情的持续反复叠加上地产断供事件的影响，股价出现回调；我们持仓的第二个链条比如光伏即便在全球能源价格走高的背景下景气持续改善，但也很难避免由于各种悲观传闻导致的股价闪崩。这种轮流闪崩的现象更多源自于风险偏好下降导致资金外流，而非公司实际基本面的因素，也就是典型的杀估值。

历史上，股票市场与上市公司盈利同步性很强，但三季度以来的市场却明显走弱，而这两者的持续背离一般不会持续太长时间，我们认为主要是几个影响股市中期定价的问题尚未解决，导致股市定价失灵，风偏走弱导致股价出现了明显偏离基本面的迹象。

三季度以来大家对很多问题的分歧明显加大。比如，地产领域的收缩政策将在何种情况下结束（地产行业是否已经开始出现系统性风险），挤牙膏式的放松是否依然具备有效性；疫情防控是否存在终极目标，比如特效药上市，还是等待病毒进一步变异，还是可能依然是常态；是美国经济先回落导致外需恶化，还是联储政策先转向导致全球流动性预期拐点临近；如果经济增长不是政府工作的核心目标，那是否放弃多年以来经济层面上的底线思维，如果有底线是 4% 还是

3%甚至更低。这些问题如果得不到明确答案，投资者很容易在全球流动性趋紧的环境下抛售中国的风险资产，反之如果中国经济确定性上升，A 股和人民币资产有可能是下一阶段全球最具备避险性质的资产。

我认为以上问题可能在四季度这个节点将逐步得到答案，股市也将结束下半年以来的磨底。虽然我们不认为短期国家在大的战略方向上调整，比如房住不炒、动态清零，但随着人事布局逐步到位，政府部门将开始为四季度乃至明年的经济工作开始布局，10 月下旬政治局会议，12 月中央经济工作会议等等都会再次就政府下一步的工作给大家指明方向，扫除疑虑，经济工作的贯彻度将有所上升。国内地产和海外货币转向大概率年内至少会有一个出现，届时杀估值的核心变量将被逐步消除。

由于今年以来打新策略收益明显下降，本组合下半年以来适度调整了策略，维持 25%左右的权益仓位，并在此前提下尽量获取打新收益，下一阶段如果权益市场机会凸显，比如中央对经济增长存在明显定调上的变化，抑或疫情防控方针出现调整，我们将适度提高权益仓位至 30%以内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，报告期内 A 类份额净值为 1.4082 元，本报告期份额净值增长率为-3.00%，同期业绩比较基准增长率为-2.00%；C 类基金份额净值为 1.4055 元，本报告期份额净值增长率为-3.02%，同期业绩比较基准增长率为-2.00%。

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 | 48,420,578.70 | 27.87 |
| | 其中：股票 | 48,420,578.70 | 27.87 |

| | | | |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 2 | 固定收益投资 | 111,563,074.13 | 64.21 |
| | 其中：债券 | 111,563,074.13 | 64.21 |
| | 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 | 7,921,583.40 | 4.56 |
| | 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 | 5,128,499.49 | 2.95 |
| 7 | 其他各项资产 | 724,587.88 | 0.42 |
| 8 | 合计 | 173,758,323.60 | 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 | 1,107,808.00 | 0.64 |
| B | 采矿业 | 16,452.92 | 0.01 |
| C | 制造业 | 34,236,354.71 | 19.82 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 618,560.89 | 0.36 |
| E | 建筑业 | 475,716.07 | 0.28 |
| F | 批发和零售业 | 483,139.31 | 0.28 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 376,469.40 | 0.22 |
| H | 住宿和餐饮业 | 13,970.88 | 0.01 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,583,679.76 | 0.92 |
| J | 金融业 | 6,164,680.07 | 3.57 |
| K | 房地产业 | 100,035.00 | 0.06 |

| | | | |
|---|---------------|---------------|-------|
| L | 租赁和商务服务业 | 2,701,907.46 | 1.56 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 379,620.59 | 0.22 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 91,999.59 | 0.05 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 26,238.54 | 0.02 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 43,945.51 | 0.03 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 48,420,578.70 | 28.04 |

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通过港股通投资的股票。

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 | 600519 | 贵州茅台 | 1,800 | 3,370,500.00 | 1.95 |
| 2 | 000568 | 泸州老窖 | 12,100 | 2,790,986.00 | 1.62 |
| 3 | 600690 | 海尔智家 | 100,000 | 2,477,000.00 | 1.43 |
| 4 | 002459 | 晶澳科技 | 34,260 | 2,194,010.40 | 1.27 |
| 5 | 601888 | 中国中免 | 10,900 | 2,160,925.00 | 1.25 |
| 6 | 600036 | 招商银行 | 42,900 | 1,443,585.00 | 0.84 |
| 7 | 300750 | 宁德时代 | 3,500 | 1,403,115.00 | 0.81 |
| 8 | 603816 | 顾家家居 | 32,720 | 1,306,836.80 | 0.76 |
| 9 | 601628 | 中国人寿 | 39,900 | 1,262,037.00 | 0.73 |
| 10 | 002142 | 宁波银行 | 38,400 | 1,211,520.00 | 0.70 |

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 | 14,479,652.66 | 8.38 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 72,000,949.71 | 41.69 |

| | | | |
|----|-----------|----------------|-------|
| | 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 | 10,156,126.03 | 5.88 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 103,793.96 | 0.06 |
| 8 | 同业存单 | 14,822,551.77 | 8.58 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 111,563,074.13 | 64.60 |

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 | 112206132 | 22 交通银行 CD132 | 150,000.00 | 14,822,551.77 | 8.58 |
| 2 | 149274 | 20 申证 10 | 100,000.00 | 10,438,235.62 | 6.04 |
| 3 | 163736 | 20 信达 G1 | 100,000.00 | 10,189,298.63 | 5.90 |
| 4 | 132100111 | 21 三峡租赁 GN001(碳中和债) | 100,000.00 | 10,156,126.03 | 5.88 |
| 5 | 2022018 | 20 上汽通用债 | 100,000.00 | 10,150,570.96 | 5.88 |

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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交通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招商证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券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。

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 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。

5.11.3 其他各项资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 42,259.91 |
| 2 | 应收证券清算款 | 680,645.43 |
| 3 | 应收股利 | - |

| | | |
|---|-------|------------|
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 1,682.54 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 724,587.88 |

5.11.4 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。

5.11.5 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证券。

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 | 金鹰元禧混合A | 金鹰元禧混合C |
|----------------|----------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 128,638,538.83 | 166,148,180.85 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 120,059.52 | 166,007.91 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 46,380,161.15 | 125,968,131.89 |
| 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 | 82,378,437.20 | 40,346,056.87 |

§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 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到或者超过20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 2022年8月4日至 2022年8月4日 | 50,111,72 5.74 | 0.00 | 50,111,72 5.74 | 0.00 | 0.00% |

产品特有风险

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：

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；

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；

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；

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。

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。

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。

9.2 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、中国证监会批准发行及募集的文件。
- 2、《金鹰元禧混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、《金鹰元禧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