金鹰信息产业股票型证券投资基金

2023 年第 1 季度报告

2023 年 3 月 31 日

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：广州农村商业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年四月二十一日

§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。

基金托管人广州农村商业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 4 月 20 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 2023 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金鹰信息产业股票
基金主代码	003853
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 4 月 18 日
报告期末基金份额总额	466,575,602.45 份
投资目标	本基金主要投资于信息产业证券，在有效控制风险并保持良好流动性的前提下，通过积极主动的资产配置，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	本基金将从宏观经济、财政货币政策、经济景气度和货币资金供求等多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，进行积极灵活的资产配置，合理确定基金在股票

	类、债券类、现金类等大类资产上的投资比例，最大限度地提高基金资产的收益。	
业绩比较基准	中证 TMT 产业主题指数收益率×80%+中债总财富（总值）指数收益率×20%	
风险收益特征	本基金为股票型基金，其风险和预期收益均高于混合型基金、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	广州农村商业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	金鹰信息产业股票 A	金鹰信息产业股票 C
下属分级基金的交易代码	003853	005885
报告期末下属分级基金的份额总额	335,342,995.12 份	131,232,607.33 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 (2023 年 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 日)	
	金鹰信息产业股票 A	金鹰信息产业股票 C
1.本期已实现收益	-36,308,575.18	-18,915,232.25
2.本期利润	172,248,919.54	85,199,921.48
3.加权平均基金份额本期利润	0.6373	0.6238
4.期末基金资产净值	1,260,445,024.31	489,216,552.14
5.期末基金份额净值	3.7587	3.7279

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额；

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、金鹰信息产业股票 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	19.93%	1.49%	23.18%	1.21%	-3.25%	0.28%
过去六个月	18.37%	1.50%	30.08%	1.21%	-11.71%	0.29%
过去一年	8.04%	1.85%	14.27%	1.30%	-6.23%	0.55%
过去三年	144.09%	1.99%	10.12%	1.23%	133.97%	0.76%
自基金合同生效起至今	297.98%	1.88%	14.67%	1.40%	283.31%	0.48%

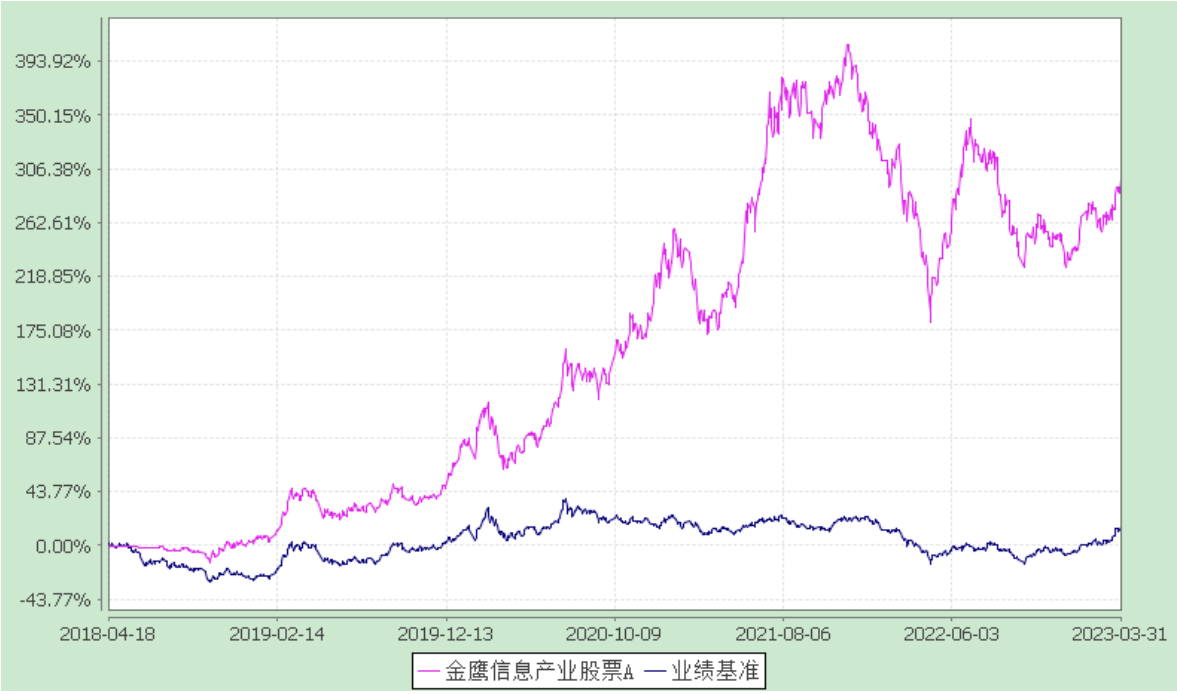
2、金鹰信息产业股票 C：

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	19.81%	1.49%	23.18%	1.21%	-3.37%	0.28%
过去六个月	18.13%	1.50%	30.08%	1.21%	-11.95%	0.29%
过去一年	7.61%	1.85%	14.27%	1.30%	-6.66%	0.55%
过去三年	141.18%	1.99%	10.12%	1.23%	131.06%	0.76%
自基金合同生效起至今	294.73%	1.88%	14.67%	1.40%	280.06%	0.48%

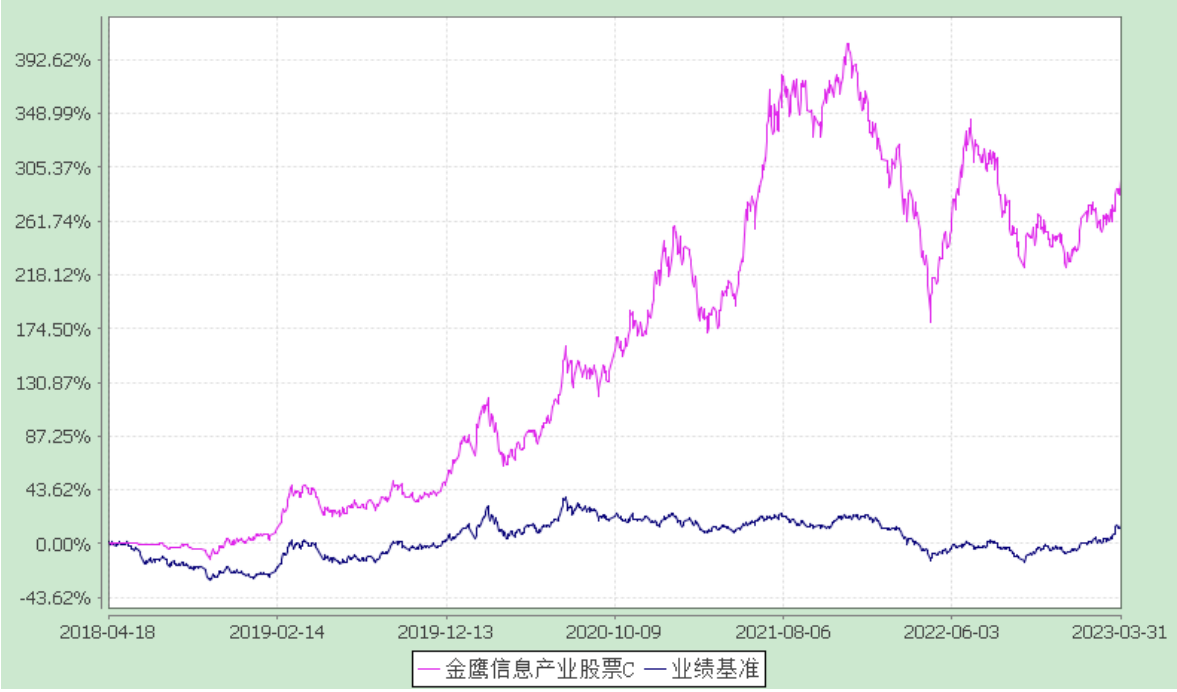
3.2.2 自基金转型以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

金鹰信息产业股票型证券投资基金
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
(2018 年 4 月 18 日至 2023 年 3 月 31 日)

1．金鹰信息产业股票 A：



2．金鹰信息产业股票 C：



注：1、本基金由原金鹰添惠纯债债券型证券投资基金于 2018 年 4 月 18 日

转型而来；

2、本基金于转型当日增加 C 类份额类别，C 类份额首次确认日为 2018 年 4 月 20 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算；

3、自基金转型至本报告期末，A 类基金份额净值增长率为 297.98%，同期业绩比较基准收益率为 14.67%，C 类基金份额净值增长率为 294.73%，同期业绩比较基准收益率为 14.67%。

§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		
倪超	本基金的基金经理，公司权益研究部总经理	2022-03-14	-	14	倪超先生，厦门大学硕士研究生。2009 年 6 月加盟金鹰基金管理有限公司，先后任行业研究员，消费品研究小组组长、基金经理助理。现任权益研究部基金经理。

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、证券从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、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遵规守信情况说明

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

国内方面，2023 年一季度经济如期弱复苏，但冷热不均是其复苏力度偏弱的原因，一季度已能观察到居民端消费和投资意愿出现了一定恢复。

国外方面，在商品消费和地产投资的联合拉动下，美国经济增长继续降速，但是通胀的韧性强于年初投资者的预期；美联储基本上采取“高利率+临时扩表”的组合来应对通胀与金融风险的双重挑战，而不是降息。

一季度权益市场表现方面：年初反弹，以首先出现疫后困境反转的消费与房地产为主，但春节后市场对经济复苏幅度仍然有所怀疑，但风险偏好已经见底的情况下，主题投资表现活跃。结构性成长行情以信创和 AIGC 为主线的科技成长跑赢消费及其他行业，中特估主线也有相对较强表现，同时小盘跑赢大盘。

各指数涨幅层面：一季度上证指数涨幅 5.94%，深证指数涨幅 7.55%，创业

板指数涨幅 2.25%，科创 50 指数涨幅 12.67%，沪深 300 指数涨幅 4.63%。

综合考虑宏观经济增长预期、市场流动行判断、产业趋势和行业景气度趋势比较，本基金在一季度逐步配置了计算机、电子、通信和传媒等行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类份额净值为 3.7587 元，本报告期份额净值增长率为 19.93%，同期业绩比较基准增长率为 23.18%；C 类基金份额净值为 3.7279 元，本报告期份额净值增长率为 19.81%，同期业绩比较基准增长率为 23.18%。

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	1,575,056,948.09	84.27
	其中：股票	1,575,056,948.09	84.27
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	285,100,131.28	15.25
7	其他各项资产	8,856,259.47	0.47

8	合计	1,869,013,338.84	100.00

注：其他资产包括：存出保证金、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	-	-
C	制造业	574,364,777.85	32.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	368,222.80	0.02
E	建筑业	77,329.12	0.00
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	信息传输、软件和信息技术服务业	839,912,821.37	48.00
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	457,291.32	0.03
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	159,876,505.63	9.14
S	综合	-	-
	合计	1,575,056,948.09	90.02

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	688111	金山办公	254,209	120,240,857.00	6.87
2	002555	三七互娱	3,588,005	102,078,742.25	5.83
3	002153	石基信息	3,656,756	93,832,358.96	5.36
4	600570	恒生电子	1,733,417	92,252,452.74	5.27
5	300133	华策影视	11,467,435	90,936,759.55	5.20
6	002415	海康威视	2,023,806	86,335,563.96	4.93
7	000063	中兴通讯	2,265,800	73,774,448.00	4.22
8	600536	中国软件	1,065,540	73,341,118.20	4.19
9	002436	兴森科技	5,130,688	63,056,155.52	3.60
10	300036	超图软件	2,593,871	60,696,581.40	3.47

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

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 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	872,131.62
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	7,984,127.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,856,259.47

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	金鹰信息产业股票A	金鹰信息产业股票C
本报告期期初基金份额总额	271,721,371.65	139,573,706.92
报告期期间基金总申购份额	85,146,169.08	20,994,825.42
减：报告期期间基金总赎回份额	21,524,545.61	29,335,925.01
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	335,342,995.12	131,232,607.33

§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	金鹰信息产业股票A	金鹰信息产业股票C
报告期期初管理人持有的本基金份额	222,573.39	981,546.92
报告期期间买入/申购总份额	0.00	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	222,573.39	981,546.92
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.07	0.75

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无交易。

§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、中国证监会批准基金发行及募集的文件。

2、《金鹰信息产业股票型证券投资基金基金合同》。

3、《金鹰信息产业股票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

二〇二三年四月二十一日