

金鹰元安混合型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 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

送出日期：二〇二一年八月二十八日

§ 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。本中期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 2021 年 8 月 27 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 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	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
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	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合规守信情况的说明	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	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
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	50
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	50
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	50
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	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50

7.12 本报告期投资基金情况	51
7.13 投资组合报告附注	51
§ 8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末上市基金前十名持有人	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
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	52
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况	53
§9 开放式基金份额变动	53
§ 10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
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	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	54
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	54
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
10.9 其他重大事件	55
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	57
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	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	57
§ 12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

§ 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	
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	472,879,327.22 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	330,970,365.90 份	141,908,961.32 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	刘盛	王葭芳
	联系电话	020-83936180	010-65169958
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	lijin@cgbchina.com.cn
客户服务电话		4006135888	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	广东省广州市越秀区东风东路

	171号11楼自编1101之一J79	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	王铁	尹兆君

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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.gefund.com.cn
基金中期报告备置地点	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（2021年1月1日至2021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	21,435,547.35	8,419,828.06
本期利润	23,176,402.31	8,835,373.68
加权平均基金份额本期利润	0.0680	0.0637
本期加权平均净值利润率	4.44%	4.25%
本期基金份额净值增长率	4.56%	4.50%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021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	187,010,322.60	52,823,421.84
期末可供分配基金份额利润	0.5650	0.3722
期末基金资产净值	518,026,631.75	217,286,363.65
期末基金份额净值	1.5652	1.5312
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021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	49.67%	54.01%

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	0.75%	0.23%	-0.33%	0.17%	1.08%	0.06%
过去三个月	3.35%	0.25%	1.85%	0.20%	1.50%	0.05%
过去六个月	4.56%	0.38%	1.88%	0.28%	2.68%	0.10%
过去一年	22.11%	0.40%	7.11%	0.26%	15.00%	0.14%
过去三年	46.84%	0.46%	22.24%	0.26%	24.60%	0.20%
自基金合同生效起至今	49.67%	0.41%	28.02%	0.25%	21.65%	0.16%

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	0.74%	0.23%	-0.33%	0.17%	1.07%	0.06%
过去三个月	3.33%	0.25%	1.85%	0.20%	1.48%	0.05%
过去六个月	4.50%	0.38%	1.88%	0.28%	2.62%	0.10%
过去一年	21.98%	0.40%	7.11%	0.26%	14.87%	0.14%
过去三年	51.30%	0.48%	22.24%	0.26%	29.06%	0.22%
自基金合同生效起至今	54.01%	0.42%	28.02%	0.25%	25.99%	0.17%

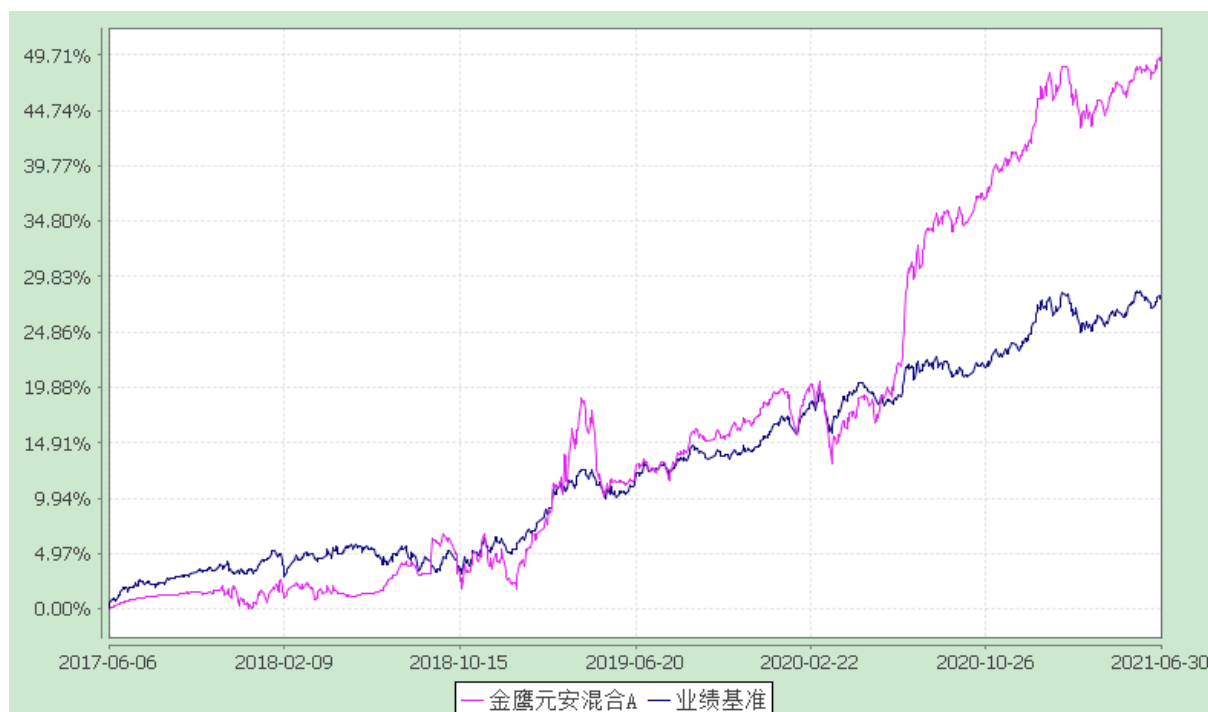
注：本基金的业绩比较基准是：沪深 300 指数收益率×20%+中债总财富(总值)指数收益率×80%。

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

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 2021 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。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。2015 年 12 月,获得受托管理保险资金投资管理资格。

“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。金鹰基金拥有一支经验丰富,风格多元的投资团队。

公司秉承开放、包容、多元的投资文化,采取基金经理负责制,将产品契约与基金经理风格有机结合,鼓励基金经理个人风格的充分展现,强化产品投资风格的稳定性,逐步形成了风险收益特征多元,投资研究体系有机互补的整体投研平台和基金产品线。截至报告期末,合计管理公募基金 50 支。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

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		
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	-	13	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。
杨晓斌	本基金的基金经理	2019-06-26	-	10	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。
周雅雯	本基金的基金经理助理	2020-10-15	-	4	周雅雯女士, 上海财经大学金融学硕士研究生, 2018 年 8 月加入金鹰基金管理有限公司, 担任绝对收益投资部信用研究员职务。现任基金经理助理。

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间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

21 年上半年 A 股大致围绕 3500 点中枢，整体呈箱体震荡，波动区间 3300-3700 点。年初宽松流动性及风险偏好上升，一度推动年初出现明显上涨，但春节后预期流动性收缩、10 年期美债收益率大涨及全球通胀预期快速升温等因素综合影响下，A 股出现较大回撤。进入二季度后，市场风险偏好逐渐回暖，尤其 5 月后流动性超预期宽松，对股票和债券市场均形成一定的利好支持，随着经

济见顶预期逐步成为一致预期，股市风格出现明显偏离，弱周期成长股明显上涨，同时顺周期和消费则出现明显调整。

本组合延续上期季报的打新增厚策略，权益方面主要维持底仓稳健+打新增厚原则，争取在保证底仓足额并稳健的基础上，力求尽可能获得稳定的低风险收益。

我们上个季报也重点强调过，今年年内宏观变量波动较小，股市不存在大的趋势性机会，行业分化较大的结构性机会突出，因此我们当时提到逐步减仓顺周期（内需），并且加大关注受益于外需和通胀的相关品种，以及逐步布局弱周期成长类个股。

我们二季度以来对组合的微调主要在几方面，整体维持较高仓位：1、普减了比较依赖内需抑或业绩不及预期的一些顺周期类品种；2、加仓通胀预期抬头、受益于涨价且具备弱周期属性的必需消费品和医药等；3、将存量的少数保险持仓切换至银行。另外，加大成长股机会的参与；4、成长股内部减仓了计算机品种，加仓了回调较多且基本面改善的半导体；5、5月中旬后加仓了新能源车和光伏类个股。

总结反思一下具体操作中的问题，二季度社融、工业增加值、PMI 以及美联储缩表等变量都在持续打击市场对经济积极的态度，逻辑上布局弱周期成长或消费将是较确定的方向。在消费和成长二者的选择当中，我主要观察的是通胀的预期。虽然我一直不认为通胀会是本轮经济的核心矛盾，实质上国内 CPI 目前依然处于非常低的位置，美国 CPI 较高主要与其一直以来过度宽松有关，对中国的短期影响依然有限。但由于在 5 月份观察到美国通胀数据的持续反弹，我增持了较多受益于通胀的必需消费品，而对已经累积了较大涨幅的成长类品种，大多数选择规避，只增持了涨幅相对滞后的半导体。但回过头来会发现，市场的理性远超我预期，本轮成长股的表现明显超过了我的预期；而受到原材料等价格上涨的影响，本轮消费品成本转嫁是否顺畅依然受到市场的质疑，影响到了相关股价表现。类似的，持仓当中部分外需驱动型的标的，也由于本轮原材料价格的上涨受到压制。

虽然一直以来我对自身构建的一系列策略投资框架有较强的信心，但具体执行的过程中依然需要不断加强对很多潜在干扰变量的关注和重视。

回顾 2021 年二季度，债券市场则呈现出震荡下行的态势。一季度跨季后，由于地方债发行速度大幅低于预期，同时，超储率处于高位，市场资金超预期宽松，整体市场体现为融资价格的超预期下行，带动短端收益率下行，与此同时，配置盘，以及前期担忧地方债供给而一直处于观望状态的交易盘开始大举买入，打破了市场的平衡，带动长端收益率大幅下行，10 年期国债收益率一度突破 3.1%，最低达到 3.04% 的位置。但由于通胀预期的逐渐升温以及短端资金面价格的波动逐步加大，进入 6 月以后，债券市场小幅反弹。进入 6 月中，伴随着通胀预期的逐步缓解，同时央行对于资金面的态度保持稳定，长端收益率再次下行。

整个季度来看，10 年期国债收益率下行 11bp，10 年期国开债收益率下行 8bp。我们固收方面的策略主要是通过置换的方式，适度增加组合久期到 1.8 年左右，持仓个债评级均为 AAA 低风险品种，组合债券持仓保持较高的流动性，行业方向主要还是以金融行业公司债为主。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值为 1.5652 元，本报告期份额净值增长率为 4.56%，同期业绩比较基准增长率为 1.88%；C 类基金份额净值为 1.5312 元，本报告期份额净值增长率 4.50%，同期业绩比较基准增长率为 1.88%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021 年下半年，国内货币政策平稳，社融下行有底，财政后移将带来传统基建温和上行，上半年的出口、地产投资动力依然保持韧性，服务消费和制造业投资缓慢修复，经济依然不均衡。盈利整体提升空间有限背景下，企业盈利分化决定投资机会的结构。但由于盈利和利率都不存在大趋势波动，因此股市波动不存在明显趋势，过于乐观或者过于悲观的容易犯错。

由于全球疫苗接种进度，全球经济呈现“接力式”复苏，经济韧性被拉长，强度被平滑，对我国出口带来持续支撑；就业将主要决定美联储行动节奏，预计 Q3 释放 Taper 信号，但“缩减恐慌”的影响有限；在实际利率带动，美债收益率仍将脉冲式上行，不排除长端利率在 Taper 开始减量后，接近本轮上行周期顶部，谨防下半年美国加息预期的潜在扰动。

本组合仍将延续权益底仓+打新策略，权益仓位维持在 20%-25%之间，并通过打新增厚收益。

权益方面，在经济见顶、流动性平稳、PPI 厚尾的宏观环境下，下半年我们整体看好具备弱周期特性、且业绩具有相对优势的成长和必需消费板块，但由于目前多数品种已经有较大累积涨幅，我们将着重关注可能潜在导致成长股调整的变量：1、联储表态；2、海外疫情修复；3、国内社融；4、中报情况。若因为相关因素导致成长股调整较大则是较好的加仓机会。

风格：6 月份以来中小盘市值个股涨幅明显，本质源于部分成长板块的行情扩散。除非核心成长赛道龙头价值严重偏离，否则中小票个股更多是跟随式上涨；如果行业拐点出现，需警惕中小盘个股大幅调整。应对上，我们如果对个别成长行业预期较为乐观会小幅加仓估值性价比更高，业绩确定性强的二线标的，并且跟着乐观预期兑现逐步切换至大盘，并将加强对成长板块基本面的密切跟踪。

自上而下角度，我们将围绕以下弱周期主线进行择股：

①通胀无忧，赛道景气明确业绩确定性不断被验证的成长行业，如半导体、电新、CXO、医美等；

②通胀抬头，通胀传导通畅的大众消费行业：通胀持续保持高位的背景下，能够走出成本困境的行业将更多取决于成本能否转嫁，如医药、化妆品、化工、啤酒、种植、半导体材料等。

固收方面，我们认为货币政策还将在较长的时间内维持稳健以维护金融系统的稳定性。而下半年最大的问题来源于信用收紧所带来的风险事件。我们认为如果因为信用事件出现债券的抛售，将会是较好的左侧做多机会，组合持仓仍将保持高信用评级高流动性持仓策略，择机布局做多机会。

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

本报告期内无应当说明的预警事项。

§ 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

本报告期内，广发银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对金鹰元安混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作方面进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 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：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,294,348.51	5,645,052.09
结算备付金		6,485.59	189,068.20
存出保证金		56,405.75	111,820.57
交易性金融资产	6.4.7.2	753,587,973.71	703,382,041.54

其中：股票投资		182,224,163.71	190,823,081.54
基金投资		-	-
债券投资		571,363,810.00	512,558,960.00
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	-	-
应收证券清算款		437,884.31	39,465.05
应收利息	6.4.7.5	8,686,866.83	7,132,044.91
应收股利		-	-
应收申购款		834,825.66	1,088,282.95
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		765,904,790.36	717,587,775.31
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
负债：			
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		29,000,000.00	8,000,000.00
应付证券清算款		-	1,396,970.81
应付赎回款		699,765.06	6,904,605.65
应付管理人报酬		359,936.61	351,604.08
应付托管费		119,978.87	117,201.37
应付销售服务费		17,690.18	14,619.48
应付交易费用	6.4.7.7	39,251.75	36,850.35
应交税费		42.40	1,340.79
应付利息		13,514.30	1,665.76
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	341,615.79	262,158.26
负债合计		30,591,794.96	17,087,016.55
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	405,267,540.72	400,496,629.55
未分配利润	6.4.7.10	330,045,454.68	300,004,129.21
所有者权益合计		735,312,995.40	700,500,758.76
负债和所有者权益总计		765,904,790.36	717,587,775.31

注：截止报告期末 2021 年 6 月 30 日，本基金份额总额 472,879,327.22 份。本基金 A 类份额净值 1.5652 元，份额总额 330,970,365.90 份；本基金 C 类份额净值 1.5312 元，份额总额 141,908,961.32 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		35,354,651.19	7,860,894.95
1.利息收入		9,190,291.05	2,667,041.75
其中：存款利息收入	6.4.7.11	37,163.49	30,521.12
债券利息收入		9,153,127.56	2,613,923.77
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	22,596.86
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		23,946,633.53	5,565,250.68
其中：股票投资收益	6.4.7.12	22,673,535.02	4,663,238.62
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	158,606.36	-77,016.31
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	1,114,492.15	979,028.37
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	2,156,400.58	-380,237.71
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	61,326.03	8,840.23
减：二、费用		3,342,875.20	1,616,026.05
1. 管理人报酬		2,173,840.53	763,656.26
2. 托管费		724,613.48	254,552.10
3. 销售服务费		103,113.21	2,516.02
4. 交易费用	6.4.7.21	193,910.41	275,832.99
5. 利息支出		48,514.66	223,668.31
其中：卖出回购金融资产支出		48,514.66	223,668.31
6. 税金及附加		939.75	123.37
7. 其他费用	6.4.7.22	97,943.16	95,677.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		32,011,775.99	6,244,868.90
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		32,011,775.99	6,244,868.90

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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	400,496,629.55	300,004,129.21	700,500,758.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	32,011,775.99	32,011,775.99
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）	4,770,911.17	-1,970,450.52	2,800,460.65
其中：1.基金申购款	93,121,243.57	68,222,875.47	161,344,119.04
2.基金赎回款	-88,350,332.40	-70,193,325.99	-158,543,658.39
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）	405,267,540.72	330,045,454.68	735,312,995.40
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	206,993,794.67	113,678,411.73	320,672,206.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,244,868.90	6,244,868.90
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）	-60,553,204.11	-32,328,576.05	-92,881,780.16
其中：1.基金申购款	38,265,012.08	18,169,041.28	56,434,053.36
2.基金赎回款	-98,818,216.19	-50,497,617.33	-149,315,833.52
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）	146,440,590.56	87,594,704.58	234,035,295.14

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：姚文强，主管会计工作负责人：姚文强，会计机构负责人：董霞

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和基金合同等有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可交换公司债券、可转换公司债券（含可分离交易可转债）、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券），以及权证、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货等及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则（以下简称“企业会计准则”）要求，并按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在会计核算和信息披露方面亦参考了中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及其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及基金业协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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日起至 2021 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;对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税;同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。2018年1月1日(含)以后,资管产品管理人(以下称管理人)运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,以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。对资管产品在2018年1月1日以前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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.对基金从上市公司取得的股息、红利所得,由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起,对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额: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,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照

上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。

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. 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

7. 对基金在 2018 年 1 月 1 日 (含) 以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	2,294,348.51
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	2,294,348.51

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	137,183,030.63	182,224,163.71	45,041,133.08
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	309,817,482.83	309,471,810.00
	银行间市场	262,805,169.68	261,892,000.00
	合计	572,622,652.51	571,363,810.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-

合计	709,805,683.14	753,587,973.71	43,782,290.57
----	----------------	----------------	---------------

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**

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

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 2021年6月30日
应收活期存款利息	472.11
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	2.61
应收债券利息	8,686,369.25
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	-
应收出借证券利息	-
其他	22.86
合计	8,686,866.83

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 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	39,251.75
银行间市场应付交易费用	-
合计	39,251.75

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
----	-------------------

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	128.83
应付证券出借违约金	-
预提审计费用	59,835.79
预提信息披露费	279,507.37
其他应付款	2,143.80
合计	341,615.79

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 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	343,343,051.47	273,203,642.67
本期申购	64,225,443.17	51,105,105.81
本期赎回（以“-”号填列）	-76,598,128.74	-60,950,169.08
本期末	330,970,365.90	263,358,579.40

金鹰元安混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	127,292,986.88	127,292,986.88
本期申购	42,016,137.76	42,016,137.76
本期赎回（以“-”号填列）	-27,400,163.32	-27,400,163.32
本期末	141,908,961.32	141,908,961.32

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	172,410,533.23	68,374,760.03	240,785,293.26
本期利润	21,435,547.35	1,740,854.96	23,176,402.31
本期基金份额交易产生的变动数	-6,835,757.98	-2,457,885.24	-9,293,643.22

其中：基金申购款	33,942,656.62	13,143,797.37	47,086,453.99
基金赎回款	-40,778,414.60	-15,601,682.61	-56,380,097.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	187,010,322.60	67,657,729.75	254,668,052.35

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	39,645,379.64	19,573,456.31	59,218,835.95
本期利润	8,419,828.06	415,545.62	8,835,373.68
本期基金份额交易产生的变动数	4,758,214.14	2,564,978.56	7,323,192.70
其中：基金申购款	14,404,212.06	6,732,209.42	21,136,421.48
基金赎回款	-9,645,997.92	-4,167,230.86	-13,813,228.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	52,823,421.84	22,553,980.49	75,377,402.33

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	34,886.08
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	1,738.06
其他	539.35
合计	37,163.49

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	77,548,368.42
减：卖出股票成本总额	54,874,833.40
买卖股票差价收入	22,673,535.02

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——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成	50,996,937.80

交总额	
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	49,908,316.58
减：应收利息总额	930,014.86
买卖债券差价收入	158,606.36

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 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,114,492.15
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,114,492.15

6.4.7.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	2,156,400.58
——股票投资	1,404,509.21
——债券投资	751,891.37
——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	2,156,400.58

6.4.7.20 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	59,516.68
转换费收入	1,809.35
合计	61,326.03

6.4.7.21 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	193,910.41
银行间市场交易费用	0.00
合计	193,910.41

6.4.7.21.1 持有基金产生的费用

本基金本报告期未投资基金。

6.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,600.00
合计	97,943.16

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，本基金无须披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无重大须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

本报告期内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
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**

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

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 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,173,840.53	763,656.26
其中：支付销售机构的客户维护费	162,369.51	24,248.85

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 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	724,613.48	254,552.10

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 2021年1月1日至2021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	-	39,598.41	39,598.41
合计	-	39,598.41	39,598.41
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	-	847.81	847.81
合计	-	847.81	847.81

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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

本基金本报告期内及上年度可比期间未参与转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自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自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 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。

6.4.10.6 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	
	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年1月1日至2020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	2,294,348.51	34,886.08	2,161,531.93	26,280.84

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、2021年6月30日清算备付金期末余额 6,485.59 元，清算备付金利息收入 1,738.06 元；2020年6月30日清算备付金期末余额 38,632.07 元，清算备付金利息收入 3,553.88 元。

6.4.10.7 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。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**6.4.10.8.1 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（2021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**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688696	极米科技	2021-02-23	2021-09-03	网下配售锁定	133.73	780.24	1,252.00	167,429.96	976,860.48	网下配售锁定
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	网下配售锁定	28.28	115.71	360.00	10,180.80	41,655.60	网下配售锁定
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	网下配售锁定	28.77	99.85	240.00	6,904.80	23,964.00	网下配售锁定
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	网下配售锁定	48.59	90.39	438.00	21,282.42	39,590.82	网下配售锁定
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	网下配售锁定	33.22	87.50	703.00	23,353.66	61,512.50	网下配售锁定
688217	睿昂基因	2021-05-07	2021-11-17	网下配售锁定	18.42	58.40	1,040.00	19,156.80	60,736.00	网下配售锁定
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	网下配售锁定	18.71	57.62	201.00	3,760.71	11,581.62	网下配售锁定
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	网下配售锁定	12.25	53.71	244.00	2,989.00	13,105.24	网下配售锁定
688216	气派科技	2021-06-15	2021-12-23	网下配售锁定	14.82	47.64	2,000.00	29,640.00	95,280.00	网下配售锁定
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	网下配售锁定	15.83	45.29	317.00	5,018.11	14,356.93	网下配售锁定
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	网下配售锁定	12.76	43.38	307.00	3,917.32	13,317.66	网下配售锁定
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	网下配售锁定	20.81	42.23	241.00	5,015.21	10,177.43	网下配售锁定
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	网下配售锁定	9.19	40.38	329.00	3,023.51	13,285.02	网下配售锁定
68831	诺禾	2021-0	2021-1	网下	12.76	39.20	3,711.	47,352	145,47	网下

5	致源	4-02	0-13	配售 锁定			00	.36	1.20	配售 锁定
30095 0	德固 特	2021-0 2-24	2021-0 9-03	网下 配售 锁定	8.41	39.13	219.00	1,841. 79	8,569. 47	网下 配售 锁定
68849 9	利元 亨	2021-0 6-23	2021-0 7-01	网下 新股 申购	38.85	38.85	2,149. 00	83,488 .65	83,488 .65	网下 新股 待上 市
30101 5	百洋 医药	2021-0 6-22	2021-1 2-30	网下 配售 锁定	7.64	38.83	462.00	3,529. 68	17,939 .46	网下 配售 锁定
30101 1	华立 科技	2021-0 6-09	2021-1 2-17	网下 配售 锁定	14.20	33.84	175.00	2,485. 00	5,922. 00	网下 配售 锁定
68809 2	爱科 科技	2021-0 3-12	2021-0 9-22	网下 配售 锁定	19.11	33.21	1,137. 00	21,728 .07	37,759 .77	网下 配售 锁定
30101 6	雷尔 伟	2021-0 6-23	2021-1 2-30	网下 配售 锁定	13.75	32.98	275.00	3,781. 25	9,069. 50	网下 配售 锁定
68862 8	优利 德	2021-0 1-22	2021-0 8-02	网下 配售 锁定	19.11	32.62	2,789. 00	53,297 .79	90,977 .18	网下 配售 锁定
68857 5	亚辉 龙	2021-0 5-10	2021-1 1-17	网下 配售 锁定	14.80	32.09	3,435. 00	50,838 .00	110,22 9.15	网下 配售 锁定
30093 2	三友 联众	2021-0 1-15	2021-0 7-22	网下 配售 锁定	24.69	31.71	492.00	12,147 .48	15,601 .32	网下 配售 锁定
60528 7	德才 股份	2021-0 6-28	2021-0 7-06	网下 新股 申购	31.56	31.56	349.00	11,014 .44	11,014 .44	网下 新股 待上 市
30096 6	共同 药业	2021-0 3-31	2021-1 0-11	网下 配售 锁定	8.24	31.54	286.00	2,356. 64	9,020. 44	网下 配售 锁定
30098 6	志特 新材	2021-0 4-21	2021-1 1-01	网下 配售 锁定	14.79	30.57	264.00	3,904. 56	8,070. 48	网下 配售 锁定
30092 7	江天 化学	2020-1 2-29	2021-0 7-07	网下 配售 锁定	13.39	30.10	217.00	2,905. 63	6,531. 70	网下 配售 锁定
30092	华骐	2021-0	2021-0	网下	13.87	29.55	183.00	2,538.	5,407.	网下

9	环保	1-12	7-20	配售 锁定				21	65	配售 锁定
30097 1	博亚 精工	2021-0 4-07	2021-1 0-15	网下 配售 锁定	18.24	28.29	245.00	4,468. 80	6,931. 05	网下 配售 锁定
30100 9	可靠 股份	2021-0 6-08	2021-1 2-17	网下 配售 锁定	12.54	27.89	801.00	10,044 .54	22,339 .89	网下 配售 锁定
30094 8	冠中 生态	2021-0 2-18	2021-0 8-25	网下 配售 锁定	8.67	27.42	324.00	2,808. 00	8,884. 08	网下 配售 锁定
30095 2	恒辉 安防	2021-0 3-03	2021-0 9-13	网下 配售 锁定	11.72	27.08	340.00	3,984. 80	9,207. 20	网下 配售 锁定
30098 7	川网 传媒	2021-0 4-28	2021-1 1-11	网下 配售 锁定	6.79	26.81	301.00	2,043. 79	8,069. 81	网下 配售 锁定
68861 9	罗普 特	2021-0 2-08	2021-0 8-23	网下 配售 锁定	19.31	26.74	5,856. 00	113,07 9.36	156,58 9.44	网下 配售 锁定
30099 1	创益 通	2021-0 5-12	2021-1 1-22	网下 配售 锁定	13.06	26.51	254.00	3,317. 24	6,733. 54	网下 配售 锁定
30095 6	英力 股份	2021-0 3-16	2021-0 9-27	网下 配售 锁定	12.85	25.80	371.00	4,767. 35	9,571. 80	网下 配售 锁定
30099 5	奇德 新材	2021-0 5-17	2021-1 1-26	网下 配售 锁定	14.72	23.32	191.00	2,811. 52	4,454. 12	网下 配售 锁定
30096 0	通业 科技	2021-0 3-22	2021-0 9-29	网下 配售 锁定	12.08	23.06	234.00	2,826. 72	5,396. 04	网下 配售 锁定
30094 3	春晖 智控	2021-0 2-03	2021-0 8-10	网下 配售 锁定	9.79	23.01	255.00	2,496. 45	5,867. 55	网下 配售 锁定
30096 3	中洲 特材	2021-0 3-30	2021-1 0-11	网下 配售 锁定	12.13	22.49	283.00	3,432. 79	6,364. 67	网下 配售 锁定
30092 6	博俊 科技	2020-1 2-29	2021-0 7-07	网下 配售 锁定	10.76	22.20	359.00	3,862. 84	7,969. 80	网下 配售 锁定
68808 7	英科 再生	2021-0 6-30	2021-0 7-09	网下 新股 申购	21.96	21.96	2,469. 00	54,219 .24	54,219 .24	网下 新股 待上

										市
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	网下配售锁定	6.02	21.32	201.00	1,210.02	4,285.32	网下配售锁定
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	网下配售锁定	9.36	20.32	200.00	1,872.00	4,064.00	网下配售锁定
300993	玉马遮阳	2021-05-17	2021-11-24	网下配售锁定	12.10	19.29	410.00	4,961.00	7,908.90	网下配售锁定
688533	上声电子	2021-04-09	2021-10-19	网下配售锁定	7.72	19.11	3,493.00	26,965.96	66,751.23	网下配售锁定
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	网下配售锁定	4.56	18.88	474.00	2,161.44	8,949.12	网下配售锁定
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	网下配售锁定	7.83	17.61	218.00	1,706.94	3,838.98	网下配售锁定
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	网下配售锁定	3.40	16.37	576.00	1,958.40	9,429.12	网下配售锁定
688609	九联科技	2021-03-15	2021-09-23	网下配售锁定	3.99	15.29	10,372.00	41,384.28	158,587.88	网下配售锁定
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	网下配售锁定	5.29	14.44	303.00	1,602.87	4,375.32	网下配售锁定
688565	力源科技	2021-05-06	2021-11-15	网下配售锁定	9.39	14.00	2,464.00	23,136.96	34,496.00	网下配售锁定
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	网下配售锁定	4.31	13.11	672.00	2,896.32	8,809.92	网下配售锁定
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	网下配售锁定	4.94	13.05	928.00	4,584.32	12,110.40	网下配售锁定
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	网下配售锁定	5.48	13.03	492.00	2,696.16	6,410.76	网下配售锁定
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	网下配售锁定	6.87	12.07	1,162.00	7,982.94	14,025.34	网下配售锁定
30096	晓鸣	2021-0	2021-1	网下	4.54	11.54	507.00	2,301.	5,850.	网下

7	股份	4-02	0-13	配售 锁定				78	78	配售 锁定
30102 0	密封 科技	2021-0 6-28	2022-0 1-06	网下 配售 锁定	10.64	10.64	421.00	4,479. 44	4,479. 44	网下 配售 锁定
30102 0	密封 科技	2021-0 6-28	2021-0 7-06	网下 新股 申购	10.64	10.64	3,789. 00	40,314 .96	40,314 .96	网下 新股 待上 市
30093 3	中辰 股份	2021-0 1-15	2021-0 7-22	网下 配售 锁定	3.37	10.44	1,112. 00	3,747. 44	11,609 .28	网下 配售 锁定
30102 1	英诺 激光	2021-0 6-28	2021-0 7-06	网下 新股 申购	9.46	9.46	2,609. 00	24,681 .14	24,681 .14	网下 新股 待上 市
30102 1	英诺 激光	2021-0 6-28	2022-0 1-06	网下 配售 锁定	9.46	9.46	290.00	2,743. 40	2,743. 40	网下 配售 锁定
30101 7	漱玉 平民	2021-0 6-23	2021-0 7-05	网下 新股 申购	8.86	8.86	4,995. 00	44,255 .70	44,255 .70	网下 新股 待上 市
30101 7	漱玉 平民	2021-0 6-23	2022-0 1-05	网下 配售 锁定	8.86	8.86	555.00	4,917. 30	4,917. 30	网下 配售 锁定
68822 6	威腾 电气	2021-0 6-28	2021-0 7-07	网下 新股 申购	6.42	6.42	2,693. 00	17,289 .06	17,289 .06	网下 新股 待上 市
60516 2	新中 港	2021-0 6-29	2021-0 7-07	网下 新股 申购	6.07	6.07	1,377. 00	8,358. 39	8,358. 39	网下 新股 待上 市
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流 通日	流通 受 限类 型	认购 价格	期末估 值单价	数量(单 位：张)	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注
11305 0	南银 转债	2021-0 6-17	2021-0 7-01	网下 新债 申购	100.00	100.00	2,120. 00	212,00 0.00	212,00 0.00	网下 新债 待上 市

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

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 29,000,000.00 元，于 2021 年 7 月 1 日、7 月 2 日、7 月 5 日先后到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期内未参与转融通证券出借业务。

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设，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；对公司各部门作业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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	0.00	30,003,000.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	30,003,000.00

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 2021年6月30日	上年度末 2020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 2021年6月30日	上年度末 2020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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	493,590,760.00	392,161,260.00
AAA 以下	0.00	62,700.00
未评级	0.00	0.00
合计	493,590,760.00	392,223,960.00

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。

6.4.13.2.5 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 2021年6月30日	上年度末 2020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 2021年6月30日	上年度末 2020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

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 2021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	2,294,348.51	-	-	-	-	-	-	-	-	2,294,348.51
结算备付金	6,485.59	-	-	-	-	-	-	-	-	6,485.59

存出保证金	56,405.75	-	-	-	-	-	-	-	-	56,405.75
交易性金融资产	-	-	-	-	228,915,810.00	342,236,000.00	212,000.00	182,224,163.71	753,587,973.71	
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	437,884.31	437,884.31	
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	8,686,866.83	8,686,866.83	
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	834,825.66	834,825.66	
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
资产总计	2,357,239.85	-	-	-	228,915,810.00	342,236,000.00	212,000.00	192,183,740.51	765,904,790.36	
负债										
短期借款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
卖出回购金融资产款	29,000,000.00	-	-	-	-	-	-	-	29,000,000.00	
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	699,765.06	699,765.06	
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	359,936.61	359,936.61	
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	119,978.87	119,978.87	
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-	17,690.18	17,690.18	
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	39,251.75	39,251.75	
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	42.40	42.40	
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	13,514.30	13,514.30	
应付利润	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	341,615.79	341,615.79	
负债总计	29,000,000.00	-	-	-	-	-	-	1,591,794.96	30,591,794.96	

利率敏感缺口	-26,642,760.15	-	-	-	-	228,915,810.00	342,236,000.00	212,000.00	190,591,945.55	735,312,995.40
上年度末 2020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	5,645,052.09	-	-	-	-	-	-	-	-	5,645,052.09
结算备付金	189,068.20	-	-	-	-	-	-	-	-	189,068.20
存出保证金	111,820.57	-	-	-	-	-	-	-	-	111,820.57
交易性金融资产	19,998,000.00	-	-	-	-	80,381,000.00	412,117,260.00	62,700.00	190,823,081.54	703,382,041.54
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	39,465.05	39,465.05
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	7,132,044.91	7,132,044.91
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	1,088,282.95	1,088,282.95
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	25,943,940.86	-	-	-	-	80,381,000.00	412,117,260.00	62,700.00	199,082,874.45	717,587,775.31
负债										
短期借款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	8,000,000.00	-	-	-	-	-	-	-	-	8,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	1,396,970.81	1,396,970.81
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	6,904,605.65	6,904,605.65
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	351,604.08	351,604.08
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	117,201.37	117,201.37
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-	-	14,619.48	14,619.48

应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	-36,850.35	36,850.35
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	-	1,340.79	1,340.79
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-	1,665.76	1,665.76
应付利润	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	262,158.26	262,158.26
负债总计	8,000,000.00	-	-	-	-	-	-	-	9,087,016.55	17,087,016.55
利率敏感度缺口	17,943,940.86	-	-	-	-	80,381,000.00	412,117,260.00	62,700.00	189,995,857.90	700,500,758.76

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

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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
	利率上升 25 个基点	-1,575,909.76	-1,621,686.12
利率下降 25 个基点	1,594,348.90	1,641,359.77	

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 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净	公允价值	占基金 资产净

		值比例 (%)		值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	182,224,163.71	24.78	190,823,081.54	27.24
交易性金融资产—债券投资	212,000.00	0.03	62,700.00	0.01
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	182,436,163.71	24.81	190,885,781.54	27.25

注：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，主要涉及股票、可转债、可交换债、权证等交易性金融资产。

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

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
		2021年6月30日	2020年12月31日
	业绩比较基准变动+5%	32,543,876.21	39,611,119.10
	业绩比较基准变动-5%	-32,543,876.21	-39,611,119.10

金鹰元安混合 C

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
		2021年6月30日	2020年12月31日
	业绩比较基准变动+5%	13,653,298.95	14,365,239.67
	业绩比较基准变动-5%	-13,653,298.95	-14,365,239.67

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 2021 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 179,462,528.03 元，第二层级的余额为 574,125,445.68 元，无属于第三层级的余额。

(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

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	182,224,163.71	23.79
	其中：股票	182,224,163.71	23.79
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	571,363,810.00	74.60
	其中：债券	571,363,810.00	74.60
	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	-	-
	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	2,300,834.10	0.30

	计		
8	其他各项资产	10,015,982.55	1.31
9	合计	765,904,790.36	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 报告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

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	32,707.58	0.00
B	采矿业	76,731.20	0.01
C	制造业	109,391,254.98	14.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,213,007.29	0.57
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	95,577.58	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	14,014,130.00	1.91
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,824,744.16	0.79
J	金融业	28,978,764.51	3.94
K	房地产业	5,341,880.00	0.73
L	租赁和商务服务业	9,908,654.06	1.35
M	科学研究和技术服务业	2,662,427.20	0.36
N	水利、环境和公共设施管理业	62,072.75	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	16,262.03	0.00
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,580,579.00	0.21
S	综合	-	-
	合计	182,224,163.71	24.78

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港股通投资股票。

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	000001	平安银行	480,000	10,857,600.00	1.48
2	601012	隆基股份	70,000	6,218,800.00	0.85
3	603456	九洲药业	127,700	6,203,666.00	0.84
4	601919	中远海控	200,000	6,108,000.00	0.83
5	601233	桐昆股份	250,000	6,022,500.00	0.82
6	601888	中国中免	17,600	5,281,760.00	0.72
7	002415	海康威视	80,000	5,160,000.00	0.70
8	600519	贵州茅台	2,500	5,141,750.00	0.70
9	002027	分众传媒	490,000	4,610,900.00	0.63
10	600036	招商银行	69,945	3,790,319.55	0.52
11	000725	京东方A	600,000	3,744,000.00	0.51
12	000858	五粮液	12,500	3,723,625.00	0.51
13	300124	汇川技术	50,000	3,713,000.00	0.50
14	600690	海尔智家	140,000	3,627,400.00	0.49
15	000661	长春高新	8,700	3,366,900.00	0.46
16	002594	比亚迪	13,000	3,263,000.00	0.44
17	000651	格力电器	60,000	3,126,000.00	0.43
18	600377	宁沪高速	320,000	3,123,200.00	0.42
19	002142	宁波银行	80,000	3,117,600.00	0.42
20	300682	朗新科技	182,000	3,061,240.00	0.42
21	600031	三一重工	102,000	2,965,140.00	0.40
22	601601	中国太保	100,000	2,897,000.00	0.39
23	600660	福耀玻璃	50,000	2,792,500.00	0.38
24	002371	北方华创	10,000	2,773,800.00	0.38
25	000002	万科A	108,000	2,571,480.00	0.35
26	300751	迈为股份	5,400	2,455,380.00	0.33
27	002460	赣锋锂业	20,000	2,421,800.00	0.33
28	000568	泸州老窖	10,000	2,359,400.00	0.32
29	002110	三钢闽光	350,000	2,359,000.00	0.32
30	601318	中国平安	35,000	2,249,800.00	0.31
31	600887	伊利股份	60,200	2,217,166.00	0.30
32	600900	长江电力	104,000	2,146,560.00	0.29
33	300750	宁德时代	4,000	2,139,200.00	0.29
34	300476	胜宏科技	97,600	2,132,560.00	0.29
35	300630	普利制药	40,000	2,096,000.00	0.29
36	002304	洋河股份	10,000	2,072,000.00	0.28
37	600383	金地集团	200,000	2,048,000.00	0.28

38	002230	科大讯飞	30,000	2,027,400.00	0.28
39	600886	国投电力	210,000	2,018,100.00	0.27
40	002245	蔚蓝锂芯	100,000	1,970,000.00	0.27
41	600885	宏发股份	30,800	1,931,160.00	0.26
42	601128	常熟银行	300,000	1,860,000.00	0.25
43	601689	拓普集团	48,000	1,796,640.00	0.24
44	300049	福瑞股份	150,000	1,770,000.00	0.24
45	600966	博汇纸业	130,000	1,696,500.00	0.23
46	002739	万达电影	100,100	1,580,579.00	0.21
47	603915	国茂股份	40,000	1,580,000.00	0.21
48	600276	恒瑞医药	22,800	1,549,716.00	0.21
49	601995	中金公司	24,951	1,534,486.50	0.21
50	600926	杭州银行	100,000	1,475,000.00	0.20
51	002738	中矿资源	30,000	1,332,000.00	0.18
52	603259	药明康德	8,400	1,315,356.00	0.18
53	601058	赛轮轮胎	130,000	1,298,700.00	0.18
54	002241	歌尔股份	30,000	1,282,200.00	0.17
55	601138	工业富联	100,000	1,241,000.00	0.17
56	000710	贝瑞基因	40,000	1,201,600.00	0.16
57	603338	浙江鼎力	20,000	1,173,800.00	0.16
58	000429	粤高速 A	150,000	1,075,500.00	0.15
59	002601	龙佰集团	30,000	1,037,400.00	0.14
60	601398	工商银行	200,000	1,034,000.00	0.14
61	600009	上海机场	21,000	1,010,730.00	0.14
62	688696	极米科技	1,252	976,860.48	0.13
63	300122	智飞生物	5,000	933,650.00	0.13
64	002756	永兴材料	15,000	890,850.00	0.12
65	000977	浪潮信息	30,000	843,900.00	0.11
66	603019	中科曙光	30,000	828,300.00	0.11
67	603369	今世缘	15,000	812,400.00	0.11
68	600004	白云机场	65,000	726,700.00	0.10
69	600048	保利地产	60,000	722,400.00	0.10
70	688019	安集科技	2,000	622,000.00	0.08
71	603520	司太立	10,000	616,500.00	0.08
72	688699	明微电子	1,869	533,263.08	0.07
73	300601	康泰生物	3,000	447,000.00	0.06
74	688601	力芯微	1,174	216,133.40	0.03
75	688136	科兴制药	4,981	184,695.48	0.03
76	688308	欧科亿	2,457	166,510.89	0.02
77	688609	九联科技	10,372	158,587.88	0.02
78	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.02
79	688619	罗普特	5,856	156,589.44	0.02
80	688315	诺禾致源	3,711	145,471.20	0.02
81	600906	财达证券	7,597	128,237.36	0.02

82	688314	康拓医疗	1,085	114,619.40	0.02
83	688575	亚辉龙	3,435	110,229.15	0.01
84	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01
85	688216	气派科技	2,000	95,280.00	0.01
86	688628	优利德	2,789	90,977.18	0.01
87	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
88	688117	圣诺生物	1,672	80,924.80	0.01
89	605117	德业股份	627	80,005.20	0.01
90	001203	大中矿业	3,808	76,731.20	0.01
91	688533	上声电子	3,493	66,751.23	0.01
92	300979	华利集团	703	61,512.50	0.01
93	688217	睿昂基因	1,040	60,736.00	0.01
94	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
95	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
96	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
97	300973	立高食品	360	41,655.60	0.01
98	300981	中红医疗	438	39,590.82	0.01
99	688092	爱科科技	1,137	37,759.77	0.01
100	605339	南侨食品	863	37,264.34	0.01
101	605090	九丰能源	1,090	35,326.90	0.00
102	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
103	688565	力源科技	2,464	34,496.00	0.00
104	605089	味知香	370	32,197.40	0.00
105	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
106	605296	神农集团	569	26,856.80	0.00
107	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
108	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
109	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
110	605389	长龄液压	356	20,890.08	0.00
111	001206	依依股份	321	20,389.92	0.00
112	603511	爱慕股份	553	18,249.00	0.00
113	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
114	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
115	300909	汇创达	386	16,636.60	0.00
116	605098	行动教育	289	16,262.03	0.00
117	605196	华通线缆	1,172	16,079.84	0.00
118	605300	佳禾食品	576	16,012.80	0.00
119	603836	海程邦达	733	15,994.06	0.00
120	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
121	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
122	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
123	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
124	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
125	300940	南极光	307	13,317.66	0.00

126	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
127	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
128	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
129	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
130	003042	中农联合	420	11,839.80	0.00
131	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
132	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
133	605488	福莱新材	416	11,103.04	0.00
134	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
135	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
136	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
137	605189	富春染织	422	10,165.98	0.00
138	300922	天秦装备	287	9,996.21	0.00
139	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
140	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
141	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
142	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
143	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
144	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
145	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
146	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
147	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
148	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
149	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
150	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
151	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
152	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
153	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
154	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
155	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
156	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
157	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
158	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
159	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
160	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
161	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
162	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
163	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
164	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
165	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
166	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
167	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
168	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

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	000725	京东方 A	4,010,120.00	0.57
2	601888	中国中免	2,655,037.00	0.38
3	002110	三钢闽光	2,527,140.00	0.36
4	002371	北方华创	1,958,086.00	0.28
5	601138	工业富联	1,893,000.00	0.27
6	002027	分众传媒	1,841,500.00	0.26
7	300049	福瑞股份	1,739,438.00	0.25
8	601233	桐昆股份	1,651,890.00	0.24
9	300682	朗新科技	1,561,438.00	0.22
10	002245	蔚蓝锂芯	1,516,609.00	0.22
11	600966	博汇纸业	1,422,203.00	0.20
12	002738	中矿资源	1,251,050.00	0.18
13	601058	赛轮轮胎	1,247,582.00	0.18
14	000651	格力电器	1,199,289.00	0.17
15	300124	汇川技术	1,104,416.00	0.16
16	002709	天赐材料	1,018,279.34	0.15
17	000661	长春高新	956,073.00	0.14
18	002756	永兴材料	868,500.00	0.12
19	300122	智飞生物	856,673.00	0.12
20	000100	TCL 科技	811,000.00	0.12

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	000100	TCL 科技	6,548,956.00	0.93
2	603915	国茂股份	4,072,503.54	0.58
3	688981	中芯国际	3,397,184.79	0.48
4	002594	比亚迪	2,744,651.00	0.39
5	000725	京东方 A	2,572,000.00	0.37
6	002601	龙佰集团	2,392,114.00	0.34
7	000830	鲁西化工	2,225,183.00	0.32
8	600104	上汽集团	2,207,535.78	0.32
9	002304	洋河股份	2,006,147.00	0.29
10	002027	分众传媒	2,001,226.00	0.29

11	601012	隆基股份	1,883,700.00	0.27
12	000636	风华高科	1,646,170.00	0.23
13	601186	中国铁建	1,598,000.00	0.23
14	603659	璞泰来	1,566,290.00	0.22
15	000651	格力电器	1,516,850.00	0.22
16	002600	领益智造	1,458,959.00	0.21
17	002008	大族激光	1,365,656.00	0.19
18	002508	老板电器	1,311,850.91	0.19
19	600048	保利地产	1,250,528.06	0.18
20	000671	阳光城	1,232,016.00	0.18

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

买入股票成本（成交）总额	44,871,406.36
卖出股票收入（成交）总额	77,548,368.42

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	7,522,050.00	1.02
2	央行票据	-	-
3	金融债券	563,528,000.00	76.64
	其中：政策性金融债	70,251,000.00	9.55
4	企业债券	101,760.00	0.01
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	212,000.00	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	571,363,810.00	77.70

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	1922033	19 建信金融债 01	500,000.00	50,435,000.00	6.86
2	1922039	19 农银投资债 01	400,000.00	40,328,000.00	5.48
3	1922012	19 信达租赁债	400,000.00	40,300,000.00	5.48
4	190214	19 国开 14	400,000.00	40,152,000.00	5.46
5	155596	19 东吴债	300,000.00	30,195,000.00	4.11

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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于权证。

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。

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	56,405.75
2	应收证券清算款	437,884.31
3	应收股利	-
4	应收利息	8,686,866.83
5	应收申购款	834,825.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,015,982.55

7.13.4 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。

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	4,586	72,169.73	306,160,358.97	92.50%	24,810,006.93	7.50%
金鹰元安混合 C	1,645	86,266.85	116,659,120.92	82.21%	25,249,840.40	17.79%
合计	6,231	75,891.40	422,819,479.89	89.41%	50,059,847.33	10.59%

8.2 期末上市基金前十名持有人

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	13,392.23	0.00%
	金鹰元安混合 C	40,716.18	0.03%
	合计	54,108.41	0.01%

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	247,018,345.11	10,437,664.38
本报告期初基金份额总额	343,343,051.47	127,292,986.88
本报告期基金总申购份额	64,225,443.17	42,016,137.76
减：本报告期基金总赎回份额	76,598,128.74	27,400,163.32
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	330,970,365.90	141,908,961.32

§ 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、本报告期，本基金管理人副总经理、督察长、首席信息官等进行了调整。2021 年 2 月 8 日，徐娇娇女士离任督察长，由公司总经理姚文强先生代行督察长职务；2021 年 5 月 11 日，周蔚女士担任公司常务副总经理；2021 年 5 月 14 日，耿源先生担任公司副总经理；2021 年 7 月 28 日，刘盛先生担任公司督察长，并离任公司副总经理及首席信息官；2021 年 7 月 28 日，总经理姚文强先生兼任首席信息官，不再代行督察长职务。截至报告日，王铁先生担任公司法定代表人及董事长，姚文强先生担任公司总经理及首席信息官，周蔚女士担任公司常务副总经理，耿源先生担任公司副总经理，刘盛先生担任公司督察长职务。

2、本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门发生人事变动，胡杰于 2021 年 1 月担任托管部副总经理。

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

本基金于 2021 年 6 月 3 日修改基金投资范围，增加了存托凭证为投资标的，相应增加了存托凭证投资策略。详情请查阅基金法律文件。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金报告期内未持有基金。

10.6 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。

10.7 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。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 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	
中信证券华南（广证）	2	93,921,309.10	82.20%	66,805.72	82.20%	-
方正证券	1	20,338,399.21	17.80%	14,466.56	17.80%	-

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服务；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。

10.8.2 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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券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
中信证券华南（广证）	87,725,387.80	100.00%	126,200,000.00	100.00%	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

10.9 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部分基金参与信达证券费率优惠活动的公告	证监会指定媒介	2021-01-11
2	金鹰基金管理有限公司关于董事变更的公告	证监会指定媒介	2021-01-14
3	金鹰元安混合型证券投资基金 2020 年四季度报告	证监会指定媒介	2021-01-21
4	金鹰基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证监会指定媒介	2021-02-08
5	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增玄元保险代理有限公司为代销机构并开通基金转换、基金定投业务及费率优惠的公告	证监会指定媒介	2021-03-08

6	金鹰基金管理有限公司旗下全部基金年度报告提示性公告	证监会指定媒介	2021-03-30
7	金鹰元安混合型证券投资基金 2020 年年度报告	证监会指定媒介	2021-03-30
8	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与天风证券费率优惠活动的公告	证监会指定媒介	2021-04-16
9	金鹰基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	证监会指定媒介	2021-04-21
10	金鹰元安混合型证券投资基金 2021 年一季度报告	证监会指定媒介	2021-04-21
11	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增国盛证券为代销机构并开通基金转换、基金定投业务及费率优惠的公告	证监会指定媒介	2021-04-28
12	金鹰基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证监会指定媒介	2021-05-11
13	金鹰基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证监会指定媒介	2021-05-14
14	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增中国人寿为代销机构并开通基金转换、基金定投业务及费率优惠的公告	证监会指定媒介	2021-05-19
15	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增意才基金为代销机构并开通基金转换、基金定投业务及费率优惠的公告	证监会指定媒介	2021-06-02
16	金鹰元安混合型证券投资基金托管协议更新	证监会指定媒介	2021-06-03
17	金鹰元安 A 基金产品资料概要更新	证监会指定媒介	2021-06-03
18	金鹰元安 C 基金产品资料概要更新	证监会指定媒介	2021-06-03
19	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金招募说明书更新提示性公告	证监会指定媒介	2021-06-03
20	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金修订基金合同、托管协议的公告	证监会指定媒介	2021-06-03
21	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金产品资料概要提示性公告	证监会指定媒介	2021-06-03
22	金鹰元安混合型证券投资基金招募说明书更新	证监会指定媒介	2021-06-03
23	金鹰元安混合型证券投资基金基金合同更新	证监会指定媒介	2021-06-03
24	金鹰基金管理有限公司关于终止苏州财路基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证监会指定媒介	2021-06-07
25	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增北京广源达信基金销售有限公司为代销机构并开通基金转换、基金定投业务及费率优惠的公告	证监会指定媒介	2021-06-10

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	2021年1月4日至2021年5月21日	103,181,845.84	0.00	20,000,000.00	83,181,845.84	17.59%
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媒介公开披露的基金份额净值、季度报告、年度报告、更新的招募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
二〇二一年八月二十八日