

金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金

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：中国民生银行股份有限公司

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。

基金托管人中国民生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	11
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	12
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	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
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	51

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	53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
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	53
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	54
10.1 基金份额持有人大会决议	54
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	54
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	55
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
10.9 其他重大事件	56
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	57
11.1 影响投资者决策的其他重要信息	57
§ 12 备查文件目录	57
12.1 备查文件目录	57
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	金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金	
基金简称	金鹰民安回报定开混合	
基金主代码	006972	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 8 月 29 日	
基金管理人	金鹰基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,256,693,371.77 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	金鹰民安回报定开 A	金鹰民安回报定开 C
下属分级基金的交易代码	006972	007735
报告期末下属分级基金的份额总额	1,133,293,711.14 份	123,399,660.63 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	<p>在封闭期内，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，根据各类资产的特点采取不同的研究分析方法，最大限度地提高基金资产的收益。</p> <p>在开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。</p>
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。

注：本基金合同生效日为 2019 年 8 月 29 日。

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	中国民生银行股份有限公司
信息披露	姓名	刘盛	罗菲菲
	联系电话	020-83936180	010-58560666

负责人	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	tgbfjdx@cmbc.com.cn
客户服务电话		4006135888	95568
传真		020-83282856	010-58560798
注册地址		广东省广州市南沙区滨海路 171号11楼自编1101之一J79	北京市西城区复兴门内大街2 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	北京市西城区复兴门内大街2 号
邮政编码		510623	100031
法定代表人		王铁	高迎欣

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
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	广州市天河区珠江东路 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）	
	金鹰民安回报定开 A	金鹰民安回报定开 C
本期已实现收益	122,235,913.06	12,974,967.72
本期利润	93,771,066.74	9,880,911.75
加权平均基金份额本期利润	0.0827	0.0801
本期加权平均净值利润率	6.97%	6.77%
本期基金份额净值增长率	7.09%	6.88%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	

	金鹰民安回报定开 A	金鹰民安回报定开 C
期末可供分配利润	258,206,711.85	27,441,932.21
期末可供分配基金份额利润	0.2278	0.2224
期末基金资产净值	1,415,598,159.73	153,459,024.69
期末基金份额净值	1.2491	1.2436
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
	金鹰民安回报定开 A	金鹰民安回报定开 C
基金份额累计净值增长率	43.10%	42.06%

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、所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；

4、期末可供分配利润，采用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

金鹰民安回报定开 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	0.52%	0.60%	-0.33%	0.17%	0.85%	0.43%
过去三个月	8.83%	0.65%	1.85%	0.20%	6.98%	0.45%
过去六个月	7.09%	0.82%	1.88%	0.28%	5.21%	0.54%
过去一年	26.99%	0.74%	7.10%	0.26%	19.89%	0.48%
自基金合同生效起至今	43.10%	0.70%	12.82%	0.25%	30.28%	0.45%

金鹰民安回报定开 C

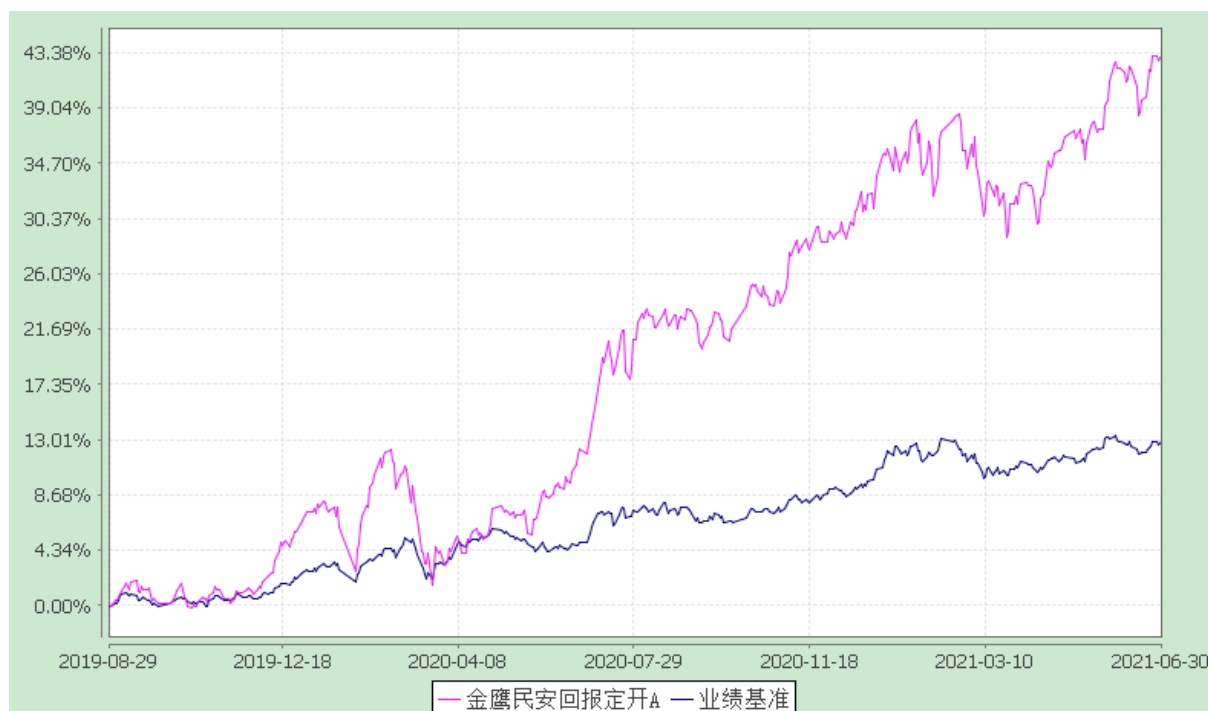
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.49%	0.60%	-0.33%	0.17%	0.82%	0.43%
过去三个月	8.72%	0.66%	1.85%	0.20%	6.87%	0.46%
过去六个月	6.88%	0.82%	1.88%	0.28%	5.00%	0.54%
过去一年	26.49%	0.74%	7.10%	0.26%	19.39%	0.48%
自基金合同生效起至今	42.06%	0.70%	12.82%	0.25%	29.24%	0.45%

3.2.2 自基金合同生效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

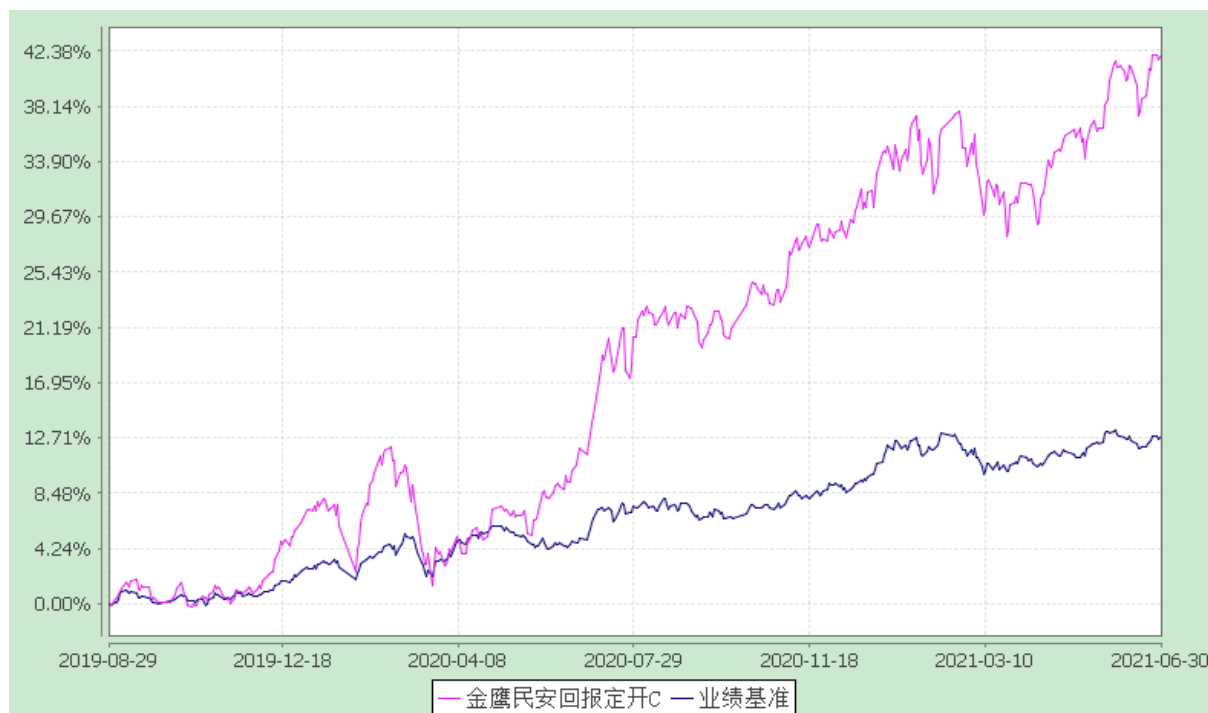
金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019 年 8 月 29 日至 2021 年 6 月 30 日)

金鹰民安回报定开 A



金鹰民安回报定开 C



- 注：1、本基金合同于 2019 年 8 月 29 日生效；
- 2、报告期末，本基金各项投资比例符合基金合同约定；
- 3、本基金业绩比较基准为：中债总财富（总值）指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*20%。

§ 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人资格。

“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	2019-08-29	-	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。
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、基金合同、基金招募说明书的规定，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 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。公司通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现。同时通过投资交易系统内的公平交易功能执行交易，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 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

我们在去年年报中提到，“2021 仍是冒险者的乐园”，这个论断正在疯狂上演。

我们不妨看一个局部统计，截止 7 月 27 日，偏股型基金今年以来收益率的均值在 4.7% 左右，但峰度 0.9 和偏度 4.2 几乎是历年之最。只有少部分基金获得了极高的收益，多数基金的投资收益并不理想。映射到基金投资者层面，这个问题同样现实。

去年我们还探讨过“买基”正确姿势，随着理财净值化和权益市场的持续高光，投资者在 2019、2020 年获得了不菲的投资回报，良好的理财习惯是好的，追求高收益率的惯性是不好的。我们在每一笔投资之前，我们都不妨试着去问几个问题：我们买基金的核心理由是什么？我们是否已充分了解这只基金的风格？是否读过这只基金的产品契约？我们追求的目标收益是多少，能承受的最大亏损是多少？

同样地，所谓“固收+”市场也正在接受资本市场和基金投资者的检验。

这几年“固收+”市场高速发展，以前少有人问津的二级债基、偏债混合重新进入大众的视野。这既得益于信用债市场快速分层后风险偏好的收缩，也得益于权益市场持续性的火热。很多基金“改头换面”，摇身一变，祭出“固收+”的招牌，我们需要高度注意的是，“固收+”投资真正的考验才刚刚开始，投资者同样需要去伪存真，科学地理解、识别、挑选、配置“固收+”基金。

在我们看来，可转债基金、二级债基、偏债混合基金只是单纯的产品类型，是实现“固收+”的载体之一。换句话说，其他类型甚至偏股型基金都可以成为实现绝对收益、实现“固收+”的载体。“固收+”应该是从产品设计、资产负债管理、投资策略设计、风险控制等环节构成的综合体，缺一不可。单就策略而言，也不仅仅局限于股债分仓，还涉及组合管理的方方面面。

从对“固收+”产品的产品评价而言，需要摒弃掉收益、回撤、排名等单一评价指标。而是要纳入更多的指标形成多维立体的评价体系。年化收益、年化波动、calmar 值、创新高次数、不同持有期获取收益的概率分布等等，都是评价基金产品不错的指标。创新高次数在我们看来，波动（回撤）不可怕，盈亏同源，我们需要去判断，预期波动是否与实际收益相匹配，是否与投资者的风险偏好吻合。简而言之，合理、科学地评价“固收+”基金，适合自己的才是最好的。

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 1.2491 元，本报告期份额净值增长率为 7.09%，同期业绩比较基准增长率为 1.88%；C 类基金份额净值为 1.2436 元，本报告期份额净值增长率 6.88%，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

总体而言，我们旗下的产品风格、定位都十分鲜明。随着我们团队的不断扩大，能力圈已得到快速地丰富。我们奉行的是基金经理研究负责制，对每一类策略、每一类资产都尽可能沉下去，不断反思、不断进步。可以说，我们每一只产品都凝聚着每一位团队成员的研究成果。失败时，多反思，成功时，多总结。尽可能让研究方法、投资策略变得可以复制。

展望下半年，我们的组合管理会偏重风险控制一些。宏观层面的滞胀风险、债券层面的信用风险、权益层面的风格再平衡、转债层面的估值收敛风险，都是我们关注的方向。

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，金鹰民安回报定开 A 类及 C 类份额均未进行利润分配。

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

本报告期无应预警说明事项。

§ 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，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、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：金鹰民安回报一年定期开放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	13,660,282.01	10,365,197.98
结算备付金		36,522,699.83	53,415,122.18
存出保证金		616,630.07	864,953.19
交易性金融资产	6.4.7.2	2,104,826,122.36	2,183,417,570.72
其中：股票投资		602,175,307.78	535,919,133.17
基金投资		-	-
债券投资		1,500,019,814.58	1,629,315,437.55
资产支持证券投资		2,631,000.00	18,183,000.00
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		2,003,997.69	142,446.61
应收利息	6.4.7.5	22,604,570.14	19,418,060.92
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,180,234,302.10	2,267,623,351.60
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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		603,000,000.00	795,000,000.00
应付证券清算款		4,994,096.29	4,326,209.73
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,275,943.04	1,210,432.07
应付托管费		191,391.45	181,564.82
应付销售服务费		49,924.24	47,445.92
应付交易费用	6.4.7.7	1,417,237.15	974,696.57
应交税费		22,101.19	23,949.27
应付利息		147,081.16	293,847.29
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	79,343.16	160,000.00
负债合计		611,177,117.68	802,218,145.67
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,256,693,371.77	1,256,693,371.77

未分配利润	6.4.7.10	312,363,812.65	208,711,834.16
所有者权益合计		1,569,057,184.42	1,465,405,205.93
负债和所有者权益总计		2,180,234,302.10	2,267,623,351.60

注：截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.2491 元，A 类基金份额总额为 1,133,293,711.14 份；C 类基金份额净值为 1.2436 元，C 类基金份额总额为 97,278,091.88 份；基金总份额合计为 123,399,660.63 份。

6.2 利润表

会计主体：金鹰民安回报一年定期开放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		126,981,121.79	45,942,804.52
1.利息收入		25,677,221.68	10,471,328.19
其中：存款利息收入	6.4.7.11	383,384.52	120,873.28
债券利息收入		25,033,053.96	9,209,293.08
资产支持证券利息收入		252,447.26	1,121,029.14
买入返售金融资产收入		8,335.94	20,132.69
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		132,862,802.40	39,235,027.80
其中：股票投资收益	6.4.7.12	115,564,772.88	33,355,638.67
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	12,516,825.82	4,763,206.80
资产支持证券投资收益	6.4.7.15	-	-80,315.07
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	4,781,203.70	1,196,497.40
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	-31,558,902.29	-3,763,551.47
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	-	-
减：二、费用		23,329,143.30	8,968,340.15
1. 管理人报酬		7,397,938.27	3,251,244.39
2. 托管费		1,109,690.72	487,686.59
3. 销售服务费		289,675.59	207,359.07
4. 交易费用	6.4.7.21	4,799,967.50	2,991,634.53

5. 利息支出		9,617,204.37	1,915,764.45
其中：卖出回购金融资产支出		9,617,204.37	1,915,764.45
6. 税金及附加		16,129.95	16,003.00
7. 其他费用		98,536.90	98,648.12
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		103,651,978.49	36,974,464.37
减：所得税费用	6.4.7.22	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		103,651,978.49	36,974,464.37

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金鹰民安回报一年定期开放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）	1,256,693,371.77	208,711,834.16	1,465,405,205.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	103,651,978.49	103,651,978.49
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）	0.00	0.00	0.00
其中：1.基金申购款	0.00	0.00	0.00
2.基金赎回款	0.00	0.00	0.00
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）	1,256,693,371.77	312,363,812.65	1,569,057,184.42
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）	608,897,718.34	39,933,158.48	648,830,876.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	36,974,464.37	36,974,464.37
三、本期基金份额交易产	0.00	0.00	0.00

生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	0.00	0.00	0.00
2.基金赎回款	0.00	0.00	0.00
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）	608,897,718.34	76,907,622.85	685,805,341.19

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

金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金(“本基金”)经中国证券监督管理委员会(“中国证监会”)证监许可[2019]1057号《关于准予金鹰添悦债券型证券投资基金变更注册的批复》核准，准予金鹰添悦债券型证券投资基金变更注册为金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金。由金鹰基金管理有限公司依照《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》等有关规定和《金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》(“基金合同”)发起，于2019年8月5日向社会公开发行募集并于2019年8月29日正式成立。本基金的基金管理人为金鹰基金管理有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，募集资金总额和利息合计为人民币608,897,718.34元，其中，A类基金为人民币511,619,626.46元，C类基金为人民币97,278,091.88元。

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（含中小板、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（含国债、地方政府债、金融债、公司债、企业债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

6.4.2 会计报表的编制基础

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财务报表一致。

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	13,660,282.01
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	13,660,282.01

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	565,530,613.78	602,175,307.78	36,644,694.00
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,216,159,248.87	1,203,976,964.58
	银行间市场	297,104,396.62	296,042,850.00
	合计	1,513,263,645.49	1,500,019,814.58
资产支持证券	2,628,000.00	2,631,000.00	3,000.00
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,081,422,259.27	2,104,826,122.36	23,403,863.09

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期内未投资金融衍生资产及负债。

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**

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

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	1,380.48
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	14,791.68
应收债券利息	22,587,510.60
应收资产支持证券利息	637.63
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	249.75
合计	22,604,570.14

6.4.7.6 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	1,417,107.40
银行间市场应付交易费用	129.75
合计	1,417,237.15

6.4.7.7 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	-
应付证券出借违约金	-
审计费用	19,835.79
预提信息披露费	59,507.37
合计	79,343.16

6.4.7.8 实收基金**金鹰民安回报定开 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	1,133,293,711.14	1,133,293,711.14
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,133,293,711.14	1,133,293,711.14

金鹰民安回报定开 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	123,399,660.63	123,399,660.63
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-

本期末	123,399,660.63	123,399,660.63
-----	----------------	----------------

6.4.7.9 未分配利润

金鹰民安回报定开 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	135,970,798.79	52,562,583.06	188,533,381.85
本期利润	122,235,913.06	-28,464,846.32	93,771,066.74
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	258,206,711.85	24,097,736.74	282,304,448.59

金鹰民安回报定开 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	14,466,964.49	5,711,487.82	20,178,452.31
本期利润	12,974,967.72	-3,094,055.97	9,880,911.75
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	27,441,932.21	2,617,431.85	30,059,364.06

6.4.7.10 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	22,305.84
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	355,065.70
其他	6,012.98
合计	383,384.52

6.4.7.11 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	1,745,742,098.49
减：卖出股票成本总额	1,630,177,325.61

买卖股票差价收入	115,564,772.88
----------	----------------

6.4.7.12 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）成交总额	880,334,728.08
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	857,684,459.69
减：应收利息总额	10,133,442.57
买卖债券差价收入	12,516,825.82

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	15,749,210.14
减：卖出资产支持证券成本总额	15,537,000.00
减：应收利息总额	212,210.14
资产支持证券投资收益	-

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内未投资衍生品工具。

6.4.7.15 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	4,781,203.70
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	4,781,203.70

6.4.7.16 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	-31,558,902.29
——股票投资	-29,808,637.98
——债券投资	-1,735,264.31

——资产支持证券投资	-15,000.00
——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	-31,558,902.29

6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.18 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	4,799,692.50
银行间市场交易费用	275.00
合计	4,799,967.50

6.4.7.19 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	-
汇划手续费	743.74
帐户维护费	17,850.00
其他项目	600.00
合计	98,536.90

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

截止本财务报表批准报出日，本基金无需用披露的重大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
中国民生银行股份有限公司	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**

本基金本报告期内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

本基金本报告期内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

本基金本报告期内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

本基金本报告期内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

1、本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行任何交易，无应支付关联方交易佣金。

2、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除中国证券登记结算公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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	7,397,938.27	3,251,244.39
其中：支付销售机构的客户维护费	3,659,114.74	1,787,228.56

注：基金管理费按前一日基金资产净值 1.00% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

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，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的托管费	1,109,690.72	487,686.59

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 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		
	金鹰民安回报定开A	金鹰民安回报定开C	合计
民生银行股份有限公司	-	173,947.24	173,947.24
金鹰基金管理有限公司	-	1.22	1.22
合计	-	173,948.46	173,948.46
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		
	金鹰民安回报定开A	金鹰民安回报定开C	合计
金鹰基金管理有限公司	-	1.38	1.38
民生银行股份有限公司	-	205,935.28	205,935.28

合计	-	205,936.66	205,936.66
----	---	------------	------------

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费。本基金销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提，销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记结算机构，由登记结算机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

本基金本报告期内无应支付关联方的销售服务费。

6.4.10.3 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.3.1 报告期内基金管理人运用固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固有资金投资本基金。

6.4.10.3.2 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

金鹰民安回报定开 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。

金鹰民安回报定开 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。

6.4.10.4 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
中国民生银行股份有限公司	13,660,282.01	22,305.84	14,356,005.24	22,578.36

注：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；2021 年 6 月 30 日清算备付金期末余额 36,522,699.83 元，清算备付金利息收入 355,065.7 元。

6.4.10.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.6 其他关联交易事项的说明

6.4.10.6.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.10.6.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

本基金本报告期内未投资基金。

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
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
688269	凯立新材	2021-06-01	2021-12-09	网下配售锁定	18.94	100.92	1,941.00	36,762.54	195,885.72	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	601.00	29,202.59	54,324.39	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	925.00	30,728.50	80,937.50	网下配售锁定
688661	和林微纳	2021-03-19	2021-09-29	网下配售锁定	17.71	84.01	1,452.00	25,714.92	121,982.52	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
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
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	网下配售锁定	8.41	39.13	219.00	1,841.79	8,569.47	网下配售锁定
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	网下配售锁定	7.64	38.83	462.00	3,529.68	17,939.46	网下配售锁定
688328	深科达	2021-03-01	2021-09-09	网下配售锁定	16.49	37.79	1,499.00	24,718.51	56,647.21	网下配售锁定
301011	华立科技	2021-06-09	2021-12-17	网下配售锁定	14.20	33.84	175.00	2,485.00	5,922.00	网下配售锁定
688669	聚石化学	2021-01-15	2021-07-26	网下配售锁定	36.65	32.39	2,681.00	98,258.65	86,837.59	网下配售锁定
300932	三友联众	2021-01-15	2021-07-22	网下配售锁定	24.69	31.71	492.00	12,147.48	15,601.32	网下配售锁定
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	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
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	网下配售锁定	8.24	31.54	286.00	2,356.64	9,020.44	网下配售锁定
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	网下配售锁定	14.79	30.57	264.00	3,904.56	8,070.48	网下配售锁定
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	网下配售锁定	13.39	30.10	217.00	2,905.63	6,531.70	网下配售锁定
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-20	网下配售锁定	13.87	29.55	183.00	2,538.21	5,407.65	网下配售锁定
300971	博亚精工	2021-04-07	2021-10-15	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	可靠	2021-0	2021-1	网下	12.54	27.89	801.00	10,044	22,339	网下

9	股份	6-08	2-17	配售 锁定				.54	.89	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
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	N 英科	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
30099 8	宁波 方正	2021-0 5-25	2021-1 2-02	网下 配售 锁定	6.02	21.32	201.00	1,210. 02	4,285. 32	网下 配售 锁定
30099 2	泰福 泵业	2021-0 5-17	2021-1 1-25	网下 配售 锁定	9.36	20.32	200.00	1,872. 00	4,064. 00	网下 配售 锁定
68868 5	迈信 林	2021-0 4-30	2021-1 1-15	网下 配售	9.02	19.50	2,612. 00	23,560 .24	50,934 .00	网下 配售

				锁定						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
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
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
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
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
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	网下配售锁定	4.54	11.54	507.00	2,301.78	5,850.78	网下配售锁定
301020	C 密封	2021-06-28	2021-07-06	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
301020	C 密封	2021-06-28	2022-01-06	网下配售锁定	10.64	10.64	421.00	4,479.44	4,479.44	网下配售锁定
300933	中辰股份	2021-01-15	2021-07-22	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
301021	C 英诺	2021-06-28	2021-07-06	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
301021	C 英诺	2021-06-28	2022-01-06	网下配售	9.46	9.46	290.00	2,743.40	2,743.40	网下配售

				锁定						锁定
301017	C 漱玉	2021-06-23	2021-07-05	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
301017	C 漱玉	2021-06-23	2022-01-05	网下配售锁定	8.86	8.86	555.00	4,917.30	4,917.30	网下配售锁定
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	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
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	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
113050	南银转债	2021-06-17	2021-07-01	网下新债申购	100.00	100.00	4,510.00	451.00	451.00	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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601015	陕西黑猫	2021-06-30	重大事项停牌	8.95	2021-07-08	-	1,693,000.00	16,111,843.90	15,152,350.00	重大事项

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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购。

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、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	100,000,000.00	110,027,000.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	49,990,000.00
合计	100,000,000.00	160,017,000.00

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	1,172,174,916.38	1,293,174,816.00
AAA 以下	227,844,898.20	176,123,621.55
未评级	0.00	0.00
合计	1,400,019,814.58	1,469,298,437.55

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	2,631,000.00	18,183,000.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	2,631,000.00	18,183,000.00

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	13,660,282.01	-	-	-	-	-	-	-	-	13,660,282.01
结算备付金	36,522,699.83	-	-	-	-	-	-	-	-	36,522,699.83
存出保证金	616,630.07	-	-	-	-	-	-	-	-	616,630.07
交易性金融资产	244,188,000.00	-	-	-	-	925,374,210.00	167,952,737.88	165,135,866.70	602,175,307.78	2,104,826,122.36
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	2,003,997.69	2,003,997.69
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	22,604,570.14	22,604,570.14
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	294,987,611.91	-	-	-	-	925,374,210.00	167,952,737.88	165,135,866.70	626,783,875.61	2,180,234,302.10

负债											
短期借款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融 负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金 融资产款	603,000 ,000.00	-	-	-	-	-	-	-	-	-	603,000 ,000.00
应付证券清 算款	-	-	-	-	-	-	-	-	4,994,096 .29	4,994,0 96.29	
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人 报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	1,275,943 .04	1,275,9 43.04	
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	191,391.4 5	191,391 .45	
应付销售服 务费	-	-	-	-	-	-	-	-	49,924.24	49,924. 24	
应付交易费 用	-	-	-	-	-	-	-	-	1,417,237 .15	1,417,2 37.15	
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	-	22,101.19	22,101. 19	
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-	147,081.1 6	147,081 .16	
应付利润	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	79,343.16	79,343. 16	
负债总计	603,000 ,000.00	-	-	-	-	-	-	-	8,177,117. 68	611,177 ,117.68	
利率敏感 度缺口	-308,01 2,388.0 9	-	-	-	-	925,374,2 10.00	167,952 ,737.88	165,135,8 66.70	618,606,7 57.93	1,569,0 57,184. 42	
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	10,365, 197.98	-	-	-	-	-	-	-	-	-	10,365, 197.98
结算备付金	53,415, 122.18	-	-	-	-	-	-	-	-	-	53,415, 122.18
存出保证金	864,953 .19	-	-	-	-	-	-	-	-	-	864,953 .19
交易性金融 资产	30,081, 000.00	-	-	-	-	1,090,087 ,300.00	360,420 ,301.50	166,909,8 36.05	535,919,1 33.17	2,183,4 17,570.	

										72
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	142,446.61	142,446.61
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	19,418,060.92	19,418,060.92
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	94,726,273.35	-	-	-	-	1,090,087,300.00	360,420,301.50	166,909,836.05	555,479,640.70	2,267,623,351.60
负债										
短期借款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	795,000,000.00	-	-	-	-	-	-	-	-	795,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	4,326,209.73	4,326,209.73
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	1,210,432.07	1,210,432.07
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	181,564.82	181,564.82
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-	-	47,445.92	47,445.92
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	974,696.57	974,696.57
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	-	23,949.27	23,949.27
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-	293,847.29	293,847.29
应付利润	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	160,000.00	160,000.00
负债总计	795,000,000.00	-	-	-	-	-	-	-	7,218,145.67	802,218,145.67
利率敏感度缺口	-700,273,726.65	-	-	-	-	1,090,087,300.00	360,420,301.50	166,909,836.05	548,261,495.03	1,465,405,205.93

--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--

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	-1,501,532.15	-3,028,085.96
	利率下降 25 个基点	1,515,264.21	3,057,075.45

6.4.13.4.2 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 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	602,175,307.78	38.38	535,919,133.17	36.57
交易性金融资产—债券投资	284,685,664.58	18.14	162,245,737.55	11.07
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	886,860,972.36	56.52	698,164,870.72	47.64

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

金鹰民安回报定开 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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	业绩比较基准变动+5%	161,599,589.25	142,151,748.31
	业绩比较基准变动-5%	-161,599,589.25	-142,151,748.31

金鹰民安回报定开 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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	业绩比较基准变动+5%	17,515,238.79	15,448,437.83
	业绩比较基准变动-5%	-17,515,238.79	-15,448,437.83

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 求和项:市值 886,648,699.29 元，第二层级的余额为 1,218,177,423.07 元，无第三层级的金融工具。

(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	602,175,307.78	27.62
	其中：股票	602,175,307.78	27.62
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,502,650,814.58	68.92
	其中：债券	1,500,019,814.58	68.80
	资产支持证券	2,631,000.00	0.12
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计	50,182,981.84	2.30
8	其他各项资产	25,225,197.90	1.16
9	合计	2,180,234,302.10	100.00

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	50,460,231.20	3.22
C	制造业	440,945,791.25	28.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	108,377.93	0.01
E	建筑业	61,656.03	0.00

F	批发和零售业	3,032,374.86	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	39,570.63	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,797,546.93	0.94
J	金融业	59,305,277.40	3.78
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	24,073,464.36	1.53
M	科学研究和技术服务业	9,069,986.66	0.58
N	水利、环境和公共设施管理业	214,637.11	0.01
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	33,685.84	0.00
S	综合	-	-
	合计	602,175,307.78	38.38

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	688005	容百科技	275,535	33,394,842.00	2.13
2	002466	天齐锂业	458,000	28,405,160.00	1.81
3	300014	亿纬锂能	266,000	27,645,380.00	1.76
4	000725	京东方 A	4,050,000	25,272,000.00	1.61
5	601888	中国中免	80,000	24,008,000.00	1.53
6	002080	中材科技	909,919	23,812,580.23	1.52
7	688599	天合光能	833,094	23,618,214.90	1.51
8	601166	兴业银行	1,120,000	23,016,000.00	1.47
9	002206	海利得	3,523,025	21,877,985.25	1.39
10	002709	天赐材料	200,000	21,316,000.00	1.36
11	000933	神火股份	2,000,000	18,900,000.00	1.20
12	600188	兖州煤业	1,200,000	18,432,000.00	1.17
13	002110	三钢闽光	2,650,000	17,861,000.00	1.14
14	601066	中信建投	550,000	17,286,500.00	1.10
15	000902	新洋丰	1,070,000	16,724,100.00	1.07
16	300037	新宙邦	152,000	15,215,200.00	0.97
17	601015	陕西黑猫	1,693,000	15,152,350.00	0.97

18	603218	日月股份	500,000	13,540,000.00	0.86
19	300253	卫宁健康	800,000	13,016,000.00	0.83
20	600166	福田汽车	3,500,000	12,075,000.00	0.77
21	000807	云铝股份	1,000,000	11,900,000.00	0.76
22	300769	德方纳米	55,960	11,566,372.40	0.74
23	600873	梅花生物	2,000,000	11,200,000.00	0.71
24	002812	恩捷股份	47,750	11,178,275.00	0.71
25	601168	西部矿业	880,000	10,498,400.00	0.67
26	300772	运达股份	545,000	9,924,450.00	0.63
27	601377	兴业证券	1,000,000	9,660,000.00	0.62
28	000100	TCL 科技	1,200,000	9,180,000.00	0.59
29	601658	邮储银行	1,800,000	9,036,000.00	0.58
30	300012	华测检测	280,000	8,926,400.00	0.57
31	002050	三花智控	349,988	8,392,712.24	0.53
32	600123	兰花科创	1,000,000	7,740,000.00	0.49
33	600348	华阳股份	1,000,000	7,420,000.00	0.47
34	000932	华菱钢铁	1,100,000	7,260,000.00	0.46
35	600409	三友化工	700,000	7,077,000.00	0.45
36	000923	河钢资源	330,000	6,293,100.00	0.40
37	603185	上机数控	30,000	5,368,500.00	0.34
38	000683	远兴能源	1,100,000	5,137,000.00	0.33
39	300890	翔丰华	86,283	4,711,051.80	0.30
40	000822	山东海化	600,000	4,680,000.00	0.30
41	000422	湖北宜化	500,000	4,380,000.00	0.28
42	600546	山煤国际	400,000	2,872,000.00	0.18
43	300035	中科电气	100,800	2,464,560.00	0.16
44	002850	科达利	20,000	1,748,000.00	0.11
45	688050	爱博医疗	3,520	1,329,785.60	0.08
46	688256	寒武纪	6,894	952,750.80	0.06
47	688680	海优新材	2,795	718,315.00	0.05
48	688027	国盾量子	2,830	613,968.50	0.04
49	300999	金龙鱼	7,177	609,757.92	0.04
50	300896	爱美客	648	511,194.24	0.03
51	688586	江航装备	16,436	458,235.68	0.03
52	688508	芯朋微	3,729	412,576.56	0.03
53	688051	佳华科技	4,053	301,137.90	0.02
54	688665	四方光电	1,687	229,685.05	0.01
55	688269	凯立新材	1,941	195,885.72	0.01
56	688677	海泰新光	1,768	193,596.00	0.01
57	688345	博力威	2,332	171,518.60	0.01
58	688338	赛科希德	3,041	169,018.78	0.01
59	688700	东威科技	3,049	162,755.62	0.01
60	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.01
61	688216	气派科技	2,000	133,400.00	0.01

62	688667	菱电电控	1,191	131,021.91	0.01
63	600906	财达证券	7,597	128,237.36	0.01
64	688377	迪威尔	7,894	128,040.68	0.01
65	688661	和林微纳	1,452	121,982.52	0.01
66	688314	康拓医疗	1,085	114,619.40	0.01
67	688639	华恒生物	2,302	110,472.98	0.01
68	003035	南网能源	11,046	109,797.24	0.01
69	688329	艾隆科技	1,846	100,902.36	0.01
70	300922	天秦装备	2,863	99,718.29	0.01
71	688678	福立旺	4,198	99,492.60	0.01
72	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01
73	688698	伟创电气	4,751	94,972.49	0.01
74	601568	北元集团	11,007	94,219.92	0.01
75	688456	有研粉材	3,396	93,729.60	0.01
76	688628	优利德	2,789	93,292.05	0.01
77	688607	康众医疗	1,890	87,507.00	0.01
78	688669	聚石化学	2,681	86,837.59	0.01
79	688217	睿昂基因	1,040	86,736.00	0.01
80	300920	润阳科技	2,503	84,301.04	0.01
81	300948	冠中生态	2,905	83,983.55	0.01
82	601963	重庆银行	7,472	81,220.64	0.01
83	300979	华利集团	925	80,937.50	0.01
84	605117	德业股份	627	80,005.20	0.01
85	688309	恒誉环保	2,880	79,833.60	0.01
86	001203	大中矿业	3,808	76,731.20	0.00
87	300861	美畅股份	889	74,951.59	0.00
88	688571	杭华股份	8,200	73,882.00	0.00
89	688611	杭州柯林	1,400	68,726.00	0.00
90	601665	齐鲁银行	6,731	62,598.30	0.00
91	300869	康泰医学	862	61,046.84	0.00
92	603529	爱玛科技	1,019	59,224.28	0.00
93	688195	腾景科技	2,693	58,626.61	0.00
94	688328	深科达	1,499	56,647.21	0.00
95	301007	德迈仕	2,719	55,929.83	0.00
96	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
97	688087	N 英科	2,469	54,219.24	0.00
98	300995	奇德新材	1,718	52,914.40	0.00
99	600916	中国黄金	3,371	52,317.92	0.00
100	688685	迈信林	2,612	50,934.00	0.00
101	601156	东航物流	2,090	49,470.30	0.00
102	301017	C 漱玉	5,550	49,173.00	0.00
103	688618	三旺通信	1,117	47,718.24	0.00
104	605337	李子园	788	46,886.00	0.00
105	301020	C 密封	4,210	44,794.40	0.00

106	688395	正弦电气	1,627	44,465.91	0.00
107	688565	力源科技	2,464	44,376.64	0.00
108	003039	顺控发展	1,024	42,813.44	0.00
109	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
110	003021	兆威机电	680	41,534.40	0.00
111	688679	通源环境	3,139	41,372.02	0.00
112	688067	爱威科技	1,259	39,520.01	0.00
113	688092	爱科科技	1,137	39,283.35	0.00
114	003012	东鹏控股	2,278	37,905.92	0.00
115	605339	南侨食品	863	37,264.34	0.00
116	688367	工大高科	1,717	37,035.69	0.00
117	003009	中天火箭	623	36,183.84	0.00
118	300871	回盛生物	927	36,153.00	0.00
119	605090	九丰能源	1,090	35,326.90	0.00
120	688681	科汇股份	1,899	34,903.62	0.00
121	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
122	300887	谱尼测试	378	33,789.42	0.00
123	300860	锋尚文化	578	33,685.84	0.00
124	300900	广联航空	879	32,857.02	0.00
125	605338	巴比食品	1,012	32,717.96	0.00
126	300872	天阳科技	871	31,617.30	0.00
127	301021	C 英诺	2,899	27,424.54	0.00
128	003016	欣贺股份	1,681	26,912.81	0.00
129	605296	神农集团	569	26,856.80	0.00
130	603324	盛剑环境	732	26,630.16	0.00
131	605268	王力安防	1,642	22,659.60	0.00
132	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
133	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
134	300911	亿田智能	309	21,407.52	0.00
135	300877	金春股份	569	20,922.13	0.00
136	601279	英利汽车	2,004	20,901.72	0.00
137	300873	海晨股份	484	20,720.04	0.00
138	001206	依依股份	321	20,389.92	0.00
139	300884	狄耐克	748	20,106.24	0.00
140	300891	惠云钛业	1,143	19,876.77	0.00
141	001205	盛航股份	577	18,850.59	0.00
142	605122	四方新材	703	18,770.10	0.00
143	603511	爱慕股份	553	18,249.00	0.00
144	300868	杰美特	593	18,151.73	0.00
145	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
146	605208	永茂泰	801	17,485.83	0.00
147	300864	南大环境	315	17,328.15	0.00
148	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
149	605368	蓝天燃气	1,204	17,217.20	0.00

150	003029	吉大正元	716	17,069.44	0.00
151	003037	三和管桩	1,274	16,765.84	0.00
152	300909	汇创达	386	16,636.60	0.00
153	603836	海程邦达	733	15,994.06	0.00
154	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
155	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
156	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
157	605016	百龙创园	445	14,222.20	0.00
158	003001	中岩大地	560	14,112.00	0.00
159	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
160	605060	联德股份	883	13,933.74	0.00
161	002998	优彩资源	1,353	13,719.42	0.00
162	605319	无锡振华	764	13,706.16	0.00
163	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
164	003030	祖名股份	480	13,516.80	0.00
165	605500	森林包装	762	13,464.54	0.00
166	605133	嵘泰股份	618	13,398.24	0.00
167	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
168	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
169	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
170	605058	澳弘电子	548	12,899.92	0.00
171	003025	思进智能	425	12,898.75	0.00
172	300892	品渥食品	272	12,479.36	0.00
173	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
174	605286	同力日升	597	12,208.65	0.00
175	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
176	003042	中农联合	420	11,839.80	0.00
177	300889	爱克股份	479	11,639.70	0.00
178	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
179	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
180	300876	蒙泰高新	350	11,567.50	0.00
181	300895	铜牛信息	339	11,529.39	0.00
182	605228	神通科技	1,217	11,464.14	0.00
183	003002	壶化股份	921	11,365.14	0.00
184	603408	建霖家居	762	11,292.84	0.00
185	300879	大叶股份	466	11,267.88	0.00
186	605303	园林股份	610	11,242.30	0.00
187	605488	福莱新材	416	11,103.04	0.00
188	605018	长华股份	840	11,096.40	0.00
189	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
190	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
191	605289	罗曼股份	379	10,930.36	0.00
192	605055	迎丰股份	1,146	10,909.92	0.00
193	605259	绿田机械	295	10,516.75	0.00

194	003038	鑫铂股份	383	10,463.56	0.00
195	605005	合兴股份	634	10,321.52	0.00
196	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
197	605189	富春染织	422	10,165.98	0.00
198	603112	华翔股份	920	10,018.80	0.00
199	300882	万胜智能	572	9,981.40	0.00
200	003041	真爱美家	349	9,876.70	0.00
201	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
202	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
203	300893	松原股份	414	9,240.48	0.00
204	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
205	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
206	300881	盛德鑫泰	291	8,959.89	0.00
207	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
208	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
209	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
210	003004	声迅股份	306	8,613.90	0.00
211	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
212	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
213	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
214	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
215	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
216	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
217	605298	必得科技	391	7,847.37	0.00
218	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
219	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
220	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
221	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
222	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
223	300886	华业香料	191	6,194.13	0.00
224	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
225	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
226	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
227	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
228	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
229	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
230	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
231	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
232	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
233	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
234	002773	康弘药业	135	3,122.55	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	688005	容百科技	93,073,012.23	6.35
2	002206	海利得	49,817,962.67	3.40
3	000807	云铝股份	44,139,610.92	3.01
4	603348	文灿股份	42,428,064.35	2.90
5	000783	长江证券	41,487,032.32	2.83
6	000933	神火股份	38,780,386.90	2.65
7	601899	紫金矿业	38,228,068.43	2.61
8	603799	华友钴业	37,453,146.44	2.56
9	300059	东方财富	35,574,243.80	2.43
10	002466	天齐锂业	34,864,846.57	2.38
11	601166	兴业银行	33,644,951.00	2.30
12	002709	天赐材料	33,376,551.62	2.28
13	300014	亿纬锂能	32,029,416.61	2.19
14	601888	中国中免	31,148,810.00	2.13
15	601168	西部矿业	30,790,487.00	2.10
16	600166	福田汽车	28,410,180.00	1.94
17	601658	邮储银行	28,232,267.67	1.93
18	600497	驰宏锌锗	28,087,567.10	1.92
19	000703	恒逸石化	26,686,945.27	1.82
20	002759	天际股份	26,636,272.00	1.82

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	688005	容百科技	95,505,030.15	6.52
2	600966	博汇纸业	78,198,761.63	5.34
3	603799	华友钴业	58,003,244.03	3.96
4	603348	文灿股份	49,085,167.30	3.35
5	601318	中国平安	49,001,301.20	3.34
6	002850	科达利	41,353,906.89	2.82
7	601899	紫金矿业	40,439,947.69	2.76
8	000783	长江证券	39,653,044.42	2.71
9	000807	云铝股份	39,631,213.15	2.70
10	300059	东方财富	38,821,923.56	2.65

11	601916	浙商银行	34,256,948.12	2.34
12	002709	天赐材料	34,084,373.50	2.33
13	300035	中科电气	33,709,788.00	2.30
14	600497	驰宏锌锗	32,754,631.00	2.24
15	000703	恒逸石化	32,403,723.57	2.21
16	002064	华峰化学	31,982,569.72	2.18
17	002206	海利得	31,360,345.02	2.14
18	601966	玲珑轮胎	28,649,785.49	1.96
19	000636	风华高科	28,252,729.97	1.93
20	600036	招商银行	27,873,759.26	1.90

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	1,726,242,138.20
卖出股票收入（成交）总额	1,745,742,098.49

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,002,121,300.00	63.87
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	143,952,000.00	9.17
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	69,260,850.00	4.41
7	可转债（可交换债）	284,685,664.58	18.14
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,500,019,814.58	95.60

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	112901	19 申证 05	1,000,000.00	100,860,000.00	6.43
2	163812	20 信投 S2	1,000,000.00	100,000,000.00	6.37
3	136554	16 中金 01	700,000.00	70,021,000.00	4.46
4	143795	18 华福 G1	640,000.00	64,204,800.00	4.09
5	136656	14 银河 G4	630,000.00	63,031,500.00	4.02

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	169317	恒信 31A1	300,000.00	2,631,000.00	0.17

注：本基金本报告期末仅持有一只资产支持证券。

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于股指期货。

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

本基金本报告期内未投资于国债期货。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

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之一的兴业银行股份有限公司为无证机构提供转接清算服务等未依法履行其他职责等行为，于 2020 年 9 月 11 日被中国人民银行福州中心支行公开处罚、公开批评，给予警告、没收违法所得 10,875,088.15 元，并处 13,824,431.23 元罚款；因同业投资用途不合规等未依法履行其他职责等行为，于 2020 年 9 月 4 日被中国银行保险监督管理委员会福建监管局公开处罚，没收违法所得 6,361,807.97 元、并合计处以罚款 15,961,807.97 元。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

7.13.2 报告期内基金投资的前十名股票没有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	616,630.07
2	应收证券清算款	2,003,997.69
3	应收股利	-
4	应收利息	22,604,570.14
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,225,197.90

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110053	苏银转债	10,922,400.00	0.70
2	110061	川投转债	116,581.10	0.01
3	113009	广汽转债	41,493,060.00	2.64
4	113011	光大转债	8,826,844.60	0.56
5	113013	国君转债	4,173,970.00	0.27
6	113563	柳药转债	37,558,379.80	2.39
7	113615	金诚转债	37,247,328.00	2.37
8	123067	斯莱转债	382,702.50	0.02
9	123079	运达转债	17,884,319.20	1.14
10	127005	长证转债	58,962,653.28	3.76
11	127022	恒逸转债	55,843,054.40	3.56
12	128048	张行转债	1,757,984.00	0.11
13	128071	合兴转债	5,382,031.60	0.34
14	128100	搜特转债	65,893.50	0.00

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无流通受限情况。

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
金鹰民安回报定开 A	5,032	225,217.35	0.00	0.00%	1,133,293,711.14	100.00%
金鹰民安回报定开 C	736	167,662.58	0.00	0.00%	123,399,660.63	100.00%

合计	5,768	217,873.33	0.00	0.00%	1,256,693,371.77	100.00%
----	-------	------------	------	-------	------------------	---------

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	金鹰民安回报定开 A	27,882.08	0.00%
	金鹰民安回报定开 C	0.00	0.00%
	合计	27,882.08	0.00%

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	金鹰民安回报定开 A	0
	金鹰民安回报定开 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	金鹰民安回报定开 A	0
	金鹰民安回报定开 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	金鹰民安回报定开 A	金鹰民安回报定开 C
基金合同生效日（2019 年 8 月 29 日）基金份额总额	511,619,626.46	97,278,091.88
本报告期期初基金份额总额	1,133,293,711.14	123,399,660.63
本报告期基金总申购份额	0.00	0.00
减：本报告期基金总赎回份额	0.00	0.00
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期末基金份额总额	1,133,293,711.14	123,399,660.63
-------------	------------------	----------------

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开基金份额持有人大会。

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无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金报告期内无涉及基金管理人、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	
长江证券	2	1,251,052,619.63	36.41%	889,870.69	33.16%	-
太平洋证券	2	1,196,175,264.70	34.81%	1,090,077.00	40.62%	-
东兴证券	2	841,374,083.20	24.49%	598,464.85	22.30%	-
东吴证券	1	147,459,716.69	4.29%	104,887.65	3.91%	-
民生证券	2	-	-	-	-	-

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
长江证券	386,839,874.48	31.14%	14,800,000.00	31.61%	-	-
太平洋证券	441,895,306.20	35.57%	20,407,787,000.00	43.59%	-	-
东兴证券	369,618,211.11	29.75%	9,286,000,000.00	19.83%	-	-
东吴证券	23,990,577.50	1.93%	2,323,000,000.00	4.96%	-	-
民生证券	20,000,000.00	1.61%	-	-	-	-

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	证监会规定媒介	2021-01-11
2	金鹰基金管理有限公司关于董事变更的公告	证监会规定媒介	2021-01-14
3	金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金 2020 年四季度报告	证监会规定媒介	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	证监会规定媒介	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	证监会规定媒介	2021-03-08
6	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增大有期货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	证监会规定媒介	2021-03-18
7	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	证监会规定媒介	2021-03-30
8	金鹰民安回报一年定期开放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
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	金鹰民安回报一年定期开放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	金鹰民安回报一年定开 A 基金产品资料概要更新	证监会指定媒介	2021-06-03
16	金鹰民安回报一年定开 C 基金产品资料概要更新	证监会指定媒介	2021-06-03
17	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
18	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

19	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
20	金鹰民安回报一年定期开放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
21	金鹰民安回报一年定期开放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
22	金鹰民安回报一年定期开放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
23	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增中邮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	2021-06-07
24	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
25	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	2021-06-25

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 影响投资者决策的其他重要信息

无影响投资者决策的其它重大信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准基金发行及募集的文件。
- 2、《金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、《金鹰民安回报一年定期开放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上公开披露的基金份额净值、季度报告、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