

# 金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金

## 金

### 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 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：二〇二二年三月三十日

## § 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。本年度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 2022 年 3 月 29 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。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
<b>§2 基金简介</b>	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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	12
<b>§4 管理人报告</b>	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	16
4.10 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	16
<b>§5 托管人报告</b>	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
<b>§6 审计报告</b>	17
6.1 审计意见	17
6.2 形成审计意见的基础	18
6.3 其他信息	18
6.4 管理层对财务报表的责任	18
6.5 注册会计师的责任	18
<b>§7 年度财务报表</b>	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	23
7.4 报表附注	24
<b>§8 投资组合报告</b>	62
8.1 期末基金资产组合情况	62
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	63
8.3 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	64

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	72
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	75
8.6 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 .....	75
8.7 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 .....	76
8.8 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 .....	76
8.9 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 .....	76
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	76
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	76
8.12 本报告期投资基金情况 .....	77
8.13 投资组合报告附注 .....	77
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>78</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	78
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	79
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	79
9.4 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情况 .....	79
9.5 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	79
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>80</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>80</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	80
11.2 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 .....	80
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	80
11.4 基金投资策略的改变 .....	81
11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	81
11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	81
11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	81
11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	81
11.9 其他重大事件 .....	82
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>85</b>
12.1 影响投资者决策的其他重要信息 .....	85
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>85</b>
13.1 备查文件目录 .....	85
13.2 存放地点 .....	86
13.3 查阅方式 .....	86

## § 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	2,874,917,333.04 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	2,605,379,902.96 份	269,537,430.08 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。

**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 负责人	姓名	凡湘平	罗菲菲
	联系电话	020-83936180	010-58560666
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	tgxxpl@cmbc.com.cn
客户服务电话		4006135888	95568
传真		020-83282856	010-57093382
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		姚文强	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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.gefund.com.cn">http://www.gefund.com.cn</a>
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京东长安街1号东方广场毕马威大楼8层
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、基金净值表现及利润分配情况

## 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	2021 年		2020 年		2019 年 8 月 29 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日	
	金鹰民安回报定开 A	金鹰民安回报定开 C	金鹰民安回报定开 A	金鹰民安回报定开 C	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	281,809,024.88	29,732,997.44	162,187,475.22	24,568,397.30	17,274,538.89	3,147,136.25
本期利润	249,324,309.35	26,277,657.24	194,825,786.76	27,381,367.80	33,671,640.45	6,261,518.03
加权平均基金份额本期利润	0.1613	0.1601	0.2773	0.2627	0.0658	0.0644
本期加权平均净值利润率	13.45%	13.41%	25.18%	23.92%	6.48%	6.34%
本期基金份额净值增长率	18.88%	18.41%	25.38%	24.87%	6.58%	6.44%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
	金鹰民安回报定开 A	金鹰民安回报定开 C	金鹰民安回报定开 A	金鹰民安回报定开 C	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	402,940,029.93	39,372,190.98	135,970,798.79	14,466,964.49	17,274,538.89	3,147,136.25
期末可供分配基金份额利润	0.1547	0.1461	0.1200	0.1172	0.0338	0.0324
期末基金资产净值	3,060,900,938.33	314,343,307.15	1,321,827,092.99	143,578,112.94	545,291,266.91	103,539,609.91
期末基金份额净值	1.1748	1.1662	1.1664	1.1635	1.0658	1.0644
3.1.3 累计	2021 年末		2020 年末		2019 年末	

期末指标	金鹰民安回 报定开 A	金鹰民安回 报定开 C	金鹰民安回 报定开 A	金鹰民安回 报定开 C	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	58.85%	57.38%	33.63%	32.91%	6.58%	6.44%

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
过去三个月	1.08%	0.51%	1.52%	0.16%	-0.44%	0.35%
过去六个月	11.01%	0.57%	1.78%	0.21%	9.23%	0.36%
过去一年	18.88%	0.70%	3.69%	0.25%	15.19%	0.45%
自基金合同生 效起至今	58.85%	0.67%	14.83%	0.24%	44.02%	0.43%

注：1、本基金合同生效日期为 2019 年 8 月 29 日。

2、本基金的投资范围是：具有良好流动性的金融工具，包括国债、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债、中小企业私募债、可分离交易可转债的纯债部分、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不投资于股票、权证等资产，也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部除外)、可交换债券。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

3、本基金的业绩比较基准是：中债总财富指数收益率\*80%+沪深 300 指数收益率\*20%。

##### 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
过去三个月	0.97%	0.51%	1.52%	0.16%	-0.55%	0.35%
过去六个月	10.78%	0.57%	1.78%	0.21%	9.00%	0.36%
过去一年	18.41%	0.70%	3.69%	0.25%	14.72%	0.45%
自基金合同生效起至今	57.38%	0.67%	14.83%	0.24%	42.55%	0.43%

注：1、本基金合同生效日期为 2019 年 8 月 29 日。

2、本基金的投资范围是：具有良好流动性的金融工具，包括国债、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债、中小企业私募债、可分离交易可转债的纯债部分、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不投资于股票、权证等资产，也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部除外)、可交换债券。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

3、本基金的业绩比较基准是：中债总财富指数收益率\*80%+沪深 300 指数收益率\*20%。

### 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 12 月 31 日)

金鹰民安回报定开 A



注：（1）本基金合同生效日期为 2019 年 8 月 29 日；

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

### 金鹰民安回报定开 C



注：（1）本基金合同生效日期为 2019 年 8 月 29 日；

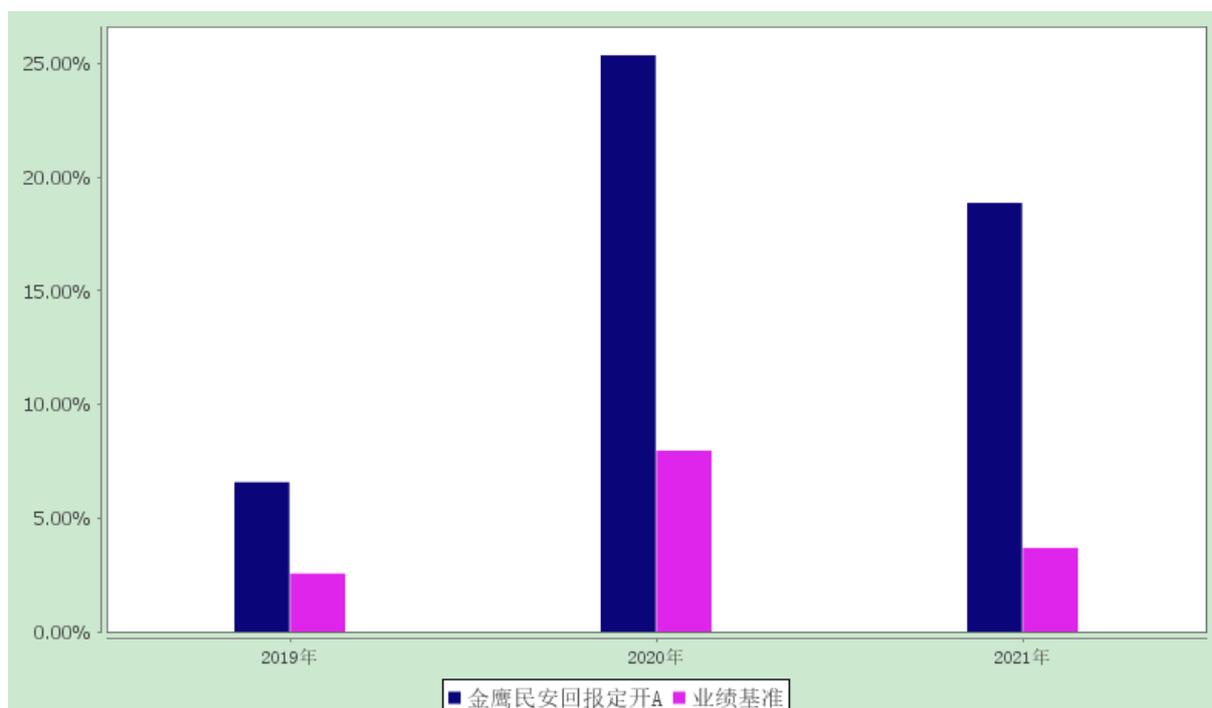
（2）本基金的业绩比较基准是：中债总财富（总值）指数收益率\*80+沪深 300 指数收益率\*20%。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图

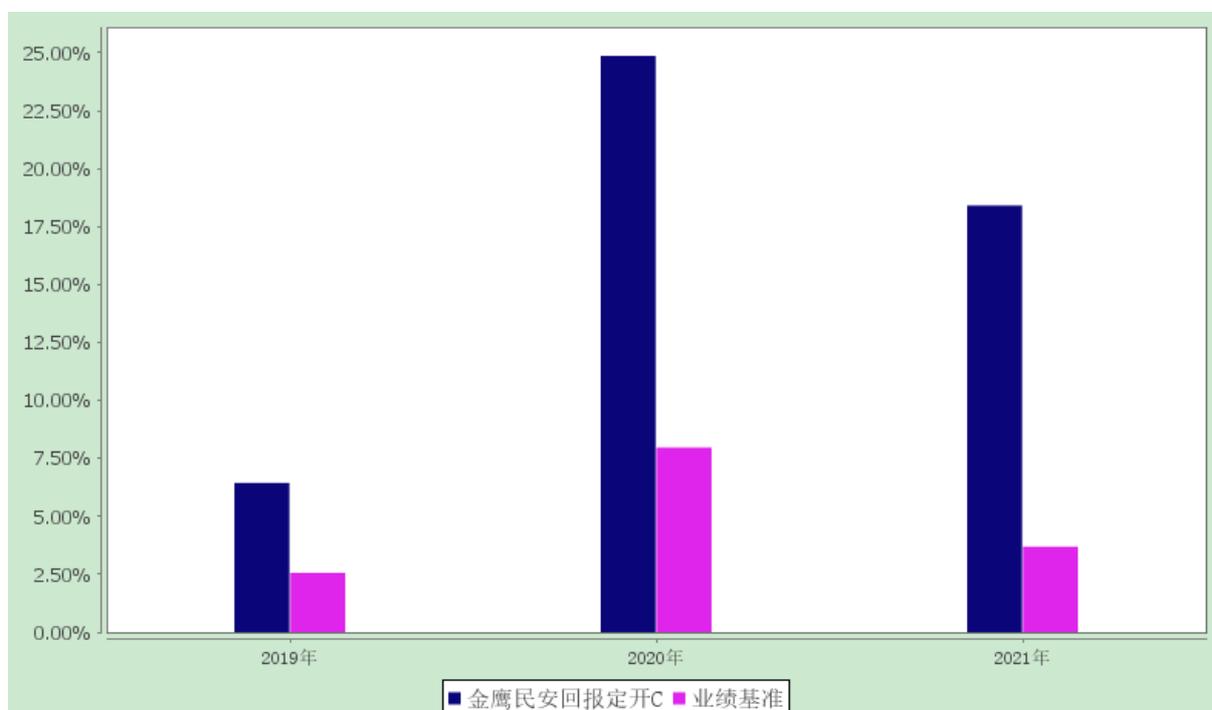
金鹰民安回报定开 A



注：（1）本基金合同生效日期为 2019 年 8 月 29 日；

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

金鹰民安回报定开 C



注：（1）本基金合同生效日期为 2019 年 8 月 29 日；

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

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

#### 1、金鹰民安回报定开 A

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2020	1.552	77,407,886.87	1,995,478.81	79,403,365.68	-
2021	2.100	219,207,469.41	18,784,210.04	237,991,679.45	-
合计	3.652	296,615,356.28	20,779,688.85	317,395,045.13	-

#### 2、金鹰民安回报定开 C

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2020	1.515	14,354,071.37	383,559.62	14,737,630.99	-
2021	2.100	23,410,757.13	2,503,171.69	25,913,928.82	-
合计	3.615	37,764,828.50	2,886,731.31	40,651,559.81	-

## § 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53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，严格遵守本基金的基金合同、托管协议、招募说明书等法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，基金运作合法合规，无出现重大违法违规或违反基金合同的行为，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了保证本基金管理人管理的不同投资组合得到公平对待，本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，以及公司内控大纲的要求，制定了《金鹰基金管理有限公司公平交易管理规定》并严格执行，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。本基金管理人通过投资交易系统公平交易功能，对不同投资组合进行公平交易事前控制。

同时，本基金管理人引入公平交易分析系统，定期或不定期对公司旗下投资组合在一定期间内买卖相同证券的情况进行监控和分析。

#### 4.3.2 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中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。

报告期内，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。

#### 4.3.3 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

2021 年，权益市场整体向好，行业轮动加速，围绕盈利弹性，自上而下和自下而上的打法在不同阶段可以锁定正收益。春节前市场延续了去年的拥抱核心资产，节后市场在海外利率上行的压力下全面回调，低估值、周期涨价板块取得相对收益，随着大宗商品价格管控压力加大，新能源为首的成长板块迅速崛起，行情进展至 8-9 月，市场重新交易能耗双控下的大宗商品价格上涨，而限产蔓延导致周期行情戛然而止，资金转向景气反转的汽车零部件、消费，以及故事加持的元宇宙等板块。全年市场回调幅度较大的两个时间点在 3 月和 9 月，也是行业风格切换的关键时点，从中可以看出资金在各板块间快速切换的暗潮涌动。操作方面，我们基本顺着市场盈利弹性的思路，不足之处在个别时间点上仓位过重，导致调整节奏滞后于判断，组合出现较大回撤，但基本控制在组合预期的范围内，全年权益贡献收益好于目标。

债券方面，国内充足流动性的呵护带来全年利率中枢阶梯式下行，期间市场短暂交易过海外市场货币政策转向、国内地方债放量、全球通胀等，但从中长期的维度来看，这些变量对利率的向上压力都被宽松的货币政策、实体经济投融资下行抵减，结构性资产荒下全年利率小牛市行情。

可转债指数全年表现亮眼，尽管市场反复争议高溢价风险，但在固收+大行其道，优质资产供给

不足的背景下，可转债成为增厚组合收益的主力，高溢价存在的合理性也就得到了解释，尤其是在权益结构性行情、中小盘强势、主流不强赎的阶段。操作上，我们适当放宽对绝对价格和相对溢价的容忍度，以转债卡位权益，全年取得正向回报。

通过以转债和权益做收益增强的策略，组合提前实现预期收益，信用债配置压力减轻，我们把重心还是放在排雷上，全年持仓无一违约。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金报告期内 A 类份额净值为 1.1748 元，本报告期份额净值增长率为 18.88%，同期业绩比较基准增长率为 3.69%；C 类基金份额净值为 1.1662 元，本报告期份额净值增长率为 18.41%，同期业绩比较基准增长率为 3.69%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年，海外大环境错综复杂，本是海外货币政策转向的大年，却因资源国地缘对决加剧通胀压力，导致在稳物价和保就业间的博弈情绪放大了全球资产的波动，面对供给驱动的通胀环境，需要谨慎中期外需崩塌的风险。与海外市场的风起雨涌相比，国内稳增长政策方向确定性较强，不足在宏观至微观主体的推进速度和幅度仍存在不确定性。板块方面，均衡配置更符合今年行情，筹码结构、估值风险、困境反转是选股关注的重点。

利率方面，在资产荒的环境中，配置盘仍对稳市场起到重要作用，在宽信用未完全疏通前，扰动主要来自通胀风险。转债方面，压力主要来自高估值溢价和潜在赎回，全年操作难度增加，但市场充分调整后，还是可以利用转债“进可攻、退可守”的特性捡到便宜货，保持谨慎而不悲观。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，监察稽核工作根据独立、客观、公正的原则，按照规定的权限和程序独立开展本基金运作的合规性监察，认真履行职责，通过材料审阅、监督监控、覆盖检查、重点抽查等多种方法开展工作，督促各项业务的合规运作，发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告，定期向公司董事会出具监察稽核报告。

本报告期有关本基金的监察稽核内容包括投资、交易、研究、市场营销、信息披露等各项业务的每个环节以及信息技术、运营保障、行政管理等后台支持工作。监察结果显示，本报告期内公司对本基金的管理始终都能按照法律法规、基金合同、基金招募说明书的要求和公司制度的规定进行。本基金的投资决策、投资交易程序、投资权限等各方面均符合规定的要求；交易行为合法合规，未出现异常交易、操纵市场的现象；未发现内幕交易的情况；基金持有的证券符合规定的比例要求；基金专用交易席位年度交易量比例符合证监会的有关规定；相关的信息披露真实、完整、准确、及

时；销售工作合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内共进行了 1 次利润分配。

权益登记日为 2021 年 9 月 7 日，A 类每 10 份分配 2.100 元，C 类每 10 份分配 2.100 元，本次利润分配总额 263,905,608.27 元。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

本报告期，会计师事务所未对本基金出具非标准审计报告。

#### 4.10 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，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，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 托管人对本年度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、投资组合报告内容真实、准确和完整。

## §6 审计报告

毕马威华振审字第 2201818 号

金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金（以下简称“金鹰民安回报”）财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表、2021 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

### 6.1 审计意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了金鹰民安回报 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。

## 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于金鹰民安回报，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

## 6.3 其他信息

金鹰民安回报管理人金鹰基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括金鹰民安回报 2021 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

## 6.4 管理层对财务报表的责任

基金管理人管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估金鹰民安回报的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非金鹰民安回报计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督金鹰民安回报的财务报告过程。

## 6.5 注册会计师的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对金鹰民安回报持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致金鹰民安回报不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙） 中国注册会计师  
叶云晖 宋扬  
中国北京东长安街1号东方广场毕马威大楼8层  
2022年3月30日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日

<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	22,468,850.30	10,365,197.98
结算备付金		21,508,953.98	53,415,122.18
存出保证金		1,285,081.10	864,953.19
交易性金融资产	7.4.7.2	3,750,917,860.38	2,183,417,570.72
其中：股票投资		1,167,850,569.23	535,919,133.17
基金投资		-	-
债券投资		2,583,067,291.15	1,629,315,437.55
资产支持证券投资		-	18,183,000.00
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		43,950,863.64	142,446.61
应收利息	7.4.7.5	38,752,199.54	19,418,060.92
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>3,878,883,808.94</b>	<b>2,267,623,351.60</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年12月31日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		489,399,805.90	795,000,000.00
应付证券清算款		7,799,478.71	4,326,209.73
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,875,881.74	1,210,432.07

应付托管费		431,382.24	181,564.82
应付销售服务费		107,151.82	47,445.92
应付交易费用	7.4.7.7	2,893,337.18	974,696.57
应交税费		40,250.15	23,949.27
应付利息		-72,724.28	293,847.29
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	165,000.00	160,000.00
<b>负债合计</b>		<b>503,639,563.46</b>	<b>802,218,145.67</b>
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	2,874,917,333.04	1,256,693,371.77
未分配利润	7.4.7.10	500,326,912.44	208,711,834.16
<b>所有者权益合计</b>		<b>3,375,244,245.48</b>	<b>1,465,405,205.93</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>3,878,883,808.94</b>	<b>2,267,623,351.60</b>

注：截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日，基金份额总额 2,874,917,333.04 份；其中金鹰民安回报定开 A 基金份额净值 1.1748 元，份额总额 2,605,379,902.96 份；金鹰民安回报定开 C 基金份额净值 1.1662 元，份额总额 269,537,430.08 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>327,711,048.66</b>	<b>248,442,208.66</b>
1.利息收入		63,766,219.13	30,631,537.74
其中：存款利息收入	7.4.7.11	768,563.44	482,371.32
债券利息收入		61,784,034.16	28,227,484.92
资产支持证券利息收入		275,303.98	1,467,214.32

买入返售金融资产收入		938,317.55	454,467.18
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		299,785,518.86	182,339,898.39
其中：股票投资收益	7.4.7.12	263,634,126.83	152,083,148.06
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	29,014,850.89	27,915,961.82
资产支持证券投资收益	7.4.7.15	-	-101,273.97
贵金属投资收益	7.4.7.16	-	-
衍生工具收益	7.4.7.17	-	-
股利收益	7.4.7.18	7,136,541.14	2,442,062.48
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	-35,940,055.73	35,451,282.04
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	99,366.40	19,490.49
<b>减：二、费用</b>		<b>52,109,082.07</b>	<b>26,235,054.10</b>
1. 管理人报酬		20,536,734.54	8,858,327.25
2. 托管费		3,080,510.09	1,328,749.06
3. 销售服务费		785,198.87	457,115.14
4. 交易费用	7.4.7.21	13,615,296.24	7,155,048.18
5. 利息支出		13,841,555.66	8,203,399.57
其中：卖出回购金融资产支出		13,841,555.66	8,203,399.57
6. 税金及附加		42,141.61	30,778.11
7. 其他费用	7.4.7.22	207,645.06	201,636.79
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>275,601,966.59</b>	<b>222,207,154.56</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>275,601,966.59</b>	<b>222,207,154.56</b>

## 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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）	-	275,601,966.59	275,601,966.59
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）	1,618,223,961.27	279,918,719.96	1,898,142,681.23
其中：1.基金申购款	2,400,899,678.00	416,636,715.28	2,817,536,393.28
2.基金赎回款	-782,675,716.73	-136,717,995.32	-919,393,712.05
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）	-	-263,905,608.27	-263,905,608.27
五、期末所有者权益（基金净值）	2,874,917,333.04	500,326,912.44	3,375,244,245.48
项目	上年度可比期间		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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）	-	222,207,154.56	222,207,154.56
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）	647,795,653.43	40,712,517.79	688,508,171.22
其中：1.基金申购款	1,146,661,626.09	75,536,815.14	1,222,198,441.23
2.基金赎回款	-498,865,972.66	-34,824,297.35	-533,690,270.01
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）	-	-94,140,996.67	-94,140,996.67
五、期末所有者权益（基金净值）	1,256,693,371.77	208,711,834.16	1,465,405,205.93

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：周蔚，主管会计工作负责人：耿源，会计机构负责人：董霞

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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。

#### 7.4.2 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。

#### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### 1. 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产包括股票投资、债券投资、资产支持证券和衍生工具投资等，其中股票投资、债券投资和资产支持证券在资产负债表中作为交易性金融资产列报，衍生工具投资在资产负债表中作为衍生金融资产列报。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

## 2. 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时全部划分为其他金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该等金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益；应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一的金融资产，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：(1)所转移金融资产的账面价值；(2)因转移而收到的对价。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。

#### 1. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

##### (1) 股票投资

买入股票于交易日按股票的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

股票持有期间获得的股票股利(包括送红股和公积金转增股本)，于除息日按股权登记日持有的股数及送股或转增比例，计算确定增加的股票数量。

卖出股票于交易日确认股票投资收益。卖出股票按移动加权平均法结转成本。

##### (2) 债券投资

买入债券于交易日按债券的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益，上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

配售及认购新发行的分离交易可转换债券，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转换债券的认购成本进行分摊，确定应归属于债券部分的成本。

买入央行票据和零息债券视同到期一次还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率后，逐日确认债券利息收入。

卖出债券于交易日确认债券投资收益。卖出债券按移动加权平均法结转成本。

### (3) 权证投资

买入权证于交易日按公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

获赠的权证(包括配股权证)，在除权日按照持有的股数及获赠比例，计算确定增加的权证数量，成本为零。

配售及认购新发行的分离交易可转换债券而取得的权证，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转换债券的认购成本进行分摊，确定应归属于权证部分的成本。

卖出权证于交易日确认权证投资收益。卖出权证的成本按移动加权平均法结转。

### (4) 期货投资

期货投资于相关合同签署日以公允价值进行初始计量，并以公允价值进行后续计量，公允价值变动计入当期损益。因期货交易每日无负债结算确认的相关金融资产和金融负债，与相关的期货暂收暂付款之间按抵销后的净额在资产负债表内列示。

### (5) 资产支持证券

买入资产支持证券于交易日按资产支持证券的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益，上述公允价值不包含资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

卖出资产支持证券于交易日确认资产支持证券投资收益。卖出资产支持证券按移动加权平均法结转成本。

## 2. 贷款及应收款项

### 买入返售金融资产

买入返售金融资产为本基金按照返售协议约定先买入再按固定价格返售证券等金融资产所融出的资金。

买入返售金融资产按交易日应支付或实际支付的全部价款入账，相关交易费用计入初始确认金额。买入返售金融资产于返售日按账面余额结转。

## 3. 其他金融负债

### 卖出回购金融资产款

卖出回购金融资产款为本基金按照回购协议先卖出再按固定价格买入票据、证券等金融资产所

融入的资金。

卖出回购金融资产款于交易日按照应收或实际收到的金额入账，相关交易费用计入初始确认金额。卖出回购金融资产款于回购日按账面余额结转。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

1.对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值；对于发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行时股票公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按照中国证监会或中国证券投资基金业协会的有关规定确定公允价值。

2.对存在活跃市场的投资品种，如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

3.当投资品种不再存在活跃市场，且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上，应采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和市价折扣法等。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

4.对于交易所市场和银行间市场交易的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，采用第三方估值机构所提供的估值确定公允价值，另有规定的除外。

具体投资品种的估值方法如下：

##### (1) 股票投资

交易所上市流通的股票以其估值日在证券交易所挂牌的收盘价为公允价值。

对于长期停牌的股票，若其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，

本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，依据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售份、通过大宗交易取得的带限售期股票等流通受限股票，考虑估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值以及该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣的影响，采用市价折扣法确定公允价值。

首次公开发行但未上市股票按采用估值技术确定的公允价值估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本计量。

## (2) 债券投资

银行间和交易所市场上市交易的债券(另有规定除外)，采用第三方估值机构(中央国债登记结算公司或中证指数有限公司)提供的估值净价确定公允价值。

交易所市场上市交易的可转换债券按估值日收盘价减去收盘价中所含债券应收利息后的净价作为公允价值。

未上市或未挂牌转让的债券、以及在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

## (3) 权证投资

交易所上市流通的权证以其估值日在证券交易所上市的收盘价为公允价值。

首次公开发行但尚未上市的权证在上市交易前，采用估值技术确定公允价值，如估值技术难以可靠计量，则以成本计量。

配售及认购分离交易可转换债券所获得的权证自实际取得日至在交易所上市交易前，采用估值技术确定公允价值。如估值技术难以可靠计量，则按成本计量。

因持有股票而享有的配股权，以及停止交易但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

如有确凿证据表明按上述方法不能客观反映交易性金融工具的公允价值，基金管理人将根据具体情况与基金托管人商定后确定最能反映公允价值的价格。

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次的输入值确定公允价值计量层次。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。

### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并全额转入“未分配利润 / (累计亏损)”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### 1. 利息收入

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

(2) 除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率后，逐日确认债券利息收入。

(3) 买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

(4) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提。

##### 2. 投资收益

(1) 股票投资收益于交易日按卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

(2) 债券投资收益于交易日按卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

(3) 资产支持证券投资收益于交易日按卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

(4) 衍生工具投资收益于交易日按交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

(5) 股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

### 3. 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产/负债卖出或到期时转出计入投资收益。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 $\times 1.00\%$ 的年费率逐日计提。

2. 本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 $\times 0.15\%$ 的年费率逐日计提。

3. 本基金的 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  $0.4\%$  年费率计提

4. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

5. 卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后两类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的两类基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管

理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 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。

##### 7.4.5.2 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。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	22,468,850.30	10,365,197.98
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	22,468,850.30	10,365,197.98

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,162,163,849.53	1,167,850,569.23	5,686,719.70

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	699,545,639.64	701,588,141.15	2,042,501.51
	银行间市场	1,870,185,661.56	1,881,479,150.00	11,293,488.44
	合计	2,569,731,301.20	2,583,067,291.15	13,335,989.95
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		3,731,895,150.73	3,750,917,860.38	19,022,709.65
项目		上年度末		
		2020 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		469,465,801.19	535,919,133.17	66,453,331.98
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	1,283,321,116.08	1,272,817,537.55	-10,503,578.53
	银行间市场	357,502,888.07	356,497,900.00	-1,004,988.07
	合计	1,640,824,004.15	1,629,315,437.55	-11,508,566.60
资产支持证券		18,165,000.00	18,183,000.00	18,000.00
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,128,454,805.34	2,183,417,570.72	54,962,765.38

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	935.38	1,381.48
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	9,679.10	24,036.80
应收债券利息	38,741,006.76	19,386,376.94
应收资产支持证券利息	-	5,876.50
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	578.30	389.20
合计	38,752,199.54	19,418,060.92

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	2,881,736.47	971,994.24
银行间市场应付交易费用	11,600.71	2,702.33
合计	2,893,337.18	974,696.57

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 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	-	-
预提审计费用	45,000.00	40,000.00
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00
合计	165,000.00	160,000.00

**7.4.7.9 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12月31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	2,172,549,646.20	2,172,549,646.20
本期赎回（以“-”号填列）	-700,463,454.38	-700,463,454.38
本期末	2,605,379,902.96	2,605,379,902.96

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12月31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	228,350,031.80	228,350,031.80
本期赎回（以“-”号填列）	-82,212,262.35	-82,212,262.35
本期末	269,537,430.08	269,537,430.08

**7.4.7.10 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	281,809,024.88	-32,484,715.53	249,324,309.35
本期基金份额交易产生的	223,151,885.71	32,503,137.91	255,655,023.62

变动数			
其中：基金申购款	329,393,300.40	49,173,585.84	378,566,886.24
基金赎回款	-106,241,414.69	-16,670,447.93	-122,911,862.62
本期已分配利润	-237,991,679.45	-	-237,991,679.45
本期末	402,940,029.93	52,581,005.44	455,521,035.37

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	29,732,997.44	-3,455,340.20	26,277,657.24
本期基金份额交易产生的变动数	21,086,157.87	3,177,538.47	24,263,696.34
其中：基金申购款	32,961,408.18	5,108,420.86	38,069,829.04
基金赎回款	-11,875,250.31	-1,930,882.39	-13,806,132.70
本期已分配利润	-25,913,928.82	-	-25,913,928.82
本期末	39,372,190.98	5,433,686.09	44,805,877.07

## 7.4.7.11 存款利息收入

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 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	198,380.45	123,603.05
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	556,926.64	349,813.08
其他	13,256.35	8,955.19
合计	768,563.44	482,371.32

## 7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	4,776,776,050.41	2,436,095,647.89
减：卖出股票成本总额	4,513,141,923.58	2,284,012,499.83
买卖股票差价收入	263,634,126.83	152,083,148.06

#### 7.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无基金投资收益。

#### 7.4.7.14 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	3,270,720,226.42	1,550,386,379.12
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,198,750,082.70	1,508,415,070.51
减：应收利息总额	42,955,292.83	14,055,346.79
买卖债券差价收入	29,014,850.89	27,915,961.82

#### 7.4.7.15 资产支持证券投资收益

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12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	18,396,551.64	65,066,484.28
减：卖出资产支持证券成本总额	18,165,000.00	63,499,273.97
减：应收利息总额	231,551.64	1,668,484.28
资产支持证券投资收益	-	-101,273.97

#### 7.4.7.16 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.17 衍生工具收益

##### 7.4.7.17.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

##### 7.4.7.17.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

## 7.4.7.18 股利收益

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12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	7,136,541.14	2,442,062.48
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	7,136,541.14	2,442,062.48

## 7.4.7.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
1.交易性金融资产	-35,940,055.73	35,451,282.04
——股票投资	-60,766,612.28	48,636,112.50
——债券投资	24,844,556.55	-13,141,145.53
——资产支持证券投资	-18,000.00	-43,684.93
——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	-35,940,055.73	35,451,282.04

## 7.4.7.20 其他收入

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12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
基金赎回费收入	99,366.40	19,490.49

合计	99,366.40	19,490.49
----	-----------	-----------

#### 7.4.7.21 交易费用

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12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	13,602,596.24	7,149,685.68
银行间市场交易费用	12,700.00	5,362.50
合计	13,615,296.24	7,155,048.18

##### 7.4.7.21.1 持有基金产生的费用

本基金本报告期及上年度可比期间无持有基金产生的费用。

#### 7.4.7.22 其他费用

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12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	45,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	5,595.06	4,436.79
帐户维护费	35,850.00	36,000.00
其他项目	1,200.00	1,200.00
合计	207,645.06	201,636.79

#### 7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

##### 7.4.8.2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。

#### 7.4.9关联方关系

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

广州越秀金融控股集团股份有限公司	基金管理人股东
广州金鹰资产管理有限公司	基金管理人子公司
广州白云山医药集团股份有限公司	基金管理人股东
东旭集团有限公司	基金管理人股东

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

###### 7.4.10.1.5 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。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

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12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	20,536,734.54	8,858,327.25
其中：支付销售机构的客户维护费	10,184,322.16	4,670,235.27

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。

## 7.4.10.2 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12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,080,510.09	1,328,749.06

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。

## 7.4.10.2.3 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12月31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	-	586,269.15	586,269.15
金鹰基金管理有限公司	-	67.55	67.55
合计	-	586,336.70	586,336.70
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12月31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	-	388,181.23	388,181.23
金鹰基金管理有限公司	-	3.52	3.52
合计	-	388,184.75	388,184.75

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结构，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。

#### 7.4.10.3 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无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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

本基金本报告期及上年度可比期间无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。

##### 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

##### 7.4.10.5.2 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。

#### 7.4.10.6 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12月31日		2020年1月1日至2020年12月31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	22,468,850.30	198,380.45	10,365,197.98	123,603.05

限公司				
-----	--	--	--	--

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 12 月 31 日清算备付金期末余额 21,508,953.98 元，清算备付金利息收入 556,926.64 元；2020 年 12 月 31 日清算备付金期末余额 53,415,122.18 元，清算备付金利息收入 349,813.08 元。

#### 7.4.10.7 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的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.8.1 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

本基金本报告期及上年度可比期间无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。

#### 7.4.11 利润分配情况

金鹰民安回报定开 A

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2021-09-07	-	2021-09-07	2.100	219,207,469.41	18,784,210.04	237,991,679.45	-
合计				2.100	219,207,469.41	18,784,210.04	237,991,679.45	-

金鹰民安回报定开 C

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2021-09-07	-	2021-	2.100	23,410,757.13	2,503,171.69	25,913,928.82	-

			09-07						
合计				2.100	23,410,757.13	2,503,171.69	25,913,928.82	-	

## 7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
301050	雷电微力	2021-08-17	2022-02-24	网下配售锁定	60.64	234.74	233.00	14,129.12	54,694.42	网下配售锁定
301177	迪阿股份	2021-12-08	2022-06-15	网下配售锁定	116.88	116.08	792.00	92,568.96	91,935.36	网下配售锁定
688778	厦钨新能	2021-07-29	2022-02-07	网下配售锁定	24.50	100.74	5,075.00	124,337.50	511,255.50	网下配售锁定
301155	海力风电	2021-11-17	2022-05-24	网下配售锁定	60.66	96.75	1,054.00	63,935.64	101,974.50	网下配售锁定
301221	光庭信息	2021-12-15	2022-06-22	网下配售锁定	69.89	88.72	280.00	19,569.20	24,841.60	网下配售锁定
301096	百诚医药	2021-12-13	2022-06-20	网下配售	79.60	78.53	272.00	21,651.20	21,360.16	网下

				锁定						配售 锁定
688670	金迪克	2021-07-23	2022-02-07	网下 配售 锁定	55.18	74.11	2,310.00	127,465.80	171,194.10	网下 配售 锁定
301089	拓新药业	2021-10-20	2022-04-27	网下 配售 锁定	19.11	67.93	220.00	4,204.20	14,944.60	网下 配售 锁定
688103	国力股份	2021-09-02	2022-03-10	网下 配售 锁定	12.04	66.10	1,595.00	19,203.80	105,429.50	网下 配售 锁定
688303	大全能源	2021-07-15	2022-01-24	网下 配售 锁定	21.49	60.51	30,456.00	654,499.44	1,842,892.56	网下 配售 锁定
301033	迈普医学	2021-07-15	2022-01-26	网下 配售 锁定	15.14	59.97	108.00	1,635.12	6,476.76	网下 配售 锁定
301189	奥尼电子	2021-12-21	2022-06-28	网下 配售 锁定	66.18	56.62	435.00	28,788.30	24,629.70	网下 配售 锁定
301035	润丰股份	2021-07-21	2022-01-28	网下 配售 锁定	22.04	56.28	644.00	14,193.76	36,244.32	网下 配售 锁

										定
688511	天微电子	2021-07-22	2022-02-07	网下配售锁定	28.09	54.52	1,490.00	41,854.10	81,234.80	网下配售锁定
301108	洁雅股份	2021-11-25	2022-06-06	网下配售锁定	57.27	53.71	280.00	16,035.60	15,038.80	网下配售锁定
301168	通灵股份	2021-12-02	2022-06-10	网下配售锁定	39.08	52.13	329.00	12,857.32	17,150.77	网下配售锁定
301179	泽宇智能	2021-12-01	2022-06-08	网下配售锁定	43.99	50.77	295.00	12,977.05	14,977.15	网下配售锁定
301093	华兰股份	2021-10-21	2022-05-05	网下配售锁定	58.08	49.85	409.00	23,754.72	20,388.65	网下配售锁定
301118	恒光股份	2021-11-09	2022-05-18	网下配售锁定	22.70	49.02	315.00	7,150.50	15,441.30	网下配售锁定
300994	久祺股份	2021-08-02	2022-02-14	网下配售锁定	11.90	45.45	420.00	4,998.00	19,089.00	网下配售锁定
301069	凯盛新材	2021-09-16	2022-03-28	网下配售	5.17	44.21	539.00	2,786.63	23,829.19	网下

				锁定						配售 锁定
301021	英诺 激光	2021-06-28	2022-01-06	网下 配售 锁定	9.46	41.43	290.00	2,743.40	12,014.70	网下 配售 锁定
688799	华纳 药厂	2021-07-05	2022-01-13	网下 配售 锁定	30.82	40.73	1,917.00	59,081.94	78,079.41	网下 配售 锁定
301063	海锅 股份	2021-09-09	2022-03-24	网下 配售 锁定	17.40	36.11	153.00	2,662.20	5,524.83	网下 配售 锁定
301092	争光 股份	2021-10-21	2022-05-05	网下 配售 锁定	36.31	35.52	323.00	11,728.13	11,472.96	网下 配售 锁定
301211	亨迪 药业	2021-12-14	2022-06-22	网下 配售 锁定	25.80	33.65	967.00	24,948.60	32,539.55	网下 配售 锁定
301052	果麦 文化	2021-08-23	2022-02-28	网下 配售 锁定	8.11	33.64	252.00	2,043.72	8,477.28	网下 配售 锁定
301072	中捷 精工	2021-09-22	2022-03-29	网下 配售 锁定	7.46	33.41	181.00	1,350.26	6,047.21	网下 配售 锁

										定
301049	超越科技	2021-08-17	2022-02-24	网下配售锁定	19.34	32.92	196.00	3,790.64	6,452.32	网下配售锁定
301073	君亭酒店	2021-09-22	2022-03-30	网下配售锁定	12.24	32.00	144.00	1,762.56	4,608.00	网下配售锁定
301091	深城交	2021-10-20	2022-04-29	网下配售锁定	36.50	31.31	524.00	19,126.00	16,406.44	网下配售锁定
301100	风光股份	2021-12-10	2022-06-17	网下配售锁定	27.81	31.14	599.00	16,658.19	18,652.86	网下配售锁定
301060	兰卫医学	2021-09-06	2022-03-14	网下配售锁定	4.17	30.94	587.00	2,447.79	18,161.78	网下配售锁定
301182	凯旺科技	2021-12-16	2022-06-23	网下配售锁定	27.12	30.58	294.00	7,973.28	8,990.52	网下配售锁定
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	网下配售锁定	10.64	30.44	421.00	4,479.44	12,815.24	网下配售锁定
301036	双乐股份	2021-07-21	2022-02-16	网下配售	23.38	29.93	205.00	4,792.90	6,135.65	网下

				锁定						配售 锁定
301198	喜悦 智行	2021-11-25	2022-06-02	网下 配售 锁定	21.76	29.20	262.00	5,701.12	7,650.40	网下 配售 锁定
301053	远信 工业	2021-08-25	2022-03-01	网下 配售 锁定	11.87	28.78	155.00	1,839.85	4,460.90	网下 配售 锁定
301068	大地 海洋	2021-09-16	2022-03-28	网下 配售 锁定	13.98	28.38	144.00	2,013.12	4,086.72	网下 配售 锁定
301041	金百 泽	2021-08-02	2022-02-11	网下 配售 锁定	7.31	28.21	215.00	1,571.65	6,065.15	网下 配售 锁定
300854	中兰 环保	2021-09-08	2022-03-16	网下 配售 锁定	9.96	27.29	203.00	2,021.88	5,539.87	网下 配售 锁定
301079	邵阳 液压	2021-10-11	2022-04-19	网下 配售 锁定	11.92	24.82	140.00	1,668.80	3,474.80	网下 配售 锁定
301088	戎美 股份	2021-10-19	2022-04-28	网下 配售 锁定	33.16	24.67	704.00	23,344.64	17,367.68	网下 配售 锁

										定
301037	保立佳	2021-07-21	2022-02-07	网下配售锁定	14.82	24.26	193.00	2,860.26	4,682.18	网下配售锁定
300814	中富电路	2021-08-04	2022-02-14	网下配售锁定	8.40	23.88	328.00	2,755.20	7,832.64	网下配售锁定
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	网下配售锁定	8.86	23.80	555.00	4,917.30	13,209.00	网下配售锁定
301098	金埔园林	2021-11-04	2022-05-12	网下配售锁定	12.36	22.17	307.00	3,794.52	6,806.19	网下配售锁定
301055	张小泉	2021-08-26	2022-03-07	网下配售锁定	6.90	21.78	355.00	2,449.50	7,731.90	网下配售锁定
300774	倍杰特	2021-07-26	2022-02-16	网下配售锁定	4.57	21.08	444.00	2,029.08	9,359.52	网下配售锁定
301025	读客文化	2021-07-06	2022-01-24	网下配售锁定	1.55	20.88	403.00	624.65	8,414.64	网下配售锁定
301038	深水规院	2021-07-22	2022-02-07	网下配售	6.68	20.23	266.00	1,776.88	5,381.18	网下

				锁定						配售 锁定
301059	金三江	2021-09-03	2022-03-14	网下 配售 锁定	8.09	19.30	259.00	2,095.31	4,998.70	网下 配售 锁定
301057	汇隆 新材	2021-08-31	2022-03-09	网下 配售 锁定	8.03	19.02	218.00	1,750.54	4,146.36	网下 配售 锁定
688038	中科 通达	2021-07-05	2022-01-13	网下 配售 锁定	8.60	18.72	2,132.00	18,335.20	39,911.04	网下 配售 锁定
301081	严牌 股份	2021-10-13	2022-04-20	网下 配售 锁定	12.95	17.44	403.00	5,218.85	7,028.32	网下 配售 锁定
301149	隆华 新材	2021-11-03	2022-05-10	网下 配售 锁定	10.07	16.76	1,214.00	12,224.98	20,346.64	网下 配售 锁定
301027	华蓝 集团	2021-07-08	2022-01-19	网下 配售 锁定	11.45	16.65	286.00	3,274.70	4,761.90	网下 配售 锁定
001234	泰慕 士	2021-12-31	2022-01-11	网下 新股 申购	16.53	16.53	333.00	5,504.49	5,504.49	网下 新股 待

										上市
301083	百胜智能	2021-10-13	2022-04-21	网下配售锁定	9.08	14.21	416.00	3,777.28	5,911.36	网下配售锁定
688701	卓锦股份	2021-09-08	2022-03-16	网下配售锁定	7.48	13.50	2,340.00	17,503.20	31,590.00	网下配售锁定
301028	东亚机械	2021-07-12	2022-01-20	网下配售锁定	5.31	13.50	733.00	3,892.23	9,895.50	网下配售锁定
301048	金鹰重工	2021-08-11	2022-02-28	网下配售锁定	4.13	12.96	843.00	3,481.59	10,925.28	网下配售锁定
301039	中集车辆	2021-07-01	2022-01-10	网下配售锁定	6.96	12.51	2,064.00	14,365.44	25,820.64	网下配售锁定
301090	华润材料	2021-10-19	2022-04-26	网下配售锁定	10.45	11.22	2,764.00	28,883.80	31,012.08	网下配售锁定
301056	森赫股份	2021-08-27	2022-03-07	网下配售锁定	3.93	11.09	572.00	2,247.96	6,343.48	网下配售锁定

## 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 49,399,805.90 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值总额
210210	21 国开 10	2022-01-04	102.16	520,000.00	53,123,200.00
合计				520,000.00	53,123,200.00

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，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 440,000,000.00 元。于 2022 年 1 月 4 日到期。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。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.4.13 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。

##### 7.4.13.1 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立，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；对公司各部门业务流程的遵守合规性和有效性的检查、监督、评价及建议等。

### 7.4.13.2 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度的证券，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。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评

估控制证券发行人的信用风险，建立了内部评级体系，通过内部评级与外部评级相结合的方法充分评估证券以及交易对手的信用风险。

#### 7.4.13.2.1 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12月31日	上年度末 2020年12月31日
A-1	0.00	110,027,000.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	49,990,000.00
合计	0.00	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、地方政府债和同业存单。

#### 7.4.13.2.2 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12月31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

#### 7.4.13.2.3 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12月31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

#### 7.4.13.2.4 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12月31日	上年度末 2020年12月31日
--------	--------------------	---------------------

AAA	1,656,753,677.20	1,293,174,816.00
AAA 以下	170,459,613.95	176,123,621.55
未评级	0.00	0.00
合计	1,827,213,291.15	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、地方政府债和同业存单。

#### 7.4.13.2.5 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12月31日	上年度末 2020年12月31日
AAA	0.00	18,183,000.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	18,183,000.00

#### 7.4.13.2.6 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12月31日	上年度末 2020年12月31日
AAA	467,570,000.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	467,570,000.00	0.00

注：以上数据按照最新发行人评级填列。

#### 7.4.13.3 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。

##### 7.4.13.3.1 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。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场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所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 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。基金管理人通过久期、凸度等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	22,468,850.30	-	-	-	22,468,850.30
结算备付金	21,508,953.98	-	-	-	21,508,953.98
存出保证金	1,285,081.10	-	-	-	1,285,081.10
交易性金融资产	865,101,150.00	1,416,451,928.30	301,514,212.85	1,167,850,569.23	3,750,917,860.38
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	43,950,863.64	43,950,863.64
应收利息	-	-	-	38,752,199.54	38,752,199.54
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	910,364,035.38	1,416,451,928.30	301,514,212.85	1,250,553,632.41	3,878,883,808.94

负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	489,399,805.90	-	-	-	489,399,805.90
应付证券清算款	-	-	-	7,799,478.71	7,799,478.71
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	2,875,881.74	2,875,881.74
应付托管费	-	-	-	431,382.24	431,382.24
应付销售服务费	-	-	-	107,151.82	107,151.82
应付交易费用	-	-	-	2,893,337.18	2,893,337.18
应交税费	-	-	-	40,250.15	40,250.15
应付利息	-	-	-	-72,724.28	-72,724.28
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	165,000.00	165,000.00
负债总计	489,399,805.90	-	-	14,239,757.56	503,639,563.46
利率敏感度缺口	420,964,229.48	1,416,451,928.30	301,514,212.85	1,236,313,874.85	3,375,244,245.48
<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
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	1,120,168,300.00	360,420,301.50	166,909,836.05	535,919,133.17	2,183,417,570.72
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	1,184,813,573.35	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	389,813,573.35	360,420,301.50	166,909,836.05	548,261,495.03	1,465,405,205.93

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。

#### 7.4.13.4.1.2 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	上年度末
		2021年12月31日	2020年12月31日
	利率上升 25 个基点	-12,921,062.60	-3,028,085.96
	利率下降 25 个基点	13,261,911.49	3,057,075.45

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 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	1,167,850,569.23	34.60	535,919,133.17	36.57
交易性金融资产—债券投资	41,018,141.15	1.22	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	1,208,868,710.38	35.82	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。

#### 7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	业绩比较基准变动+5%	279,429,417.10	142,151,748.31
	业绩比较基准变动-5%	-279,429,417.10	-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 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	业绩比较基准变动+5%	28,690,126.04	15,448,437.83
	业绩比较基准变动-5%	-28,690,126.04	-15,448,437.83

#### 7.4.14 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 12 月 31 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 1,205,087,050.33 元，第二层级的余额为 2,545,830,810.05 元，无第三层级的金额。

## (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。

## § 8 投资组合报告

## 8.1 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	1,167,850,569.23	30.11
	其中：股票	1,167,850,569.23	30.11
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,583,067,291.15	66.59
	其中：债券	2,583,067,291.15	66.59
	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计	43,977,804.28	1.13
8	其他各项资产	83,988,144.28	2.17
9	合计	3,878,883,808.94	100.00

注：其他资产包括：存出保证金、应收利息（股利）、应收证券清算款、应收申购款、待摊费用、其他应收款。

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	36,453.01	0.00
B	采矿业	50,361,424.64	1.49
C	制造业	953,840,241.73	28.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,172,116.15	0.45
E	建筑业	18,158,079.41	0.54
F	批发和零售业	1,366,535.09	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	45,793,561.06	1.36
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,788,758.95	0.08
J	金融业	400,391.58	0.01
K	房地产业	51,579,000.00	1.53
L	租赁和商务服务业	19,241.25	0.00
M	科学研究和技术服务业	1,303,818.57	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	449,025.97	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	201,605.64	0.01
R	文化、体育和娱乐业	215,228.18	0.01
S	综合	26,160,480.00	0.78
	合计	1,167,850,569.23	34.60

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

### 8.3 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	002466	天齐锂业	845,951	90,516,757.00	2.68
2	002384	东山精密	2,600,000	70,460,000.00	2.09
3	300014	亿纬锂能	450,000	53,181,000.00	1.58
4	300037	新宙邦	465,000	52,545,000.00	1.56
5	600048	保利发展	3,300,000	51,579,000.00	1.53
6	000636	风华高科	1,600,000	47,680,000.00	1.41
7	002192	融捷股份	360,000	46,854,000.00	1.39
8	603179	新泉股份	1,059,854	45,870,481.12	1.36
9	601111	中国国航	4,999,901	45,649,096.13	1.35
10	000568	泸州老窖	170,000	43,157,900.00	1.28
11	002937	兴瑞科技	2,000,000	40,320,000.00	1.19
12	002709	天赐材料	329,974	37,831,519.10	1.12
13	300726	宏达电子	340,000	34,020,400.00	1.01
14	600111	北方稀土	710,000	32,518,000.00	0.96
15	600893	航发动力	490,000	31,095,400.00	0.92
16	002025	航天电器	350,000	29,382,500.00	0.87
17	003022	联泓新科	670,000	24,414,800.00	0.72
18	601966	玲珑轮胎	659,974	24,122,049.70	0.71
19	688599	天合光能	300,000	23,670,000.00	0.70
20	002984	森麒麟	600,000	21,342,000.00	0.63
21	600585	海螺水泥	500,000	20,150,000.00	0.60
22	601117	中国化学	1,500,000	18,000,000.00	0.53
23	002129	中环股份	420,000	17,535,000.00	0.52
24	688005	容百科技	150,000	17,337,000.00	0.51
25	603985	恒润股份	300,000	16,026,000.00	0.47
26	603005	晶方科技	289,940	15,972,794.60	0.47
27	600809	山西汾酒	50,000	15,789,000.00	0.47

28	600141	兴发集团	400,000	15,152,000.00	0.45
29	000738	航发控制	500,000	15,140,000.00	0.45
30	600905	三峡能源	2,000,000	15,020,000.00	0.45
31	300443	金雷股份	260,000	15,017,600.00	0.44
32	002340	格林美	1,300,000	13,455,000.00	0.40
33	000009	中国宝安	920,000	13,275,600.00	0.39
34	600673	东阳光	1,451,000	12,884,880.00	0.38
35	601231	环旭电子	700,000	11,242,000.00	0.33
36	000657	中钨高新	500,000	8,040,000.00	0.24
37	002138	顺络电子	200,000	7,636,000.00	0.23
38	000768	中航西飞	200,000	7,300,000.00	0.22
39	000792	盐湖股份	200,000	7,078,000.00	0.21
40	600110	诺德股份	400,000	6,380,000.00	0.19
41	300568	星源材质	100,000	3,673,000.00	0.11
42	603788	宁波高发	250,000	3,570,000.00	0.11
43	000552	靖远煤电	1,000,000	3,450,000.00	0.10
44	002460	赣锋锂业	20,000	2,857,000.00	0.08
45	600989	宝丰能源	150,000	2,604,000.00	0.08
46	603185	上机数控	12,000	2,003,760.00	0.06
47	600096	云天化	100,000	1,962,000.00	0.06
48	688303	大全能源	30,456	1,842,892.56	0.05
49	300243	瑞丰高材	99,913	1,331,840.29	0.04
50	688032	禾迈股份	1,810	1,274,221.90	0.04
51	688082	盛美上海	9,337	1,193,268.60	0.04
52	688186	广大特材	25,000	1,115,250.00	0.03
53	301177	迪阿股份	7,920	999,187.20	0.03
54	688680	海优新材	2,795	853,313.50	0.03
55	688232	新点软件	18,893	820,900.85	0.02
56	688739	成大生物	9,882	752,316.66	0.02
57	688050	爱博医疗	3,520	740,009.60	0.02
58	688256	寒武纪	6,894	655,619.40	0.02
59	688105	诺唯赞	6,180	655,080.00	0.02
60	688586	江航装备	16,436	557,180.40	0.02
61	688778	厦钨新能	5,075	511,255.50	0.02
62	688027	国盾量子	2,830	490,722.00	0.01
63	688112	鼎阳科技	4,901	480,199.98	0.01
64	300999	金龙鱼	7,177	451,648.61	0.01
65	688151	华强科技	12,238	443,994.64	0.01
66	688167	炬光科技	2,014	441,066.00	0.01
67	688508	芯朋微	3,729	432,041.94	0.01
68	688789	宏华数科	1,400	366,534.00	0.01
69	300896	爱美客	648	347,399.28	0.01
70	688211	中科微至	4,501	337,575.00	0.01
71	688192	迪哲医药	8,926	330,351.26	0.01

72	688665	四方光电	1,687	302,344.14	0.01
73	688553	汇宇制药	8,928	300,248.64	0.01
74	688639	华恒生物	2,302	297,533.50	0.01
75	688776	国光电气	1,447	282,787.21	0.01
76	301039	中集车辆	20,640	264,150.72	0.01
77	301189	奥尼电子	4,345	259,307.90	0.01
78	688269	凯立新材	1,941	242,625.00	0.01
79	688087	英科再生	2,469	233,221.74	0.01
80	301096	百诚医药	2,714	231,152.38	0.01
81	688206	概伦电子	6,000	220,140.00	0.01
82	301100	风光股份	5,985	218,204.16	0.01
83	301093	华兰股份	4,088	212,432.45	0.01
84	688700	东威科技	3,049	207,636.90	0.01
85	688667	菱电电控	1,191	205,030.65	0.01
86	301060	兰卫医学	5,869	201,605.64	0.01
87	300994	久祺股份	4,195	198,854.50	0.01
88	301168	通灵股份	3,281	194,447.89	0.01
89	688051	佳华科技	4,053	193,530.75	0.01
90	301118	恒光股份	3,142	190,856.65	0.01
91	301088	戎美股份	7,036	181,366.48	0.01
92	301091	深城交	5,240	171,845.80	0.01
93	605117	德业股份	627	171,666.33	0.01
94	688670	金迪克	2,310	171,194.10	0.01
95	688677	海泰新光	1,768	166,368.80	0.00
96	301179	泽宇智能	2,941	161,592.01	0.00
97	688091	上海谊众	3,294	147,834.72	0.00
98	688377	迪威尔	7,894	146,907.34	0.00
99	688661	和林微纳	1,452	146,013.12	0.00
100	688345	博力威	2,332	138,987.20	0.00
101	688678	福立旺	4,198	137,652.42	0.00
102	688338	赛科希德	3,041	135,719.83	0.00
103	301020	密封科技	4,210	130,084.79	0.00
104	688698	伟创电气	4,751	127,421.82	0.00
105	688669	聚石化学	2,681	125,872.95	0.00
106	301092	争光股份	3,230	124,293.63	0.00
107	605499	东鹏饮料	632	114,922.88	0.00
108	301048	金鹰重工	8,424	114,557.55	0.00
109	688236	春立医疗	4,052	110,984.28	0.00
110	688296	和达科技	2,173	110,388.40	0.00
111	688103	国力股份	1,595	105,429.50	0.00
112	601825	沪农商行	15,480	104,490.00	0.00
113	300922	天秦装备	2,863	104,213.20	0.00
114	301182	凯旺科技	2,932	103,061.60	0.00
115	301155	海力风电	1,054	101,974.50	0.00

116	688768	容知日新	907	101,130.50	0.00
117	301028	东亚机械	7,329	100,722.42	0.00
118	688216	气派科技	2,000	99,300.00	0.00
119	688611	杭州柯林	1,400	99,078.00	0.00
120	688697	纽威数控	5,837	98,295.08	0.00
121	300774	倍杰特	4,435	97,161.52	0.00
122	600906	财达证券	7,597	96,937.72	0.00
123	688456	有研粉材	3,396	96,921.84	0.00
124	301198	喜悦智行	2,613	95,084.09	0.00
125	688210	统联精密	2,218	91,958.28	0.00
126	003035	南网能源	11,046	91,571.34	0.00
127	688718	唯赛勃	3,145	89,506.70	0.00
128	601568	北元集团	11,007	89,486.91	0.00
129	301052	果麦文化	2,520	89,331.48	0.00
130	688786	悦安新材	1,513	85,650.93	0.00
131	300920	润阳科技	2,503	85,352.30	0.00
132	301098	金埔园林	3,069	84,970.79	0.00
133	300979	华利集团	925	82,371.25	0.00
134	688628	优利德	2,789	81,689.81	0.00
135	688511	天微电子	1,490	81,234.80	0.00
136	301081	严牌股份	4,024	80,824.30	0.00
137	300948	冠中生态	3,229	79,175.08	0.00
138	688799	华纳药厂	1,917	78,079.41	0.00
139	688329	艾隆科技	1,846	77,698.14	0.00
140	600955	维远股份	1,694	77,297.22	0.00
141	688217	睿昂基因	1,040	75,628.80	0.00
142	688071	华依科技	1,101	72,434.79	0.00
143	688622	禾信仪器	1,204	72,179.80	0.00
144	688607	康众医疗	1,890	71,801.10	0.00
145	688314	康拓医疗	1,085	71,588.30	0.00
146	688685	迈信林	2,612	71,307.60	0.00
147	301083	百胜智能	4,160	70,270.72	0.00
148	600927	永安期货	1,859	69,749.68	0.00
149	688571	杭华股份	8,200	69,618.00	0.00
150	300861	美畅股份	889	69,137.53	0.00
151	301072	中捷精工	1,802	67,726.26	0.00
152	301049	超越科技	1,954	67,173.64	0.00
153	605589	圣泉集团	1,750	67,025.00	0.00
154	601963	重庆银行	7,472	66,500.80	0.00
155	688255	凯尔达	1,648	66,183.68	0.00
156	301056	森赫股份	5,716	65,653.80	0.00
157	301033	迈普医学	1,076	65,640.92	0.00
158	688328	深科达	1,499	65,011.63	0.00
159	301041	金百泽	2,150	63,670.10	0.00

160	301036	双乐股份	2,047	62,445.59	0.00
161	688309	恒誉环保	2,880	60,508.80	0.00
162	301007	德迈仕	3,022	60,198.24	0.00
163	688272	富吉瑞	1,263	59,651.49	0.00
164	301063	海锅股份	1,524	59,268.03	0.00
165	300854	中兰环保	2,026	58,735.01	0.00
166	001203	大中矿业	3,808	57,424.64	0.00
167	301038	深水规院	2,660	55,607.30	0.00
168	301050	雷电微力	233	54,694.42	0.00
169	003021	兆威机电	680	54,298.00	0.00
170	300995	奇德新材	1,909	52,898.39	0.00
171	301059	金三江	2,581	52,808.68	0.00
172	688618	三旺通信	1,117	49,583.63	0.00
173	300860	锋尚文化	578	48,991.28	0.00
174	301027	华蓝集团	2,856	48,631.80	0.00
175	301037	保立佳	1,923	48,157.08	0.00
176	300981	中红医疗	601	48,043.94	0.00
177	300973	立高食品	360	47,548.80	0.00
178	603529	爱玛科技	1,019	46,435.83	0.00
179	688395	正弦电气	1,627	46,304.42	0.00
180	600916	中国黄金	3,371	46,283.83	0.00
181	601156	东航物流	2,090	45,729.20	0.00
182	301068	大地海洋	1,436	43,660.68	0.00
183	301079	邵阳液压	1,396	43,352.80	0.00
184	688092	爱科科技	1,137	43,024.08	0.00
185	301057	汇隆新材	2,173	42,953.11	0.00
186	688367	工大高科	1,717	42,873.49	0.00
187	688226	威腾电气	2,693	42,791.77	0.00
188	603071	物产环能	1,627	41,098.02	0.00
189	688679	通源环境	3,139	40,273.37	0.00
190	688565	力源科技	2,464	39,916.80	0.00
191	688038	中科通达	2,132	39,911.04	0.00
192	605337	李子园	788	39,163.60	0.00
193	688501	青达环保	1,759	38,557.28	0.00
194	003009	中天火箭	623	38,482.71	0.00
195	605090	九丰能源	1,090	38,335.30	0.00
196	688681	科汇股份	1,899	38,245.86	0.00
197	601665	齐鲁银行	6,731	37,558.98	0.00
198	600935	华塑股份	4,811	36,756.04	0.00
199	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.00
200	605338	巴比食品	1,012	35,258.08	0.00
201	001213	中铁特货	5,818	35,257.08	0.00
202	688067	爱威科技	1,259	35,012.79	0.00
203	300869	康泰医学	862	34,954.10	0.00

204	605507	国邦医药	1,202	34,653.66	0.00
205	301211	亨迪药业	967	32,539.55	0.00
206	003039	顺控发展	1,024	31,774.72	0.00
207	688701	卓锦股份	2,340	31,590.00	0.00
208	003012	东鹏控股	2,278	31,254.16	0.00
209	301090	华润材料	2,764	31,012.08	0.00
210	601921	浙版传媒	3,154	30,373.02	0.00
211	300900	广联航空	879	30,193.65	0.00
212	603230	内蒙新华	1,140	29,491.80	0.00
213	300872	天阳科技	871	29,056.56	0.00
214	605339	南侨食品	863	28,755.16	0.00
215	003038	鑫铂股份	383	28,330.51	0.00
216	605555	德昌股份	655	26,724.00	0.00
217	300871	回盛生物	927	26,400.96	0.00
218	605020	永和股份	850	26,095.00	0.00
219	001317	三羊马	300	25,722.00	0.00
220	300887	谱尼测试	378	25,590.60	0.00
221	300911	亿田智能	309	25,313.28	0.00
222	601528	瑞丰银行	2,230	25,154.40	0.00
223	301221	光庭信息	280	24,841.60	0.00
224	605167	利柏特	2,471	24,339.35	0.00
225	001217	华尔泰	1,239	23,925.09	0.00
226	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
227	300873	海晨股份	484	23,764.40	0.00
228	300982	苏文电能	317	23,328.03	0.00
229	605296	神农集团	569	22,936.39	0.00
230	603171	税友股份	637	22,422.40	0.00
231	605268	王力安防	1,642	21,066.86	0.00
232	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.00
233	001216	华瓷股份	1,177	19,667.67	0.00
234	603836	海程邦达	733	19,241.25	0.00
235	300932	三友联众	492	18,745.20	0.00
236	603213	镇洋发展	799	18,504.84	0.00
237	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
238	300891	惠云钛业	1,143	18,299.43	0.00
239	605286	同力日升	597	17,850.30	0.00
240	605133	嵘泰股份	618	17,742.78	0.00
241	605162	新中港	1,377	17,570.52	0.00
242	605056	咸亨国际	933	17,521.74	0.00
243	003016	欣贺股份	1,681	17,516.02	0.00
244	605368	蓝天燃气	1,204	17,397.80	0.00
245	300925	法本信息	600	17,292.00	0.00
246	001215	千味央厨	295	17,171.95	0.00
247	300986	志特新材	264	16,898.64	0.00

248	605208	永茂泰	801	16,861.05	0.00
249	300909	汇创达	386	16,617.30	0.00
250	300997	欢乐家	928	16,082.24	0.00
251	300968	格林精密	1,162	15,977.50	0.00
252	605122	四方新材	703	15,922.95	0.00
253	300893	松原股份	414	15,876.90	0.00
254	605018	长华股份	840	15,859.20	0.00
255	300614	百川畅银	329	15,792.00	0.00
256	605016	百龙创园	445	15,623.95	0.00
257	300868	杰美特	593	15,275.68	0.00
258	001218	丽臣实业	350	15,267.00	0.00
259	601279	英利汽车	2,004	15,210.36	0.00
260	605289	罗曼股份	379	15,197.90	0.00
261	605005	合兴股份	634	15,082.86	0.00
262	003029	吉大正元	716	15,071.80	0.00
263	301108	洁雅股份	280	15,038.80	0.00
264	605060	联德股份	883	15,011.00	0.00
265	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
266	001207	联科科技	682	14,922.16	0.00
267	001206	依依股份	321	14,894.40	0.00
268	301009	可靠股份	801	14,778.45	0.00
269	300877	金春股份	569	14,458.29	0.00
270	300884	狄耐克	748	14,376.56	0.00
271	605028	世茂能源	615	14,329.50	0.00
272	300864	南大环境	315	14,304.15	0.00
273	003025	思进智能	425	14,275.75	0.00
274	301015	百洋医药	462	13,998.60	0.00
275	001205	盛航股份	577	13,992.25	0.00
276	605058	澳弘电子	548	13,952.08	0.00
277	003037	三和管桩	1,274	13,912.08	0.00
278	300895	铜牛信息	339	13,807.47	0.00
279	605500	森林包装	762	13,754.10	0.00
280	300933	中辰股份	1,112	13,588.64	0.00
281	300967	晓鸣股份	507	13,516.62	0.00
282	603048	浙江黎明	464	13,456.00	0.00
283	605567	春雪食品	629	13,397.70	0.00
284	605566	福莱茵特	435	13,350.15	0.00
285	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.00
286	605599	菜百股份	980	13,190.80	0.00
287	603511	爱慕股份	553	13,117.16	0.00
288	605319	无锡振华	764	12,957.44	0.00
289	003030	祖名股份	480	12,475.20	0.00
290	605365	立达信	645	12,364.65	0.00
291	300996	普联软件	385	12,162.15	0.00

292	603112	华翔股份	920	12,144.00	0.00
293	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
294	300943	春晖智控	255	11,801.40	0.00
295	300993	玉马遮阳	410	11,771.10	0.00
296	300966	共同药业	286	11,731.72	0.00
297	300987	川网传媒	301	11,678.80	0.00
298	002998	优彩资源	1,353	11,635.80	0.00
299	003001	中岩大地	560	11,519.20	0.00
300	300962	中金辐照	576	11,422.08	0.00
301	605033	美邦股份	423	11,298.33	0.00
302	605228	神通科技	1,217	11,281.59	0.00
303	605488	福莱新材	416	11,119.68	0.00
304	300937	药易购	244	11,114.20	0.00
305	605011	杭州热电	525	11,056.50	0.00
306	001210	金房节能	311	11,037.39	0.00
307	300892	品渥食品	272	11,021.44	0.00
308	300940	南极光	307	10,907.71	0.00
309	003042	中农联合	420	10,878.00	0.00
310	300918	南山智尚	1,063	10,874.49	0.00
311	003002	壶化股份	921	10,830.96	0.00
312	301002	崧盛股份	201	10,813.80	0.00
313	300882	万胜智能	572	10,759.32	0.00
314	605189	富春染织	422	10,625.96	0.00
315	605580	恒盛能源	654	10,614.42	0.00
316	300876	蒙泰高新	350	10,594.50	0.00
317	301011	华立科技	175	10,535.00	0.00
318	603219	富佳股份	528	10,449.12	0.00
319	300945	曼卡龙	474	9,968.22	0.00
320	605259	绿田机械	295	9,838.25	0.00
321	300971	博亚精工	245	9,787.75	0.00
322	001288	运机集团	537	9,563.97	0.00
323	605303	园林股份	610	9,540.40	0.00
324	300889	爱克股份	479	9,263.86	0.00
325	300879	大叶股份	466	9,212.82	0.00
326	300950	德固特	219	9,143.25	0.00
327	605055	迎丰股份	1,146	9,053.40	0.00
328	605598	上海港湾	553	8,809.29	0.00
329	001209	洪兴股份	321	8,756.88	0.00
330	605138	盛泰集团	723	8,733.84	0.00
331	003041	真爱美家	349	8,690.10	0.00
332	605577	龙版传媒	588	8,625.96	0.00
333	300975	商络电子	492	8,575.56	0.00
334	300926	博俊科技	359	8,544.20	0.00
335	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00

336	300991	创益通	254	8,359.14	0.00
337	001219	青岛食品	272	8,323.20	0.00
338	003004	声迅股份	306	8,301.78	0.00
339	300881	盛德鑫泰	291	8,081.07	0.00
340	300956	英力股份	371	7,965.37	0.00
341	300952	恒辉安防	340	7,956.00	0.00
342	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
343	300931	通用电梯	672	7,808.64	0.00
344	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
345	605298	必得科技	391	7,397.72	0.00
346	300927	江天化学	217	7,354.13	0.00
347	300963	中洲特材	283	6,888.22	0.00
348	300998	宁波方正	201	6,699.33	0.00
349	300960	通业科技	234	5,833.62	0.00
350	300886	华业香料	191	5,794.94	0.00
351	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
352	300992	泰福泵业	200	4,950.00	0.00
353	300929	华骐环保	183	4,904.40	0.00
354	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
355	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
356	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
357	002773	康弘药业	135	2,747.25	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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	002466	天齐锂业	283,942,881.36	19.38
2	600188	兖矿能源	153,521,459.03	10.48
3	300014	亿纬锂能	125,111,066.62	8.54
4	300568	星源材质	115,762,486.69	7.90
5	688005	容百科技	110,105,550.86	7.51
6	600048	保利发展	107,215,961.95	7.32
7	601001	晋控煤业	98,541,511.29	6.72
8	002709	天赐材料	97,093,656.05	6.63
9	300037	新宙邦	85,468,032.67	5.83
10	600030	中信证券	85,413,316.91	5.83
11	600111	北方稀土	70,928,891.89	4.84
12	000683	远兴能源	69,173,860.61	4.72

13	002384	东山精密	68,040,403.01	4.64
14	000636	风华高科	65,339,787.93	4.46
15	688599	天合光能	63,238,429.40	4.32
16	603799	华友钴业	58,237,282.44	3.97
17	002192	融捷股份	55,157,327.76	3.76
18	000807	云铝股份	54,584,501.92	3.72
19	601111	中国国航	54,244,590.06	3.70
20	002206	海利得	49,817,962.67	3.40
21	601966	玲珑轮胎	47,130,248.17	3.22
22	000933	神火股份	46,489,972.90	3.17
23	601600	中国铝业	46,032,435.90	3.14
24	600141	兴发集团	45,230,523.52	3.09
25	603179	新泉股份	44,378,618.46	3.03
26	601318	中国平安	43,741,000.93	2.98
27	601166	兴业银行	43,464,366.00	2.97
28	000568	泸州老窖	42,618,352.40	2.91
29	002937	兴瑞科技	42,494,916.83	2.90
30	603348	文灿股份	42,428,064.35	2.90
31	000783	长江证券	41,487,032.32	2.83
32	600893	航发动力	40,588,042.80	2.77
33	688128	中国电研	39,120,272.63	2.67
34	601658	邮储银行	38,705,014.67	2.64
35	601899	紫金矿业	38,228,068.43	2.61
36	000725	京东方 A	35,993,630.00	2.46
37	601555	东吴证券	35,988,986.58	2.46
38	300726	宏达电子	35,868,401.90	2.45
39	601168	西部矿业	35,630,581.00	2.43
40	601888	中国中免	35,585,676.00	2.43
41	300059	东方财富	35,574,243.80	2.43
42	600596	新安股份	35,546,769.00	2.43
43	000301	东方盛虹	34,358,950.00	2.34
44	300657	弘信电子	34,148,605.76	2.33
45	600166	福田汽车	33,852,180.00	2.31
46	300816	艾可蓝	33,313,629.00	2.27
47	300601	康泰生物	32,535,782.00	2.22
48	601388	怡球资源	30,316,103.98	2.07
49	600782	新钢股份	29,717,463.00	2.03

## 8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	002466	天齐锂业	245,496,741.31	16.75
2	600188	兖矿能源	172,668,309.44	11.78
3	688005	容百科技	133,695,653.08	9.12
4	300568	星源材质	111,910,346.40	7.64
5	600030	中信证券	83,423,238.80	5.69
6	300014	亿纬锂能	82,237,773.14	5.61
7	600966	博汇纸业	78,198,761.63	5.34
8	603799	华友钴业	77,608,616.75	5.30
9	601001	晋控煤业	75,210,130.13	5.13
10	002709	天赐材料	75,015,365.65	5.12
11	601318	中国平安	72,417,942.31	4.94
12	600048	保利发展	68,859,192.39	4.70
13	000683	远兴能源	65,313,926.29	4.46
14	000807	云铝股份	64,777,100.15	4.42
15	000933	神火股份	62,238,861.92	4.25
16	000725	京东方 A	56,832,215.83	3.88
17	002206	海利得	56,530,871.02	3.86
18	688599	天合光能	56,287,174.55	3.84
19	601166	兴业银行	55,740,980.20	3.80
20	601966	玲珑轮胎	53,564,113.49	3.66
21	603348	文灿股份	49,085,167.30	3.35
22	300037	新宙邦	48,686,052.22	3.32
23	600111	北方稀土	46,494,679.38	3.17
24	000895	双汇发展	45,496,573.00	3.10
25	002850	科达利	43,994,346.89	3.00
26	601600	中国铝业	43,750,566.14	2.99
27	688128	中国电研	41,502,567.48	2.83
28	600166	福田汽车	41,113,266.07	2.81
29	601899	紫金矿业	40,439,947.69	2.76
30	000783	长江证券	39,653,044.42	2.71
31	600782	新钢股份	39,400,083.00	2.69
32	300059	东方财富	38,821,923.56	2.65
33	600036	招商银行	38,140,917.26	2.60
34	601168	西部矿业	37,869,812.67	2.58
35	601555	东吴证券	36,953,597.54	2.52
36	300035	中科电气	36,785,551.00	2.51
37	601658	邮储银行	36,587,630.69	2.50
38	300890	翔丰华	36,550,939.46	2.49
39	300382	斯莱克	34,295,399.22	2.34
40	601916	浙商银行	34,256,948.12	2.34
41	300816	艾可蓝	33,222,006.00	2.27
42	600497	驰宏锌锗	32,754,631.00	2.24

43	000703	恒逸石化	32,403,723.57	2.21
44	002064	华峰化学	31,982,569.72	2.18
45	000902	新洋丰	31,115,950.00	2.12
46	002895	川恒股份	30,183,853.00	2.06
47	300601	康泰生物	30,105,944.93	2.05
48	601888	中国中免	29,938,755.00	2.04
49	600596	新安股份	29,530,890.75	2.02
50	300657	弘信电子	29,393,476.15	2.01

#### 8.4.3 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	5,205,839,971.92
卖出股票收入（成交）总额	4,776,776,050.41

#### 8.5 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	1,679,903,000.00	49.77
	其中：政策性金融债	288,284,000.00	8.54
4	企业债券	40,222,000.00	1.19
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	354,354,150.00	10.50
7	可转债（可交换债）	41,018,141.15	1.22
8	同业存单	467,570,000.00	13.85
9	其他	-	-
10	合计	2,583,067,291.15	76.53

#### 8.6 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	112110387	21 兴业银行 CD387	2,000,000.00	194,820,000.00	5.77
2	210210	21 国开 10	1,300,000.00	132,808,000.00	3.93
3	2028032	20 农业银行永续债 02	1,000,000.00	104,460,000.00	3.09
4	1928001	19 中国银行永续债 01	1,000,000.00	103,810,000.00	3.08
5	2128021	21 工商银行永续债 01	1,000,000.00	103,040,000.00	3.05

### 8.7 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。

### 8.8 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

#### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 8.12 本报告期投资基金情况

### 8.12.1 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

本基金本报告期末未投资基金。

## 8.13 投资组合报告附注

8.13.1 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因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定等未依法履行其他职责等行为，于 2021 年 8 月 20 日被中国人民银行公开处罚，罚款 5 万元。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

本基金投资的前十名证券的发行主体之一的国家开发银行因为违规的政府购买服务项目提供融资等未依法履行其他职责的行为，于 2021 年 1 月 8 日被中国银行保险监督管理委员会公开处罚，罚款 4880 万元。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

本基金投资的前十名证券的发行主体之一的中国农业银行股份有限公司因侵害客户自主选择权等未依法履行其他职责等行为，于 2021 年 12 月 14 日被中国银行保险监督管理委员会公开处罚，罚款 150 万元；因发生重要信息系统突发事件未报告等未依法履行其他职责等行为，于 2021 年 1 月 29 日被中国银行保险监督管理委员会公开处罚，罚款 420 万元。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

本基金投资的前十名证券的发行主体之一的中国银行股份有限公司因向未纳入预算的政府购买服务项目发放贷款等未依法履行其他职责行为，于 2021 年 5 月 21 日被中国银行保险监督管理委员会公开处罚，罚没 8761.355 万元。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

本基金投资的前十名证券的发行主体之一的海通证券股份有限公司因未充分履行持续督导义务，涉嫌存在未能勤勉尽责情形等未及时披露公司重大事项，未依法履行其他职责的行为，于 2021 年 10 月 15 日被中国证券监督管理委员会重庆监管局责令改正，公开处罚，没收财务顾问业务收入 100 万元，并处以 300 万元罚款；因在开展部分投资顾问、私募资产管理业务过程中，未按照审慎经营原则，有效控制和防范风险等未依法履行其他职责行为，于 2021 年 3 月 31 日被中国证券监督管理委员会上海监管局处以暂停受理或办理业务等监管措施。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

本基金投资的前十名证券的发行主体之一的中国工商银行股份有限公司因未按规定将案件风险事件确认为案件并报送案件信息确认报告等未依法履行其他职责的行为，于 2021 年 1 月 8 日被中国银行保险监督管理委员会公开处罚，罚款 5470 万元。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

8.13.2 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。

### 8.13.3 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	1,285,081.10
2	应收证券清算款	43,950,863.64
3	应收股利	-
4	应收利息	38,752,199.54
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	83,988,144.28

## 8.13.4 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	110079	杭银转债	6,227,000.00	0.18
2	127027	靖远转债	27,787,928.30	0.82
3	127032	苏行转债	4,250,677.20	0.13

## 8.13.5 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。

## 8.13.6 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。

## §9 基金份额持有人信息

## 9.1 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	户均持有的	持有人结构
------	------	-------	-------

	数(户)	基金份额	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	14,557	178,977.80	0.00	0.00%	2,605,379,902. 96	100.00 %
金鹰民安回报定 开 C	1,809	148,998.03	0.00	0.00%	269,537,430.08	100.00 %
合计	16,366	175,664.02	0.00	0.00%	2,874,917,333. 04	100.00 %

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

本基金非上市基金。

## 9.3 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	833,335.99	0.03%
	金鹰民安回报定开 C	42,987.21	0.02%
	合计	876,323.20	0.03%

## 9.4 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	0~10
	金鹰民安回报定开 C	0
	合计	0~10
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

## 9.5 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金非发起式基金。

## § 10 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
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	2,172,549,646.20	228,350,031.80
减：本报告期基金总赎回份额	700,463,454.38	82,212,262.35
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,605,379,902.96	269,537,430.08

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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；2021 年 9 月 2 日，牟敦国先生担任公司副总经理；2022 年 3 月 5 日，王铁先生离任公司董事长，姚文强先生离任公司总经理并担任公司董事长，周蔚女士离任公司常务副总经理并担任公司总经理。2022 年 3 月 19 日，公司法定代表人由王铁先生变更为姚文强先生，姚文强先生离任公司首席信息官，刘盛先生离任公司督察长并担任公司副总经理兼首席信息官，凡湘平先生担任督察长职务。截至报告日，姚文强先生担任公司董事长、法定代表人，周蔚女士担任公司总经理，耿源先生担任公司副总经理，牟敦国先生担任公司副总经理，刘盛先生担任公司副总经理兼首席信息官，凡湘平先生担任公司督察长职务。

2、本基金托管人中国民生银行股份有限公司于 2021 年 11 月 19 日公告，根据工作需要，任命崔岩女士担任本公司资产托管部总经理，负责资产托管部相关工作。

### 11.3 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。

#### 11.4 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。

#### 11.5 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。

#### 11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金审计的会计师事务所为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），已为本基金提供 3 年审计服务。

本报告期内实际应支付会计师事务所的审计费为 45000 元。

#### 11.7 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，基金管理人和托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

本报告期，中国证券监督管理委员会广东监管局对公司进行了现场检查，并对公司及相关人员的投资运作提出了监管要求，公司已及时按要求执行。

#### 11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 11.8.1 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	4,434,319,350.77	45.36%	3,154,117.98	40.43%	-
太平洋证券	2	4,237,211,944.47	43.34%	3,861,366.16	49.50%	-
东兴证券	2	841,374,083.20	8.61%	598,464.85	7.67%	-
东吴证券	1	262,991,564.54	2.69%	187,061.79	2.40%	-
民生证券	2	-	-	-	-	-

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。

### 11.8.2 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		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	1,654,459,143.03	45.81%	22,946,100,000.00	34.30%	-	-
太平洋证券	1,542,495,610.19	42.71%	30,225,787,000.00	45.18%	-	-
东兴证券	369,618,211.11	10.24%	9,286,000,000.00	13.88%	-	-
东吴证券	24,693,487.50	0.68%	4,441,000,000.00	6.64%	-	-
民生证券	20,000,000.00	0.55%	-	-	-	-

### 11.9 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	证监会规定媒介	2021-01-21
4	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
5	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
6	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增玄	证监会规定媒介	2021-03-08

	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		
7	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
8	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
9	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	证监会规定媒介	2021-03-30
10	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	证监会规定媒介	2021-04-21
11	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	证监会规定媒介	2021-04-21
12	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	证监会规定媒介	2021-04-28
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	证监会规定媒介	2021-05-11
14	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	2021-05-14
15	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	证监会规定媒介	2021-05-19
16	金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金 A 类份额基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2021-06-03
17	金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金 C 类份额基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2021-06-03
18	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	证监会规定媒介	2021-06-03
19	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	证监会规定媒介	2021-06-03
20	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	证监会规定媒介	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招募说明书更新	证监会规定媒介	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基金合同更新	证监会规定媒介	2021-06-03
23	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	证监会规定媒介	2021-06-03
24	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	证监会规定媒介	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	证监会规定媒介	2021-06-10

	开通基金转换、基金定投业务及费率优惠的公告		
26	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	证监会规定媒介	2021-06-25
27	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增招赢通为代销机构的公告	证监会规定媒介	2021-07-13
28	金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金 2021 年二季度报告	证监会规定媒介	2021-07-20
29	金鹰基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年第二季度报告提示性公告	证监会规定媒介	2021-07-20
30	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增上海万得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	证监会规定媒介	2021-07-26
31	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与嘉实财富费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2021-07-28
32	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	2021-07-28
33	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	2021-07-28
34	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	2021-07-29
35	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与盈米基金费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2021-07-30
36	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增招赢通为代销机构的公告	证监会规定媒介	2021-08-25
37	金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金 2021 年中期报告	证监会规定媒介	2021-08-28
38	金鹰基金管理有限公司旗下基金 2021 年中期报告提示性公告	证监会规定媒介	2021-08-28
39	金鹰基金管理有限公司金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金开放日常申购(赎回、转换)业务公告	证监会规定媒介	2021-08-30
40	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	2021-09-02
41	金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金分红公告	证监会规定媒介	2021-09-06
42	金鹰基金管理有限公司新增交通银行为金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金代销机构的公告	证监会规定媒介	2021-09-13
43	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增天风证券股份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	2021-09-16
44	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增泰	证监会规定媒介	2021-09-17

	信财富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		
45	金鹰基金管理有限公司关于金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金暂停大额申购（转换转入）公告	证监会规定媒介	2021-09-17
46	金鹰基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年第三季度报告提示性公告	证监会规定媒介	2021-10-26
47	金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金 2021 年第三季度报告	证监会规定媒介	2021-10-26
48	金鹰基金管理有限公司关于设立海南分公司的公告	证监会规定媒介	2021-10-26
49	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	2021-11-03
50	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增国信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	证监会规定媒介	2021-11-05
51	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增北京度小满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	证监会规定媒介	2021-11-09
52	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	2021-12-07
53	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增上海爱建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	证监会规定媒介	2021-12-21
54	金鹰基金管理有限公司网上交易、微信理财宝系统维护暂停使用公告	证监会规定媒介	2021-12-24
55	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	证监会规定媒介	2021-12-30

注：相关信息披露文件请登录本基金管理人网站查询。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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规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。

### 13.2 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

### 13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅或按工本费购买复印件，也可登录本基金管理人网站查阅，本基金管理人网址：<http://www.gefund.com.cn>。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人客户服务中心，客户服务中心电话：4006-135-888 或 020-83936180。

金鹰基金管理有限公司

二〇二二年三月三十日