

金鹰灵活配置混合型证券投资基金

2022 年第 1 季度报告

2022 年 3 月 31 日

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年四月二十二日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 4 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金鹰灵活配置混合
基金主代码	210010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 6 日
报告期末基金份额总额	390,927,914.89 份
投资目标	本基金在有效控制风险并保持良好流动性的前提下，通过对股票、固定收益和现金类等资产的积极灵活配置，力争使基金份额持有人获得超额收益与长期资本增值。
投资策略	本基金从宏观面、政策面、基本面和资金面等四个纬度进行综合分析，主动判断市场时机，在严格控制投资组合风险的前提下，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票类资产、固定收益类资产、现

	金类资产等各类资产类别上的投资比例，最大限度的提高收益。	
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中高等风险水平的投资品种。	
基金管理人	金鹰基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	金鹰灵活配置混合 A 类	金鹰灵活配置混合 C 类
下属分级基金的交易代码	210010	210011
报告期末下属分级基金的份额总额	154,336,140.30 份	236,591,774.59 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2022 年 1 月 1 日-2022 年 3 月 31 日)	
	金鹰灵活配置混合 A 类	金鹰灵活配置混合 C 类
1.本期已实现收益	-2,324,995.44	-3,360,696.41
2.本期利润	-15,127,994.13	-19,287,150.41
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0837	-0.0772
4.期末基金资产净值	254,256,673.97	360,782,652.64
5.期末基金份额净值	1.6474	1.5249

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额；

2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

3、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、金鹰灵活配置混合 A 类：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-4.76%	0.37%	-7.04%	0.73%	2.28%	-0.36%
过去六个月	-1.92%	0.31%	-5.65%	0.59%	3.73%	-0.28%
过去一年	2.69%	0.30%	-5.72%	0.57%	8.41%	-0.27%
过去三年	36.03%	0.35%	13.00%	0.63%	23.03%	-0.28%
过去五年	60.19%	0.33%	26.76%	0.61%	33.43%	-0.28%
自基金合同生效起至今	72.93%	0.31%	16.78%	0.73%	56.15%	-0.42%

2、金鹰灵活配置混合 C 类：

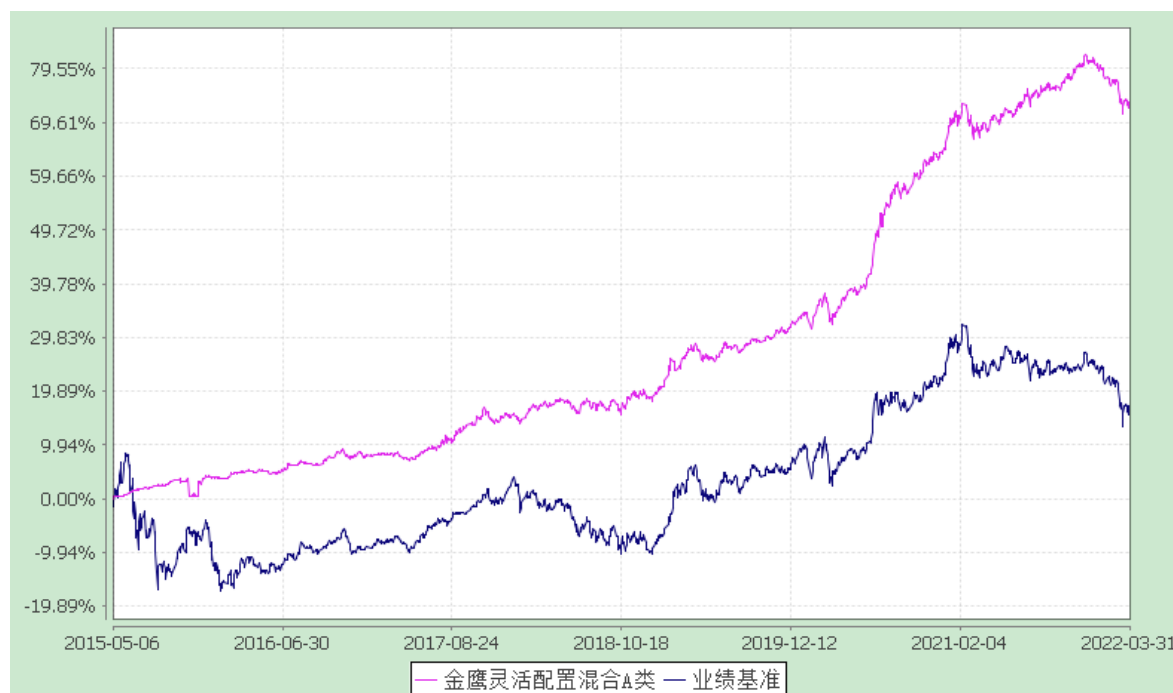
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-4.79%	0.37%	-7.04%	0.73%	2.25%	-0.36%
过去六个月	-1.99%	0.31%	-5.65%	0.59%	3.66%	-0.28%
过去一年	2.46%	0.30%	-5.72%	0.57%	8.18%	-0.27%
过去三年	34.36%	0.35%	13.00%	0.63%	21.36%	-0.28%
过去五年	55.52%	0.33%	26.76%	0.61%	28.76%	-0.28%
自基金合同生效起	58.43%	0.30%	16.78%	0.73%	41.65%	-0.43%

至今						
----	--	--	--	--	--	--

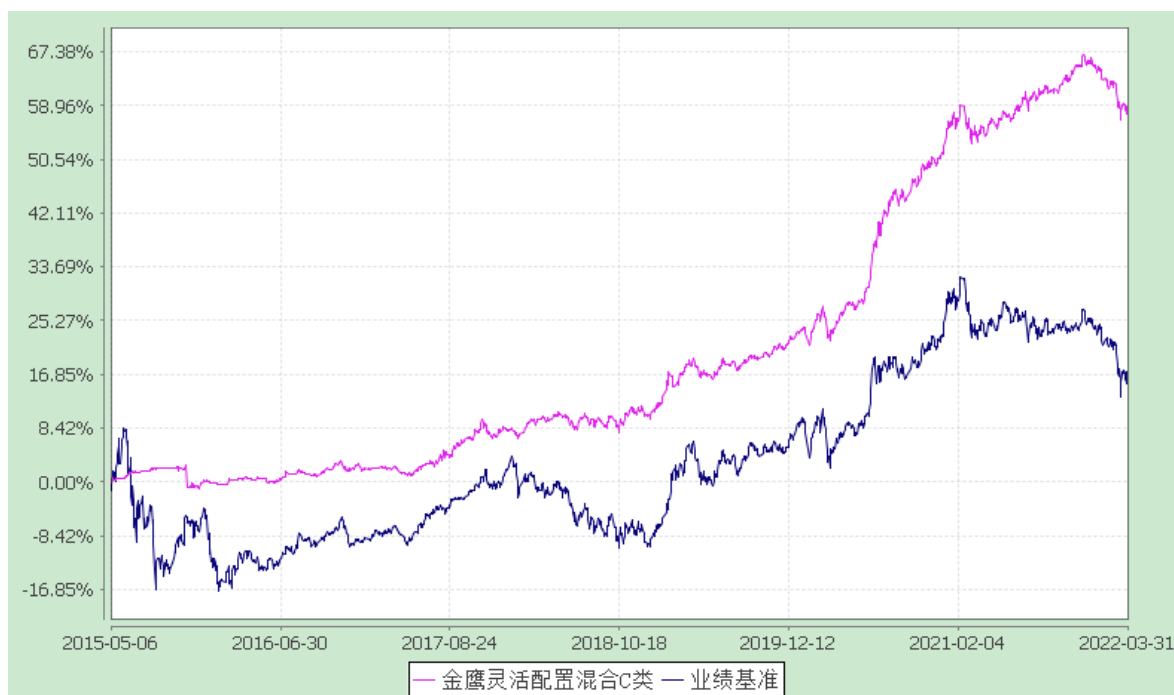
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

金鹰灵活配置混合型证券投资基金
 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
 (2015 年 5 月 6 日至 2022 年 3 月 31 日)

1. 金鹰灵活配置混合 A 类:



2. 金鹰灵活配置混合 C 类:



注：1、本基金由金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金于 2015 年 5 月 6 日转型而来；

2、截至报告日本基金的投资比例符合本基金基金合同规定，即本基金投资组合中股票资产占基金资产的比例为 0-95%，本基金每个交易日终在扣除股指期货合约需要缴纳的交易保证金后，保持现金以及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

3、本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨晓斌	本基金的基金经理	2018-04-03	-	11	杨晓斌先生，曾任银华基金管理有限公司研究员、首席宏观分析师、投资经理等职务。2018 年 2 月加入金鹰基金管理有限公司，现任权益投资部

					基金经理。
--	--	--	--	--	-------

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 报告期内本基金运作合规守信情况说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》和其他有关法律法规及其各项实施准则、本基金基金合同等法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无出现重大违法违规或违反基金合同的行为，无损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

公司通过规范的投资交易流程、完善的权限管理机制、有效的交易控制制度，确保公平交易的实施。同时通过投资交易系统内的公平交易功能执行交易，不断强化事后监控分析，以尽可能确保公平对待各投资组合。

报告期，公司对不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

年初以来股市的暴跌确实重重地挫伤了股市的情绪，导致大量绝对收益资金的被动离场，也有很多投资者对目前市场比较迷茫。本次季报我主要着眼于讨

论本轮调整的来由，并客观冷静讨论下一阶段市场的风险收益情况。回顾一下今年以来市场的变化：

首先，1 月份市场的调整，本质是资金的腾挪行为带来个别领域的调整。去年 12 月份政策开始强调稳增长以后，我们会发现很多基金经理面临的问题是，我要不要把我手上拿了很多的新能源或半导体设备等强势的品种切换一部分到受益稳增长的领域，经历了全年单边的成长股行情后，踩踏行为在开年以后会尤为明显。

到了 2 月份以后，市场的理性程度慢慢上升，稳增长政策的落实过程中，很多相关领域的需求层面上的改善是非常缓慢的，比如建筑股，1 月份炒了一波后调整回来，其实本质上在于没有收入增速上实质性的改善。市场在这样的情况下，同时发现光伏各方面的政策，包括实际的订单需求非常旺盛，通过实地调研，我们发现很多新能源领域订单保守预测今年是至少四五十的增速，乐观的话能做到翻番，它相对于很多稳增长领域是有明显的优势的，随着预期慢慢往这一块方向靠拢，2 月份的市场慢慢回到成长股相对占优这样的市场。

后来其实随着俄乌战争不断的加剧，从不相信会真正打仗，到市场预期闪电战，到后面又持续了两个星期，最近为止才慢慢淡出视野。虽然冷静思考大家都不相信俄乌战争对中国有实质性的影响，只是在俄乌战争过程中，它带来的大宗商品里材料价格上涨的预期，推升了市场对经济进入通滞胀的担忧，中国的经济结构中制造业的占比是非常高的，所以原材料价格如果上涨，无论是农产品还是能源，都会对各种制造业企业利润形成挤压，2 月底开始，我们制造业为主部分的持仓，遭受比较重的打击，但实际情况经我们调研研究，实质的冲击非常有限，但是因为市场担忧，风险偏好开始有明显的下滑，这是市场第二波的调整。

对于原材料上涨的担忧，我认为市场需要的是时间，用时间证明随着俄乌冲突消停，各种上游价格将逐步回落。本质上多数上游原料供需并不稀缺，俄铝即便不卖去西方也可以卖去别的地方，今年供需格局相对紧张的只是在部分能源领域，我们对其影响也不必过度担忧。

三月份以来，市场的担忧慢慢转向中美金融方面的割裂，担忧疫情，所以其实会发现先市场调整比较多的主要集中在龙头的海外资金，北上资金持仓比较集中的领域，像白酒、宁德，受到疫情影响的酒店、航空等，实际基本面没有大的

波动，更多反映出来是市场情绪，存量资金受到海外资金的流出影响，包括有很多绝对收益的账户的被动赎回，确实带来市场的踩踏。但与此同时，我们也能真切感受到三月份以来监管对市场的呵护态度是明确的，特别是当市场已经被悲观情绪主导后。

该组合在年初主要配置方向主要在几方面：1、具备较强业绩确定性以及增长的成长领域；2、受益于终端提价，且原材料价格回落的消费和制造领域；3、稳增长相关领域如地产和基建。但由于受到俄乌冲突以及疫情的先后影响，原材料价格均出现广谱的上涨，上游通胀对我们持仓中的第 1、2 部分均有较大的冲击，承受了较大的回撤。我们在充分评估这些外生变量对组合业绩影响的程度大小，减持了部分食品、化工制造、消费建材、光伏和汽配等持仓，增持了医药（防守）、白酒（业绩确定无成本压力）、养殖（长周期确定）、建筑（疫情战争下稳增长诉求强）、地产（疫情战争下稳增长诉求强）等，并在疫情冲击较剧烈的时期买入了部分疫情受损的品种如酒店、景区和机场。

短期的市场其实更多的是由风偏决定的，但是如果看长，其实本质上是由盈利决定的，所以其实我们往后看，要看这个市场能不能够稳定住，或者是能不能够看好，我们还是认为说要看清楚制约盈利的核心逻辑是否有变化，否则市场可能只敢买传统上游、养殖、医药、稳增长之类的少数能相对看清楚趋势的板块。

在稳增长政策态度明确的大环境下，制约上市公司盈利的核心变量主要在三方面，而整个市场赚钱效应不断恶化。目前这三个问题均处在最悲观的阶段，晴雨指数也已经持续多月处于 0 以上的位置，但凡以下三座大山如果有一座能够得到解决的苗头，股市将大概率启动，按短期可能出现变化的概率我做个排序：

①稳增长政策是否能够进一步体现在社融和基建投资持续改善，地产成交见底且明显反弹，这个也可以持续跟踪我们晴雨指数的变化。其实这方面今年以来态度已经明确，但由于 2 月份数据有波动，所以预期存在反复，也助推了 3 月份市场的调整（受益领域：短期可选消费白酒家电，后续顺周期链条）。

②沪深疫情是否能平复还是进一步扩散开，以及中期能否酝酿放开动态清零政策或者特效药根本解决本轮疫情。这导致了 3 月份各项数据消费和生产数据走弱（比如汽车和地产，包括零售端和消费电子等生产领域），前者短期内是可能出现的，后者需要决策层较强的决断力，有待观察。（受益领域：疫情受损的消

费服务领域，可选消费品，部分制造领域）

③俄乌冲突是否告一段落，中期欧美对俄罗斯的制裁撤除，美国放开页岩油资本开支，中国放开煤炭供给。这个问题是导致今年上游原材料价格持续走高的核心问题，年初我认为今年原油供需紧张可能会导致油价在 85 美元附近的高位维持，而目前超过 100 美元的过高的油价本身更多的反映了来自于俄罗斯受制裁的担忧，导致中国大面积的制造业中游和下游企业盈利被严重挤压，资金只敢在少数上游领域（包括新能源上游）抱团取暖。（受益领域：制造和成长板块）

综合上述讨论，我们认为目前阶段应维持乐观积极的心态，制约企业盈利的不确定性因素都已经逐步开始往积极的方向变化，4 月份开始市场将逐步回归到一季报改善的个股，我们关注的领域依然主要在几方面，整体可能会偏向于价值和消费，适度减持上游压力较大的制造：1、必需消费领域短期关注养殖和医药，特别是一季报较好的医药品种；2、根据稳增长政策节奏和疫情恢复进度，关注白酒、食品和出行链等受益于提价的品种，左侧关注家电和消费建材；3、逆周期地产和建筑；4、一季报业绩确定的成长领域，下一步可以观察上游价格变化配置先前跌幅较大的汽配等领域。

固收方面，今年政府工作的重心从调结构转为稳经济，逆周期政策加速出台，基建投资适度超前，房地产政策逐渐放松，宽信用预期抬头。而俄乌战争导致原油等大宗商品价格上涨，美联储加息制约货币政策进一步宽松的空间。站在当下，受疫情影响，基本面依然偏弱，信用需求不强；而货币政策保持定力，并未大水漫灌，也未调降 5 年期 LPR 刺激地产，而是希望通过创新的货币政策工具将有限的“水”直接导入实体经济。在这种情况下，债市可能没有大的机会也没有大的风险，震荡为主。信用债方面，当前各行业历史分位数都很低，整体的大板块机会很少，信用利差已经达到了 5 年前市场所期待的“信用分层”实现的阶段，多数风险与价值已经被充分定价。考虑到现阶段市场货币环境仍然相对宽松，配置需求还是较大，且供给端在整个社会融资需求回落的背景下，信用债资产供给的收缩可能还将延续一段时间，叠加信用风险事件不断机构风险偏好不可逆下降，我们还将维持中短久期高等级持仓策略。

本组合将延续打新增厚策略，权益方面主要维持底仓分散稳健+打新增厚原则，力求在保证底仓足额并稳健的基础上，争取确保尽可能获得稳定的低风险收

益。固收方面，二季度仍将有小幅政策宽松预期带来收益率下行机会，但随着通胀预期逐步抬头，以及信用扩张逐步兑现，收益率下行将逐步受阻，组合也将逐步降低组合久期至 1.2 年附近，并维持 AAA 高资质信用债的底仓配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，A 类基金份额净值为 1.6474 元，本报告期份额净值增长率为-4.76%，同期业绩比较基准增长率为-7.04%；C 类基金份额净值为 1.5249 元，本报告期份额净值增长率为-4.79%，同期业绩比较基准增长率为-7.04%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内无应当说明的预警事项。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	143,518,568.46	19.61
	其中：股票	143,518,568.46	19.61
2	固定收益投资	579,676,367.29	79.19
	其中：债券	579,676,367.29	79.19
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	6,237,433.10	0.85
7	其他各项资产	2,539,895.14	0.35

8	合计	731,972,263.99	100.00
---	----	----------------	--------

注：其他资产包括：交易保证金、应收利息、应收证券清算款、其他应收款、应收申购款、待摊费用。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	4,691,022.00	0.76
B	采矿业	705,861.32	0.11
C	制造业	96,920,546.68	15.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,060,730.12	0.66
F	批发和零售业	813,121.22	0.13
G	交通运输、仓储和邮政业	2,175,289.50	0.35
H	住宿和餐饮业	899,191.20	0.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,074,504.08	0.66
J	金融业	11,630,434.11	1.89
K	房地产业	13,390,570.00	2.18
L	租赁和商务服务业	1,616,919.00	0.26
M	科学研究和技术服务业	1,818,273.31	0.30
N	水利、环境和公共设施管理业	48,181.34	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	41,445.09	0.01
R	文化、体育和娱乐业	632,479.49	0.10
S	综合	-	-
	合计	143,518,568.46	23.33

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产 净值比例 （%）
1	600048	保利发展	464,600	8,223,420.00	1.34
2	002180	纳思达	103,472	4,422,393.28	0.72
3	603392	万泰生物	15,300	4,253,400.00	0.69
4	600519	贵州茅台	2,400	4,125,600.00	0.67
5	601117	中国化学	420,500	4,053,620.00	0.66
6	600036	招商银行	80,000	3,744,000.00	0.61
7	300750	宁德时代	6,700	3,432,410.00	0.56
8	300682	朗新科技	120,900	3,362,229.00	0.55
9	002597	金禾实业	79,100	3,118,122.00	0.51
10	002142	宁波银行	73,100	2,733,209.00	0.44

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产 净值比例(%)
1	国家债券	37,923,160.68	6.17
2	央行票据	-	-
3	金融债券	448,168,842.78	72.87
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	41,400,261.92	6.73
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	51,913,922.74	8.44
7	可转债（可交换债）	270,179.17	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	579,676,367.29	94.25

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值 (元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	019664	21 国债 16	315,000.00	31,812,713.01	5.17
2	101801227	18 京国资 MTN004	300,000.00	31,219,431.78	5.08
3	188282	21 华泰 09	300,000.00	30,971,252.06	5.04
4	1922023	19 农银租赁 绿色债	300,000.00	30,962,917.81	5.03
5	188558	21 光证 G6	300,000.00	30,568,001.10	4.97

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体之一的农银金融租赁有限公司因未按规定报送统计报表未依法履行其他职责的行为,于 2021 年 8 月 25 日被中国银行保险监督管理委员会上海监管局公开处罚,罚款 15 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信证券股份有限公司因未按规定履行客户身份识别义务、与身份不明的客户进行交易等未依法履行其他职责的行为,于 2022 年 2 月 22 日被中国人民银行深圳市中心支行公开处罚,罚款人民币 105 万元。

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光大证券股份有限公司因重大合同披露不及时、重大诉讼事项进展披露不及时等未及时披露公司重大事项的行为,于 2022 年 3 月 1 日被上海证券交易所予以通报批评;因重大合同披露不及时,重大事件进展披露不及时,业绩预告信息披露不准确、不充分,重大交易披露不完整等业绩预测结果不准确或不及时,未及时披露公司重大事项,未依法履行其他职责的行为,于 2022 年 1 月 8 日被中国证券监督管理委员会上海监管局采取出具警示函的监管措施。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民生银行股份有限公司因监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送存在违法违规等未依法履行其他职责的行为,于 2022 年 3 月 25 日被中国银行保险监督管理委员会公开处罚,罚款

490 万元；因违规为房地产企业缴纳土地出让金提供融资，未依法履行其他职责等行为，于 2021 年 7 月 16 日被中国银行保险监督管理委员会公开处罚，罚款 11450 万元。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

5.11.2 本基金本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。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	40,310.67
2	应收证券清算款	2,401,314.30
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	98,270.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,539,895.14

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113050	南银转债	183,675.80	0.03
2	118002	天合转债	86,195.20	0.01

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	金鹰灵活配置混合A 类	金鹰灵活配置混合C 类
本报告期期初基金份额总额	230,988,509.48	229,708,622.21
报告期期间基金总申购份额	23,696,030.06	64,777,896.15
减：报告期期间基金总赎回份额	100,348,399.24	57,894,743.77
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	154,336,140.30	236,591,774.59

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况**

基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

本基金非发起式基金。

§9 影响投资者决策的其他重要信息**9.1 影响投资者决策的其他重要信息**

无。

§10 备查文件目录**10.1 备查文件目录**

1、中国证监会批准金鹰灵活配置混合型证券投资基金发行及募集的文件。

- 2、《金鹰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、《金鹰灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。
- 4、金鹰基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程。
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照。

10.2 存放地点

广东省广州市天河区珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

10.3 查阅方式

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

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

金鹰基金管理有限公司
二〇二二年四月二十二日