金鹰产业整合灵活配置混合型证券投资基金

2018年第四季度报告

基金管理人:金鹰基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年一月二十一日

§1 重要提示

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

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年1月18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2018年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金鹰产业整合混合
基金主代码	001366
交易代码	001366
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月16日
报告期末基金份额总额	670,507,389.33份
投资目标	本基金在有效控制投资组合风险并保持良好流动性的前提下,努力把握宏观经济结构调整、产业发展以及产业整合的规律和特征,精选产业整合相关主题股票,重点投资于已经实现整合或具有潜在整合前景的优势企业,追求基金资产的长期持续增值。
投资策略	本基金在构建和管理基金的投资组合的过程中,以产业整合作为行业配置与个股精选的投资主线,深入挖掘受益于产业结构调整与整合的上市公司企业价值,进行长期价值投资。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%。
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于证券投资基金中较高预期收益、较高预期风险的品种,其预期风险收益水平低于股票型基金、高于债券型基金及货币市场基金。
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司

§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(2018年10月1日-2018年12月31日)
1.本期已实现收益	-20,071,091.20
2.本期利润	-75,382,493.73
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1121
4.期末基金资产净值	367,087,702.92
5.期末基金份额净值	0.547

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、期末可供分配利润,指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

4、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

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	-17.00%	1.94%	-6.41%	0.98%	-10.59%	0.96%

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

金鹰产业整合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历史走势对比图

(2015年6月16日至2018年12月31日)

注:(1)截至本报告期末,各项投资比例符合基金合同的约定;

(2)本基金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%,权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金投资于产业整合相关主题的证券不低于非现金基金资产的80%。 当法律法规的相关规定变更时,基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整;

(3)业绩比较基准:沪深300指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%。

§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		
于利强	基金经理	2015-06-16	-	9	于利强先生,复旦大学金融学学士。历任安永华明会计师事务所审计师,华禾投资管理有限公司风险投资经理,2009年加入银华基金管理有限公司,历任旅游、地产、中小盘行业研究员和银华中小盘基金经理助理,2015年1月加入金鹰基金管理有限公司,担任权益投资部副总监。现任金鹰中小盘精选证券投资基金、金鹰产业整合灵活配置混合型证券投资基金、金鹰多元策略灵活配置混合型证券投资基金、金鹰核心资源混合型证券投资基金、金鹰稳健成长混合型证券投资基金基金经理。

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颁布的《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遵规守信情况的说明

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、《金鹰产业整合灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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,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 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

随着国内经济数据的快速回落和中美贸易战的加剧,市场在10月后继续下挫,前期下跌的低估值板块走出了相对收益,受我们组合仓位较高影响,净值损失较大,报告期内组合结构基本没有变化。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2018年12月31日,基金份额净值为0.547元,本报告期份额净值增长率为-17.00%,同期业绩比较基准收益率为-6.41%。

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2019年,我们认为市场难以继续走出单边下跌的行情,全年来看筑底震荡概率较大,我们将集中精力挑选个股。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期无应预警说明事项。

§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	341,313,023.87	92.69
	其中:股票	341,313,023.87	92.69
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	26,769,256.51	7.27
7	其他各项资产	141,899.10	0.04
8	合计	368,224,179.48	100.00

注:其他各项资产包括:交易保证金、应收利息、应收证券清算款、其他应收款、应收申购款、买入返售证券。

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	8,641,127.88	2.35
B	采矿业	-	-
C	制造业	219,203,981.08	59.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	60,727.90	0.02
F	批发和零售业	10,425,009.00	2.84
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	65,113,942.15	17.74
J	金融业	50,145.80	0.01
K	房地产业	11,910,000.00	3.24
L	租赁和商务服务业	9,633,444.80	2.62
M	科学研究和技术服务业	601,949.26	0.16
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	15,672,705.00	4.27
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	341,313,023.87	92.98

5.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期内未通过港股通投资股票。

5.3 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	300357	我武生物	425,000	15,720,750.00	4.28
2	603899	晨光文具	500,000	15,125,000.00	4.12
3	601799	星宇股份	295,082	14,016,395.00	3.82
4	002563	森马服饰	1,550,000	13,826,000.00	3.77
5	002493	荣盛石化	1,350,098	13,622,488.82	3.71
6	002821	凯莱英	200,005	13,570,339.25	3.70
7	300253	卫宁健康	1,075,000	13,394,500.00	3.65
8	000661	长春高新	70,000	12,250,000.00	3.34
9	000002	万 科A	500,000	11,910,000.00	3.24
10	603605	珀莱雅	270,019	11,899,737.33	3.24

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期内未投资贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期内未投资权证。

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

本基金本报告期内未投资股指期货。

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

本基金本报告期内未投资国债期货。

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本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2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。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	135,138.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,567.20
5	应收申购款	1,193.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	141,899.10

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	674,460,641.87
报告期基金总申购份额	1,043,695.42
减:报告期基金总赎回份额	4,996,947.96
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	670,507,389.33

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
	1	2018年10月1日至2018年10月24日	135,087.00	-	1,087.00	134,000.00	19.98%
	2	2018年10月1日至2018年12月31日	202,213.36	-	-	202,213.36	30.16%

产品特有风险

本基金在报告期内,存在报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情形,可能会存在以下风险:

1)基金净值大幅波动的风险:当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时,基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券,可能造成证券价格波动,导致本基金的收益水平发生波动。同时,因巨额赎回、份额净值小数保留位数与方式、管理费及托管费等费用计提等原因,可能会导致基金份额净值出现大幅波动;

2)巨额赎回的风险:当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时,可能触发本基金巨额赎回条款,基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额;

3)流动性风险:当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时,可能导致本基金的流动性风险;

4)基金提前终止、转型或与其他基金合并的风险:当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时,可能导致在其赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元,可能导致本基金面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

5)基金规模过小导致的风险:当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时,可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。

6)份额占比较高的投资者申购申请被拒绝的风险:当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金总份额的50%时,本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金总份额50%的情况下,该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的50%,该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期,经基金管理人董事会审议通过,免去刘岩先生总经理、满黎先生副总经理职务,聘请刘志刚先生担任公司副总经理。自2018年12月5日起,公司董事长李兆廷先生代行总经理职务。上述事项已在正监会指定媒体披露。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准金鹰产业整合灵活配置混合型证券投资基金发行及募集的文件。

2、《金鹰产业整合灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

3、《金鹰产业整合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。

9.2 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

9.3 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

二〇一九年一月二十一日

金鹰多元策略灵活配置混合型证券投资基金

2018年第四季度报告

基金管理人:金鹰基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年一月二十一日

§1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年1月18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2018年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金鹰多元策略混合
基金主代码	002844
交易代码	002844
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年8月9日
报告期末基金份额总额	59,750,506.65份
投资目标	通过灵活运用多种投资策略,充分挖掘和利用市场中潜在的投资机会,力争实现基金资产的稳健回报和长期增值。
投资策略	(一)资产配置策略 本基金将从宏观面、政策面、基本面和资金面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,进行积极的资产配置,合理确定基金在股票类资产、固定收益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。 (二)股票投资策略 本基金根据不同市场环境灵活运用成长、主题、定向增发、动量、事件驱动等多种投资策略积极进行股票投资。本基金通过对以上策略的综合运用,力争实现基金资产的稳健增值。包括成长策略、主题策略、动量策略、定向增发策略、事件驱动策略等。 (三)债券投资策略 基金管理人将兼顾稳健优先的原则,在保证投资低风险的基础上谨慎投资债券市场,力图获得良好的收益。 (四)中小企业私募债券投资策略 本基金将运用基本面研究结合公司财务分析方法,对债券发行人信用风险进行分析和度量,选择风险与收益相匹配的更优品种进行投资。 (五)衍生品投资策略 基金的衍生品投资将严格遵守证监会及相关法律法规的约束,在充分评估衍生产品的风险和收益的基础上,谨慎地进行投资。 (六)资产支持证券投资策略 本基金将分析资产支持证券的资产特征,估计违约率和提前偿付比率,并利用收益率曲线和期权定价模型,对资产支持证券进行估值。
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,属于证券投资基金中较高预期收益、较高预期风险的品种,其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金、低于股票型基金。
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§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(2018年10月1日-2018年12月31日)
1.本期已实现收益	-4,487,425.42
2.本期利润	-1,450,682.92
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0242
4.期末基金资产净值	52,098,254.33
5.期末基金份额净值	0.8719

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、期末可供分配利润,指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

4、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

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	-2.60%	0.89%	-4.88%	0.82%	2.28%	0.07%

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

金鹰多元策略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历史走势对比图

(2016年8月9日至2018年12月31日)

注:(1)截至报告期末,各项资产配置比例已符合基金合同约定;

(2)本基金的业绩比较基准是:沪深30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		
于利强	基金经理	2016-09-23	-	9	于利强先生,复旦大学金融学学士。历任安永华明会计师事务所审计师,华禾投资管理有限公司风险投资经理,2009年加入银华基金管理有限公司,历任旅游、地产、中小盘行业研究员和银华中小盘基金经理助理,2015年1月加入金鹰基金管理有限公司,担任权益投资部副总监。现任金鹰中小盘精选证券投资基金、金鹰产业整合灵活配置混合型证券投资基金、金鹰多元策略灵活配置混合型证券投资基金、金鹰核心资源混合型证券投资基金、金鹰稳健成长混合型证券投资基金基金经理。

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颁布的《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遵规守信情况的说明

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

本报告期内,基金运作合法合规,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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

报告期,公司对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 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

回顾4季度,社融增速继续回落,伴随贸易战抢出口进入尾声,经济先导指标PMI回落至荣枯线之下,市场对未来经济增长展望悲观;但临近四季度末外部环境出现一些改善迹象,中美贸易磋商迎来转机,美元加息节奏受美国国内金融市场影响出现放缓预期。但股票市场主要指数仍出现较大幅回落。本基金保持了较低仓位,主要配置了食品、养殖和医药等行业。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2018年12月31日,基金份额净值为0.8719元,本报告期份额净值增长率为-2.60%,同期业绩比较基准收益率为-4.88%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2019年1季度,外部贸易战进程和内部如降税等改革措施仍是影响资本市场的主要变量,需求回落带来实体资金成本降低,同时美元加息进入尾声,中美利差回升,将带来国内货币政策进一步宽松的空间。本基金将逐步提高至中性偏高仓位,适度增加早周期行业配置,如地产、金融、家电、汽车等。

4.6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	38,358,452.79	58.30
	其中:股票	38,358,452.79	58.30
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	27,393,916.78	41.64
7	其他各项资产	41,919.91	0.06
8	合计	65,794,289.48	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。

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	5,157,460.00	9.90
B	采矿业	-	-
C	制造业	13,149,698.21	25.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	342,056.00	0.66
J	金融业	781,200.00	1.50
K	房地产业	15,812,269.49	30.35
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	3,115,779.09	5.98
S	综合	-	-
	合计	38,358,452.79	73.63

5.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期内未通过港股通投资股票。

5.3 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	300498	温氏股份	197,000	5,157,460.00	9.90
2	603711	香飘飘	231,900	4,927,875.00	9.46
3	603517	绝味食品	94,516	3,129,424.76	6.01
4	600162	香江控股	1,256,362	2,650,923.49	5.09
5	603587	地素时尚	117,000	2,572,830.00	4.94
6	601155	新城控股	106,200	2,515,878.00	4.83
7	001979	招商蛇口	121,400	2,106,290.00	4.04
8	600383	金地集团	216,800	2,085,616.00	4.00
9	600048	保利地产	175,700	2,071,503.00	3.98
10	603096	新经典	26,600	1,641,752.00	3.15

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期内未投资贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期内未投资权证。

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

本基金本报告期内未投资股指期货。

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

本基金本报告期内未投资国债期货。

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本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2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。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	35,978.06
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,632.27
5	应收申购款	309.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	41,919.91

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末无处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600162	香江控股	2,650,752.91	5.09	定增股票限售

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

本报告期期初基金份额总额	62,282,923.89
报告期基金总申购份额	777,500.75
减:报告期基金总赎回份额	3,309,917.99
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	59,750,506.65

§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

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期,经基金管理人董事会审议通过,免去刘岩先生总经理、满黎先生副总经理职务,聘请刘志刚先生担任公司副总经理。自2018年12月5日起,公司董事长李兆廷先生代行总经理职务。上述事项已在正监会指定媒体披露。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会注册的金鹰多元策略灵活配置混合型证券投资基金发行及募集的文件。

2、《金鹰多元策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

3、《金鹰多元策略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。

9.2 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

9.3 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

二〇一九年一月二十一日

金鹰货币市场证券投资基金

2018年第四季度报告

基金管理人:金鹰基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年一月二十一日

§1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年1月18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2018年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金鹰货币
基金主代码	210012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年12月7日
报告期末基金份额总额	19,495,301,047.76份
投资目标	在力求保持基金资产本金的安全性和资产高流动性的基础上,力争获得超过基金业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	本基金结合“自上而下”和“自下而上”的研究方法对各类可投资资产进行合理的配置和选择。本基金审慎考虑各类资产的收益性、流动性及风险性特征,在风险与收益的配比中,力求将各类风险降到最低,并在控制投资组合良好流动性的基础上为投资者获取稳定的收益。
业绩比较基准	税后一年期定期存款利率,即:一年期定期存款利率×(1-利息税率)。
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种,本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	金鹰货币A / 金鹰货币B
下属分级基金的交易代码	210012 / 210013
报告期末下属分级基金的份额总额	251,819,215.76份 / 19,243,481,831.99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(2018年10月1日-2018年12月31日)	
	金鹰货币A	金鹰货币B
1.本期已实现收益	1,831,842.06	157,419,319.94
2.本期利润	1,831,842.06	157,419,319.94
3.期末基金资产净值	251,819,215.76	19,243,481,831.99

注:1、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;

2、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