金鹰多元策略灵活配置混合型证券投资基金

2019年第一季度报告

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:二〇一九年四月二十日

§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4月19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2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金鹰多元策略混合
基金主代码	002344
交易代码	002344
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	42,213,400.83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 基金管理人将秉承稳健优先的原则,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 本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 (2019年1月1日-2019年3月31日)
1.本期已实现收益	9,026,068.05
2.本期利润	19,230,998.90
3.加权平均基金份额本期利润	0.3492
4.期末基金资产净值	51,936,999.46
5.期末基金份额净值	1.2303

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。

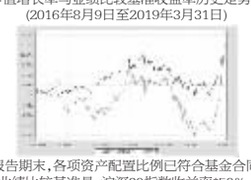
3.2 基金净值表现

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	41.11%	1.42%	14.43%	0.77%	26.68%	0.65%

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2019年3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	本基金的基金经理,公司权益投资部副总监	2016-09-23	-	10	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,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1季度,外部中美贸易谈判进展顺利,美联储加息进程超预期提前结束;内部社融增速触底回升,资金价格有所回落,流动性明显改善,整体经济预期较2018年4季度显著改善。

股票市场上,监管层面重回市场化导向激活了市场活力,风险偏好有所上升,叠加流动性改善,推动市场成交量放大,指数全线上涨,上证、深证、中小板和创业板指数分别上涨23.93%、36.84%、35.66%和35.43%,计算机、养殖、食品饮料和非银金融涨幅居前。本基金重点配置了房地产、食品、计算机和电子等行业。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,基金份额净值为1.2303元,本报告期份额净值增长率为41.11%,同期业绩比较基准收益率为14.43%。

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2季度,宏观经济见底回升的预期将进入验证阶段,新一轮减税降费将于2季度启动,有利于企业盈利回升。预计由流动性和风险偏好改善所推动的估值修复普涨行情将告一段落,本基金将保持中性偏高仓位,重点挖掘行业景气度回升和公司盈利能力回升的标的。

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	44,887,732.19	81.79
	其中:股票	44,887,732.19	81.79
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	8,790,543.19	16.02
7	其他各项资产	1,200,620.61	2.19
8	合计	54,878,795.99	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。

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	21,249,886.35	40.91
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	4,607,553.44	8.87
J	金融业	107,474.40	0.21
K	房地产业	17,151,149.00	33.02
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	1,771,669.00	3.41
S	综合	-	-
	合计	44,887,732.19	86.43

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	603711	香飘飘	142,452	4,544,218.80	8.75
2	000961	中南建设	475,684	4,518,998.00	8.70
3	601155	新城控股	98,900	4,465,335.00	8.60
4	000811	冰轮环境	382,200	3,485,664.00	6.71
5	600325	华发股份	351,700	3,263,776.00	6.28
6	603517	绝味食品	64,660	3,182,565.20	6.13
7	002174	游族网络	99,184	2,360,579.20	4.55
8	002624	完美世界	69,758	2,226,675.36	4.29
9	000671	阳光城	222,700	1,859,545.00	3.58
10	002773	康弘药业	35,600	1,812,752.00	3.49

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未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	38,562.76
2	应收证券清算款	509,963.12
3	应收股利	-
4	应收利息	2,075.97
5	应收申购款	649,918.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,200,520.61

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

本基金本期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

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	59,750,506.65
报告期基金总申购份额	2,467,173.65
减:报告期基金总赎回份额	20,004,279.47
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	42,213,400.83

§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

经广东省工商行政管理局核准,本基金管理人法定代表人已于2019年3月27日变更为刘志刚先生。

§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
二〇一九年四月二十日

金鹰货币市场证券投资基金

2019年第一季度报告

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:二〇一九年四月二十日

§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4月19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2019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	22,615,381,308.01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,力求将各类风险控制最低,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	265,122,543.22份 / 22,350,258,764.79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(2019年1月1日-2019年3月31日)	
	金鹰货币A	金鹰货币B
1.本期已实现收益	2,723,016.30	156,046,851.97
2.本期利润	2,723,016.30	156,046,851.97
3.期末基金资产净值	265,122,543.22	22,350,258,764.79

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)扣除相关费用后的余额;本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、金鹰货币A:

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.7211%	0.0009%	0.3699%	0.0000%	0.3512%	0.0009%

注:本基金收益分配是按日结转份额。

2、金鹰货币B:

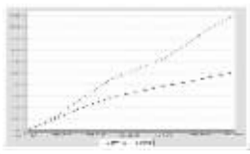
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.7807%	0.0009%	0.3699%	0.0000%	0.4108%	0.0009%

注:本基金收益分配是按日结转份额。

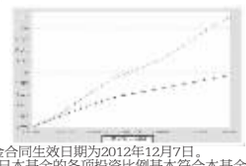
3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

金鹰货币市场证券投资基金
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2012年12月7日至2019年3月31日)

1、金鹰货币A



2、金鹰货币B



注:(1)本基金合同生效日期为2012年12月7日。

(2)截至报告日本基金的各项投资比例基本符合本基金基金合同规定,即投资于定期存款的比例不超过基金资产净值的30%;持有全部资产支持证券,市值不超过基金资产净值的20%;债券正回购的资金余额在每个交易日不超过基金资产净值的20%;以及中国证监会规定的其他比例限制。

(3)本基金的业绩比较基准为:一年期定期存款利率(税后)。

§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		
刘丽娟	本基金的基金经理,公司固定收益部总监	2015-07-22	-	12	刘丽娟女士,中南财经政法大学工商管理硕士,历任恒泰证券股份有限公司交易员、投资经理,广州证券股份有限公司资产管理总部固定收益投资总监。2014年12月加入金鹰基金管理有限公司,任固定收益部总监。现任固定收益部基金经理。
龙悦芳	本基金的基金经理,公司固定收益部副总监	2017-09-08	-	9	龙悦芳女士,曾任平安证券股份有限公司投资助理、交易员、投资经理等职务。2017年5月加入金鹰基金管理有限公司,现任固定收益部基金经理。

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颁布的《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遵规守信情况说明

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,为基金份额持有人谋求最大利益。

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。

4.3.2 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

2019年1季度债券市场行情,市场收益率整体下行。在市场流动性较为宽松的背景下,短端收益率下行至低位,而长端收益率在宽信用推进中社融企稳、地方债提前发行、股市估值修复、中美贸易战缓和等多重因素影响下步入震荡行情。整个一季度十年国开债收益率小幅下行2bp,一年国开债收益率下行约10bp,收益率曲线陡峭化。在信用违约常态化的背景下,一季度信用利差在流动性宽松和宽信用政策的呵护下小幅下行。

流动性层面,央行1月再次降准1%并置换一季度到期的MLF,加上TMLF和普惠金融定向降准动态考核所释放的资金,对冲了1月缴税和春节前现金走款对资金面带来的冲击,市场流动性整体较宽松,货币市场利率维持在相对低位,DR007较长时间处于公开市场逆回购招标利率2.55%以下。受MPA考核因素影响,季末银行减少对非银机构的融出,DR007和R007利差拉大,流动性分层显现,但回购利率整体仍维持在低位。

在流动性充裕的环境下,一季度同业存单发行利率较去年末大幅下行,尤其是三个月存单利率下行约80bp,同业存单供需两旺。我们根据对市场流动性的判断以及对持有人结构分析,严格遵守流动性新规要求,在季末市场利率冲高时加大了对高利率同业存款和存单的配置,适时拉长组合期限,在保持组合流动性和安全性的前提下,取得了一定超额收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期内,基金A类份额本报告期份额净值收益率为0.7211%,同期业绩比较基准收益率为0.3699%;B类份额本报告期份额净值收益率为0.7807%,同期业绩比较基准收益率为0.3699%。

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年二季度,从基本面来看,经济下行压力仍大,出口在外围经济放缓以及贸易战的长期影响下预计将继续回落;消费在个税减免及消费刺激政策下,预计维持平稳;基建在严控地方政府隐性债务新增和财政收支平衡压力下托底力度有限;房地产投资在政策高压和销售放缓背景下回落压力较大;企业盈利增速回落以及对经济前景的悲观预期下制造业投资预计将回落。在当前经济回落压力仍存的态势下,基本面对债市仍有支撑,但社融增速企稳回升、猪周期上行带来的通胀隐忧、风险偏好回升、经济悲观预期有所修复等因素将扰动债券市场投资者情绪。

流动性层面上,二季度MLP到期量高达11855亿元,4月5月也是缴税大月,流动性缺口较大。在经济下行压力仍大、宽信用仍在推进中的背景下,预计央行将继续呵护市场资金面,保持流动性合理充裕但波动可能加大,降准仍可期。美联储3月议息会议表态年内可能暂停加息和缩表,国内货币政策面临的外部约束有所弱化。

基于以上判断,我们认为在经济下行压力仍大及扰动因素下,二季度长端利率将维持震荡走势,短端利率在合理充裕的流动性环境及公开市场逆回购利率约束下,维持平稳。我们将在缴税、季末等资金季节性紧张时点加大对高利率同业存款和存单的配置,适度拉长组合久期和提升杠杆,在确保组合良好流动性和安全性的前提下,力争有效控制并防范风险,竭力为持有人服务。

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	固定收益投资	12,590,652,174.68	51.10
	其中:债券	12,403,322,174.68	50.34
	资产支持证券	187,330,000.00	0.76
2	买入返售金融资产	6,234,948,717.72	25.30
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	5,729,297,991.21	23.25
4	其他资产	84,554,161.50	0.34
5	合计	24,639,453,045.11	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 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	7.40	
	其中:买断式回购融资	0.02	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	2,009,244,773.35	8.88
	其中:买断式回购融资	249,606,935.27	1.10

注:上表中报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金本报告期债券正回购的资金余额均未超过基金资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	81
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	89
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	50

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金本报告期内不存在投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	32.14	8.88
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	9.72	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	37.74	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	7.79	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	21.18	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		108.58	8.88

5.4报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本基金本报告期内不存在投资组合平均剩余存续期超过240天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,529,725,958.26	6.76
	其中:政策性金融债	1,529,725,958.26	6.76
4	企业债券	432,130,718.94	1.91
5	企业短期融资券	830,004,503.59	3.67
6	中期票据	-	-
7	同业存单	9,611,460,993.89	42.50
8	其他	-	-
9	合计	12,403,322,174.68	54.84
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160415	16农发15	5,350,000.00	534,774,145.92	2.36
2	1119200032	19广发银行CD032	5,000,000.00	497,301,000.28	2.20
3	140219	14国开19	3,000,000.00	301,189,675.95	1.33
4	1119024277	19贵阳银行CD028	3,000,000.00	298,658,569.02	1.32
5	111913011	19浙商银行CD011	3,000,000.00	298,143,571.69	1.32
6	111872192	18东莞农村商业银行CD134	3,000,000.00	298,019,437.39	1.32
7	122312	13海通05	2,500,000.00	251,296,326.44	1.11
8	111886867	18锦州银行CD222	2,500,000.00	245,741,258.68	1.09
9	111815519	18民生银行CD519	2,200,000.00	217,869,725.54	0.96
10	111903004	19农业银行CD004	2,000,000.00	198,905,911.77	0.88

5.7"影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.1308%
报告期内偏离度的最低值	0.0504%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0958%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内不存在负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1889124	18永动1A	1,000,000.00	67,330,000.00	0.30
2	139254	万科28A1	500,000.00	50,000,000.00	0.22
3	139261	万科29A1	500,000.00	50,000,000.00	0.22
4	139248	万科26A1	200,000.00	20,000,000.00	0.09

注:本基金本报告期末仅持有4只资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1基金计价方法说明

本基金目前投资工具的估值方法如下:

(1)基金持有的债券(包括票据)购买时采用实际支付价款(包含交易费用)确定初始成本,按实际利率计算其摊余成本及各期利息收入,每日计提收益;

(2)基金持有的回购以成本列示,按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息;合同利率与实际利率差异较小的,也可采用合同利率计算确定利息收入;

(3)基金持有的银行存款以本金列示,按实际协议利率逐日计提利息。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的方法估值。

如有新增事项,按国家最新规定估值。

5.9.2本基金投资的前十名证券的发行主体之一的民生银行,因内控管理严重违反审慎经营规则等原因,于2018年12月7日被中国银行保险监督管理委员会处以罚款。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策的程序。

5.9.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	10,476.30
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	83,392,855.66
4	应收申购款	1,150,829.54
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	84,554,161.50

5.9.4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	金鹰货币A	金鹰货币B
本报告期期初基金份额总额	251,819,215.76	19,243,481,831.99
报告期基金总申购份额	608,255,312.44	10,451,983,451.88
报告期基金总赎回份额	594,951,984.98	7,345,206,519.08
报告期基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	265,122,543.22	22,350,258,764.79

注:总申购份额包含因份额升降级导致的强制调增份额、总赎回份额包含因份额升降级导致的强制调减份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2019-02-26	140,000,000.00	140,000,000.00	0.00%
合计			140,000,000.00	140,000,000.00	

§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

经广东省工商行政管理局核准,本基金管理人法定代表人已于2019年3月27日变更为刘志刚先生。

§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货币市场证券投资基金发行及募集的文件。

2、《金鹰货币市场证券投资基金基金合同》。

3、《金鹰货币市场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
二〇一九年四月二十日

金鹰科技创新股票型证券投资基金

2019年第一季度报告

基金管理人:金鹰基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月二十日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4月19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