

金鹰主题优势混合型证券投资基金

2019年半年度报告摘要

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:二〇一九年八月二十三日

1.1 重要提示
基金管理人、董事、监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。本半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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月22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预示其未来表现。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。
本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告除财务资料未经审计。
本报告自2019年1月1日起至6月30日止。

2.1 基金基本情况

基金简称	金鹰主题优势混合
基金代码	210006
交易代码	210006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月20日
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
报告期末基金份额总额	565,202,346.03元
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明
以追求基金资产持续增值为目的,以深入的基本面分析为基础,把握主题投资机遇,在充分分散风险的前提下,分享中国经济高速增长带来的机遇,以及全球优质资产所带来的投资机会,追求基金资产的长期增值和稳健回报。

投资策略
本基金奉行“自上而下”为主,“自下而上”为辅的投资策略,在宏观政策过程中寻找体现“主题优势”这个核心命题,以主题驱动和个股挖掘相结合的方式进行主题投资,优选并持有不受市场热点主题投资影响,估值合理、成长性良好、流动性较强的资产,追求超额收益。
业绩比较基准
沪深300指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%
风险收益特征
本基金为主动操作的混合型基金投资,属于证券投资基金中的中高风险收益,风险收益特征。

2.3 基金管理人及基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	金鹰基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
法定代表人	曹光伟	姜建清
信息披露负责人	魏志勇	陈忠
电子邮箱	cmfund@cmfund.com.cn	cmfund@icbc.com.cn
客户服务电话	4006135888、020-83836180	95588
传真	020-83832856	010-66106798

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

项目	金额单位:人民币元
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日至2019年6月30日)
本期已实现收益	18,543,717.83
本期利润	61,950,471.40
加权平均基金份额本期利润	0.1075
本期基金份额净值增长率	46.93%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末基金份额净值	0.0189
期末基金资产净值	731,131,316.32
期末基金份额净值	1.317

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、期末可分配利润指,期末未分配利润中未分配利润与未分配利润中未实现部分的孰低值(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买入认购基金费的各项费用,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

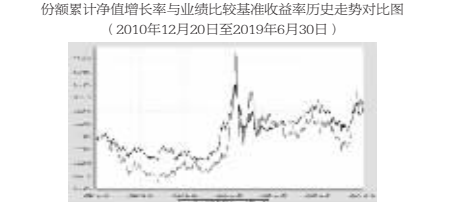
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比

阶段	基金份额净值增长率(%)	业绩比较基准收益率(%)	①-②	②-③
过去一个月	-4.63%	1.43%	4.10%	0.07%
过去三个月	-0.08%	1.98%	-0.01%	0.14%
过去六个月	26.93%	1.98%	1.16%	26.36%
过去一年	19.95%	1.70%	8.93%	1.14%
过去三年	11.42%	1.41%	19.70%	0.63%
自基金合同生效以来	31.70%	1.70%	27.86%	1.10%

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%。

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

金鹰主题优势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
(2010年12月20日至2019年6月30日)



注:1、本基金合同于2010年12月20日生效。2、本报告期末,本基金各项投资比例符合基金合同约定。3、本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经营情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会核准,2002年9月,批准金鹰基金管理有限公司于2002年12月26日正式注册,注册资本为100,000万元人民币。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成立。

“以人为本、互信协作;创新驱动、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资团队,努力为客户投资者创造丰厚回报。截至报告期末,公司共有46只公募基金,管理规模60.89亿元。

4.1.2 基金经理(或基金经小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金基金经理的期限(聘任日期)	证券从业年限	说明
陈立	本基金的基金经理	2013-08-15	-	12
潘剑刚	本基金的基金经理助理	2019-07-11	-	6

注:1、任职日期和离任日期指公司聘任或解聘日期。
2、注:任职的含义为自担行业务(证券投资基金)资产管理业务)的相关责任。

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》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定,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,基金运作符合法规,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流程和流程一致,并在获得投资建议、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对公平交易执行情况进行监控,以直接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口(日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合间向交易所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5%的情况。
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

报告期内,本基金投资策略和运作分析
回顾2019年上半年,宏观经济呈现弱复苏,各项政策逐渐落地,推动市场在一季度以快速上涨方式修复去年的悲观预期,在整体估值偏低的情况下,随后,中流易流预期有所缓解,国内进一步实施宽松的货币政策,权益市场估值有所修复。但应该看到市场面临的困难因素在增多。例如,海外资本持续流入,配置中国具有全球竞争力的消费和制造业龙头。以科创板为代表的证券市场的改革不断落地,促进了直接融资方式服务实体经济。宏观经济运行数据整体健康,市场信心好于去年四季度的悲观预期。

上半年市场整体表现方面,上证指数上涨19.4%,深成指上涨26.8%,中小板指数上涨20.7%,创业板指数上涨29.0%。行业表现上,食品饮料、非银行金融、农业、家电、计算机板块涨幅居前,建筑、传媒、汽车、钢铁、纺织服装涨幅表现落后。

基金一季度重点配置新基建、医药、农业、计算机、传媒、5G等板块,二季度在结构上降低了TMT板块配置,增加了消费板块配置。

4.4.2 报告期内基金的投资表现

截至2019年6月30日,基金份额净值为1.317元,本报告期份额净值增长率为46.93%,同期业绩比较基准增长率为6.63%。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的展望

展望未来,继续关注中美贸易谈判国内经济稳定和信心的政策措施,美国经贸问题呈现缓和态势,释放出货币转向宽松的的信号,这为国内政策调整提供了更多空间。国内经济下行压力仍存,但预计近期调控节奏将有所调整,随着货币的收紧,市场流动性压力有所缓解。例如,海外资本持续流入,配置中国具有全球竞争力的消费和制造业龙头。以科创板为代表的证券市场的改革不断落地,促进了直接融资方式服务实体经济。宏观经济运行数据整体健康,市场信心好于去年四季度的悲观预期。

本基金将保持耐心与信心,积极把握产业发展趋势,精选优质公司,努力为客户创造长期良好的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值方法的约定,对基金持仓的各项资产进行估值。本基金估值采用法律法规要求履行

信息披露

估值和净值计算的复核程序。

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,需参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、投资经理不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。

本基金管理人与中央国债登记结算有限责任公司、中金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品种的估值数据。流通受限股票流动性折价。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对于本基金持有人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,本基金托管人在对金鹰主题优势混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明
本报告期内,金鹰主题优势混合型证券投资基金的管理人——金鹰基金管理有限公司在金鹰主题优势混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何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。本报告期内,金鹰主题优势混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息真实、准确和完整发表意见
本托管人依法对金鹰基金管理有限公司编制的金鹰主题优势混合型证券投资基金2019年半年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:金鹰主题优势混合型证券投资基金
报告截止日:2019年6月30日

资产	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
货币:		
银行存款	172,009,724.27	36,890,714.70
结算备付金	902,240.84	1,003,167.40
存出保证金	287,976.63	289,940.05
交易性金融资产	560,208,127.44	123,028,490.33
基金投资	565,015,350.04	—
基金投资	5,272,776.40	—
基金支持证券	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收利息	96,446.02	7,483.02
应收股利	—	—
应收申购款	1,961,258.30	23,446.21
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	745,423,121.49	173,326,497.05
负债和所有者权益		
负债:		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
应付短期融资款	—	—
应付账款	—	—
应付利息	—	—
应付股利	—	—
应付赎回款	709,433.00	822,054.48
应付交易费用	—	—
应付利息	—	—
应付利息	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	—	—
负债合计	709,433.00	822,054.48
所有者权益:		
实收基金	565,202,346.03	187,746,036.78
未分配利润	176,028,369.62	-19,470,590.55
所有者权益合计	731,131,316.32	168,275,446.23
负债和所有者权益总计	745,423,121.49	173,326,497.05

注:截至本报告期末2019年6月30日,本基金份额净值为1.317元,基金份额总额为565,202,346.03份。

6.2 利润表

会计主体:金鹰主题优势混合型证券投资基金
本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

项目	本期末 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	68,565,021.06	-1,476,036.82
1.利息收入	362,081.64	213,438.96
其中:存款利息收入	64,711	330,573.19
债券利息收入	29,056.30	—
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	2,463.15	61,385.82
其他利息收入	—	—
2.投资收益(损失以“-”填列)	23,786,603.26	324,570.17
其中:股票投资收益	64,712	19,646,467.46
基金投资收益	64,712	—
债券投资收益	64,714	—
基金支持证券投资收益	64,715	—
公允价值变动收益	64,716	—
衍生工具收益	64,717	—
3.公允价值变动收益(损失以“-”填列)	64,718	4,112,356.89
3.1.公允价值变动收益(损失以“-”填列)	64,719	43,406,753.7
4.汇兑收益(损失以“-”填列)	64,720	—
5.其他收入(损失以“-”填列)	64,721	1,038,483.49
二、费用	6,615,460.56	4,643,360.14
1.管理人费用	3,507,767.38	1,652,915.80
2.托管费	584,627.87	276,486.01
3.销售服务费	—	—
4.交易费用	64,722	2,376,077.09
5.利息支出	64,723	—
6.其他费用	64,724	—
7.其他费用	64,725	—
三、利润总额(亏损总额以“-”填列)	64,726	61,385.82
四、净利润(净亏损以“-”填列)	64,727	61,385.82
五、净利润(净亏损以“-”填列)	64,728	61,385.82

注:截至本报告期末2019年6月30日,本基金份额净值为1.317元,基金份额总额为565,202,346.03份。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:金鹰主题优势混合型证券投资基金
本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

项目	本期末 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	68,565,021.06	-1,476,036.82
1.利息收入	362,081.64	213,438.96
其中:存款利息收入	64,711	330,573.19
债券利息收入	29,056.30	—
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	2,463.15	61,385.82
其他利息收入	—	—
2.投资收益(损失以“-”填列)	23,786,603.26	324,570.17
其中:股票投资收益	64,712	19,646,467.46
基金投资收益	64,712	—
债券投资收益	64,714	—
基金支持证券投资收益	64,715	—
公允价值变动收益	64,716	—
衍生工具收益	64,717	—
3.公允价值变动收益(损失以“-”填列)	64,718	4,112,356.89
3.1.公允价值变动收益(损失以“-”填列)	64,719	43,406,753.7
4.汇兑收益(损失以“-”填列)	64,720	—
5.其他收入(损失以“-”填列)	64,721	1,038,483.49
二、费用	6,615,460.56	4,643,360.14
1.管理人费用	3,507,767.38	1,652,915.80
2.托管费	584,627.87	276,486.01
3.销售服务费	—	—
4.交易费用	64,722	2,376,077.09
5.利息支出	64,723	—
6.其他费用	64,724	—
7.其他费用	64,725	—
三、利润总额(亏损总额以“-”填列)	64,726	61,385.82
四、净利润(净亏损以“-”填列)	64,727	61,385.82
五、净利润(净亏损以“-”填列)	64,728	61,385.82

注:截至本报告期末2019年6月30日,本基金份额净值为1.317元,基金份额总额为565,202,346.03份。

6.4 利润分配表

会计主体:金鹰主题优势混合型证券投资基金
本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

项目	本期末 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	68,565,021.06	-1,476,036.82
1.利息收入	362,081.64	213,438.96
其中:存款利息收入	64,711	330,573.19
债券利息收入	29,056.30	—
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	2,463.15	61,385.82
其他利息收入	—	—
2.投资收益(损失以“-”填列)	23,786,603.26	324,570.17
其中:股票投资收益	64,712	19,646,467.46
基金投资收益	64,712	—
债券投资收益	64,714	—
基金支持证券投资收益	64,715	—
公允价值变动收益	64,716	—
衍生工具收益	64,717	—
3.公允价值变动收益(损失以“-”填列)	64,718	4,112,356.89
3.1.公允价值变动收益(损失以“-”填列)	64,719	43,406,753.7
4.汇兑收益(损失以“-”填列)	64,720	—
5.其他收入(损失以“-”填列)	64,721	1,038,483.49
二、费用	6,615,460.56	4,643,360.14
1.管理人费用	3,507,767.38	1,652,915.80
2.托管费	584,627.87	276,486.01
3.销售服务费	—	—
4.交易费用	64,722	2,376,077.09
5.利息支出	64,723	—
6.其他费用	64,724	—
7.其他费用	64,725	—
三、利润总额(亏损总额以“-”填列)	64,726	61,385.82
四、净利润(净亏损以“-”填列)	64,727	61,385.82
五、净利润(净亏损以“-”填列)	64,728	61,385.82

注:截至本报告期末2019年6月30日,本基金份额净值为1.317元,基金份额总额为565,202,346.03份。

6.5 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:金鹰主题优势混合型证券投资基金
本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

一、本期经营活动产生的基本每股收益(本期间)	-	61,560,471.40	61,560,471.40
二、本期基本每股收益产生的基本每股收益(本期间)	307,465,603.94	133,449,404.87	500,906,164.81
其中:1.现金分红款	738,700,540.68	263,560,445.00	1,002,306,985.68
2.未分配利润	-371,304,936.64	-130,140,960.13	-501,446,820.77
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基本每股收益(本期间)	-	-	-
五、期末所有者权益(基本净值)	556,202,346.60	175,029,690.72	731,131,316.32
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
一、期初所有者权益(基本净值)	213,856,096.28	64,019,460.48	241,903,547.06
二、本期经营活动产生的基本每股收益(本期间)	-	-6,119,396.96	-6,119,396.96
三、本期基本每股收益产生的基本每股收益(本期间)	-24,300,603.94	-3,296,534.02	-27,887,137.88