金鹰多元策略灵活配置混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

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:二〇一九年七月十七日

§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7月16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4月1日起至6月30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	33,006,556.21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蕴在的投资机会,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4月1日-2019年6月30日)
1.本期已实现收益	3,816,401.02
2.本期利润	-3,105,333.12
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0834
4.期末基金资产净值	38,050,864.75
5.期末基金份额净值	1.1528

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。

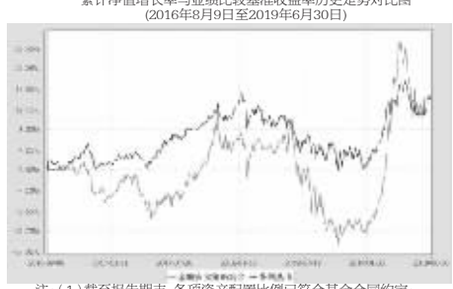
3.2 基金净值表现

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	-6.30%	1.48%	-0.11%	0.75%	-6.19%	0.73%

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6月30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2季度,外部中美贸易谈判进展曲折,贸易制裁与反制升级,一度陷入僵局;内部制造业PMI回落至荣枯线之下,工业增加值增速创多年新低,社融增速触底回升后保持平稳,整体经济增速仍在回落趋势当中。

股票市场上,流动性进一步持续宽松预期落空,贸易谈判恶化抑制了市场风险偏好提升,指数全线回落,上证、深证、中小板和创业板指数分别下跌3.62%、7.35%、10.99%和10.75%,食品饮料、家电和金融涨幅居前。本基金重点配置了食品、房地产和建材等行业。

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1.1528元,本报告期份额净值增长率为-6.30%,同期业绩比较基准收益率为-0.11%。

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3季度,美联储会议释放鸽派信息,如美元进入降息周期,则为国内货币政策进一步结构性宽松打开空间,此外6月末央行例会亦释放稳中偏松的信号。如货币政策进一步宽松,将有助于提升市场风险偏好,叠加科创板的推出,有可能出现结构性行情,此外地产和基建及产业链亦受益于宏观调控对冲政策。但是管贸易谈判重启,最终条款达成仍有较大不确定性。本基金计划适度增加TMT行业配置权重。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内,本基金资产净值已发生连续超过20个工作日低于5000万元的情形。

§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	33,278,960.57	85.28
	其中:股票	33,278,960.57	85.28
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	5,688,444.00	14.58
7	其他各项资产	56,194.02	0.14
8	合计	39,023,598.59	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	1,997,402.00	5.25
B	采矿业	20,405.40	0.05
C	制造业	18,453,846.87	48.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,888,110.00	4.96
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	-	-
J	金融业	2,146,997.60	5.64
K	房地产业	8,759,607.58	23.02
L	租赁和商务服务业	12,591.12	0.03
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	33,278,960.57	87.46

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	603517	绝味食品	79,824	3,105,951.84	8.16
2	000961	中南建设	289,500	2,507,070.00	6.59
3	000651	格力电器	44,000	2,420,000.00	6.36
4	601155	新城控股	59,018	2,349,506.58	6.17
5	600383	金地集团	187,000	2,230,910.00	5.86
6	000895	双汇发展	81,600	2,031,024.00	5.34
7	300498	温氏股份	55,700	1,997,402.00	5.25
8	000966	长源电力	333,000	1,888,110.00	4.96
9	600887	伊利股份	54,700	1,827,527.00	4.80
10	600325	华发股份	214,100	1,672,121.00	4.39

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

本基金本报告期内未投资资产支持证券。

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之一的江苏中南建设集团股份有限公司因财务会计报告违规,于2018年8月23日被中国证券监督管理委员会江苏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的程序。

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	42,433.67
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,136.95
5	应收申购款	12,623.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	56,194.02

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	42,213,400.83
报告期基金总申购份额	6,579,426.31
减:报告期基金总赎回份额	15,786,270.93
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	33,006,556.21

§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。

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
二〇一九年七月十七日

金鹰科技创新股票型证券投资基金

2019年第二季度报告

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:二〇一九年七月十七日

§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7月16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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金鹰科技创新股票
基金主代码	001167
交易代码	001167
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月30日
报告期末基金份额总额	833,986,083.02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,重点投资于以科技和创新为动力和支撑,具有核心科技或创新优势的优质上市公司,把握相关领域科技发展与创新所带来的投资机会,力争获得超额收益与长期资本增值。
投资策略	本基金将结合对包括宏观经济形势、政策走势、证券市场环境等在内的因素的分析,主动判断市场时机,进行积极的资产配置策略,合理确定基金在股票、债券等各类资产上的投资比例,最大限度地降低投资组合的风险,提高收益。 通过"自上而下"及"自下而上"相结合的方法挖掘优质的上市公司,构建股票投资组合:1)自上而下地分析行业的增长潜在空间、竞争结构、增长节奏、潜在风险等方面,把握投资机会;2)自下而上地评判企业的核心科技和创新优势、管理层、治理结构以及其提供的产品和服务是否契合科技创新的大趋势,对企业基本面和估值水平进行综合的研判,深度挖掘优质个股。并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。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金,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混合型基金、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	中国工商银行股份有限公司

§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4月1日-2019年6月30日)
1.本期已实现收益	4,298,668.19
2.本期利润	-12,920,586.99
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0153
4.期末基金资产净值	515,280,949.88
5.期末基金份额净值	0.618

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。

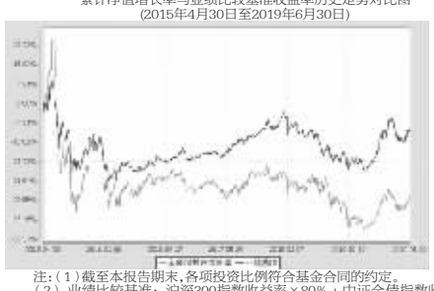
3.2 基金净值表现

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	-2.37%	1.58%	-0.72%	1.22%	-1.65%	0.36%

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

金鹰科技创新股票型证券投资基金
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4月30日至2019年6月30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)业绩比较基准:沪深300指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%。

§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		
黄艳芳	本基金的基金经理	2017-09-19	2019-04-26	12	黄艳芳女士,清华大学硕士研究生。历任天相投资顾问有限公司分析师、中航证券资产管理分公司投资主办,量化投资负责人,广州证券股份有限公司资产管理部投资主办。2015年5月加入金鹰基金管理有限公司。
樊勇	本基金的基金经理	2019-04-13	-	7	樊勇先生,曾任广州证券股份有限公司资产管理部研究员,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。
乔春	本基金的基金经理	2019-04-17	-	9	乔春先生,中南大学环境工程专业工学学士、南开大学金融学硕士,历任长城基金管理有限公司研究部行业研究员、基金经理助理、基金经理等职务。2017年11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,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

二季度市场震荡下行,公募基金整体净值出现一定幅度的回撤,金融和消费领域的超额收益显著。报告期内我们对组合结构进行了部分调整,将计算机电子更换为银行和食品饮料,维持了医药和农业的配置,并增持了部分高股息率品种,当前组合的行业配置上以食品饮料/医药/农业/银行为主,持仓品种上更偏向于白马股。

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0.618元,本报告期份额净值增长率为-2.37%,同期业绩比较基准增长率为-0.72%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度市场如期回撤,我们根据一季报的情况对组合结构进行了调整。即使国内经济面临下行压力,但我们倾向于认为市场对此已经充分预期,后市调整空间有限,因为组合将维持高仓位,行业方面我们更看好高端消费/大众消费/医药医疗/养殖/银行/水电/高速/黄金等。

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	479,449,818.88	92.55
	其中:股票	479,449,818.88	92.55
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	37,970,939.66	7.33
7	其他各项资产	643,665.85	0.12
8	合计	518,064,424.39	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	28,017,553.06	5.44
B	采矿业	36,803,516.90	7.14
C	制造业	269,268,021.05	52.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,678,000.00	2.85
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	17,503,589.13	3.40
G	交通运输、仓储和邮政业	14,713,800.00	2.86
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,603.76	0.01
J	金融业	64,902,015.68	12.60
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	16,407,519.30	3.18
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	17,116,200.00	3.32
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	479,449,818.88	93.05

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	600547	山东黄金	460,000	18,938,200.00	3.68
2	000975	银泰资源	1,330,000	17,542,700.00	3.40
3	603939	益丰药房	250,087	17,503,589.13	3.40
4	300347	泰格医药	222,000	17,116,200.00	3.32
5	000661	长春高新	50,511	17,072,718.00	3.31
6	600887	伊利股份	500,000	16,705,000.00	3.24
7	002557	洽洽食品	650,000	16,412,500.00	3.19
8	601888	中国国旅	185,082	16,407,519.30	3.18
9	603517	绝味食品	400,023	15,564,894.93	3.02
10	002142	宁波银行	640,020	15,514,084.80	3.01

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期内未投资债券。

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

本基金本报告期内未投资债券。

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

本基金本报告期内未投资资产支持证券。

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之一的江苏中南建设集团股份有限公司因财务会计报告违规,于2018年8月23日被中国证券监督管理委员会江苏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的程序。

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	218,796.23
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,448.45
5	应收申购款	417,421.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	643,665.85

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

本基金本报告期内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	859,081,876.53
报告期基金总申购份额	17,976,051.30
减:报告期基金总赎回份额	43,071,844.81
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	833,986,083.02

§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科技创新股票型证券投资基金发行及募集的文件。

2、《金鹰科技创新股票型证券投资基金基金合同》。

3、《金鹰科技创新股票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
二〇一九年七月十七日

金鹰货币市场证券投资基金

2019年第二季度报告

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:二〇一九年七月十七日

§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7月16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4月1日起至6月30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	18,424,506,268.76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	299,761,354.50份	18,124,744,914.26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4月1日-2019年6月30日)	
	金鹰货币A	金鹰货币B
1.本期已实现收益	1,476,222.09	145,144,981.34
2.本期利润	1,476,222.09	145,144,981.34
3.期末基金资产净值	299,761,354.50	18,124,744,914.26

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	0.6222%	0.0006%	0.3740%	0.0000%	0.2482%	0.0006%

注:本基金收益分配是按日结转份额。

2、金鹰货币B:

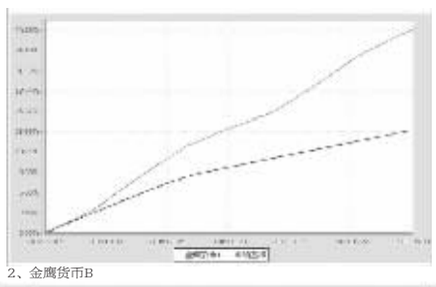
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6823%	0.0006%	0.3740%	0.0000%	0.3083%	0.0006%

注:本基金收益分配是按日结转份额。

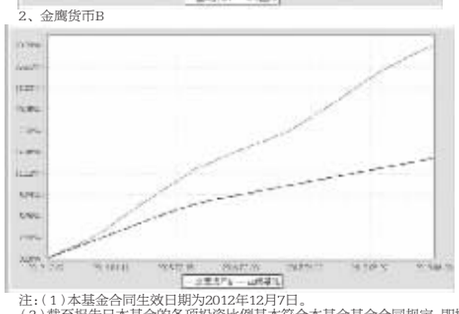
3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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6月30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 |