

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。
本报告自2019年3月1日起至3月31日止。

基金基本情况

Table with columns: 项目 (Item), 数值 (Value). Includes fields like 基金简称 (金鹰智慧生活混合), 场内简称, 基金代码 (902303), 基金运作方式 (契约型开放式), 基金合同生效日期 (2016-03-23), 报告期末基金份额总额 (27,111,033.56), 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 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).

主要财务指标

Table with columns: 主要财务指标, 报告期 (2019-01-01 至 2019-03-31), 单位: 人民币元. Includes 本期已实现收益 (2,886,268.71), 本期利润 (3,924,332.31), 加权平均基金份额本期利润 (0.1499), 期末基金资产净值 (26,047,523.85), 期末基金份额净值 (0.961).

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者（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。

基金净值表现

Table with columns: 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. Includes data for 过去三个月 (17.91%, 1.11%, 17.17%, 0.93%, 0.74%, 0.18%).



注：1、本基金于2016年3月23日成立；
2、截至报告期末，各项资产配置比例符合基金合同约定；
3、本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%。

其他指标

Table with columns: 其他指标, 报告期 (2019-01-01至2019-03-31), 单位: 人民币元.

基金经理 (或基金经理小组) 简介

Table with columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期限 (任职日期, 离任日期), 证券从业年限, 说明. Includes 王海宁 (本基金基金经理, 2018-08-22, 5 years).

注：1、任职日期和离任日期指公司聘任或解聘日期；
2、证券从业的含义遵从行业协会发布的《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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细则，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。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。

公平交易专项说明

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，以后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、不同时间留下（日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合间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。

异常交易行为的专项说明
报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开交易中，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。

报告期内基金的投资策略和运作分析

受国内刺激经济政策、中美谈判进展顺利和宏观经济超预期等多重因素影响，2019年一季度沪深300大涨28.62%。
本基金在指数底部区域持续持仓，在市场反弹初期取得了一定收益。在上涨中段，我们对宏观经济判断出现了一定程度的误判，过早的降低了仓位，对基金净值产生了一定的影响。
板块方面，一季度我们坚持精选行业龙头的选股策略，精选了处于估值底部的地产、券商等板块，也重点配置了家电、医药等有长期投资价值的板块。

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0.961元，本报告基金份额净值增长率17.91%，同期业绩比较基准增长率为17.17%。

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望一季度，我们仍然坚持年初的观点，认为市场将进入底部区域，但是市场能否直接由“熊”市转为“牛”市，还需要更多的经济数据来验证。
宏观和流动性判断：我们对二季度经济仍然维持一季度复苏的趋势，我们会重点关注CPI的变化情况。流动性层面，一季度受宏观政策影响，整体流动性收紧，但是随着经济的复苏，我们判断二季度流动性可能出現反复。
行业层面：我们仍然会保持较高仓位，重点配置行业景气周期向上或预期较强的行业，例如：家电、医药和传统行业。

报告期内基金持有人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60个工作日低于5000万元的情形，本基金管理人已依法要求向证监会报送解决方案。

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号, 项目, 金额 (元), 占基金总资产的比例 (%). Includes 权益类投资 (24,029,403.59, 84.19%), 固定收益投资 (291,635.00, 1.02%), 贵金属投资, 金融衍生品投资, 买入返售金融资产, 银行存款和结算备付金合计 (3,488,261.40, 12.22%), 其他资产 (723,048.01, 2.57%), 合计 (28,542,368.00, 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。

报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with columns: 序号, 行业类别, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). Includes 农、林、牧、渔业, 采矿业, 制造业, 电力、热力、燃气及水生产和供应业, 建筑业, 批发和零售业, 交通运输、仓储和邮政业, 住宿和餐饮业, 信息传输、软件和信息技术服务业, 金融业, 房地产业, 租赁和商务服务业, 科学研究和技术服务业, 水利、环境和公共设施管理业, 居民服务、修理和其他服务业, 教育, 卫生和社会工作, 文化、体育和娱乐业, 综合, 合计 (24,029,403.59, 92.25%).

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

Table with columns: 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 (%). Includes 002202 (金风科技), 603377 (东方时尚), 600805 (青岛海尔), 600061 (同仁堂), 300251 (宇通客车), 601933 (永辉超市), 300450 (先导智能), 300873 (当升科技), 600547 (山东黄金).

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with columns: 序号, 债券品种, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). Includes 国家债券, 央行票据, 金融债券 (131,635.00, 0.51%), 企业债券, 企业短期融资券, 中期票据, 可转债 (160,000.00, 0.61%), 其他, 合计 (291,635.00, 1.12%).

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

Table with columns: 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 (%). Includes 110554 (浦发转债), 188603 (国开1804).

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

注：本基金本报告期末未投资资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未投资贵金属。

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

注：本基金本报告期末未投资权证。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本报告期末本基金未投资股指期货。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码, 名称, 持仓量 (买/卖), 合约市值 (元), 公允价值变动 (元), 风险说明. Includes 公允价值变动总额合计 (元), 国债期货投资本期收益 (元), 国债期货投资本期公允价值变动 (元).

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

本期基金投资国债期货的投资政策

无。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

报告期末本基金投资的国债期货的投资政策

无。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码, 名称, 持仓量 (买/卖), 合约市值 (元), 公允价值变动 (元), 风险指标说明. Includes 公允价值变动总额合计 (元), 国债期货投资本期收益 (元), 国债期货投资本期公允价值变动 (元).

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

本期国债期货投资评价

无。

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况
本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现过监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库
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。

Table with columns: 序号, 名称, 金额 (元). Includes 存出保证金 (92,026.14), 应收证券清算款 (630,391.68), 应收利息 (3,155.38), 应收中融款 (7,466.81), 其他应收款, 待摊费用, 其他, 合计 (723,048.01).

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

Table with columns: 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. Includes 002202 (金风科技), 282,627.50, 1.01% (配股上市).

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，合计之和与合计项之间可能存在尾差。

开放式基金份额变动

Table with columns: 项目, 数量. Includes 报告期初基金份额总额 (25,054,158.25), 报告期间基金总申购份额 (5,424,020.98), 报告期间基金总赎回份额 (3,367,127.59), 报告期间基金净申购/赎回份额 (份额减少以“-”填列), 报告期末基金份额总额 (27,111,033.56).

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

Table with columns: 项目, 基金份额, 单位: 份. Includes 报告期末基金管理人持有的基金份额, 报告期间买入/申购总份额, 报告期间卖出/赎回总份额, 报告期末基金管理人持有的基金份额, 报告期末持有的本基金基金份额占基金份额总额比例 (%).

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table with columns: 序号, 交易方式, 交易日期, 交易份额 (份), 交易金额 (元), 适用费率. Includes 合计.

报告期末发起式基金及发起持有份额情况

Table with columns: 项目, 持有份额总数, 持有份额占基金总份额比例, 发起份额总数, 发起份额占基金总份额比例, 发起份额承诺持有期限. Includes 基金管理人固有资金, 基金管理人高级管理人员, 基金管理人股东, 其他, 合计.

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

Table with columns: 投资者类别, 序号, 持有基金份额比例达到或超过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. Includes 个人 (2019年1月1日至2019年3月31日), 6,931,288.70, 2,518,169.75, 9,449,458.45, 34.85%.

本基金在报告期内，存在报告期末单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况，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，导致本基金收益水平发生波动。同时，因巨额赎回，份额净值小数位数取整方式、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，可能导致本基金流动性风险；
4) 基金赎回压力、转型或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，可能导致在其赎回日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、交易所债券等交易困难的情形；
6) 份额占比高的投资者申购中请被拒绝的风险：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入申请，在其他基金份额持有人大量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入申请被拒绝的风险。如果投资者大量申购或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%，该笔申购或转入申请可能会被确认失败。

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。

备查文件目录

- 1、中国证监会批准金鹰智慧生活资产配置混合型证券投资基金发行及募集的文件。
2、《金鹰智慧生活资产配置混合型证券投资基金基金合同》。
3、《金鹰智慧生活资产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或授权，营业执照、公司章程。
5、基金托管人业务资格批准或授权文件。

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

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。本基金管理人网站：http://www.gfund.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020-83963880。