

信息披露 Disclosure

金鹰智慧生活灵活配置混合型证券投资基金

2018年第四季度报告

4.6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,本基金资产净值未发生连续20个工作日低于5000万元的情形,本基金管理人已依法按照约定向证监会报送解决方案。

注:1.本基金于2018年10月20日成立;
2.截至报告期末,各资产类别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%。

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 任职日期 离任日期	证券从业年限	说明
王翔宇	基金经理	2018-08-22	-	4

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
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。本报告期内,本基金运作合法合规,无出现重大违法违规或违反基金合同约定的行为,无损害基金份额持有人的行为。

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流程和流程独立决策,并未在获得投资建议、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

4.3.2 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当日成交量的5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
2018年四季度,宏观经济仍然受到金融去杠杆、中美贸易战等因素影响,走势依旧明显,宏观经济数据整体出现大幅走弱的情况。权益市场受到经济数据走弱超预期影响,四季度行情,保险等权重蓝筹股沪深300指数下跌了12.45%,最终收于3010.65点。四季度,我们选择相对中性的仓位,坚持投资有长期成长能力的企业为投资方向。行业方面重点布局受经济周期影响较大的行业,并重视个股价值的挖掘。

4.4.2 报告期内基金业绩表现说明
截至2018年12月31日,基金份额净值为0.815元,本报告期份额净值增长率为-8.94%,同期业绩比较基准增长率为-6.41%。

4.5 管理人对本报告期、证券市场及行业走势的简要展望
我们认为市场已经进入政策底,随着经济数据的企稳回升和全球权益资产价格的下行,A股市场将在未来一年内成功寻找到市场底。虽然中期经济数据可能会进一步下滑,同时中美贸易战的影响会持续影响上市公司估值业绩,但是不可否认的是现在A股的整体估值已经进入了一个合理的区间,18年四季度国家连续出台了多项刺激经济的政策,多项政策的推出会短期提振市场的信心,但这些政策对经济和企业的根本影响要到明年才能显现。因此,政策落地后市场大概率还会出现波动,我们判断随着19年宏观经济企稳,短期经济下行将逐步缓解并企稳,上市公司整体盈利状况预计在19年上半年开始逐步改善,企业的利润逐步改善之后,伴随着我们进入利率的“下行周期,权益资产有望在明年完成成功之后启动结构性行情,我们判断一季度市场可能会出现走出底部向上的震荡行情,一季度将会出现结构性偏高的个股,板块方面,我们会重点关注经济逆周期高增长,和风险偏好提升带来的或低估值的机会。

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	18,316,888.78	89.42
2	其中:股票	18,316,888.78	89.42
3	固定收益投资	242,091.20	1.14
4	其中:债券	242,091.20	1.14
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	银行存款和拆入资金	1,484,711.36	7.22
9	其他资产	510,896.35	2.43
10	合计	21,154,687.69	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

行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A 农、林、牧、渔业	197,726.00	0.93
B 采矿业	302,500.00	1.43
C 制造业	6,900,410.00	32.88
D 电力、热力、燃气及生产供应业	646,866.76	3.12
E 建筑业	1,290,000.00	6.13
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	3,040,370.00	14.80
J 金融业	1,261,300.00	6.04
K 房地产业	5,106,577.00	24.61
L 租赁和商务服务业	-	-
M 科学研究和技术服务业	129,600.00	0.62
N 水利、环境和公共设施管理业	-	-
O 建筑业	-	-
P 教育	-	-
Q 卫生和社会工作	-	-
R 文化、体育和娱乐业	203,010.00	0.99
S 综合	-	-
合计	18,316,888.78	89.42

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
本基金本报告期末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组合

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	000002	万科A	62,200	1,968,000.00	9.69
2	000048	保利地产	160,000	1,897,010.00	9.20
3	001919	南钢股份	79,000	1,278,100.00	6.20
4	001766	中信证券	129,600	1,269,360.00	6.13
5	000033	美的集团	130,100	1,261,540.00	6.11
6	000068	华阴国际	100,600	1,228,000.00	6.02
7	000089	东方宾馆	194,400	1,126,060.00	5.44
8	000225	航天机电	56,200	1,206,500.00	5.91
9	000020	中银证券	112,072	1,182,000.00	5.79
10	000087	汇源地产	98,000	811,430.00	3.97

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	000002	万科A	62,200	1,968,000.00	9.69
2	000048	保利地产	160,000	1,897,010.00	9.20
3	001919	南钢股份	79,000	1,278,100.00	6.20
4	001766	中信证券	129,600	1,269,360.00	6.13
5	000033	美的集团	130,100	1,261,540.00	6.11
6	000068	华阴国际	100,600	1,228,000.00	6.02
7	000089	东方宾馆	194,400	1,126,060.00	5.44
8	000225	航天机电	56,200	1,206,500.00	5.91
9	000020	中银证券	112,072	1,182,000.00	5.79
10	000087	汇源地产	98,000	811,430.00	3.97

5.5 投资组合报告附注
注:本基金本报告期末未持有通过港股通投资股票。

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债券投资组合

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(%)
1	190002	14国债02	800,000.00	80,112,000.00	24.83
2	001007	07国债07	100,000.00	10,142,000.00	3.13

注:本基金本报告期末仅持有两只债券。

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十名贵金属投资组合

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	999999	黄金	100,000.00	10,142,000.00	3.13

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

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组合

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	万科A	100,000.00	10,142,000.00	3.13

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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股指期货投资组合

序号	股指期货代码	股指期货名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	IF1812	IF1812	100,000.00	10,142,000.00	3.13

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 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国债期货投资组合

序号	国债期货代码	国债期货名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	TF1812	TF1812	100,000.00	10,142,000.00	3.13

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 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商品期货投资组合

序号	商品期货代码	商品期货名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	IF1812	IF1812	100,000.00	10,142,000.00	3.13

注:本基金本报告期末未持有商品期货。

5.12 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期权投资组合

序号	期权代码	期权名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	IF1812	IF1812	100,000.00	10,142,000.00	3.13

注:本基金本报告期末未持有期权。

5.13 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资产支持证券投资

序号	资产支持证券代码	资产支持证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	190002	14国债02	800,000.00	80,112,000.00	24.83

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.14 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

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	999999	黄金	100,000.00	10,142,000.00	3.13

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.15 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

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	万科A	100,000.00	10,142,000.00	3.13

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.16 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股指期货

序号	股指期货代码	股指期货名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	IF1812	IF1812	100,000.00	10,142,000.00	3.13

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.17 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国债期货

序号	国债期货代码	国债期货名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	TF1812	TF1812	100,000.00	10,142,000.00	3.13

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.18 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商品期货

序号	商品期货代码	商品期货名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	IF1812	IF1812	100,000.00	10,142,000.00	3.13

注:本基金本报告期末未持有商品期货。

5.19 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期权

序号	期权代码	期权名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	IF1812	IF1812	100,000.00	10,142,000.00	3.13

注:本基金本报告期末未持有期权。

5.20 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资产支持

序号	资产支持证券代码	资产支持证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	190002	14国债02	800,000.00	80,112,000.00	24.83

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.21 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

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	999999	黄金	100,000.00	10,142,000.00	3.13

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.22 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

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	万科A	100,000.00	10,142,000.00	3.13

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.23 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股指期货

序号	股指期货代码	股指期货名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	IF1812	IF1812	100,000.00	10,142,000.00	3.13

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.24 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国债

序号	国债期货代码	国债期货名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	TF1812	TF1812	100,000.00	10,142,000.00	3.13

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

5.25 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名商品

序号	商品期货代码	商品期货名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	IF1812	IF1812	100,000.00	10,142,000.00	3.13

注:本基金本报告期末未持有商品期货。

5.26 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期权

序号	期权代码	期权名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	IF1812	IF1812	100,000.00	10,142,000.00	3.13

注:本基金本报告期末未持有期权。

5.27 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资产支

序号	资产支持证券代码	资产支持证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	190002	14国债02	800,000.00	80,112,000.00	24.83

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.28 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

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	999999	黄金	100,000.00	10,142,000.00	3.13

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.29 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

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	万科A	100,000.00	10,142,000.00	3.13