金鹰添裕纯债债券型证券投资基金

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:交通银行股份有限公司
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。

基金托管人交通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	金鹰添裕纯债债券
基金主代码	003733
交易代码	003733
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年11月23日
报告期末基金份额总额	976,800,586.60份
投资目标	在严格控制风险的前提下,力争获得超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金充分考虑基金资产的安全性、收益性及流动性,在严格控制风险的前提下力争实现资产的稳定增值。在资产配置中,本基金以债券为主,通过密切关注债券市场变化,持续研究债券市场运行状况、研判市场风险,在确保资产稳定增值的基础上,通过积极主动的资产配置,力争实现超越业绩基准的投资收益。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为:中债综合(全价)指数收益率×80%+一年期定期存款利率(税后)×20%
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金,属于较低预期收益、较低预期风险的证券投资基金品种,其预期收益和预期风险高于货币市场基金,但低于混合型基金、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	交通银行股份有限公司

§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	10,834,521.50
2.本期利润	4,876,849.74
3.加权平均基金份额本期利润	0.0050
4.期末基金资产净值	980,704,022.28
5.期末基金份额净值	1.0040

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	0.49%	0.06%	-0.11%	0.05%	0.60%	0.01%

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

金鹰添裕纯债债券型证券投资基金

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11月23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)本基金的业绩比较基准是:中债综合(全价)指数收益率*80%+一年定期存款利率(税后)*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		
林龙军	本基金的基金经理,公司绝对收益投资部总监	2018-05-17	-	11	林龙军先生,曾任兴全基金管理有限公司产品经理、研究员、基金经理助理、投资经理兼固收投委会委员等职务。2018年3月加入金鹰基金管理有限公司,现任绝对收益投资部基金经理。
黄倩倩	本基金的基金经理	2019-03-27	-	7	黄倩倩女士,西南财经大学金融学硕士研究生,历任广州证券股份有限公司资产管理总部债券交易员,2014年11月加入金鹰基金管理有限公司,担任固定收益部债券交易员、基金经理助理,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《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、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2019年二季度,经济基本面逐步下行。一季度地产投资和基建共同支撑经济短暂企稳,3月经济数据表现超预期;但二季度以来地产开发投资增速逐渐回落,带动地产投资下行;制造业投资差强人意,5月份制造业PMI再次回落至荣枯线下方,生产扩张需求放缓;基建难以独自支撑经济持续走好。消费方面总体表现较弱,而5月的数据跳升主要归功于5天劳动节小长假且假期错位造成的低基数。出口方面仍面临着贸易摩擦所带来的负面效应。CPI方面,上半年通胀有所上行,2019年5月CPI同比达到历史高位2.7%,主要归因于农产品价格的持续上涨,黑色系价格和原油价格也有所上行。

受经济基本面的影响,债券市场二季度以来呈现倒V的走势。4月以来,对于股市的强烈看多,叠加降准预期波动,带动债市极速上行,十年国开半个月已上行30bp;4月下旬,3月经济数据全部公布完毕,利好出尽,债市结束了恐慌期的上行,开始掉头向下;直到5月24日央行和银保监公布包商银行被接管并打破刚兑,市场有如惊弓之鸟,风险偏好骤然降低,中小银行为自保流动性率先卖出流动性好的资产,利率债抛盘严重,带动整体债券收益率急速上行;信用风险叠加流动性风险向整个金融市场蔓延,资金面和二级存单交投均出现断层情况,中小银行和中小非银均出现融资困难的情况,利于无风险资产,利率债和国股存单有所下行。央行见势紧急投放流动性,对金融机构进行结构化输血, DR001和DR007都不断下行,DR001最低跌破1%;债市恐慌情绪逐步缓和,整体债市收益率也同步下行,同时无风险利率下行更多,信用利差扩张。

二季度我们维持之前金融债为主存单为辅的配置策略, 同时把握了利率债的交易性机会;长短结合,适当降低杠杆,在保证流动性安全的基础上,以票息收益为主,尽量把握确定性的机会,兼顾交易性机会带来的超额收益。

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1.0040元,本报告期份额净值增长0.49%,同期业绩比较基准增长率为-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2019年三季度,经济基本面方面,央行明确要抑制流动性过度流向房地产,表达了地产放松政策无望,地产投资将持续下行;制造业投资方面生产扩展需求放缓,减税降费政策影响有待观察;基建投资方面,近日大力发行专项债将对下半年基建投资构成进一步支撑,但财政政策空间有限,总体支持力度有限。消费方面难见改观。进出口方面,虽然中美将重启贸易谈判,但以特朗普变化无常的习性以及美国的诉求,无论最终是否谈妥,贸易方面都将受到一些负面影响。总体来讲,经济基本面大概率持续低位震荡,对债市构成利好,但不排除基建发力以及实体融资改善带来的经济短期企稳的情况。

CPI方面,水果蔬菜价格有所回落带动食品分项回落;叠加原油价格下行,整体CPI较大可能掉头向下,总体通胀无忧。货币政策方面,受制于中美贸易战不确定性和包商事件内忧外患的格局,预计央行将维持宽松的货币政策不变。李克强总理也表示将采取有针对性的降息降准,以帮助小企业降低融资成本; 而实体企业融资问题短期内改善有限, 流动性将总体宽松充裕。这对债券市场构成利好;不过资金面断层现象短时间难以缓解,更利于无风险利率和好资质的高评级债券和存单。

投资方面,我们将密切关注事件冲击带来的交易性和配置性机会,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,竭力为持有人带来更高的回报。

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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	1,030,377,470.00	98.00
	其中:债券	1,030,377,470.00	98.00
	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	6,328,373.51	0.60
7	其他各项资产	14,653,590.82	1.39
8	合计	1,051,359,434.33	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、待摊费用。

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

本基金本报告期内未投资股票。

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

本基金本报告期内未投资股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	300,192,000.00	30.61
2	央行票据	-	-
3	金融债券	730,185,470.00	74.46
	其中:政策性金融债	324,701,470.00	33.11
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,030,377,470.00	105.07

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

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	180203	18国开03	1,700,000.00	174,420,000.00	17.79
2	019614	19国债04	1,400,000.00	140,812,000.00	14.36
3	019612	19国债02	1,000,000.00	99,440,000.00	10.14
4	1820041	18盛京银行01	700,000.00	70,798,000.00	7.22
5	1820086	18厦门国际银行	700,000.00	70,399,000.00	7.18

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本基金报告期内基金投资的前十名股票没有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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,653,570.84
5	应收申购款	19.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,653,590.82

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

本基金本报告期内未投资股票。

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	976,844,200.57
报告期基金总申购份额	225,722.76
减:报告期基金总赎回份额	269,336.73
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	976,800,586.60

§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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	970,945.43
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	970,945.43
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.10

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 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过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
机构	1	2019年4月1日至2019年6月30日	487,756,316.46	-	-	487,756,316.46	49.93%
	2	2019年4月1日至2019年6月30日	487,756,316.46	-	-	487,756,316.46	49.93%
产品特有风险							

本基金在报告期内,存在报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情形,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,导致本基金的收益水平发生波动。同时,因巨额赎回、份额净值小数保留位数与方式、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,可能触发本基金巨额赎回条款,基金份额持有人将可能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,可能导致本基金的流动性风险;

4)基金提前终止、转型或与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,可能导致在其赎回后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、交易所债券时交易困难的情形。

6)份额占比较高的投资者申购申请被拒绝的风险: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换转入申请。在其他基金份额持有人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换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换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%,该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

9.2 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添裕纯债债券型证券投资基金发行及募集的文件。

2、《金鹰添裕纯债债券型证券投资基金基金合同》。

3、《金鹰添裕纯债债券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

金鹰元禧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	金鹰元禧混合	
基金主代码	210006	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年6月27日	
报告期末基金份额总额	265,714,923.55份	
投资目标	本基金在有效控制风险的前提下,力争使基金份额持有人获得超额收益与长期资本增值。	
投资策略	本基金在投资组合管理过程中采取主动投资方法,通过数量化方法严格控制风险,并通过有效的资产配置策略,动态调整安全资产和风险资产的投资比例,注重风险与收益的平衡,力争实现基金资产长期稳健增值。本基金采用固定比例组合保险策略(CPPI),该策略是将基金资产按一定比例划分为安全资产和风险资产,其中安全资产将投资于各类债券及银行存款,以保证投资本金的安全性;而除安全资产外的风险资产主要投资于股票、权证等权益类资产,以提升基金投资者的收益。本基金综合考虑国内外政治经济环境、资本市场运行状况、固定收益类与权益类资产收益特征、基金资产净值和价值底线等因素,结合资产配置研究结果和市场运行状态,动态调整安全资产和风险资产的配置比例,力争在确保本金安全的前提下,稳健获取投资收益。	
业绩比较基准	沪深300指数收益率×20%+中债总财富(总值)指数收益率×80%	
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金,其预期收益和风险水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	金鹰元禧混合A	金鹰元禧混合C
下属分级基金的交易代码	210006	002425
报告期末下属分级基金的份额总额	259,453,740.64份	6,261,182.91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)	
	金鹰元禧混合A	金鹰元禧混合C
1.本期已实现收益	1,553,881.59	35,292.44
2.本期利润	4,095,772.27	91,950.63
3.加权平均基金份额本期利润	0.0299	0.0140
4.期末基金资产净值	291,969,954.85	7,055,873.91
5.期末基金份额净值	1.1253	1.1269

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

1、金鹰元禧混合A:

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	1.28%	0.13%	0.18%	0.28%	1.10%	-0.15%

2、金鹰元禧混合C:

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	1.25%	0.13%	0.18%	0.28%	1.07%	-0.15%

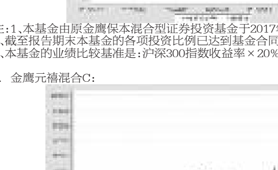
3.2.2 自基金转型以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

金鹰元禧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的历史走势对比图

(2017年6月27日至2019年6月30日)

1. 金鹰元禧混合A:

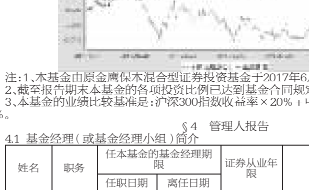


注:1、本基金由原金鹰保本混合型证券投资基金于2017年6月27日转型而来;

2、截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同规定的各项比例;

3、本基金的业绩比较基准是:沪深300指数收益率×20%+中债总财富(总值)指数收益率×80%。

2. 金鹰元禧混合C:



注:1、本基金由原金鹰保本混合型证券投资基金于2017年6月27日转型而来;

2、截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同规定的各项比例;

3、本基金的业绩比较基准是:沪深300指数收益率×20%+中债总财富(总值)指数收益率×80%。

§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		
戴骏	本基金的基金经理,公司固定收益部副总监	2016-10-22	-	8	戴骏先生,美国密歇根大学金融工程硕士研究生,历任国泰基金管理有限公司基金经理助理、东兴证券股份有限公司债券交易员等职务,2016年7月加入金鹰基金管理有限公司,现任固定收益部基金经理。
吴德瑄	本基金的基金经理	2017-09-30	-	7	吴德瑄先生,曾任广州证券股份有限公司研究员。2015年1月加入金鹰基金管理有限公司,任研究部研究员、基金经理助理、基金经理职务。现任权益投资部基金经理。
杨晓斌	本基金的基金经理	2019-06-26	-	8	杨晓斌先生,曾任银华基金管理有限公司研究员、首席宏观分析师、投资经理等职务。2018年2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《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。本报告期内,基金运作基本合法合规,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2019年第二季度债券市场,利率债震荡上涨,伴随着一季度经济数据的整体回暖,央行在货币政策态度上略显谨慎,市场预期货币政策边际收紧,带动长短债券收益率上行,10年期国债收益率上行27bp至3.4,10年期国开收益率上行22bp至3.88。后续伴随着中美贸易战重启,央行再次放松货币,长端债券收益率持续下行,5月底,包商银行事件影响下,债券收益率脉冲式上行,随即便掉头向下,整个季度来看10年国债收益率基本走平,10年国开收益率小幅下行。

二季度债券配置方面仍然以中等久期中高等级信用债为主要配置方向,股票仓位保持了一定的进攻性和弹性,组合在控制适度波动率的情况下,保证了稳定的收益水平。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,报告期内A类份额净值为1.1253元,本报告期份额净值增长率为1.28%,同期业绩比较基准增长率为0.18%;C类基金份额净值为1.1269元, 本报告份额期净值增长率1.25%,同期业绩比较基准增长率为0.18%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,我们认为利率债仍有一定的下行空间。首先,从经济基本面来看,上半年财政前置效应明显带动基建企稳,但下半年力度大概率会有所减弱,对基建的支撑力度下降,上半年支撑地产表现稳定的主要原因来源于开工较好带动建安投资增速的稳定,但下半年来看,新开工增速有下行风险,同时,棚改前置效应也将影响下半年的开工状况,对三季度的地产投资有所拖累。从物价来看,今年整体CPI水平可控,并不存在对货币政策的掣肘。同时,美联储在三季度降息的概率较大,很有可能带动国内货币政策进一步的适当放松,从而带动利率的进一步下行。

三季度,本基金在底层配置高评级存单的同时,在股票仓位积极配置平衡型股票底仓从而积极参与科创板打新。

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60个工作日低于5000万元的情形,本基金管理人已按法规要求向证监会报送解决方案。

§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	59,353,637.68	17.89
	其中:股票	59,353,637.68	17.89
2	固定收益投资	267,304,487.50	80.56
	其中:债券	267,304,487.50	80.56
	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	1,452,033.66	0.44
7	其他各项资产	3,708,942.36	1.12
8	合计	331,819,101.20	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、买入返售证券等。

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	505,424.00	0.17
C	制造业	12,526,193.00	4.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,067,490.00	1.69
E	建筑业	1,860,860.00	0.62
F	批发和零售业	1,850,052.00	0.62
G	交通运输、仓储和邮政业	9,920,805.68	3.32
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	21,620,766.00	7.23
K	房地产业	2,162,320.00	0.72
L	租赁和商务服务业	1,941,435.00	0.65
M	科学研究和技术服务业	1,898,292.00	0.63
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	59,353,637.68	19.85

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	601318	中国平安	59,200	5,245,712.00	1.75
2	600900	长江电力	283,100	5,067,490.00	1.69
3	600377	宁沪高速	470,500	5,053,170.00	1.69
4	601939	建设银行	555,200	4,130,688.00	1.38
5	600036	招商银行	83,900	3,018,722.00	1.01
6	601288	农业银行	789,400	2,841,840.00	0.95
7	600519	贵州茅台	2,700	2,656,800.00	0.89
8	601628	中国人寿	74,600	2,112,672.00	0.71
9	601333	广深铁路	624,500	2,017,135.00	0.67
10	601166	兴业银行	108,300	1,980,807.00	0.66

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	4,996,000.00	1.67
2	央行票据	-	-
3	金融债券	11,541,930.00	3.86
	其中:政策性金融债	11,541,930.00	3.86
4	企业债券	2,545,657.50	0.85
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	999,400.00	0.33
8	同业存单	247,221,500.00	82.68
9	其他	-	-
10	合计	267,304,487.50	89.39

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

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	111907045	19招商银行CD045	550,000.00	53,366,500.00	17.85
2	111915181	19民生银行CD181	500,000.00	48,490,000.00	16.22
3	111912037	19北京银行CD037	500,000.00	48,485,000.00	16.21
4	111914086	19江苏银行CD086	500,000.00	48,465,000.00	16.21
5	111921173	19渤海银行CD173	500,000.00	48,415,000.00	16.19

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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

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中国人寿保险股份有限公司存在未按照规定保存客户身份资料和交易记录、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告的行为,于2018年8月1日被中国人民银行罚款70万元。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

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	11,426.37
2	应收证券清算款	2,250,786.13
3	应收股利	-
4	应收利息	1,446,249.87
5	应收申购款	479.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,708,942.36

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	132013	17宝武EB	999,400.00	0.33

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

项目	金鹰元禧混合A	金鹰元禧混合C
本报告期期初基金份额总额	21,204,009.69	6,999,282.85
报告期基金总申购份额	239,866,846.60	1,100,972.59
减:报告期基金总赎回份额	1,617,115.65	1,839,072.53
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	259,453,740.64	6,261,182.91

§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 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过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
机构	1	2019年5月17日至2019年6月30日	0.00	132,502,253.47	-	132,502,253.47	49.87%
	2	2019年5月17日至2019年6月30日	0.00	79,321,254.73	-	79,321,254.73	29.85%
产品特有风险							

本基金在报告期内,存在报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情形,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,导致本基金的收益水平发生波动。同时,因巨额赎回、份额净值小数保留位数与方式、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,可能触发本基金巨额赎回条款,基金份额持有人将可能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,可能导致本基金的流动性风险;

4)基金提前终止、转型或与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,可能导致在其赎回后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、交易所债券时交易困难的情形。

6)份额占比较高的投资者申购申请被拒绝的风险: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换转入申请。在其他基金份额持有人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换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换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%,该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

9.2 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、中国证监会批准发行及募集的文件。

2、《金鹰元禧混合型证券投资基金基金合同》。

3、《金鹰元禧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

金鹰智慧生活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	金鹰智慧生活混合
基金主代码	002303
交易代码	002303
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年3月23日
报告期末基金份额总额	28,641,642.86份
投资目标	本基金在有效控制风险及保持良好流动性的前提下,重点投资于智慧生活相关主题证券,力争使基金份额持有人获得超额收益与长期资本增值。
投资策略	本基金将结合宏观经济环境和政策形势等因素的影响,综合分析证券市场的现状,判断市场未来发展方向,通过稳健的资产配置,合理确定基金资产在股票、债券等各类资产类别上的投资范围和投资比例,最大限度地优化投资组合,降低投资组合的风险、提高收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%
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低于股票型基金,高于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	-281,513.55
2.本期利润	-240,603.61
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0084
4.期末基金资产净值	27,287,614.09
5.期末基金份额净值	0.953

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

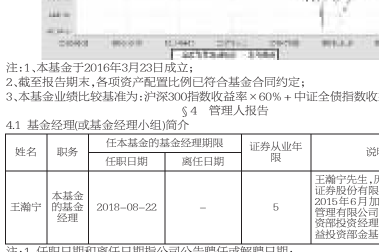
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.83%	1.26%	-0.30%	0.91%	-0.53%	0.35%

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

金鹰智慧生活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3月23日至2019年6月30日)



注:1、本基金于2016年3月23日成立;

2、截至报告期末,各项资产配置比例已符合基金合同约定;

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 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		
王瀚宁	本基金的基金经理	2018-08-22	-	5	王瀚宁先生,历任中信建投证券股份有限公司研究员。2015年6月加入金鹰基金管理有限公司,曾任专户投资部投资经理职务,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、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,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

4、5月份受流动性预期收紧和中美贸易谈判不达预期等不利因素影响,指数快速下跌,但随后又受谈判进展顺利和流动性阶段性缓解因素影响,指数走出"V"字反转。二季度,沪深300指数-1.21%,收于3825.59点。本基金在二季度初期略微减仓,随后一直维持高仓位至今,二季度整体表现和沪深300指数持平。

板块方面,二季度我们继续坚持精选行业龙头的选股策略,精选了处于历史估值底部的地产、银行等板块,也重点配置了电子、医药等有长期投资价值的板块。

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0.953元,本报告期份额净值增长率-0.83%,同期业绩比较基准增长率为-0.30%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度:我们仍然坚持年初的观点,认为市场已经进入底部区域,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:三季度地产投资可能会偏弱,但是基建会托底经济,综合判断我们认为下半年经济会有韧性。流动性层面,我们判断去杠杆仍然会持续,信用短期难以扩张,在这个背景下我们认为流动性的充裕会维持一段时间。

行业和策略层面:我们仍然会保持高仓位,重点配置行业景气周期向上或预期差较大的行业,例如,地产、医药、银行和电子等行业。

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60个工作日低于5000万元的情形,本基金管理人已按法规要求向证监会报送解决方案。

§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	25,482,188.48	92.40
	其中:股票	25,482,188.48	92.40
2	固定收益投资	238,646.30	0.87
	其中:债券	238,646.30	0.87
	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	1,740,817.04	6.31
7	其他各项资产	117,539.92	0.43
8	合计	27,579,191.74	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	7,100.00	0.03
C	制造业	8,165,757.48	29.92
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	2,847,342.00	10.43
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	3,920.00	0.01
J	金融业	2,857,513.00	10.47
K	房地产业	8,245,284.00	30.22
L	租赁和商务服务业	1,587,000.00	5.82
M	科学研究和技术服务业	1,768,272.00	6.48
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	25,482,188.48	93.38

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	000002	万 科A	93,600	2,603,016.00	9.54
2	600383	金地集团	216,700	2,585,231.00	9.47
3	600048	保利地产	193,500	2,469,060.00	9.05
4	603259	药明康德	20,400	1,768,272.00	6.48
5	002415	海康威视	63,500	1,751,330.00	6.42
6	601688	华泰证券	78,400	1,749,888.00	6.41
7	603986	兆易创新	19,400	1,681,980.00	6.16
8	600201	生物股份	106,000	1,663,140.00	6.09
9	601933	永辉超市	159,600	1,629,516.00	5.97
10	002027	分众传媒	300,000	1,587,000.00	5.82

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(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	238,646.30	0.87
	其中:政策性金融债	238,646.30	0.87
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	238,646.30	0.87

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

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	108603	国开1804	1,850.00	185,111.00	0.68
2	108602	国开1704	530.00	53,535.30	0.20

注:本基金本报告期末仅持有两只债券。

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	77,138.27
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,485.65
5	应收申购款	34,916.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	117,539.92

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限证券。

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	27,111,033.56
报告期基金总申购份额	3,834,287.07
减:报告期基金总赎回份额	2,303,677.77
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	28,641,642.86

§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 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过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
个人	1	2019年4月1日至2019年6月30日	9,449,458.45	405,728.89	-	9,855,187.34	34.41%
产品特有风险							

本基金在报告期内,存在报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情形,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,导致本基金的收益水平发生波动。同时,因巨额赎回、份额净值小数保留位数与方式、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,可能触发本基金巨额赎回条款,基金份额持有人将可能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,可能导致本基金的流动性风险;

4)基金提前终止、转型或与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,可能导致在其赎回后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、交易所债券时交易困难的情形。

6)份额占比较高的投资者申购申请被拒绝的风险: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换转入申请。在其他基金份额持有人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换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换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%,该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

9.2 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智慧生活灵活配置混合型证券投资基金发行及募集的文件。

2、《金鹰智慧生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

3、《金鹰智慧生活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