

金鹰智慧生活灵活配置混合型证券投资基金

2021 年第 1 季度报告

2021 年 3 月 31 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

报告送出日期：二〇二一年四月二十一日

§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 2021 年 4 月 20 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 2021 年 1 月 1 日起至 3 月 31 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	6,084,055.97 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 (2021 年 1 月 1 日-2021 年 3 月 31 日)
1.本期已实现收益	1,357,710.86
2.本期利润	-1,899,467.33
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2992
4.期末基金资产净值	9,789,623.68
5.期末基金份额净值	1.609

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	-15.98%	1.79%	-1.33%	0.96%	-14.65%	0.83%
过去六个月	-5.07%	1.78%	7.15%	0.80%	-12.22%	0.98%
过去一年	35.55%	1.78%	21.93%	0.79%	13.62%	0.99%
过去三年	59.15%	1.47%	26.24%	0.82%	32.91%	0.65%
过去五年	60.90%	1.27%	43.61%	0.70%	17.29%	0.57%
自基金合同生效起至今	60.90%	1.27%	43.49%	0.70%	17.41%	0.57%

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 2021 年 3 月 31 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		
王喆	本基金的基金经理，公司权益投资部权益投资总监	2020-01-04	-	22	王喆先生，工商管理硕士。历任沈阳商品交易所分析员、宏源研究发展中心高级行业研究员、宏源证券资产管理部高级投资经理。2010年加入广州证券，担任投资管理部助理投资总监、广州证券红棉1号投资主办等职。2014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内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

一季度，宏观经济延续了复苏趋势，企业盈利仍处于持续回升的过程。但伴随稳增长政策的退出，社融增速高位回落，全年经济增长存在压力。

一季度 A 股市场冲高回落，整体宽幅震荡。上证综指小幅回落 0.9%，创业板下跌 7%，科创板下跌 10.39%。同时板块个股表现差异十分明显，钢铁、煤炭、

建材等受益于经济复苏的周期型板块涨幅居前，军工、券商等高风险偏好板块跌幅居前。而此前市场高度认同较高的蓝筹类个股大幅回落，跌幅明显超出大盘。

由于对全年整体经济增长相对谨慎，一季度我们重点配置了行业景气周期持续回升，且受宏观经济影响不大的科技类成长型的细分行业，如互联网、云计算、网络安全、信创等。

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 1.609 元，本报告期份额净值增长率 -15.98%，同期业绩比较基准增长率为-1.33%。

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，随着稳增长政策的退出，信用逐渐收紧，预计经济增长动力将逐渐减弱，同时紧信用环境下市场风险偏好也有望回落，因此我们判断二季度市场震荡回落的概率较大。同时板块将继续分化，景气周期持续上升且估值合理的弱周期成长型行业及个股具有一定的投资机会。

因此在操作上，将适当保持股票持仓的弹性，同时继续重点持有景气周期持续回升，且受宏观经济影响不大的科技类成长型细分行业，如互联网、云计算、半导体、网络安全、信创等。

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	9,027,759.00	86.92
	其中：股票	9,027,759.00	86.92
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	1,313,088.59	12.64
7	其他各项资产	45,812.18	0.44
8	合计	10,386,659.77	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

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	-	-
C	制造业	1,618,138.00	16.53
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	221,280.00	2.26
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	7,188,341.00	73.43
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	9,027,759.00	92.22

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	600588	用友网络	25,000	892,750.00	9.12
2	000977	浪潮信息	30,100	824,138.00	8.42
3	300379	东方通	19,000	774,630.00	7.91
4	300598	诚迈科技	11,000	744,480.00	7.60
5	688023	安恒信息	2,700	713,691.00	7.29
6	688111	金山办公	2,000	648,000.00	6.62
7	688777	中控技术	8,000	614,560.00	6.28
8	300378	鼎捷软件	26,000	540,800.00	5.52
9	300687	赛意信息	18,000	529,740.00	5.41
10	000066	中国长城	35,000	520,100.00	5.31

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诚迈科技（南京）股份有限公司因业绩预测结果不准确或不及时，于 2020 年 6 月 15 日被深圳证券交易所予以监管关注。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	4,889.16
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	131.28
5	应收申购款	40,791.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	45,812.18

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	7,180,760.07
报告期期间基金总申购份额	2,041,452.95
减：报告期期间基金总赎回份额	3,138,157.05
报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	6,084,055.97

§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

二〇二一年四月二十一日