

# 金鹰智慧生活灵活配置混合型证券投资基金

## 2024 年第 2 季度报告

### 2024 年 6 月 30 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：二〇二四年七月十九日

## §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 2024 年 7 月 18 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 2024 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
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	21,950,789.40 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

	<p>风险、提高收益。</p> <p>本基金将以“智慧生活”作为行业配置和个股投资的主要线索,股票资产占基金资产的比例为 0-95%。本基金投资于智慧生活主题的证券不低于非现金基金资产的 80%。</p>	
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	
下属分级基金的基金简称	金鹰智慧生活混合 A	金鹰智慧生活混合 C
下属分级基金的交易代码	002303	019749
报告期末下属分级基金的份额总额	20,610,999.06 份	1,339,790.34 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 (2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	金鹰智慧生活混合 A	金鹰智慧生活混合 C
1.本期已实现收益	-748,267.25	-51,696.39
2.本期利润	-1,591,590.04	-133,548.69

3.加权平均基金份额本期利润	-0.0755	-0.0739
4.期末基金资产净值	9,881,841.81	639,697.52
5.期末基金份额净值	0.4794	0.4775

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额；

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、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、金鹰智慧生活混合 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	-13.81%	1.55%	-0.49%	0.44%	-13.32%	1.11%
过去六个月	-15.00%	1.52%	2.37%	0.53%	-17.37%	0.99%
过去一年	-45.34%	1.89%	-3.42%	0.52%	-41.92%	1.37%
过去三年	-57.49%	1.79%	-15.91%	0.62%	-41.58%	1.17%
过去五年	-23.01%	1.70%	5.75%	0.68%	-28.76%	1.02%
自基金合同生效起至今	-26.63%	1.48%	23.89%	0.67%	-50.52%	0.81%

#### 2、金鹰智慧生活混合 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	-13.96%	1.55%	-0.49%	0.44%	-13.47%	1.11%
过去六个月	-15.28%	1.52%	2.37%	0.53%	-17.65%	0.99%

自基金合同生效起至今	-18.52%	1.59%	-0.05%	0.52%	-18.47%	1.07%
------------	---------	-------	--------	-------	---------	-------

### 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

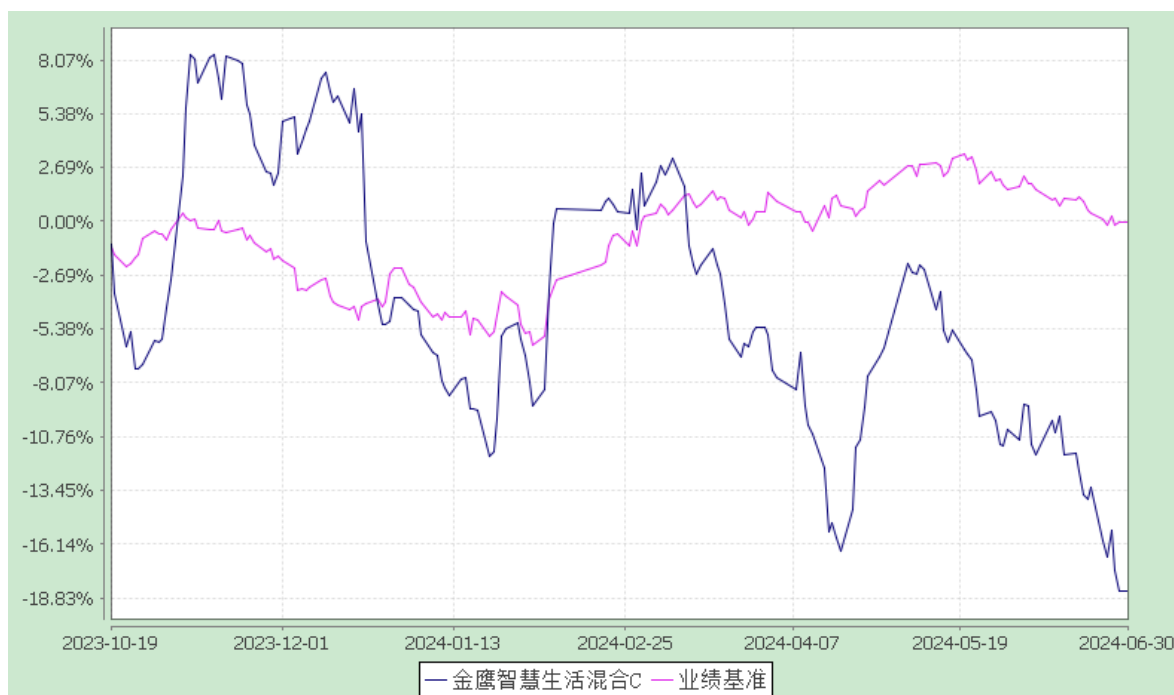
金鹰智慧生活灵活配置混合型证券投资基金  
 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2016 年 3 月 23 日至 2024 年 6 月 30 日)

#### 1. 金鹰智慧生活混合 A:



#### 2. 金鹰智慧生活混合 C:



注：1、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%；

2、本基金自 2023 年 10 月 19 日起增设 C 类基金份额，C 类基金份额首次确认日为 2023 年 10 月 20 日。

## §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		
杨凡	本基金的基金经理	2022-08-17	-	13	杨凡先生，经济学硕士，曾任金鹰基金管理有限公司研究员，广发证券股份有限公司研究员，中科沃土基金管理有限公司基金经理。2019 年 11 月加入金鹰基金管理有限公司，任投资经理，现任权益投资部基金经理。

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离

任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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，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

2024 年二季度国内宏观经济延续一季度的态势，与地产相关的投资和消费依然在寻底，但出口以及与地产关联度较低的消费延续弱改善的态势。总体来看，

宏观经济依然弱势运行，结构分化严重。因此，在这样的宏观经济背景下，二季度 A 股各大指数走势相对疲软。从行业层面来看，与地产关联度较高的板块表现疲软，与出口关联度较高的板块和高股息的红利股表现较好。

2024 年二季度，以煤炭、石化、运营商等为代表的高股息低估值类资产出现了一波较大幅度的上涨，这类资产的投资性价比显著弱化。而一些需求稳定类资产，比如医药、必需消费品等经过持续的下跌，其估值性价比明显提升。基于性价比的考虑，本基金依然坚守医疗类相关板块和个股。当前，本基金重点布局需求稳定类资产，包括医药等。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 0.4794 元，本报告期份额净值增长率为-13.81%，同期业绩比较基准增长率为-0.49%；C 类基金份额净值为 0.4775 元，本报告期份额净值增长率为-13.96%，同期业绩比较基准增长率为-0.49%。

#### 4.5 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，本基金资产净值发生过连续超过 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	9,513,590.00	89.85
	其中：股票	9,513,590.00	89.85
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	1,043,155.74	9.85
7	其他各项资产	31,947.25	0.30
8	合计	10,588,692.99	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	7,765,410.00	73.80
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	-	-
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	-	-
K	房地产业	1,748,180.00	16.62
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	9,513,590.00	90.42

### 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持有通过港股通投资的股票。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 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	002422	科伦药业	26,000	788,580.00	7.49
2	600276	恒瑞医药	20,000	769,200.00	7.31
3	688687	凯因科技	30,000	765,300.00	7.27
4	688506	百利天恒	4,000	725,600.00	6.90
5	688235	百济神州	5,500	637,120.00	6.06
6	688076	诺泰生物	8,000	626,240.00	5.95
7	300583	赛托生物	45,000	546,750.00	5.20
8	688677	海泰新光	13,000	509,990.00	4.85
9	300298	三诺生物	20,000	506,800.00	4.82
10	688062	迈威生物	17,000	491,980.00	4.68

### 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 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明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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	19,743.53
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	12,203.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	31,947.25

**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

项目	金鹰智慧生活混合A	金鹰智慧生活混合C
本报告期期初基金份额总额	21,644,494.93	1,560,681.03
报告期期间基金总申购份额	2,733,439.32	4,641,749.01
减：报告期期间基金总赎回份额	3,766,935.19	4,862,639.70
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	20,610,999.06	1,339,790.34

**§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  
二〇二四年七月十九日