

重要提示

基金管理人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。
本报告中财务资料未经审计。
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 2 columns: 项目 (Item) and 数值 (Value). Includes fields like 基金简称 (金鹰周期优选混合), 场内简称, 基金代码 (004211), 基金运作方式 (契约型开放式), 基金合同生效日 (2018-01-29), 报告期末基金份额总额 (198,219,600.24), 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 2 columns: 主要财务指标 (Main Financial Indicators) and 报告期 (2019-01-01 至 2019-03-31). Includes 本期已实现收益 (5,475,288.26), 本期利润 (26,192,948.08), 加权平均基金份额本期利润 (0.1239), 期末未分配利润 (195,279,896.23), 期末基金份额净值 (0.9850).

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。

基金净值表现

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

Table with 6 columns: 阶段 (Period), 净值增长率① (14.43%), 净值增长率标准差② (0.80%), 业绩比较基准收益率③ (17.17%), 业绩比较基准收益率标准差④ (0.93%), ①-③ (-2.74%), ②-④ (-0.13%).

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



注：1、本基金合同于2018年1月29日生效；
2、按基金合同约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关规定；
3、本基金的业绩比较基准是：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 2 columns: 其他指标 (Other Indicators) and 报告期 (2019-01-01至2019-03-31). Includes 其他指标 (0.9850).

基金经理（或基金经理小组）简介

Table with 5 columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任本基金的基金经理期限 (Start/End Date), 证券从业年限 (Years of Experience), 说明 (Remarks). Lists 王皓 (Wang Hao) as the manager.

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。

管理人对报告期内本基金运作遵信情况的说明

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。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，各投资组合按照投资管理流程和流程独立决策，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。

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，未发现同日及反向交易成交较多的单边交易超过该证券当日成交量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

一季度，稳增长政策效果逐渐显现，一季度基建投资回升，并带动宏观经济平稳运行。随着国家对金融市场定位调整，及各类改革开放政策的加速推进，市场风险偏好大幅回升，并持续流入股市场，推动市场持续上行。
海外方面，美国经济出现企稳迹象，本轮美元加息周期有望结束，吸引外资持续流入股市场。

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0.9850元，本报告期份额净值增长率为14.43%，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

展望二季度，预计宏观经济仍显韧性，在经济整体仍以平稳为主，但受到农产品价格和原油价格上涨的影响，物价水平会有所回升，对流动性进一步宽松的预期或有影响。在一季度市场大幅上行后，我们预期二季度市场整体以震荡为主，同时个股分化会更加加剧。
在操作中，我们重点把握个股结构性机会，重点配置业绩增长，且估值相对合理的个股，如前期产业链中部分细分行业中的优质公司。同时也会根据国家宏观经济政策的实施，逐渐布局未来发展空间巨大的成长型公司，及基本面出现明显改善的公司。

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。

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号 (No.), 项目 (Item), 金额 (元) (Amount), 占基金总资产的比例 (%) (Percentage). Lists categories like 权益类投资 (79,109,422.53), 固定收益投资 (79,109,422.53), 贵金属投资, 买入返售金融资产 (75,000,000.00), 其他资产 (879,546.81).

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

报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with 4 columns: 序号 (No.), 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage). Lists industries like 农林牧渔, 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, etc.

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 5 columns: 序号 (No.), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity), 公允价值 (元) (Fair Value), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage). Lists top 10 stocks like 沙钢集团, 沙钢股份, 中钢国际, etc.

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号 (No.), 债券品种 (Bond Type), 公允价值 (元) (Fair Value), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage). Lists categories like 国家债券, 央行票据, 金融债券, 企业债券, 企业短期融资券, 中期票据, 可转债(可交换债), 同业存单, 其他, 合计.

注：本基金本报告期末未持有债券资产。

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 4 columns: 序号 (No.), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 数量 (张) (Quantity), 公允价值 (元) (Fair Value), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage).

注：本基金本报告期末未持有债券资产。

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

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

Table with 4 columns: 序号 (No.), 贵金属代码 (Precious Metal Code), 贵金属名称 (Precious Metal Name), 数量 (份) (Quantity), 公允价值 (元) (Fair Value), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage).

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名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

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with 5 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量(买/卖) (Position), 合约市值(元) (Contract Value), 公允价值变动(元) (Fair Value Change), 风险说明 (Risk Statement).

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

本基金投资股指期货的投资政策

无。

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本期国债期货交易政策

无。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with 5 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量(买/卖) (Position), 合约市值(元) (Contract Value), 公允价值变动(元) (Fair Value Change), 风险指标说明 (Risk Indicator Statement).

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未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。

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没有超出基金合同规定的备选股票库。

其他资产构成

Table with 3 columns: 序号 (No.), 名称 (Name), 金额 (元) (Amount). Lists 存出保证金 (69,850.00), 应收证券清算款 (788,562.02), 应收股利, 应收利息, 应收中购款, 其他应收款, 其他, 合计 (879,546.81).

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。

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入原因，分项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 2 columns: 项目 (Item) and 数值 (Value). Includes 报告期初基金份额总额 (220,418,685.04), 报告期间基金份额总额 (837,018.18), 报告期间基金份额总额 (23,006,100.98), 报告期末基金份额总额 (198,219,600.24).

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

基金管理人持有本基金份额变动情况

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 基金份额 (Fund Shares). Includes 报告期初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, 报告期末管理人持有的基金份额, 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例(N).

注：无。

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table with 6 columns: 序号 (No.), 交易方式 (Transaction Type), 交易日期 (Transaction Date), 交易份额 (份) (Quantity), 交易金额 (元) (Amount), 适用费率 (Applicable Rate).

注：无。

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

Table with 5 columns: 项目 (Item), 持有份额总数 (Total Shares), 持有份额占基金总份额比例 (Percentage), 发起份额总数 (Initiated Shares), 发起份额占基金总份额比例 (Percentage), 发起份额承诺持有期限 (Commitment Period).

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 3 columns: 投资者类别 (Investor Category), 序号 (No.), 持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间 (Time Interval), 期初份额 (Start Shares), 申购份额 (Purchase Shares), 赎回份额 (Redemption Shares), 报告期末持有基金情况 (Fund Situation at End of Report).

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、中国证监会批准基金发行及募集的文件。
2、《金鹰周期优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。
3、《金鹰周期优选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复、营业执照、公司章程。
5、基金托管人业务资格批复和营业执照。

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：4006-135-8888或020-83961880。