

金鹰信息产业股票型证券投资基金
(金鹰添惠纯债债券型证券投资基金)

2018年第2季度报告

2018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：广州农村商业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年七月十八日

§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。

基金托管人广州农村商业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年7月17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2018年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 金鹰信息产业股票型证券投资基金

基金简称	金鹰信息产业股票
基金主代码	003853
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年4月18日
报告期末基金份额总额	2,217,142.84份
投资目标	本基金主要投资于信息产业证券，在有效控制风险并保持良好流动性的前提下，通过积极主动的资产配置，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	本基金将从宏观经济、财政货币政策、经济景气度和货币资金供求等多个维度进行综合分析，主动判断市场时机，在严格控制投资组合风险的前提下，进行积极灵活的资产配置，合理确定基金

	在股票类、债券类、现金类等大类资产上的投资比例，最大限度地提高基金资产的收益。	
业绩比较基准	中证 TMT 产业主题指数收益率×80%+中债总财富（总值）指数收益率×20%	
风险收益特征	本基金为股票型基金，其风险和预期收益均高于混合型基金、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	广州农村商业银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	金鹰信息产业股票 A	金鹰信息产业股票 C
下属两级基金的交易代码	003853	005885
报告期末下属两级基金的份额总额	240,101.93 份	1,977,040.91 份

2.2 金鹰添惠纯债债券型证券投资基金

基金简称	金鹰添惠纯债债券
基金主代码	003853
交易代码	003853
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年3月10日
报告期末基金份额总额	587,759.17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	本基金主要投资于固定收益类金融工具，在充分考虑基金资产的安全性、收益性及流动性及严格控制风险的前提下，通过分析经济周期变化、货币政策、债券供求等因素，持续研究债券市场运行状况、研判市场风险，制定债券投资策略，挖

	掘价值被低估的标的券种，力争实现超越业绩基准的投资收益。
业绩比较基准	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	广州农村商业银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

3.1.1 金鹰信息产业股票型证券投资基金

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2018年4月18日（基金合同生效日）-2018年6月30日)	
	金鹰信息产业股票 A	金鹰信息产业股票 C
1.本期已实现收益	-8,250.54	-425.57
2.本期利润	-7,567.66	10,194.84
3.加权平均基金份额 本期利润	-0.0180	0.0450
4.期末基金资产净值	243,231.18	2,023,875.03
5.期末基金份额净值	1.0130	1.0237

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。

3.1.2 金鹰添惠纯债债券型证券投资基金

单位：人民币元

主要财务指标	报告期
	(2018年4月1日-2018年4月17日)
1.本期已实现收益	-566.54
2.本期利润	-367.98
3.加权平均基金份额本期利润	0.0000
4.期末基金资产净值	605,486.97
5.期末基金份额净值	1.0302

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 金鹰信息产业股票型证券投资基金

（报告期：2018年4月18日-2018年6月30日）

3.2.1.1 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. 金鹰信息产业股票 A:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-1.67%	0.10%	-12.55%	1.48%	10.88%	-1.38%
-------	--------	-------	---------	-------	--------	--------

2. 金鹰信息产业股票 C:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-0.63%	0.15%	-12.55%	1.48%	11.92%	-1.33%

注：1、金鹰添惠纯债债券型证券投资基金自 2018 年 4 月 18 日起转型为金鹰信息产业股票型证券投资基金

2、转型后，“过去三个月”计算期间为 2018 年 4 月 18 日至 2018 年 6 月 30 日

3、转型后本基金的业绩比较基准是：中证 TMT 产业主题指数收益率×80%+中债总财富（总值）指数×20%。

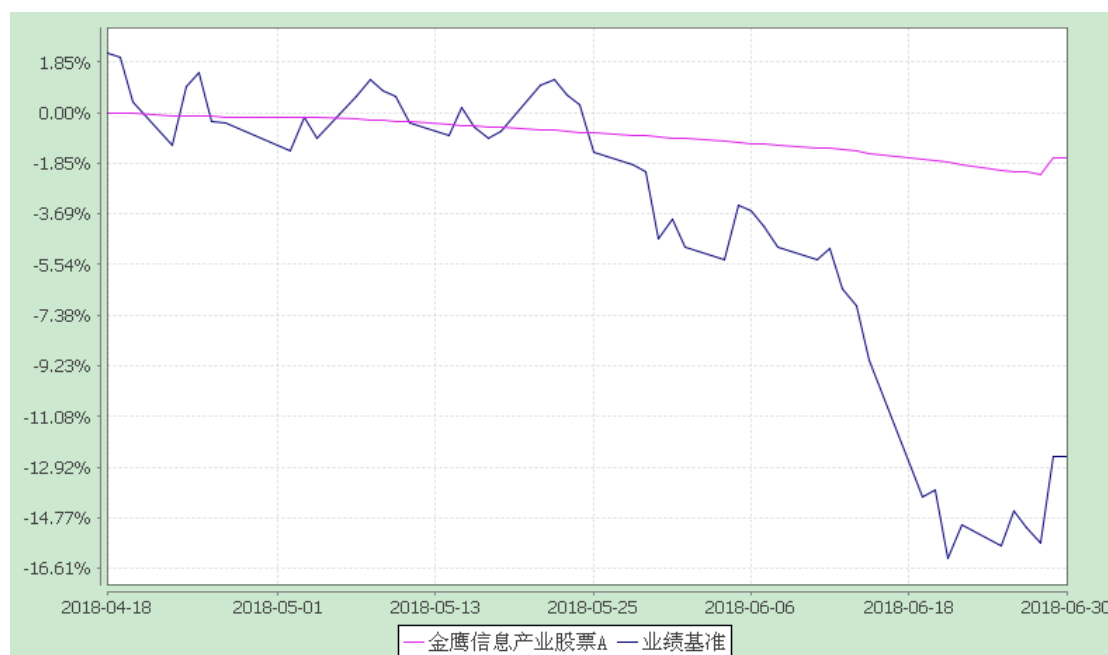
3.2.1.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

金鹰信息产业股票型证券投资基金

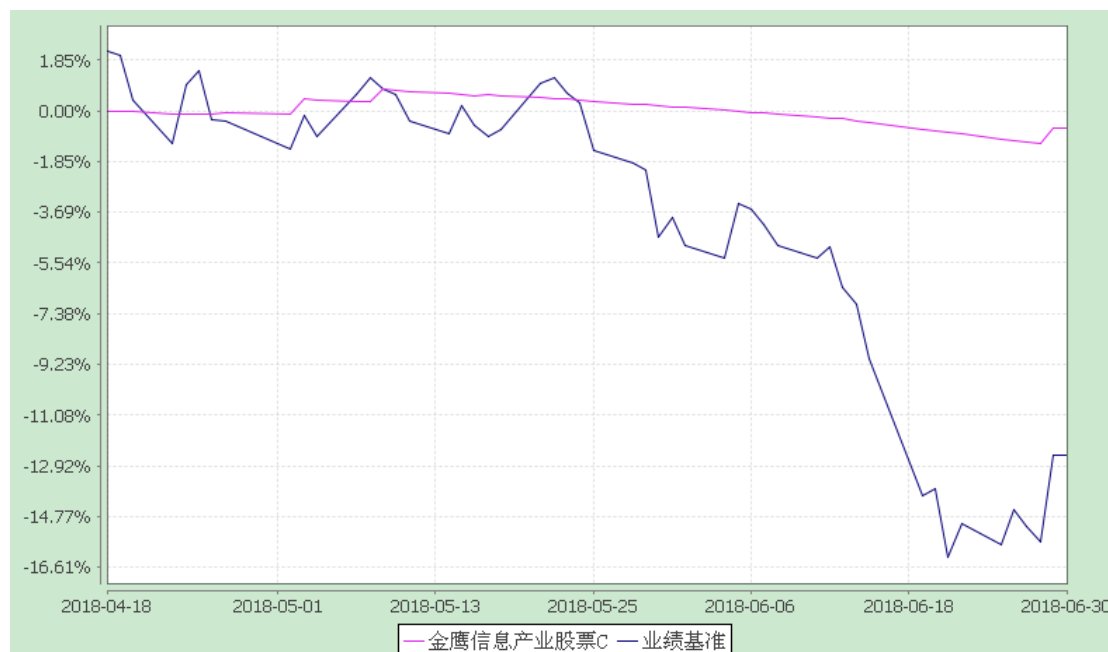
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2018 年 4 月 18 日至 2018 年 6 月 30 日)

1、金鹰信息产业股票 A



2、金鹰信息产业股票 C



注：1、金鹰添惠纯债债券型证券投资基金自 2018 年 4 月 18 日起转型为金鹰信息产业股票型证券投资基金。

2、截至 2018 年 6 月 30 日本基金仍在建仓期。

3、转型后本基金的业绩比较基准是：中证 TMT 产业主题指数收益率×80%+中债总财富（总值）指数×20%。

3.2.2 金鹰添惠纯债债券型证券投资基金

（报告期：2018年4月1日-2018年4月17日）

3.2.2.1 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	-0.06%	0.01%	0.43%	0.04%	-0.49%	-0.03%

注：1、金鹰添惠纯债债券型证券投资基金自2018年4月18日起转型为金鹰信息产业股票型证券投资基金

2、转型前，“过去三个月”计算期间为2018年4月1日至2018年4月17日

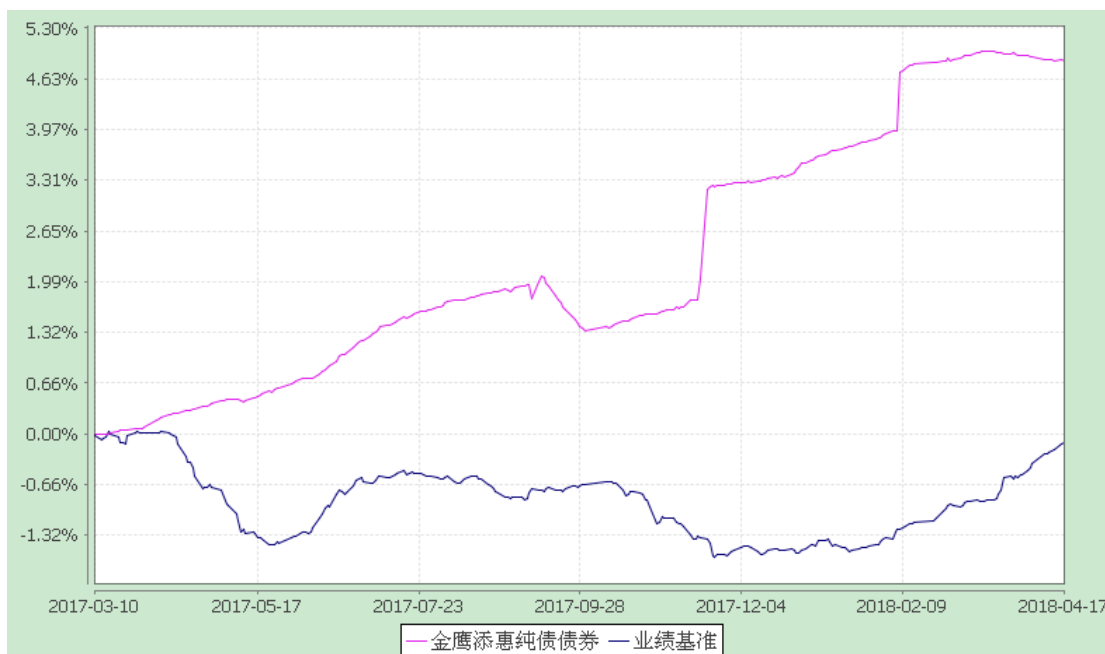
3、转型前本基金的业绩比较基准是：中债综合（全价）指数收益率×80%+一年期定期存款利率（税后）×20%。

1.1.1.1 自基金合同生效以来基金份额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

金鹰添惠纯债债券型证券投资基金

份额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3月10日至2018年4月17日)



注：1、金鹰添惠纯债债券型证券投资基金自2018年4月18日起转型为金鹰信息产业股票型证券投资基金

2、转型前本基金的业绩比较基准是：中债综合（全价）指数收益率×80%+一年期定期存款利率（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		
陈立	基金经理	2018-07-07	-	11	陈立先生，复旦大学经济学硕士。曾任银华基金管理有限公司医药行业研究员，2009年6月加盟金鹰基金管理有限

					公司，先后任行业研究员，非周期组组长、基金经理助理、投资经理。现任金鹰主题优势混合型证券投资基金、金鹰智慧生活灵活配置混合型证券投资基金、金鹰信息产业股票型证券投资基金、金鹰医疗健康产业股票型证券投资基金基金经理。
刘丽娟	固定收益部总监，基金经理	2017-03-10	2018-07-07	11	刘丽娟女士，中南财经政法大学工商管理硕士，历任恒泰证券股份有限公司交易员，投资经理，广州证券股份有限公司资产管理总部固定收益投资总监。2014年12月加入金鹰基金管理有限公司，任固定收益部总监。现任金鹰货币市场证券投资基金、金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金、金鹰添享纯债债券型证券投资基金、金鹰现金增益交易型货币市场基金、金鹰添荣纯债债券型证券投资基金、金鹰医疗健康产业股票型证券投资基金基金经理。

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合规守信情况的说明

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

债市方面，2018年二季度债券市场收益率呈整体下行走势。4月定向降准公布后，债券收益率快速大幅下行，随后基本面悲观预期和货币政策转向预期修正，市场收益率又反弹至降准前高位。随着贸易战的反复、经济金融数据不佳、季末月货币市场流动性超预期宽松刺激下，债券收益率再次大幅下行，整个二季度十年国开债收益率下行近40bp，一年国开债收益下行约30bp，短期存单收益率大幅下行至4%以下。在信用紧缩环境下，利率债表现好于信用债，高等级表现好于中低评级。

流动性层面，央行在4月份实施降准置换MLF，在6月底再次宣布定向降准。在4月公布降准置换MLF但未正式落地前，在大额缴税影响下，流动性超预期紧张，在缴税因素消退后，流动性恢复平稳。6月央行并未跟随美联储上

调政策利率，6月底的国务院常务会议和央行货币政策例会都表示要坚持稳健中性的货币政策，松紧适度，要保持流动性合理充裕。流动性合理充裕的提法和以往出现了明显变化，6月底货币市场流动性超预期宽松。

权益市场方面，二季度受到内外双重的压力，市场整体弱势下行。经济运行方面，在经历过去几年的去库存、去产能后，二季度经济总体仍是平稳扩张的。受到国内资管新规出台，社会融资规模增量大幅下降，体现了金融行业去杠杆的效应。二季度中美贸易摩擦冲突不断，期间发生了制裁中兴通讯的事件，引发了市场对美国全球战略重大调整的思考和担忧。

二季度上证综指下跌了10.1%，深成指下跌13.7%，中小板指数下跌13.0%，而创业板指数下跌15.5%。行业表现上，消费类的食品饮料、餐饮旅游、家电、医药表现相对居前，且仅有食品饮料和餐饮旅游两个行业呈现上涨。通信、电力设备、传媒、军工等跌幅居前。

本基金于2018年4月17日正式实施转型，转型后的金鹰信息产业股票型证券投资基金将重点投资于信息产业证券。自2018年4月18日（含）起6个月内的时间区间为本基金的投资转型期。基于国内金融行业去杠杆、美国贸易摩擦如何发展、美国持续加息等内外因素的不确定，本基金采取相对谨慎的建仓态度。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2018年4月17日，金鹰添惠纯债债券型证券投资基金，报告期内（2018年4月1日-2018年4月17日）份额净值为1.0302元，本报告期份额净值增长率为-0.06%，同期业绩比较基准增长率为0.43%。

截至2018年6月30日，本基金（金鹰信息产业股票型证券投资基金），报告期内（2018年4月18日-2018年6月30日）A类份额净值为1.0130元，本报告期份额净值增长率为-1.67%，同期业绩比较基准增长率为-12.55%。C类基金份额净值为1.0237元，本报告期份额净值增长率-0.63%，同期业绩比较基准增长率为-12.55%。

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，本基金认为市场短期继续处于内外都不利局面。在经济整体平稳扩张的环境下，才有利于实施金融去杠杆。货币政策方面呈现“稳货币，紧

信用，严监管”的态势。贸易摩擦改变市场对出口增长趋势的预期，从而增加经济增长下滑的担忧。三季度需要观察内外双重压力下，宏观政策修正年初的判断进行调整的可能。

但中期本基金也不悲观。实施金融去杠杆，有助于无风险利率下行，堵住资金偏门，引导资金到更理性的投资渠道上。经历信用的收缩，行业龙头公司竞争优势得到加强，确定性更高。在经历恐慌下跌后，风险得到释放，有利于本基金更加主动的选股。本基金将紧跟信息产业发展变化趋势，努力把握行业发展方向，精选具有核心竞争优势，成长性明确的优质公司，努力为基金持有人创造更好的回报。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金资产净值已发生连续超过 20 个工作日低于 5000 万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 金鹰信息产业股票型证券投资基金

(报告期：2018年4月18日-2018年6月30日)

5.1.1 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	221,828.00	9.36
	其中：股票	221,828.00	9.36
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	2,141,605.29	90.36
7	其他各项资产	6,532.88	0.28
8	合计	2,369,966.17	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。

5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.1.2.1 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	78,220.00	3.45
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	143,608.00	6.33
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	221,828.00	9.78

5.1.2.2 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。

5.1.3 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	600498	烽火通信	1,900	47,215.00	2.08
2	300017	网宿科技	4,000	42,840.00	1.89
3	600845	宝信软件	1,300	34,255.00	1.51
4	300383	光环新网	2,500	33,525.00	1.48
5	300454	深信服	300	32,988.00	1.46
6	000977	浪潮信息	1,300	31,005.00	1.37

注：本基金本报告期末仅持有6只股票。

5.1.4 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投资。

5.1.5 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投资。

5.1.6 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。

5.1.7 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投资。

5.1.8 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。

5.1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.1.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货持仓。

5.1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无

5.1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.1.10.1 本期国债期货投资政策

无

5.1.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金报告期末未持有国债期货投资。

5.1.11 投资组合报告附注

5.1.11.1 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。

5.1.11.2 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。

5.1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	158.47
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	73.41
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	6,301.00
8	其他	-
9	合计	6,532.88

5.1.11.4 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可转换债券。

5.1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.1.11.6 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。

5.2 金鹰添惠纯债债券型证券投资基金

(报告期: 2018年4月1日-2018年4月17日)

5.2.1 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	660,098.00	91.28
	其中: 股票	660,098.00	91.28
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	34,801.66	4.81
7	其他各项资产	28,269.84	3.91
8	合计	723,169.50	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。

5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2.2 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。

5.2.3 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

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.2.4 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	660,098.00	109.02
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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	660,098.00	109.02

5.2.5 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	019540	16 国债 12	2,000.00	199,960.00	33.02
2	019563	17 国债 09	4,600.00	460,138.00	76.00

注：本基金本报告期末仅持有2只债券。

5.2.6 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。

5.2.7 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

本基金报告期末未持有贵金属投资。

5.2.8 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。

5.2.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.2.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金报告期末无股指期货持仓。

5.2.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无

5.2.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.2.10.1 本期国债期货投资政策

无

5.2.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金报告期末未持有国债期货投资。

5.2.11 投资组合报告附注

5.2.11.1 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。

5.2.11.2 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。

5.2.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	222.94
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	19,211.40
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	8,835.50
8	其他	-
9	合计	28,269.84

5.2.11.4 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可转换债券。

5.2.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.2.11.6 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

6.1 金鹰信息产业股票型证券投资基金

单位：份

项目	金鹰信息产业股票A	金鹰信息产业股票C
基金合同生效日基金份额总额	587,759.17	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	10,078.72	2,484,053.53
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	357,735.96	507,012.62
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	240,101.93	1,977,040.91

6.2 金鹰添惠纯债债券型证券投资基金

单位：份

本报告期期初基金份额总额	610,484.35
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	96.93
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	22,822.11
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-

本报告期期末基金份额总额	587,759.17
--------------	------------

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 金鹰信息产业股票型证券投资基金

7.1.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	金鹰信息产业股票A	金鹰信息产业股票C
报告期期初管理人持有的本基金份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末买入/申购总份额	-	981,546.92
基金合同生效日起至报告期期末卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	-	981,546.92
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	-	44.27

7.1.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2018-06-26	981,546.92	1,000,000.00	0.00%
合计			981,546.92	1,000,000.00	

7.2 金鹰添惠纯债债券型证券投资基金

7.2.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 金鹰信息产业股票型证券投资基金

8.1.1 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	期初	申购	赎回份	持有份额	份额占

		比例达到或者超过20%的时间区间	份额	份额	额		比
机构	1	2018年6月27日至2018年6月30日	-	981,546.92	-	981,546.92	44.27%
	2	2018年6月27日至2018年6月30日	-	981,546.92	-	981,546.92	44.27%
	3	2018年4月18日至2018年6月13日	244,495.14	-	244,495.14	-	0.00%
	4	2018年4月18日至2018年6月26日	200,000.00	-	-	200,000.00	9.02%

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。

8.1.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

8.2 金鹰添惠纯债债券型证券投资基金

8.2.1 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	2018年4月2日至2018年4月17日	244,495.14	-	-	244,495.14	45.28%
	2	2018年4月2日至2018年4月17日	200,000.00	-	-	200,000.00	37.04%

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。

8.2.2 影响投资者决策的其他重要信息

金鹰添惠纯债债券型证券投资基金经持有人大会表决通过，自2018年4月18日起转型为金鹰信息产业股票型证券投资基金。相关事项详情请查阅本基金管理人相关公告。

§9 备查文件目录

9.1 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、《金鹰信息产业股票型证券投资基金基金合同》。
- 3、《金鹰信息产业股票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。
- 6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、季度报告、半年度报告、更新的招募说明书及其他临时公告。

9.2 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

9.3 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

二〇一八年七月十八日