

金鹰元禧混合型证券投资基金
(金鹰保本混合型证券投资基金)

2017年第2季度报告

2017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：二〇一七年七月二十日

§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2017年7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2017年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 金鹰元禧混合型证券投资基金

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	63,055,508.54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。
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	
下属两级基金的基金简称	金鹰元禧混合 A	金鹰元禧混合 C
下属两级基金的交易代码	210006	002425
报告期末下属两级基金的份额总额	33,950,677.01 份	29,104,831.53 份

2.2 金鹰保本混合型证券投资基金

基金简称	金鹰保本混合
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	2011 年 5 月 17 日
报告期末基金份额总额	64,986,967.84 份
投资目标	采用改进的固定比例组合保险策略（CPPI），引入收益锁定机制，在严格控制投资风险、保证本金安全的基础上，力争在保本期结束时，实现基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金的保本策略为改进的固定比例组合保险策略（CPPI），是本基金投资运作过程中的核心策略；投资策略采用“自上而下”的投资视角，根据宏观经济与资本市场运行状况、固定收益类与权益类资产风险收益特性、基金净资产、价值底线，定性分析与定量分析并用，灵活动态地选取适当的风险乘数，以期对固定收益类与权益类资产之间的配置额进行优化调节，力争在确保本金安全的前提下，获

	取投资收益。	
业绩比较基准	3年期银行定期存款利率（税后）	
风险收益特征	本基金为积极配置的保本混合型基金，属于证券投资基金当中的低风险品种，其长期平均风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金，但高于货币市场基金。	
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	
基金保证人	广州越秀金融控股集团有限公司	
下属两级基金的基金简称	金鹰保本混合 A	金鹰保本混合 C
下属两级基金的交易代码	210006	002425
报告期末下属两级基金的份额总额	35,409,225.15 份	29,577,742.69 份

§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 金鹰元禧混合型证券投资基金

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2017年6月27日（基金合同生效日）-2017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	16,288.43	13,204.78
2.本期利润	17,651.30	14,375.38
3.加权平均基金份额	0.0005	0.0005

本期利润		
4.期末基金资产净值	37,972,276.34	32,613,476.60
5.期末基金份额净值	1.1185	1.1206

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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。2、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 金鹰保本混合型证券投资基金

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2017年4月1日-2017年6月26日)	
	金鹰保本混合 A	金鹰保本混合 C
1.本期已实现收益	529,455.15	309,396.54
2.本期利润	467,208.95	249,874.73
3.加权平均基金份额 本期利润	0.0112	0.0079
4.期末基金资产净值	39,585,281.85	33,128,761.68
5.期末基金份额净值	1.1179	1.1201

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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。2、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 金鹰元禧混合型证券投资基金

(报告期：2017年6月27日-2017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. 金鹰元禧混合 A:

阶段	份额净值	份额净值增	业绩比较	业绩比较基	①—③	②—
----	------	-------	------	-------	-----	----

	增长率①	长率标准差 ②	基准收益 率③	准收益率标 准差④		④
过去三个 月	0.04%	0.01%	0.05%	0.14%	-0.01%	-0.13 %

注：1、金鹰保本型混合证券投资基金于2011年5月16日成立,存续期截止日为2017年6月26日,2017年6月27日起转型为本基金,即金鹰元禧混合型证券投资基金。

2、转型前,“过去三个月”计算期间为上季度结束日2017年4月1日至转型前基金存续期截止日2017年6月26日。

3、转型后,“过去三个月”计算期间为转型后基金存续期起始日2017年6月27日至二季度结束日2017年6月30日。

2. 金鹰元禧混合 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	0.05%	0.01%	0.05%	0.14%	0.00%	-0.13 %

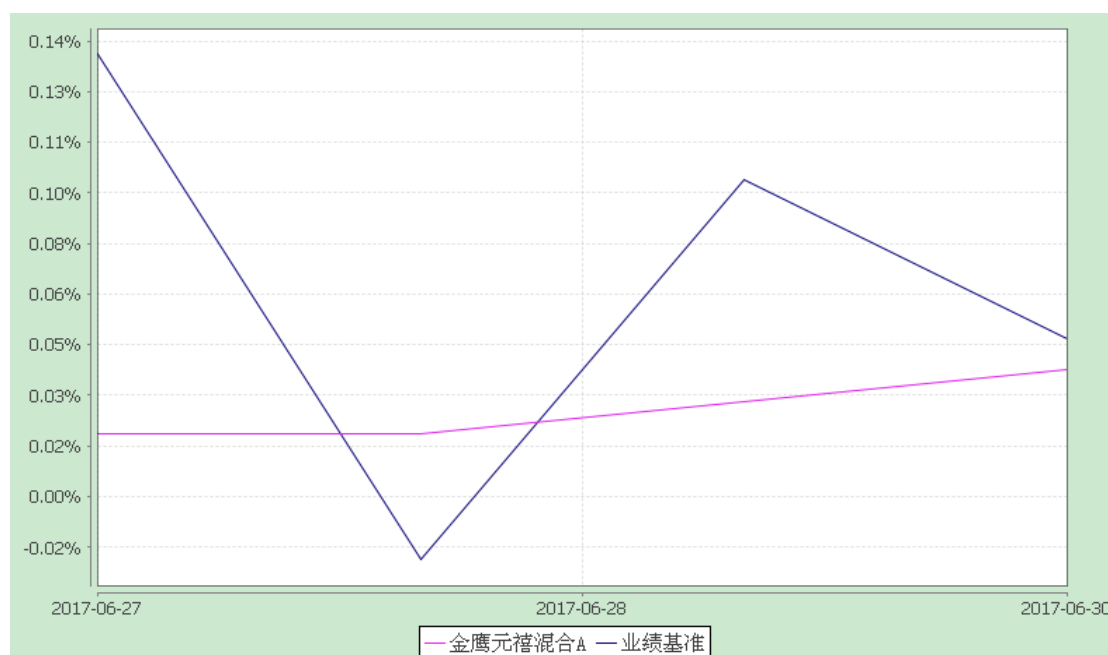
3.2.1.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

金鹰元禧混合型证券投资基金

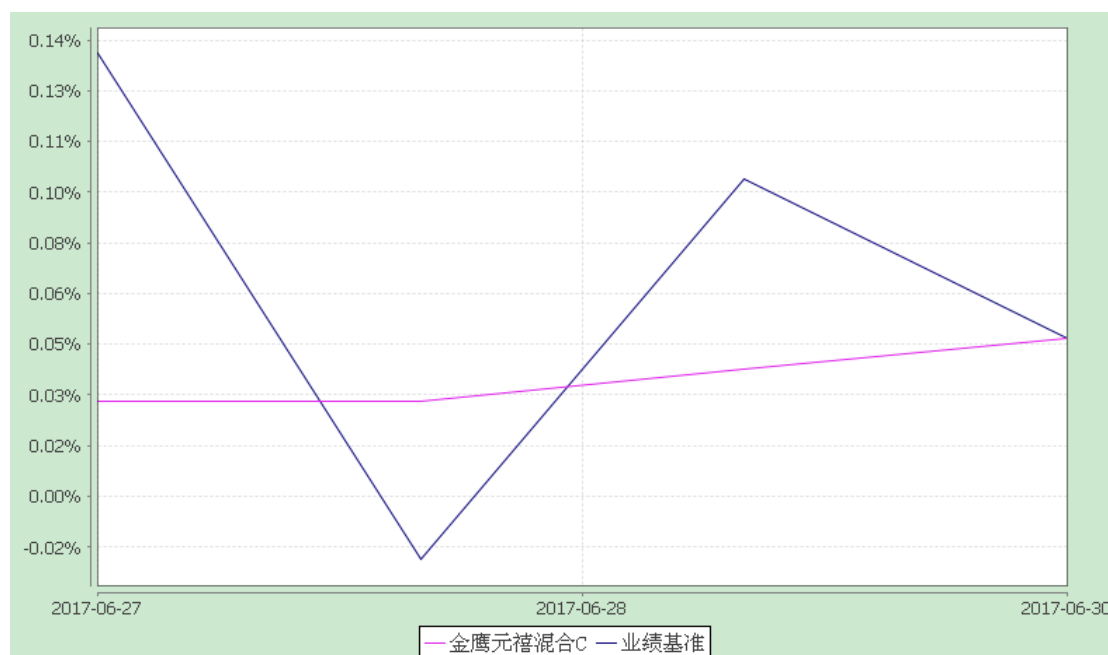
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2017年6月27日至2017年6月30日)

1、金鹰元禧混合 A



2、金鹰元禧混合 C



3.2.2 金鹰保本混合型证券投资基金

(报告期: 2017年4月1日-2017年6月26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

1. 金鹰保本混合 A:

阶段	份额净值	份额净值增	业绩比较	业绩比较基	①-③	②-

	增长率①	长率标准差 ②	基准收益 率③	准收益率标 准差④		④
过去三个 月	0.90%	0.06%	0.67%	0.01%	0.23%	0.05%

2. 金鹰保本混合 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	0.72%	0.03%	0.67%	0.01%	0.05%	0.02%

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

金鹰保本混合型证券投资基金

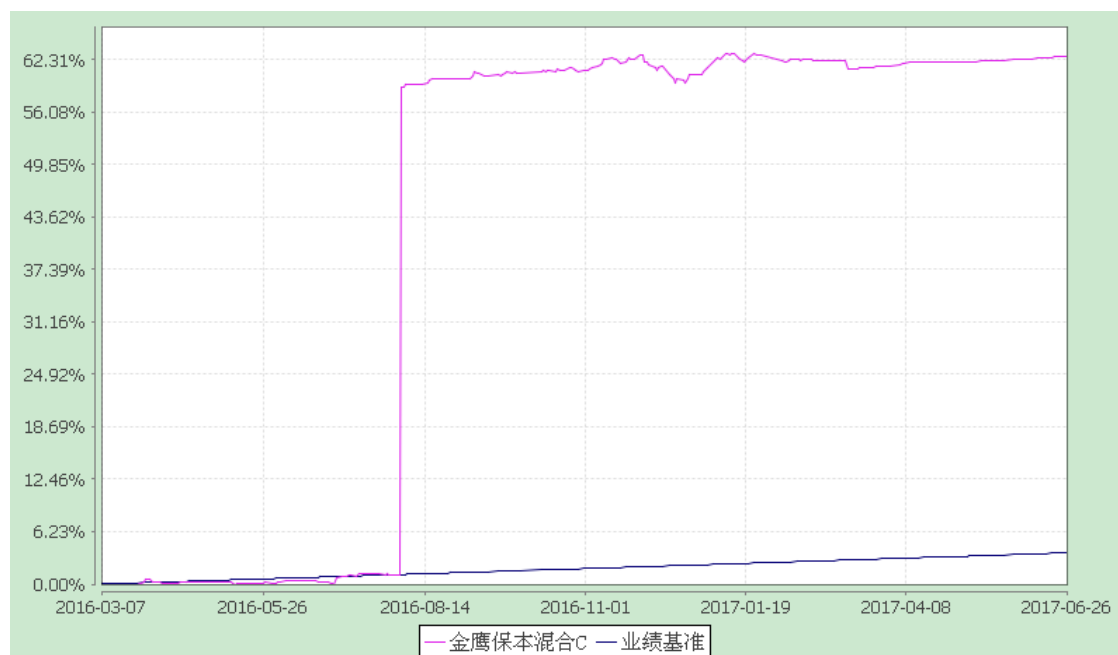
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2011年5月17日至2017年6月26日)

1、金鹰保本混合 A



2、金鹰保本混合 C



注:(1)本基金由金鹰保本混合型证券投资基金于2017年6月27日转型而来,目前仍在建仓期。

(2) 本基金的投资比例是: 股票资产占基金资产的0-40%; 每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的保证金以后, 保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

(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	基金经理	2017-06-27	-	6	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，现任金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）、金鹰元禧混合型证券投资基金、金鹰持久增利债券型证券投资基金（LOF）、金鹰添利中长期信用债债券型证券投资基金基金经理。
倪超	基金经理	2017-06-27	-	8	倪超先生，厦门大学硕士研究生。2009年6月加盟金鹰基金管理有限公司，先后任行业研究员，消费品研究小组组长、基金经理助理。现任金鹰行业优势混合型证券投资基金、金鹰元禧混合型证券投资基金、金鹰元祺保本混合型证券投资基金基金经理。

注：（1）本基金由金鹰保本混合型证券投资基金转型而来，转型为本基金后合同生效日为2017年6月27日。

（2）在金鹰保本混合型证券投资基金转型前，由戴骏先生、倪超先生共同管理该基金。

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

2017年第二季度，整个债券市场基本上经历了一波先跌后涨的行情。首先，在前半个季度，央行维持对债券市场流动性的紧平衡控制，证监会、保监会、银监会也相继出台监管文件，债券市场对委外赎回的预期逐步加强。同时，外围市场美联储加息的预期不断增强，美国国债收益率小幅走高。虽然经济数据依然比较疲软，但债券市场收益率出现的明显的上行。十年期国债收益从月初的3.28%一度上行至3.69%，上行41bp，3年AAA中票收益从月初的4.32%一度上行至4.99%，上行幅度达到67bp。但后半月，伴随着央行不断提供货币市场流动性，同时，监管机构的监管口径也有一定的放松，外围市场，美国10年期国债收益率也出现了一定的下行，人民币小幅升值。一系列的利好催生了各家投资机构的配置热情，长端国债收益率出现了小幅下行并保持震荡，月末下行12个bp到3.57%，3年AAA中票则在配置型机构的较强需求下较大幅度下行51bp至4.48%。

本基金由于在二季度内保本期到期并进行了基金的转型，故主要投资方向为短期债券，以保证在保本期到期后能够保证基金的流动性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2017年6月26日，金鹰保本混合型证券投资基金，报告期内（2017年4月1日-2017年6月26日）A类份额净值为1.1179元，本报告期份额净值增长率为0.90%，同期业绩比较基准增长率为0.67%。C类基金份额净值为1.1201

元，本报告份额期净值增长率 0.72% ，同期业绩比较基准增长率为 0.67%。

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金（金鹰元禧混合），报告期内（2017 年 6 月 27 日-2017 年 6 月 30 日）A 类份额净值为 1.1185 元，本报告期份额净值增长率为 0.04%，同期业绩比较基准增长率为 0.05%。C 类基金份额净值为 1.1206 元，本报告期份额净值增长率 0.05% ，同期业绩比较基准增长率为 0.05%。

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，房地产投资与净出口回落的压力将有所增大，叠加四季度 GDP 增速基数较高，均会加大经济增速下滑压力，存在单季增速跌破 6.5%的可能。物价来看，PPI 方面，2 月同比增速如期见顶，年内将趋势性回落；考虑基数因素，四季度面临快速下滑压力。CPI 方面，预计同比增速在三季度将温和上行，四季度同比可能低于三季度，类似于年初的预期差仍然存在。不确定性可能来自于服务消费支出增速、气温变化、政策影响与原油价格的超预期变化，但即便考虑这些不确定性的影响，全年 CPI 增速大概率低于去年。通缩压力重现。从基本面来看，对债券市场的走强的支撑力度逐步增强。从监管强度来看，下半年银行同业负债去杠杆进入到后半段，三季度有望观察到同业存单需求下滑，同业存单利率也将真正进入下行通道。而去杠杆过程中重新回流到大行的资金，也将产生出新的配置需求，且银行流动性改善也进一步刺激银行配置端需求的恢复。此外保险仍处于扩张通道，且万能险监管对债券配置影响不大，而严监管下无风险利率价值上升，保险对债券的配置力度也在加大。但唯一不确定的是海外央行不断缩表，将对我国利率带来一定的实际影响。我们预计，债券市场还将出现小幅的调整，调整结束后，将会迎来一波中期的下行行情。

本基金在三季度的投资中，主要将以转债的投资策略为主，一级市场积极参与打新，二级市场进行适当的波段操作，获得转债市场扩容，流动性推动的估值增强收益。同时信用债及利率债投资方面，适度拉长久期，获得稳定票息。

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 金鹰元禧混合型证券投资基金

(报告期: 2017年6月27日-2017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	-	-
	其中: 股票	-	-
2	固定收益投资	22,509,977.50	31.42
	其中: 债券	22,509,977.50	31.42
	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	48,684,128.53	67.96
	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	196,568.36	0.27
7	其他各项资产	249,835.83	0.35
8	合计	71,640,510.22	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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.1.4 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	4,214,578.20	5.97
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	6,281,919.30	8.90
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,126,480.00	3.01
8	同业存单	9,887,000.00	14.01
9	其他	-	-
10	合计	22,509,977.50	31.89

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

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	111721077	17 渤海银行 CD077	100,000.00	9,887,000.00	14.01
2	124251	13 鲁信投	50,000.00	5,001,000.00	7.08
3	019546	16 国债 18	32,300.00	3,226,447.00	4.57
4	122724	12 攀国投	10,570.00	1,147,373.50	1.63
5	019557	17 国债 03	9,920.00	988,131.20	1.40

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

本基金报告期末未持有贵金属。

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

本基金报告期末未持有股指期货。

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。

5.1.10.3 本期国债期货投资评价

无

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 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。

5.1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	24,337.21
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	225,498.62
5	应收申购款	-

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	249,835.83

5.1.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有处于转换期的可转换债券。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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 金鹰保本混合型证券投资基金

(报告期：2017年4月1日-2017年6月26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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	30,255,586.90	39.03
	其中：债券	30,255,586.90	39.03
	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	46,945,723.48	60.56
7	其他各项资产	321,297.91	0.41

8	合计	77,522,608.29	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。

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	4,213,461.60	5.44
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	6,272,125.30	8.09
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	19,770,000.00	25.50
9	其他	-	-
10	合计	30,255,586.90	41.61

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	111719078	17 恒丰银行 CD078	100,000.00	9,885,000.00	13.59
2	111721077	17 渤海银行 CD077	100,000.00	9,885,000.00	13.59
3	124251	13 鲁信投	10,570.00	4,994,500.00	6.87
4	019546	16 国债 18	32,300.00	3,226,124.00	4.44
5	122724	12 攀国投	10,570.00	1,144,519.60	1.57

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。

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

本基金报告期末未持有股指期货。

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。

5.2.10.3 本期国债期货投资评价

无

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 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。

5.2.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	24,337.21
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	296,960.70
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	321,297.91

5.2.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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 金鹰元禧混合型证券投资基金

单位：份

项目	金鹰元禧混合A	金鹰元禧混合C
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,458,548.14	472,911.16

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	33,950,677.01	29,104,831.53

6.2 金鹰保本混合型证券投资基金

单位：份

项目	金鹰保本混合A	金鹰保本混合C
报告期基金总申购份额	129,960.21	5,212,844.10
减：报告期基金总赎回份额	4,061,177.14	6,613,444.82
报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	35,409,225.15	29,577,742.69

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 金鹰元禧混合型证券投资基金

7.1.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无

7.1.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无

7.2 金鹰保本混合型证券投资基金

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 金鹰元禧混合型证券投资基金

8.1.1 影响投资者决策的其他重要信息

金鹰保本混合型证券投资基金于2017年6月21日第二个保本周期到期，按照《金鹰保本混合型证券投资基金基金合同》的约定转型为非保本的混合型基金，即“金鹰元禧混合型证券投资基金”，自2017年6月27日起，金鹰元禧混合型证券投资基金基金合同生效。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。
- 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、更新的招股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
二〇一七年七月二十日