

**金鹰医疗健康产业股票型证券投资基金
(金鹰鑫富灵活配置混合型证券投资基金)**

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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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 金鹰医疗健康产业股票型证券投资基金

基金简称	金鹰医疗健康股票
基金主代码	004040
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2018 年 4 月 13 日
报告期末基金份额总额	2,530,653.98 份
投资目标	本基金主要投资于医疗健康产业证券，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将从宏观面、政策面、基本面和资金面四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，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票类资产、固定收益类资产、现金类资产等各类资产类别上的投资比例，最大限度的提高收益。本基金主要投资于医疗健康产业证

	券，所指的医疗健康产业具体包括以下三类公司： 1）与医疗行业相关的上市公司，包括医药研发和生产（化学制药、中药、生物制品）、医药商业、医疗器械、医疗服务及医疗信息化等行业；2）与健康行业相关的上市公司，包括保健品、健康养老、健康检测、健康护理等行业。 本基金主要考察行业潜在空间、行业竞争结构、行业周期、行业的潜在风险等因素，进行股票资产在医疗健康各细分行业间的配置。本基金在行业配置的基础上，采取“自下而上”的方式，依靠定量与定性相结合的方法进行个股精选。基金经理将按照本基金的投资决策程序，审慎精选，权衡风险收益特征后，根据市场波动情况构建股票组合并进行动态调整。	
业绩比较基准	中证医药卫生指数收益率×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	交通银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	金鹰医疗健康股票 A	金鹰医疗健康股票 C
下属两级基金的交易代码	004040	004041
报告期末下属两级基金的份额总额	1,004,351.35 份	1,526,302.63 份

2.2 金鹰鑫富灵活配置混合型证券投资基金

基金简称	金鹰鑫富混合
基金主代码	004040
基金运作方式	契约开放式

基金合同生效日	2017 年 8 月 1 日	
报告期末基金份额总额	3,400,862.65 份	
投资目标	本基金在严格控制风险并保持良好流动性的前提下，通过精选股票、债券等投资标的，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	本基金将从宏观面、政策面、基本面和资金面四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，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票类资产、固定收益类资产、现金类资产等各类资产类别上的投资比例，最大限度的提高收益。通过“自上而下”及“自下而上”相结合的方法挖掘优质的上市公司，构建股票投资组合；以经济基本面变化趋势分析为基础，结合货币、财政宏观政策，以及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，判断利率和债券市场走势；运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略等多种积极管理策略，深入研究挖掘价值被低估的债券和市场投资机会，构建收益稳定、流动性良好的债券组合。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×40%+中证全债指数收益率×60%	
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，属于证券投资基金中预期较高风险、较高收益的品种，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	交通银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	金鹰鑫富混合 A	金鹰鑫富混合 C

下属两级基金的交易代码	004040	004041
报告期末下属两级基金的份额总额	1,325,614.13 份	2,075,248.52 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 金鹰医疗健康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 13 日（基金合同生效日）-2018 年 6 月 30 日)	
	金鹰医疗健康股票 A	金鹰医疗健康股票 C
1.本期已实现收益	582.71	-2,816.72
2.本期利润	-9,813.25	-17,860.75
3.加权平均基金份额 本期利润	-0.0083	-0.0087
4.期末基金资产净值	1,005,728.51	1,620,689.78
5.期末基金份额净值	1.0014	1.0618

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 金鹰鑫富灵活配置混合型证券投资基金

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12日)	
	金鹰鑫富混合 A	金鹰鑫富混合 C
1.本期已实现收益	-56.33	1,295.91
2.本期利润	3,406.14	7,185.84
3.加权平均基金份额 本期利润	0.0026	0.0032
4.期末基金资产净值	1,339,290.25	2,225,120.50
5.期末基金份额净值	1.0103	1.0722

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 金鹰医疗健康产业股票型证券投资基金

（报告期：2018年4月13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. 金鹰医疗健康股票 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	-0.88%	0.21%	-0.03%	1.37%	-0.85%	-1.16 %

2. 金鹰医疗健康股票 C:

阶段	份额净值 增长率①	份额净值增 长率标准差	业绩比较基 准收益率③	业绩比较 基准收益	①-③	②- ④

		②		率标准差 ④		
过去三个 月	-0.97%	0.21%	-0.03%	1.37%	-0.94%	-1.16 %

注：1、金鹰鑫富灵活配置混合型证券投资基金自 2018 年 4 月 13 日起转型为金鹰医疗健康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 13 日至 2018 年 6 月 30 日

3、转型后本基金的业绩比较基准是：中证医药卫生指数收益率×80%+中债总财富（总值）指数×20%。

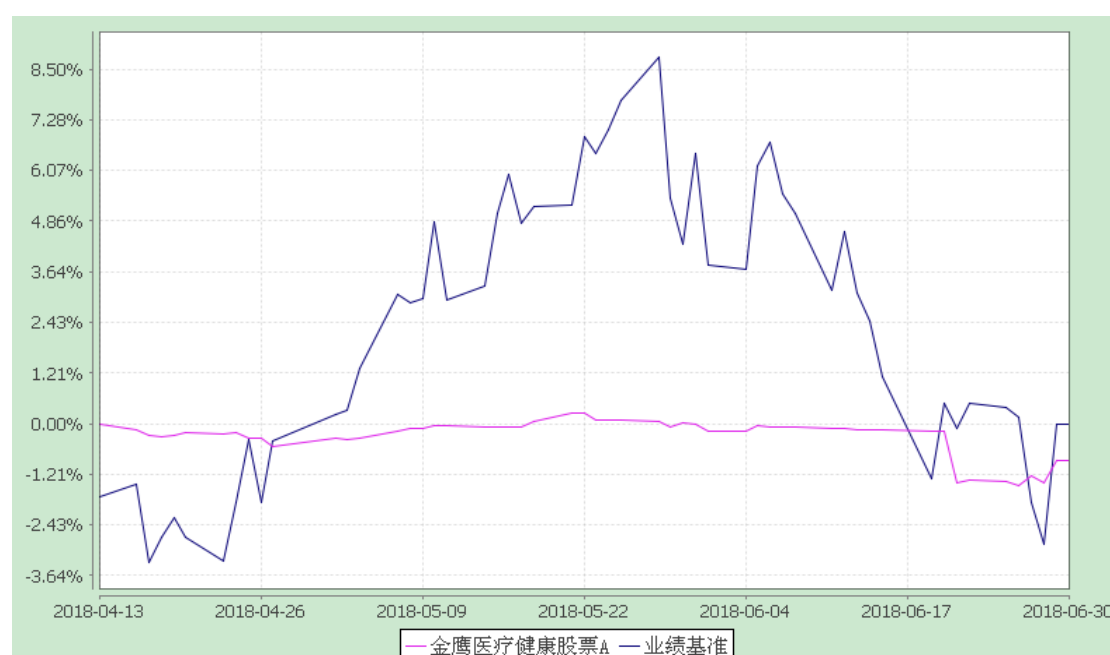
3.2.1.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

金鹰医疗健康产业股票型证券投资基金

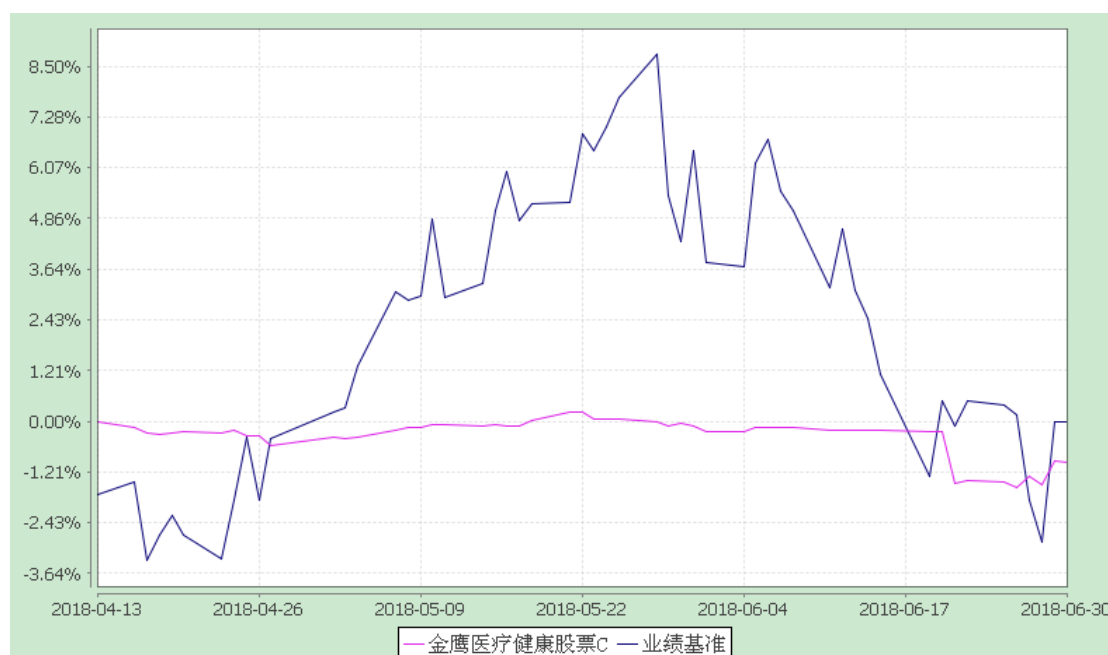
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2018 年 4 月 13 日至 2018 年 6 月 30 日)

1、金鹰医疗健康股票 A



2、金鹰医疗健康股票 C



注：1、金鹰鑫富灵活配置混合型证券投资基金自 2018 年 4 月 13 日起转型为金鹰医疗健康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：中证医药卫生指数收益率×80%+中债总财富（总值）指数×20%。

3.2.2 金鹰鑫富灵活配置混合型证券投资基金

（报告期：2018年4月1日-2018年4月12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. 金鹰鑫富混合 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	0.26%	0.13%	0.33%	0.37%	-0.07%	-0.24%

2. 金鹰鑫富混合 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

				④		
过去三个月	0.32%	0.13%	0.33%	0.37%	-0.01%	-0.24%

注：1、金鹰鑫富灵活配置混合型证券投资基金自 2018 年 4 月 13 日起转型为金鹰医疗健康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 12 日

3、转型前本基金的业绩比较基准是：沪深 300 指数收益率×40%+中证全债指数收益率×60%。

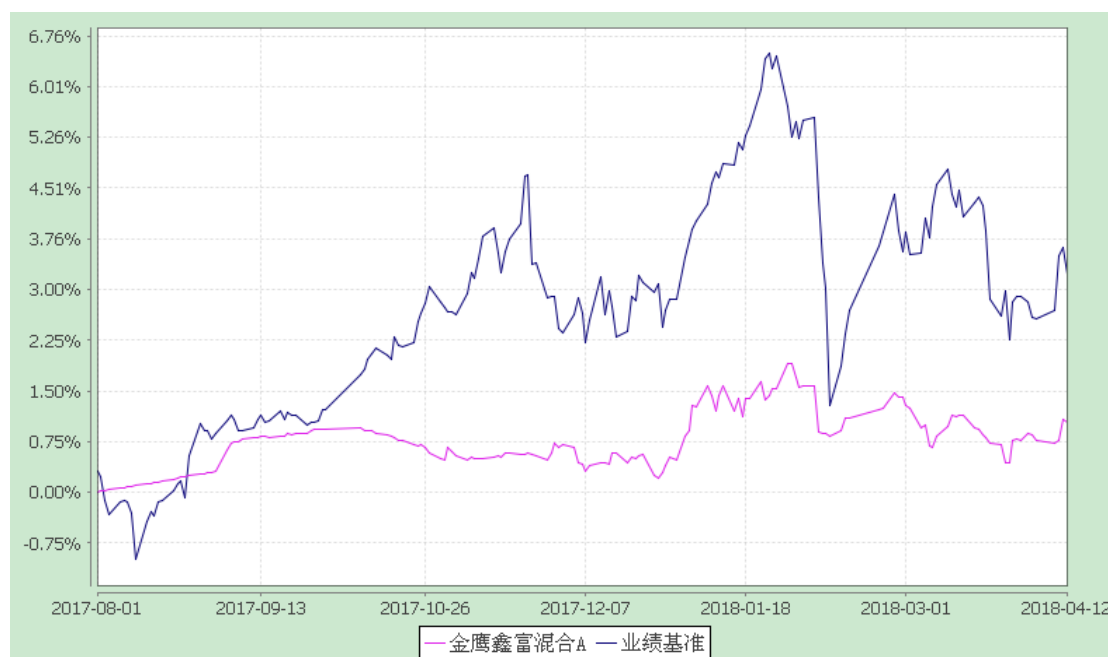
1.1.1.1 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

金鹰鑫富灵活配置混合型证券投资基金

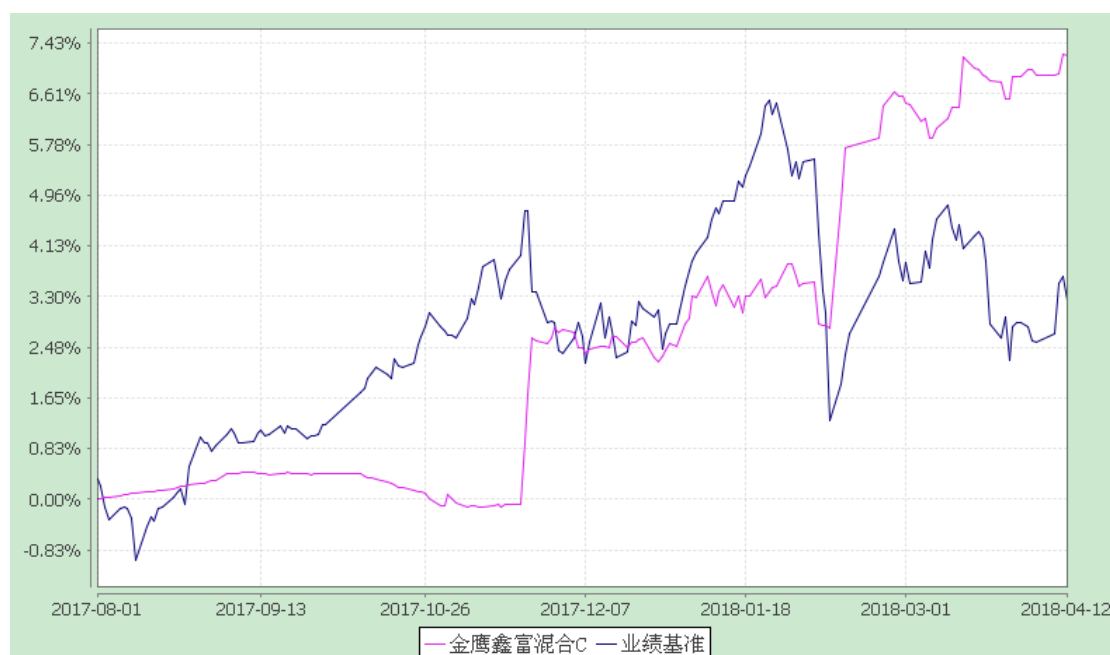
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2017 年 8 月 1 日至 2018 年 4 月 12 日)

1、金鹰鑫富混合 A



2、金鹰鑫富混合 C



注：1、金鹰鑫富灵活配置混合型证券投资基金自2018年4月13日起转型为金鹰医疗健康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：沪深300指数收益率×40%+中证全债指数收益率×60%。

§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

					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	2017-08-01	-	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 12 日正式实施转型，转型后的金鹰医疗健康产业股票型证券投资基金将主要投资于医疗健康产业证券。自 2018 年 4 月 13 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 12 日，金鹰鑫富灵活配置混合型证券投资基金，报告期内（2018 年 4 月 1 日-2018 年 4 月 12 日）A 类份额净值为 1.0103 元，本报告期份额净值增长率为 0.26%，同期业绩比较基准增长率为 0.33%。C 类基金份额净值为 1.0772 元，本报告期份额净值增长率 0.32%，同期业绩比较基准增长率为 0.33%。

截至 2018 年 6 月 30 日，本基金（金鹰医疗健康产业股票型证券投资基金），报告期内（2018 年 4 月 13 日-2018 年 6 月 30 日）A 类份额净值为 1.0014 元，本报告期份额净值增长率为-0.88%，同期业绩比较基准增长率为-0.03%。C 类基金份额净值为 1.0618 元，本报告期份额净值增长率-0.97%，同期业绩比较基准增长率为-0.03%。

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。

本基金对投资医疗健康产业的前景持乐观态度。在国民收入持续增长、人口老龄化和疾病谱变化等因素驱动下，医疗健康消费将长期获得持续的需求增长。中期而言，随着新的医疗机构改革和一系列鼓励医药行业创新、结构优化调整的政策实施，带动了医疗健康产业升级、创新崛起的投资机会。本基金投资将顺应这一趋势，从中精选个股，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 金鹰医疗健康产业股票型证券投资基金

(报告期：2018年4月13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	256,933.00	9.45
	其中：股票	256,933.00	9.45
2	固定收益投资	227,507.80	8.36
	其中：债券	227,507.80	8.36
	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	2,168,717.67	79.73

7	其他各项资产	66,845.27	2.46
8	合计	2,720,003.74	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	209,011.00	7.96
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	47,922.00	1.82
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	-	-
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	256,933.00	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投资于港股通。

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	600867	通化东宝	2,300	55,131.00	2.10
2	600771	广誉远	1,000	54,960.00	2.09
3	600521	华海药业	2,000	53,380.00	2.03
4	603233	大参林	700	47,922.00	1.82
5	000661	长春高新	200	45,540.00	1.73

注：本基金本报告期末仅持有5只股票。

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	-	-
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）	227,507.80	8.36
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	227,507.80	8.36

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	132010	17 桐昆 EB	1,690.00	227,507.80	8.66

注：本基金本报告期末仅持有一只债券。

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

本基金本报告期内未投资于资产支持证券。

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

本基金本报告期内未投资于贵金属。

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

本基金本报告期内未投资于权证。

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

本基金本报告期内未投资于股指期货。

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

本基金本报告期内未投资于国债期货。

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 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	76.73
2	应收证券清算款	39,922.01
3	应收股利	-
4	应收利息	1,679.63
5	应收申购款	25,166.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	66,845.27

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处于转股期的可转换债券。

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流通受限股票。

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 金鹰鑫富灵活配置混合型证券投资基金

(报告期：2018年4月1日-2018年4月12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	2,350,500.00	63.78
	其中：债券	2,350,500.00	63.78

	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	900,000.00	24.42
	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	356,301.31	9.67
7	其他各项资产	78,693.40	2.14
8	合计	3,685,494.71	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投资于港股通。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,008,000.00	54.48
	其中：政策性金融债	2,008,000.00	54.48
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）	342,500.00	9.29
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,350,500.00	63.78

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	108601	国开 1703	20,080.00	2,008,000.00	56.33
2	132010	17 桐昆 EB	2,500.00	342,500.00	9.61

注：本基金本报告期末仅持有两只债券。

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

本基金本报告期内未投资于资产支持证券。

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

本基金本报告期内未投资于贵金属。

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

本基金本报告期内未投资于权证。

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

本基金本报告期内未投资于股指期货。

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

本基金本报告期内未投资于国债期货。

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 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	74.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	70,537.45
5	应收申购款	1,200.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	6,881.63
8	其他	-
9	合计	78,693.40

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。

86 开放式基金份额变动

6.1 金鹰医疗健康产业股票型证券投资基金

单位：份

项目	金鹰医疗健康股票A	金鹰医疗健康股票C
基金合同生效日基金份额总额	1,325,614.13	2,075,248.52
本报告期期初基金份额总额	1,325,614.13	2,075,248.52
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	269,702.07	1,005,207.61
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	590,964.85	1,554,153.50
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	1,004,351.35	1,526,302.63

6.2 金鹰鑫富灵活配置混合型证券投资基金

单位：份

项目	金鹰鑫富混合A	金鹰鑫富混合C
本报告期期初基金份额总额	1,324,860.89	2,445,800.83
报告期基金总申购份额	3,848.21	39,182.36
减：报告期基金总赎回份额	3,094.97	409,734.67
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	1,325,614.13	2,075,248.52

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 金鹰医疗健康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

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 金鹰鑫富灵活配置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 金鹰医疗健康产业股票型证券投资基金

8.1.1 影响投资者决策的其他重要信息

无。

8.2 金鹰鑫富灵活配置混合型证券投资基金

8.2.1 影响投资者决策的其他重要信息

金鹰鑫富灵活配置混合型证券投资基金经持有人大会表决通过，自 2018 年 4 月 13 日起转型为金鹰医疗健康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、《金鹰医疗健康产业股票型证券投资基金基金合同》。
- 3、《金鹰医疗健康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