

金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金
(金鹰元和保本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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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 金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金

基金简称	金鹰元和混合
基金主代码	002681
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 5 月 31 日
报告期末基金份额总额	752,496,090.68 份
投资目标	本基金在有效控制风险并保持良好流动性的前提下，通过对股票、固定收益和现金类等资产的积极灵活配置，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。	
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	本基金为灵活配置混合型基金，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	
下属两级基金的基金简称	金鹰元和混合 A	金鹰元和混合 C
下属两级基金的交易代码	002681	002682
报告期末下属两级基金的份额总额	727,113,017.18 份	25,383,073.50 份

2.2 金鹰元和保本混合型证券投资基金

基金简称	金鹰元和保本混合
基金主代码	002681
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 5 月 25 日
报告期末基金份额总额	171,685,743.44 份
投资目标	本基金运用投资组合保险策略，严格控制投资风险，通过安全资产与风险资产的动态配置，为投资者提供保本金额安全的保证，并力争实现基金资产的稳健增值。
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,以确保保本周期到期时实现基金资产的稳健增值。	
业绩比较基准	2年期银行定期存款利率(税后)。	
风险收益特征	本基金为保本混合型证券投资基金,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,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	深圳市高新投集团有限公司	
下属两级基金的基金简称	金鹰元和保本混合 A	金鹰元和保本混合 C
下属两级基金的交易代码	002681	002682
报告期末下属两级基金的份额总额	128,931,738.99 份	42,754,004.45 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 金鹰元和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5月31日(基金合同生效日)-2018年6月30日)	
	金鹰元和混合 A	金鹰元和混合 C
1.本期已实现收益	-829,362.46	-37,096.54
2.本期利润	4,188,707.21	138,333.23

3.加权平均基金份额 本期利润	0.0129	0.0047
4.期末基金资产净值	742,621,936.57	25,832,388.16
5.期末基金份额净值	1.0213	1.0177

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 金鹰元和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 (2018年4月1日-2018年5月30日)	
	金鹰元和保本混合 A	金鹰元和保本混合 C
1.本期已实现收益	-476,461.93	-280,931.22
2.本期利润	3,733,612.77	856,683.44
3.加权平均基金份额 本期利润	0.0063	0.0053
4.期末基金资产净值	130,929,554.39	43,291,635.03
5.期末基金份额净值	1.0155	1.0126

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 金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金

(报告期: 2018年5月31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. 金鹰元和混合 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	0.62%	0.23%	-3.16%	0.81%	3.78%	-0.58%

2. 金鹰元和混合 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	0.46%	0.23%	-3.16%	0.81%	3.62%	-0.58%

注: 1、金鹰元和保本混合型证券投资基金自 2018 年 5 月 31 日起转型为金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金

2、转型后,“过去三个月”计算期间为 2018 年 5 月 31 日至 2018 年 6 月 30 日

3、转型后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×20%。

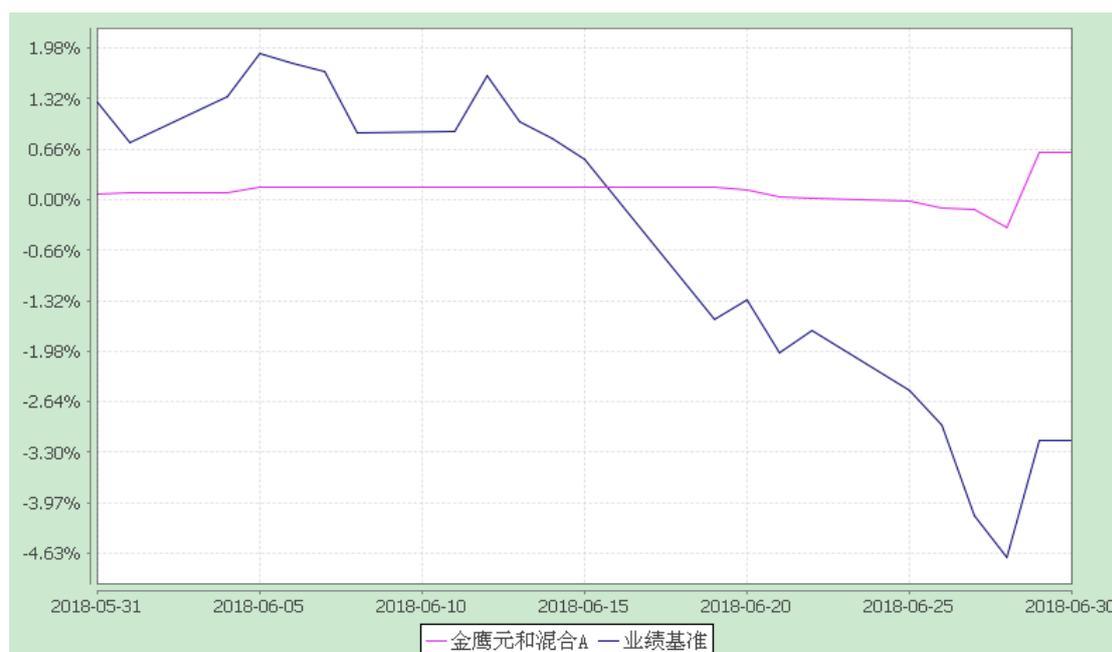
3.2.1.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金

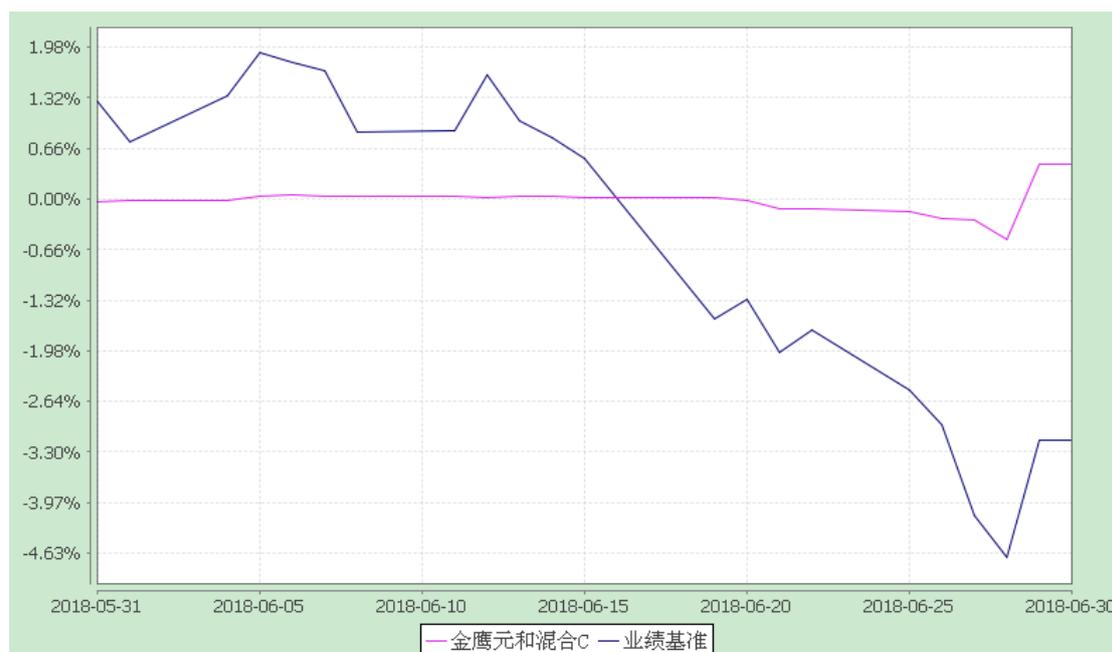
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2018 年 5 月 31 日至 2018 年 6 月 30 日)

1、金鹰元和混合 A



2、金鹰元和混合 C



注：1、金鹰元和保本混合型证券投资基金自 2018 年 5 月 31 日起转型为金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金

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：沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数×20%。

3.2.2 金鹰元和保本混合型证券投资基金

(报告期: 2018年4月1日-2018年5月30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. 金鹰元和保本混合 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	0.58%	0.04%	0.35%	0.01%	0.23%	0.03%

2. 金鹰元和保本混合 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	0.59%	0.04%	0.35%	0.01%	0.24%	0.03%

注: 1、金鹰元和保本混合型证券投资基金自 2018 年 5 月 31 日起转型为金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金

2、转型前,“过去三个月”计算期间为 2018 年 4 月 1 日至 2018 年 5 月 30 日

3、转型前本基金的业绩比较基准是: 2 年期银行定期存款利率(税后)。

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

金鹰元和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
(2016 年 5 月 25 日至 2018 年 5 月 30 日)

1、金鹰元和保本混合 A



2、金鹰元和保本混合 C



注：1、金鹰元和保本混合型证券投资基金自2018年5月31日起转型为金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金

2、转型前本基金的业绩比较基准是：2年期银行定期存款利率（税后）。

§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		
刘丽娟	固定收益部总监, 基金经理	2016-10-19	-	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

回顾2018年二季度债券市场行情，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。

反观股票市场，对经济增长预期回落，加上严监管紧信用环境下，信用违约事件频发，冲击市场风险偏好，二季度股票市场出现较大调整，其中上证综指下跌10.14%，深圳成指下跌13.7%，创业板综指下跌14.83%。

报告期内，本基金保本到期，成功转型为灵活配置型基金。在保本到期前，本基金严格按照保本新规的要求，逐渐变现资产，保证组合平均剩余期限不超过剩余避险策略周期。保本到期后，本基金部分配置利率债、回购资产，积极等待股市调整后的机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2018年5月30日,金鹰元和保本混合型证券投资基金,报告期内(2018年4月1日-2018年5月30日)A类份额净值为1.0155元,本报告期份额净值增长率为0.58%,同期业绩比较基准增长率为0.35%。C类基金份额净值为1.0126元,本报告期份额净值增长率0.59%,同期业绩比较基准增长率为0.35%。

截至2018年6月30日,本基金(金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金),报告期内(2018年5月31日-2018年6月30日)A类份额净值为1.0213元,本报告期份额净值增长率为0.54%,同期业绩比较基准增长率为-3.16%。C类基金份额净值为1.0177元,本报告期份额净值增长率0.49%,同期业绩比较基准增长率为-3.16%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,市场仍存在调整压力。从经济基本面来看,下半年经济增长存在不确定性。中美贸易摩擦将对出口增长构成不确定性;国内经济进入去库存阶段,新的增长动能难以驱动经济反转;金融政策仍处于紧缩周期。无论从经济角度还是从政策角度,A股市场很难触底反转,整体市场仍有较大调整压力。

本基金将坚持稳健的投资风格,通过合理的资产配置控制风险,力争把握景气行业的投资机会,通过自下而上的精选品种优化组合,密切关注各风险要素的变化,在操作上灵活应对。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期无应预警说明事项。

§5 投资组合报告

5.1 金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金

(报告期:2018年5月31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	578,692,839.55	48.40
	其中:股票	578,692,839.55	48.40
2	固定收益投资	80,589,791.00	6.74

	其中：债券	80,589,791.00	6.74
	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	86,000,418.95	7.19
	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	428,153,995.46	35.81
7	其他各项资产	22,315,179.54	1.87
8	合计	1,195,752,224.50	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。

5.1.2 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	400,637,426.48	52.14
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	44,930,688.00	5.85
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	44,153,000.00	5.75
J	金融业	-	-
K	房地产业	44,569,003.40	5.80

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	44,402,721.67	5.78
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	578,692,839.55	75.31

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

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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	002024	苏宁易购	3,191,100	44,930,688.00	5.85
2	000651	格力电器	952,629	44,916,457.35	5.85
3	000333	美的集团	858,600	44,836,092.00	5.83
4	000977	浪潮信息	1,869,959	44,598,522.15	5.80
5	600048	保利地产	3,653,197	44,569,003.40	5.80
6	600519	贵州茅台	60,867	44,521,775.82	5.79
7	600703	三安光电	2,316,100	44,515,442.00	5.79
8	300015	爱尔眼科	1,375,123	44,402,721.67	5.78
9	600276	恒瑞医药	584,901	44,312,099.76	5.77
10	600660	福耀玻璃	1,719,932	44,219,451.72	5.75

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	80,589,791.00	10.49

	其中：政策性金融债	80,589,791.00	10.49
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	80,589,791.00	10.49

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	140441	14 农发 41	300,000.00	30,384,000.00	3.95
2	018005	国开 1701	299,450.00	30,058,791.00	3.91
3	140358	14 进出 58	100,000.00	10,131,000.00	1.32
4	180407	18 农发 07	100,000.00	10,016,000.00	1.30

注：本基金本报告期末仅持有4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 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。

5.1.10.2 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。

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	27,253.43
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,208,926.11
5	应收申购款	20,079,000.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,315,179.54

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

本基金本报告期末持有的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 金鹰元和保本混合型证券投资基金

(报告期: 2018年4月1日-2018年5月30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	72,717.28	0.02
	其中: 股票	72,717.28	0.02
2	固定收益投资	106,155,265.40	31.10
	其中: 债券	106,155,265.40	31.10
	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	59,780,149.89	17.51
	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	173,861,182.95	50.93
7	其他各项资产	1,497,816.65	0.44
8	合计	341,367,132.17	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。

5.2.2 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

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	72,717.28	0.04
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	-	-
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	72,717.28	0.04

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

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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

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	300586	美联新材	2,515	39,636.40	0.02
2	603033	三维股份	1,624	33,080.88	0.02

注：本基金本报告期末仅持有2只股票。

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	7,345,265.40	4.22
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	98,810,000.00	56.72
9	其他	-	-
10	合计	106,155,265.40	60.93

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	111809067	18 浦发银行 CD067	1,000,000.00	98,810,000.00	56.72
2	122227	13 尖峰 01	73,460.00	7,345,265.40	4.22

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 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。

5.2.10.2 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。

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	21,103.21
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,476,713.44
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,497,816.65

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300586	美联新材	39,636.40	0.02	重大事项停牌

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 金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金**

单位：份

项目	金鹰元和混合A	金鹰元和混合C
基金合同生效日基金份额总额	128,931,738.99	42,754,004.45
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	654,882,309.49	87,930.12
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	56,701,031.30	17,458,861.07
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	727,113,017.18	25,383,073.50

6.2 金鹰元和保本混合型证券投资基金

单位：份

项目	金鹰元和保本混合A	金鹰元和保本混合C
本报告期期初基金份额总额	640,766,200.88	173,803,446.29
报告期基金总申购份额	62,945.57	27,921.29
减：报告期基金总赎回份额	511,897,407.46	131,077,363.13
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	128,931,738.99	42,754,004.45

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 金鹰元和灵活配置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 金鹰元和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 金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金

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6月15日至2018年6月26日	-	118,087,926.73	-	118,087,926.73	15.69%
	2	2018年6月21日至2018年6月26日	-	147,704,081.34	-	147,704,081.34	19.63%
	3	2018年6月8日至2018年6月26日	-	127,870,433.04	-	127,870,433.04	16.99%
	4	2018年6月7日至2018年6月7日	-	39,341,988.79	-	39,341,988.79	5.23%

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，可能导致本基金提前终止基金合同的风险。

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 金鹰元和保本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

金鹰元和保本混合型证券投资基金于 2018 年 5 月 25 日保本周期到期，自 2018 年 5 月 31 日起，金鹰元和保本混合型证券投资基金正式转型为金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金，金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金基金合同于该日生效。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、中国证监会批准基金发行及募集的文件。
- 2、《金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、《金鹰元和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。
- 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