金鹰信息产业股票型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

(原金鹰添惠纯债债券型证券投资基金转型)

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:二〇一八年八月二十五日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人根据本基金合同规定,于2018年8月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

2.1.1 金鹰信息产业股票型证券投资基金

基金名称	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
交易代码	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
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
报告期末基金份额总额	2,217,142.84份
基金合同存续期	不定期

2.1.2 金鹰添惠纯债债券型证券投资基金

基金名称	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	
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	
报告期末基金份额总额	587,759.17份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

2.2.1 金鹰信息产业股票型证券投资基金

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,主动判断市场利机,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。

2.2.2 金鹰添惠纯债债券型证券投资基金

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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		金鹰基金管理有限公司	广州农村商业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李云亮	唐茵
	联系电话	010-59944986	020-28019512
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	qingmiao@rcbank.com
客户服务电话		4006135888, 020-83936180	95313
传真		020-83282856	020-28019340
注册地址		广东省广州市南沙区滨海路171号11楼自编1101之一J79	广州市黄埔区映日路9号
办公地址		广州市天河区珠江东路28号越秀金融大厦30层	广州市天河区珠江新城华夏路1号
邮政编码		510623	510623
法定代表人		刘岩	王继康

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》《证券时报》《上海证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gefund.com.cn
基金半年度报告备置地点	广东省广州市天河区珠江新城珠江东路28号越秀金融大厦30层

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 金鹰信息产业股票型证券投资基金

3.1.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年4月18日至2018年6月30日)	
	金鹰信息产业股票A	金鹰信息产业股票C
本期已实现收益	-8,250.54	-425.57
本期利润	-7,567.66	10,194.84
加权平均基金份额本期利润	-0.0171	0.0450
本期加权平均净值利润率	-1.68%	4.38%
本期基金份额净值增长率	-1.67%	-0.63%
3.1.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
	金鹰信息产业股票A	金鹰信息产业股票C
期末可供分配利润	1,618.75	38,620.61
期末可供分配基金份额利润	0.0067	0.0195
期末基金资产净值	243,231.18	2,023,875.03
期末基金份额净值	1.0130	1.0237
3.1.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)	
	金鹰信息产业股票A	金鹰信息产业股票C
基金份额累计净值增长率	3.12%	-0.63%

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.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)。

3.1.2 基金净值表现

3.1.2.1 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

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
过去一个月	-0.75%	0.16%	-9.04%	1.86%	8.29%	-1.70%
自基金合同生效起至今	-1.67%	0.10%	-12.55%	1.48%	10.88%	-1.38%

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
过去一个月	-0.79%	0.15%	-9.04%	1.86%	8.25%	-1.71%
自基金合同生效起至今	-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.转型前,"过去三个月"计算期间为2018年4月17日前推3个月,即2018年1月18日至2018年4月17日,其他区间依此类推

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%。

3.2.2.2 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

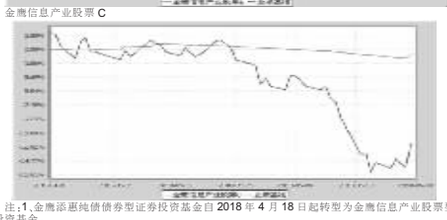
金鹰信息产业股票型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018年4月18日至2018年6月30日)

金鹰信息产业股票A

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 金鹰添惠纯债债券型证券投资基金

3.2.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.2.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日至2018年4月17日)
本期已实现收益	14,212.75
本期利润	15,071.50
加权平均基金份额本期利润	0.0073
本期加权平均净值利润率	0.72%
本期基金份额净值增长率	1.29%
3.2.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年4月17日)
期末可供分配利润	16,488.65
期末可供分配基金份额利润	0.0281
期末基金资产净值	605,486.97
期末基金份额净值	1.0302
3.2.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年4月17日)
基金份额累计净值增长率	4.87%

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.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)。

3.2.2 基金净值表现

3.2.2.1 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	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
过去一个月	-0.13%	0.01%	0.76%	0.05%	-0.89%	-0.04%
过去三个月	1.09%	0.10%	1.42%	0.03%	-0.33%	0.07%
过去六个月	3.35%	0.12%	0.70%	0.04%	2.65%	0.08%
过去一年	4.56%	0.09%	0.19%	0.05%	4.37%	0.04%
自基金合同生效起至今	4.87%	0.09%	-0.11%	0.05%	4.98%	0.04%

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17日前推3个月,即2018年1月18日至2018年4月17日,其他区间依此类推

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%。

3.2.2.2 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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

金鹰基金管理有限公司经中国证监会证监基字[2002]97号文批准,于2002年12月25日成立,总部设在广州,目前注册资本5.102亿元人民币。2011年12月公司获得特定客户资产管理计划业务资格,2013年7月设立全资子公司广州金鹰资产管理有限公司。近年来,公司秉承"以人为本、互信协作;创新谋变、挑战超越"的核心价值观,始终追求以更高的标准为投资者提供专业、贴心的财富管理服务,获得了越来越多投资者的认可。

截至2018年6月30日,公司下设17个一级职能部门及北京、广州、上海、深圳、成都共五个分公司,旗下公募基金42只,管理资产规模476.38亿元。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)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	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。
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。
黄倩倩	基金经理助理	2017-03-11	2018-07-07	6	黄倩倩女士,西南财经大学金融学硕士研究生,历任广州证券股份有限公司资产管理总部债券交易员,2014年11月加入金鹰基金管理有限公司,担任固定收益部债券交易员,基金经理助理,现任金鹰现金增益交易型货币市场基金、金鹰添益纯债债券型证券投资基金、金鹰添富纯债债券型证券投资基金、金鹰添盈纯债债券型证券投资基金、金鹰添润定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。金鹰货币市场证券投资基金等基金的基金经理助理。

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、基金合同的规定,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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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。公司通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则,严格的流程控制,持续的技术改进,确保公平交易原则的实现。同时通过投资交易系统中的公平交易功能执行交易,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 管理人对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年上半年债券市场行情,市场收益率呈整体下行走势。在流动性较宽松局面下,短端收益率下行幅度大于长端,收益率曲线陡峭化;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。年初随着监管政策的密集发布,长端债券收益率大幅上行并超过去年高位;1月下旬开始随着监管政策冲击缓和,市场流动性超预期宽松、贸易战、降准置换MLF等因素带动下,债券收益率开启反弹行情持续向下;4月下旬开始,随着基本面悲观预期和货币政策转向预期修正,市场收益率又上行至降准前点位;5月中随着贸易战的反复、经济金融数据不佳,季末月货币市场流动性超预期宽松缓和,债券收益率再次大幅下行。整个上半年十年国开债收益率下行超60bp,一年国开债收益下行近100bp,3个月股份制存单收益率大幅下行至4%以下。

在流动性层面,上半年货币市场流动性维持较宽松局面。CRA和1月底定向降准落地脱平了春节前流动性波动局面,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。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。

上半年权益市场,整体表现较弱。期初在一月信贷数据投放较好的预期下,地产、银行板块曾出现一轮上涨。但随后美国公布的良好经济数据引发加息预期的上升,美股出现较大的波动,而国内方面许多公司披露2017年度业绩大幅调整的公告,导致A股市场一度出现系统性较大的调整。之后,在鼓励新兴行业发展的政策氛围中,以工业互联网等为代表的计算机等板块又迎来一轮大幅反弹。进入二季度,受到国内资产管新规出台、社会融资规模增量大幅下降,金融行业去杠杆的紧缩效应快速显现。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。二季度在内外双重的压力下,市场整体继续弱势下行。

上半年权益市场表现方面,上证综指下跌了13.9%,深成指下跌15.0%,中小板指数下跌14.3%,创业板指数下跌8.3%。行业表现上,消费类的餐饮旅游、医药、食品饮料表现相对居前,板块呈现上涨。其余板块都表现为下跌,电力设备、通信、有色金属、机械、建筑等跌幅较前。

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1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1.29%,同期业绩比较基准增长率为1.41%。

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,本报告份额期净值增长率-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

展望下半年,本基金认为市场短期继续处于内外都不利局面。货币政策方面呈现"稳货币,紧信用,严监管"的态势,在经济整体平稳扩张的环境下,才有利于实施金融去杠杆,因此需要把握好去杠杆的方与节奏。中美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,中美贸易摩擦仍有不断升级扩大的风险。在经济运行中发生内外不利变化因素下,下半年本基金将观察宏观政策修正年初的判断并进行调整的可能。

中期而言,本基金不悲观。实施金融去杠杆,有利于中国经济中长期的健康发展。中期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,成长的确定性更高。在经历市场的恐慌下跌后,市场风险得到释放,有利于本基金更加积极主动的选股,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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会,估值委员会由基金估值业务分管领导、督察长、基金事务部负责人、基金会计、合规风控部人员及相关投研人员等组成。在特殊情况下,公司召集估值委员会会议,讨论和决策特殊估值事项,估值委员会集体决策,需到会的三分之二估值委员会成员表决通过。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序,指导和监督整个估值流程。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立,基金经理、投资经理可参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行,一切以维护基金持有人利益为准则。

本报告期内,参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议,由其按约定分别提供银行间同业市场债券品种的估值数据及交易所交易的债券品种的估值数据、流通受限股票流动性折扣。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内广州农村商业银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对金鹰添惠纯债债券型证券投资基金(2018年1月1日至2018年4月17日)及金鹰信息产业股票型证券投资基金(2018年4月18日至2018年6月30日)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本基金的管理人——金鹰基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内本基金未进行收益分配,符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对金鹰基金管理有限公司编制和披露的本基金2018年上半年报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 金鹰信息产业股票型证券投资基金

6.1.1 资产负债表

会计主体:金鹰信息产业股票型证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年6月30日
资产:	
银行存款	2,141,605.29
结算备付金	-
存出保证金	158.47
交易性金融资产	221,828.00
其中:股票投资	221,828.00
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	73.41
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	6,301.00
资产总计	2,369,966.17
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30日
负债:	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	42,923.82
应付赎回款	10.02
应付管理人报酬	727.83
应付托管费	97.06
应付销售服务费	75.91
应付交易费用	1,721.78
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	57,303.54
负债合计	102,859.96
所有者权益:	
实收基金	2,217,142.84
未分配利润	49,963.37
所有者权益合计	2,267,106.21
负债和所有者权益总计	2,369,966.17

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额总额2,217,142.84份。其中A类份额净值为1.0130元,份额总额240,101.93份;C类份额净值1.0237元,份额总额1,977,040.91份。

6.1.2 利润表

会计主体:金鹰信息产业股票型证券投资基金

本报告期:2018年4月18日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年4月18日至2018年6月30日
一、收入	15,777.63
1.利息收入	1,318.10
其中:存款利息收入	386.01
债券利息收入	932.09
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	-
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	526.75
其中:股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	526.75
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	11,303.29
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	2,629.49
减:二、费用	13,150.45
1.管理人报酬	2,005.13
2.托管费	267.41
3.销售服务费	167.91
4.交易费用	209.99
5.利息支出	-
其中:卖出回购金融资产支出	-
6.税金及附加	-
7.其他费用	10,500.01
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	2,627.18
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	2,627.18

6.1.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:金鹰信息产业股票型证券投资基金

本报告期:2018年4月18日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年4月18日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	587,759.17	17,727.80	605,486.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)	-	2,627.18	2,627.18
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	1,629,383.67	29,608.39	1,658,992.06
其中:1.基金申购款	2,494,132.25	52,266.59	2,546,398.84
2.基金赎回款	-864,748.58	-22,658.20	-887,406.78
四、本期向基金分额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	2,217,142.84	49,963.37	2,267,106.21

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1.1至6.1.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理公司负责人:刘岩,主管会计工作负责人:曾长兴,会计机构负责人:谢文君

6.1.4 报表附注

6.1.4.1 基金基本情况

金鹰信息产业股票型证券投资基金由金鹰添惠纯债债券型证券投资基金转型而来。

金鹰添惠纯债债券型证券投资基金经中国证监会证监许可[2016]2481号文批准,基金管理人为金鹰基金管理有限公司,基金托管人为广州农村商业银行股份有限公司。

金鹰添惠纯债债券型证券投资基金自2017年3月6日至2017年3月7日公开募集,募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认,《金鹰添惠纯债债券型证券投资基金基金合同》于2017年3月10日生效。

自2018年3月22日至2018年4月16日,金鹰添惠纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开,大会审议并通过了《关于金鹰添惠纯债债券型证券投资基金转型有关事项的议案》,内容包括金鹰添惠纯债债券型证券投资基金变更名称和基金类别、修改基金投资目标、投资范围、投资策略、估值、费用和修订基金合同等事项。持有人大会决议自通过之日起生效,决议生效后,基金管理人实施基金转型,转型完成后,由《金鹰添惠纯债债券型证券投资基金基金合同》修订而成的《金鹰信息产业股票型证券投资基金基金合同》正式生效,原《金鹰添惠纯债债券型证券投资基金基金合同》自同一日起失效。

6.1.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布并于2014年7月修改的《企业会计准则—基本准则》和41项具体会计准则及其应用指南、解释及其他相关规定(以下合称"企业会计准则"),中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号(年度报告和半年度报告)》和中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定而编制。

6.1.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则和《证券投资基金会计核算业务指引》的要求,真实、完整地反映了本基金2018年6月30日的财务状况以及2018年4月17日至2018年6月30日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.1.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最新一期年度报告一致。

6.1.4.5 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年1月1日至12月31日。

6.1.4.6 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.1.4.7 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产包括股票投资、债券投资和衍生工具投资(主要为权证投资)等,其中股票投资和债券投资在资产负债表中作为交易性金融资产列报,衍生工具投资在资产负债表中作为衍生金融资产列报。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

(2)金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将持有的金融负债在初始确认时全部划分为其他金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

6.2.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

初始确认金融资产或金融负债,应当按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票投资、债券投资等,以及不作为有效套期工具的衍生金融工具,相关的交易费用在发生时计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债,相关交易费用在发生时计入初始确认金额。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利,应当确认为当期收益。每日,本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债,采用实际利率法,按摊余成本进行后续计量。

处置该金融资产或金融负债时,其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益,其中包括同时结转的公允价值变动收益。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或该金融资产已转移,且符合金融资产转移的终止确认条件的,金融资产将终止确认。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,终止确认该金融负债或其一部分。

金融资产转移,是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方)。本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的,终止确认该金融资产;保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,不终止确认该金融资产。本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,分别下列情况处理:放弃了对该金融资产控制的,终止确认该金融资产;未放弃对该金融资产控制的,按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产,并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下:

(1)股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资,股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账。

因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价,于股权分置改革方案实施后的股票复牌日,冲减股票投资成本。

卖出股票于成交日确认股票投资收益,出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(2)债券投资

买入证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账,其中所包含的债券应收利息单独核算,不构成债券投资成本。

买入未上市债券银行间同业市场交易的债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本,按成交总额扣除交易费用入账,其中所包含的债券应收利息单独核算,不构成债券投资成本。

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券,根据其发行价、到期价和发行期限计算应收利息,按上述会计处理方法核算。

卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券投资收益。

卖出未上市债券银行间同业市场交易的债券于成交日确认债券投资收益。

卖出债券的成本按移动加权平均法结转。

(3)权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本,按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账。

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益,出售权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(4)分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日,按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本,按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本。

上市后,上市流通的债券和权证分别按上述(2).(3)中相关原则进行计算。

(5)回购协议

基金持有的回购协议(封闭式回购)以成本列示,按实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在实际持有期间内逐日计提利息。

6.1.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金日前金融资产和金融负债的估值原则和方法如下:

1.股票估值原则和方法

(1)上市流通股票的估值

上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值;估值日无交易的,且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,以最近交易日的收盘价估值;如最近交易日后发生了影响公允价值计量的重大事件的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格。

(2)未上市股票的估值

送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票,按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值;估值日无交易的,且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,以最近交易日的收盘价估值;如最近交易日后发生了影响公允价值计量的重大事件的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格。

首次发行未上市的股票,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按成本估值。

(3)长期停牌股票的估值

已停牌股票,最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,使潜在估值调整对前一估值日的基金资产