金鹰鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

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:二〇一八年十月二十四日

§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10月23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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金鹰鑫瑞混合	
基金主代码	003502	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年12月6日	
报告期末基金份额总额	4,512,189,081.10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,其预期风险和收益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	
下属分级基金的基金简称	金鹰鑫瑞混合A	金鹰鑫瑞混合C
下属分级基金的交易代码	003502	003503
报告期末下属分级基金的份额总额	2,838,044,501.68份	1,674,144,579.42份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日-2018年9月30日)	
	金鹰鑫瑞混合A	金鹰鑫瑞混合C
1.本期已实现收益	19,261,720.91	17,233,257.50
2.本期利润	20,851,260.34	18,732,290.72
3.加权平均基金份额本期利润	0.0119	0.0137
4.期末基金资产净值	3,117,424,992.70	2,078,028,504.89
5.期末基金份额净值	1.0984	1.2412

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、金鹰鑫瑞混合A:

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	1.79%	0.04%	0.12%	0.54%	1.67%	-0.50%

2、金鹰鑫瑞混合C:

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	1.78%	0.04%	0.12%	0.54%	1.66%	-0.50%

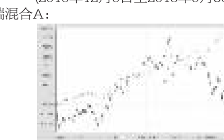
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

金鹰鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金

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12月6日至2018年9月30日)

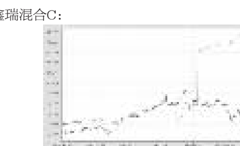
1. 金鹰鑫瑞混合A:



注:(1)截至本报告期末,各项投资比例符合基金合同的约定。

(2)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%

2. 金鹰鑫瑞混合C:



注:(1)截至本报告期末,各项投资比例符合基金合同的约定。

(2)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		
龙悦芳	基金经理	2018-06-14	-	8	龙悦芳女士,曾任平安证券股份有限公司投资助理、交易员、投资经理等职务。2017年5月加入金鹰基金管理有限公司,现任金鹰货币市场证券投资基金、金鹰添瑞中短债债券型证券投资基金、金鹰添祥中短债债券型证券投资基金、金鹰鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
黄艳芳	基金经理	2016-12-06	2018-07-11	11	黄艳芳女士,清华大学硕士研究生。历任天相投资顾问有限公司分析师,中航证券资产管理分公司投资主办,量化投资负责人,广州证券股份有限公司资产管理部投资主办。2015年5月加入金鹰基金管理有限公司,任指数及量化投资部数量策略研究员,现任金鹰量化精选股票型证券投资基金(LOF)、金鹰科技创新股票型证券投资基金基金经理。
汪伟	基金经理	2018-04-10	-	5	汪伟先生,2013年7月至2014年9月曾任广州证券股份有限公司交易员、投资经理等职务,2014年9月至2016年2月曾任金鹰基金管理有限公司交易主管,2016年3月至2017年7月曾任广东南粤银行股份有限公司交易员、宏观分析师等职务,2017年7月加入金鹰基金管理有限公司,现任金鹰元安混合型证券投资基金、金鹰元丰债券型证券投资基金、金鹰鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金、金鹰民丰回报定期开放混合型证券投资基金、金鹰添利中长期信用债债券型证券投资基金、金鹰元祺信用债债券型证券投资基金、金鹰元盛债券型发起式证券投资基金(LOF)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报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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,严格遵守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

2018年3季度,经济下行压力显现,投资消费继续回落,贸易摩擦愈演愈烈,出口回落压力加大。通胀方面,受非洲猪瘟及天气影响,食品价格上涨带动CPI回升,滞胀预期抬头。

流动性方面,央行通过定向降准及超额续作到期MLF释放流动性,且在9月末未跟随美联储上调政策利率,货币市场流动性整体保持宽松。

回顾债券市场,收益率整体下行,短端利率在较为宽松的流动性环境下,收益率大幅下行,而长端利率受地方债供给放量、宽信用措施下社融企稳预期,基建托底经济回稳预期及滞胀担忧等因素影响下,收益率处于区间震荡。三季度10年期国债收益率上行14BP,10年期国开债收益率下行5BP,1年期国开债收益率下行近60BP,存单发行利率大幅下行,收益率曲线进一步陡峭化。股票市场延续低迷走势,其中,创业板指数单季下跌12.16%。

本基金延续经济下行,狭义流动性的改善及银行负债端压力逐渐缓释将推动收益率曲线陡峭化的判断,三季度坚持中短久期配置,主体仓位以中短久期利率债、同业存单为主,以赚取票息及骑乘价差收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2018年9月30日,A类基金份额净值为1.0984元,本报告期份额净值增长率为1.79%,同期业绩比较基准增长率为0.12%;C类基金份额净值为1.2412元,本报告份额期净值增长率1.78% ,同期业绩比较基准增长率为0.12%。

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2018年4季度,经济面临下行压力,贸易摩擦愈演愈烈,加大出口回落的压力;地产调控未放松下,地产投资承压;尽管基建投资下滑有望在地方债资金到位和财政加快支出的支撑下逐步平稳,但基建对冲只能延缓经济下行速度,难以扭转下行方向。中长期看,经济基本面对债市仍有支撑。但潜在风险点来自内外部货币政策方向不一致,中美利差收窄,汇率压力加大以及潜在通胀预期。考虑到汇率压力及潜在通胀预期,货币政策进一步宽松空间有限。在通胀及海外制约因素消除前,利率或维持区间震荡。短端利率在较为宽松的流动性环境及银行理财新规下短端资产需求的支撑下,收益率或保持相对平稳。而股票市场在内外部因素明显改善之前,还将继续磨底。

四季度,本基金将继续维持票息加利率骑乘策略,主体仓位以中短久期利率债、同业存单为主,在确保组合良好流动性和安全性的前提下,结合货币市场流动性情况,适时调整组合各类资产比例和久期,竭力为持有人服务。

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 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	6,146,576,294.00	96.19
	其中:债券	6,146,576,294.00	96.19
	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	164,900,410.00	2.58
	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	230,164.32	0.00
7	其他各项资产	78,165,762.43	1.22
8	合计	6,389,872,630.75	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 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1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。

5.3 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。

5.4 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	140,140,000.00	2.70
2	央行票据	-	-
3	金融债券	689,132,294.00	13.26
	其中:政策性金融债	525,836,294.00	10.12
4	企业债券	59,748,000.00	1.15
5	企业短期融资券	110,353,000.00	2.12
6	中期票据	81,272,000.00	1.56
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	5,065,931,000.00	97.51
9	其他	-	-
10	合计	6,146,576,294.00	118.31

5.5 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	111882352	18徽商银行CD102	3,000,000.00	292,260,000.00	5.63
2	111808202	18中信银行CD202	2,500,000.00	243,550,000.00	4.69
3	111814183	18江苏银行CD183	2,500,000.00	243,400,000.00	4.68
4	111816244	18上海银行CD244	2,000,000.00	194,920,000.00	3.75
5	111818263	18华夏银行CD263	2,000,000.00	194,780,000.00	3.75
6	111812187	18北京银行CD187	2,000,000.00	194,780,000.00	3.75

注:本基金本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的第五名债券并列两只。

5.6 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。

5.7 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贵金属。

5.8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权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 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国债期货。

5.11投资组合报告附注

5.11.1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。

5.11.2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。

5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	8,502.60
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	56,767,910.86
5	应收申购款	21,389,348.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	78,165,762.43

5.11.4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。

5.11.5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。

5.11.6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

单位:份

项目	金鹰鑫瑞混合A	金鹰鑫瑞混合C
本报告期期初基金份额总额	36,524,175.98	127,333,402.95
报告期基金总申购份额	2,946,721,580.39	2,474,716,753.66
减:报告期基金总赎回份额	145,201,254.69	927,905,577.19
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,838,044,501.68	1,674,144,579.42

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 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 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期,经基金管理人董事会审议通过,免去李云亮先生督察长、陈瀚先生副总经理、曾长兴先生副总经理职务,聘请曾长兴先生担任公司督察长,聘请满黎先生担任公司副总经理,上述事项已在证监会指定媒体披露。

§9 备查文件目录

9.1备查文件目录

1、中国证监会注册的金鹰鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金发行及募集的文件。

2、《金鹰鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

3、《金鹰鑫瑞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。

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

二〇一八年十月二十四日

金鹰鑫益灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:金鹰基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年十月二十四日

§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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月23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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金鹰鑫益混合	
基金主代码	003484	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年11月16日	
报告期末基金份额总额	21,742,612.34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×50%+中证全债指数收益率×50%	
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,其预期风险和收益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	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	金鹰鑫益混合A	金鹰鑫益混合C
下属分级基金的交易代码	003484	003485
报告期末下属分级基金的份额总额	16,232,598.34份	5,510,014.00份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日-2018年9月30日)	
	金鹰鑫益混合A	金鹰鑫益混合C
1.本期已实现收益	-270,369.61	-10,564.19
2.本期利润	-136,741.90	102,777.00
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0084	0.0110
4.期末基金资产净值	17,031,039.41	5,801,857.46
5.期末基金份额净值	1.0492	1.0530

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、金鹰鑫益混合A:

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	-0.72%	0.39%	-0.21%	0.67%	-0.51%	-0.28%

2、金鹰鑫益混合C:

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	-0.64%	0.39%	-0.21%	0.67%	-0.43%	-0.28%

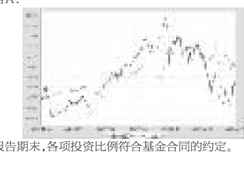
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

金鹰鑫益灵活配置混合型证券投资基金

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11月16日至2018年9月30日)

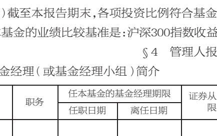
1. 金鹰鑫益混合A:



注:(1)截至本报告期末,各项投资比例符合基金合同的约定。

(2)本基金的业绩比较基准是:沪深300指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%

2. 金鹰鑫益混合C:



注:(1)截至本报告期末,各项投资比例符合基金合同的约定。

(2)本基金的业绩比较基准是:沪深300指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%

§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		
黄艳芳	基金经理	2016-11-16	2018-07-11	11	黄艳芳女士,清华大学硕士研究生。历任天相投资顾问有限公司分析师,中航证券资产管理分公司投资主办,量化投资负责人,广州证券股份有限公司资产管理部投资主办。2015年5月加入金鹰基金管理有限公司,任指数及量化投资部数量策略研究员,现任金鹰量化精选股票型证券投资基金(LOF)、金鹰科技创新股票型证券投资基金基金经理。
林龙军	基金经理	2018-05-17	-	10	林龙军先生,曾任兴全基金管理有限公司产品经理、研究员、基金经理助理、投资经理兼固收投委会委员等职务。2018年3月加入金鹰基金管理有限公司,现任金鹰持久增利债券型证券投资基金(LOF)、金鹰民丰回报定期开放混合型证券投资基金、金鹰添裕纯债债券型证券投资基金、金鹰鑫益灵活配置混合型证券投资基金、金鹰元安混合型证券投资基金、金鹰元丰债券型证券投资基金、金鹰元祺信用债债券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报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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,严格遵守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

进入三季度,我们看到了一些积极的因素正在酝酿,企业盈利总体平稳,而政治局会议提出"六个稳",试图扭转前期市场对于信用加速收缩的悲观预期。资本市场也一度走出了较为积极的局面。本组合相比上季度更加积极,提升了权益品种尤其是转债品种的仓位,但事后来看,本运作期内股债并没有走出一致预期的行情,债券受制于汇率和油价震荡中略微上行,而权益市场并没有受到政策的提振,在贸易战的反复拉锯下仅在季末走出权重股主导的指数行情。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2018年9月30日,A类基金份额净值为1.0492元,本报告期份额净值增长率为-0.72%,同期业绩比较基准增长率为-0.21%;C类基金份额净值为1.0530元,本报告份额期净值增长率-0.64%,同期业绩比较基准增长率为-0.21%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来一个季度,我们认为并不需要过分悲观,在美联储加速收缩的大背景下,所有新兴市场今年都遭受了重创,但中国市场仍然具有相对优势,抗击打能力仍然顽强。当然,仅短期而言,市场仍然会担忧明年通胀与汇率对于市场的干扰,我们倾向于认为四季度会是重要的喘息期,债券资产的表现或会优于三季度。风险资产则需要观察美国的中期选举,以及美债收益率的走向,因为这直接关系到国内资本市场的信心,因为我们现在最缺的也是信心。

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 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	4,554,094.00	17.42
	其中:股票	4,554,094.00	17.42
2	固定收益投资	21,195,275.46	81.08
	其中:债券	21,195,275.46	81.08
	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	161,145.99	0.62
7	其他各项资产	230,013.41	0.88
8	合计	26,140,528.86	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 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1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	522,000.00	2.29
C	制造业	3,235,494.00	14.17
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	244,500.00	1.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	552,100.00	2.42
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	4,554,094.00	19.95

5.2.2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。

5.3 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	300470	日机密封	52,200	1,313,874.00	5.75
2	600570	恒生电子	10,000	552,100.00	2.42
3	600458	时代新材	70,000	544,600.00	2.39
4	601225	陕西煤业	60,000	522,000.00	2.29
5	601233	桐昆股份	25,000	411,000.00	1.80
6	000703	恒逸石化	22,000	372,900.00	1.63
7	603816	顾家家居	6,000	298,800.00	1.31
8	600585	海螺水泥	8,000	294,320.00	1.29
9	601111	中国国航	30,000	244,500.00	1.07

注:本基金本报告期末仅持有9只股票。

5.4 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	1,378,220.00	6.04
	其中:政策性金融债	1,378,220.00	6.04
4	企业债券	3,135,600.00	13.73
5	企业短期融资券	4,035,800.00	17.68
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	12,645,655.46	55.38
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	21,195,275.46	92.83

5.5 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	011800474	18常城建SCP004	20,000.00	2,018,600.00	8.84
2	011800365	18常州投资SCP002	20,000.00	2,017,200.00	8.83
3	1680088	16唐山金控债	20,000.00	1,939,200.00	8.49
4	128010	顺昌转债	16,000.00	1,501,760.00	6.58
5	018005	国开1701	13,700.00	1,378,220.00	6.04

5.6 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。

5.7 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贵金属。

5.8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权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 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国债期货。

5.11投资组合报告附注

5.11.1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。

5.11.2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。

5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,616.76
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	224,053.79
5	应收申购款	1,342.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	230,013.41

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110038	济川转债	117,010.00	0.51
2	110040	生益转债	1,281,600.00	5.61
3	110041	蒙电转债	595,343.30	2.61
4	113011	光大转债	232,974.00	1.02
5	113012	骆驼转债	490,100.00	2.15
6	113014	林洋转债	274,830.00	1.20
7	113015	隆基转债	681,660.00	2.99
8	113018	常熟转债	677,520.00	2.97
9	127004	模塑转债	247,152.00	1.08
10	127005	长证转债	382,480.00	1.68
11	127006	敖东转债	97,260.00	0.43
12	128010	顺昌转债	1,501,760.00	6.58
13	128024	宁行转债	794,990.00	3.48
14	132004	15国盛EB	400,900.00	1.76
15	132008	17山高EB	963,000.00	4.22
16	132012	17巨化EB	487,000.00	2.13

5.11.5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。

5.11.6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

单位:份

项目	金鹰鑫益混合A	金鹰鑫益混合C
本报告期期初基金份额总额	15,821,192.55	32,842,573.52
报告期基金总申购份额	2,107,749.36	3,866,297.96
减:报告期基金总赎回份额	1,696,343.57	31,198,857.48
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	16,232,598.34	5,510,014.00

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

项目	金鹰鑫益混合A	金鹰鑫益混合C
报告期期初管理人持有的本基金份额	-	-
报告期期间买入/申购总份额	1,864,389.87	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	1,864,389.87	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	11.49	-

7.2 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	2018-07-19	1,864,389.87	2,000,000.00	0.50%
合计			1,864,389.87	2,000,000.00	

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

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会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 影响投资者决策的其他重要信息

1、本报告期,经基金管理人董事会审议通过,免去李云亮先生督察长、陈瀚先生副总经理、曾长兴先生副总经理职务,聘请曾长兴先生担任公司督察长,聘请满黎先生担任公司副总经理,上述事项已在证监会指定媒体披露。

2、金鹰鑫益灵活配置混合型证券投资基金的基金份额持有人大会于2018年6月21日至2018年7月16日12:00以通讯方式召开,会议审议通过了《关于金鹰鑫益灵活配置混合型证券投资基金修改基金合同的议案》。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、中国证监会注册的金鹰鑫益灵活配置混合型证券投资基金发行及募集的文件。

2、《金鹰鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

3、《金鹰鑫益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。

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

二〇一八年十月二十四日

金鹰转型动力灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:金鹰基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年十月二十四日

§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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月23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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金鹰转型动力混合
基金主代码	004044
交易代码	004044
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2017年11月16日
报告期末基金份额总额	467,591,459.34份
投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下,积极优选受益于中国经济的转型升级而获取增长动力的优势行业及上市公司,力求实现基金资产的长期稳定增值。
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	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	本基金为混合型基金,属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种,其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金、低于股票型基金。
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	兴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

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日-2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-7,925,544.93
2.本期利润	-11,913,077.76
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0250
4.期末基金资产净值	403,959,440.60
5.期末基金份额净值	0.8639

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 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

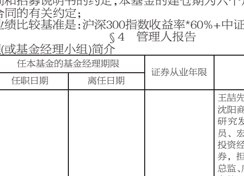
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.91%	1.58%	-0.56%	0.81%	-2.35%	0.77%

3.2.2自基金合同生效以来基金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

金鹰转型动力灵活配置混合型证券投资基金

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11月16日至2018年9月30日)



注:1、本基金合同于2017年11月16日生效,截止报告期末本基金合同生效未满一年;

2、按基金合同和招募说明书的约定,本基金的建仓期为六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关约定;

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

§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		
王喆	权益投资部总监、基金经理	2017-11-16	-	19	王喆先生,工商管理硕士。历任沈阳商品交易所分析员、宏源研究发展中心高级行业研究员、宏源证券资产管理部高级投资经理。2010年加入广州证券,担任投资管理部助理投资总监、广州证券红棉1号投资主办等职。2014年11月加入金鹰基金管理有限公司,现任权益投资部总监、金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金、金鹰成份股优选证券投资基金、金鹰民族新兴混合型证券投资基金、金鹰转型动力灵活配置混合型证券投资基金、金鹰周期优选灵活配置混合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

三季度,金融监管政策对实体经济的影响开始显现,宏观经济有走弱的迹象。社会融资总额降幅明显收窄,但仍未摆脱下行趋势;基建投资继续回落,地产受到政策调控的影响,也出现走弱迹象。市场对未来经济增长预期出现持续回落。同时中美贸易争端也再度升级,继续打压市场风险偏好。不过面对当前宏观形势,三季度国家宏观调控政策出现明显调整:转向稳增长。

三季度市场出现分化,上证综指小幅下跌0.92%,而创业板综指则继续下跌11.84%。

三季度,政策转向稳增长,流动性边际改善,但市场信心仍明显不足。在此情况下,我们以企业盈利增长及估值为主线,重点配置景气度上行、盈利持续增长、现金流充裕,并且能够受益于稳增长政策的上游周期型行业,如钢铁、水泥等。不过由于市场对未来宏观经济前景的预期回落,同时稳增长政策效果也迟迟未能显现,导致上游行业估值被持续压缩,产品净值表现不佳。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2018年9月30日,基金份额净值为0.8639元,本报告期份额净值增长率为-2.91%,同期业绩比较基准增长率为-0.56%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,虽然宏观经济出现转弱迹象,但宏观政策明显转向,随着稳增长政策的持续推进,经济下行风险可控。而A股市场经过持续下跌后,风险得到一定程度的释放,市场整体风险相对可控。不过随着盈利水平的分化,各行业板表现会存在较大的差异。

在配置上,我们仍坚持以盈利和估值为主线,重点配置业绩较好,估值低,且有望受益于稳增长政策的板块。如钢铁、水泥等。同时在操作上保持适当灵活性,根据市场变化及时应对。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内无应当说明的预警事项。

§5 投资组合报告

5.1 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	331,453,452.59	79.83
	其中:股票	331,453,452.59	79.83
2	固定收益投资	32,400,332.00	7.80
	其中:债券	32,400,332.00	7.80
	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	10,000,000.00	2.41
	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	41,036,553.90	9.88
7	其他各项资产	305,269.78	0.07
8	合计	415,195,608.27	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 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1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	5,760,000.00	1.43
C	制造业	284,002,412.91	70.30
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	36,700,344.20	9.09
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	4,990,695.48	1.24
S	综合	-	-
	合计	331,453,452.59	82.05

5.2.2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。

5.3 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	600019	宝钢股份	4,031,289	31,645,618.65	7.83
2	600782	新钢股份	5,000,000	29,500,000.00	7.30
3	000717	韶钢松山	4,220,000	27,345,600.00	6.77
4	600507	方大特钢	2,333,506	25,341,875.16	6.27
5	600808	马钢股份	5,288,600	21,683,260.00	5.37
6	000932	华菱钢铁	2,130,000	17,870,700.00	4.42
7	600231	凌钢股份	4,922,770	17,278,922.70	4.28
8	002110	三钢闽光	973,500	17,123,865.00	4.24
9	000581	威孚高科	808,086	15,798,081.30	3.91
10	300473	德尔股份	458,900	15,281,370.00	3.78

5.4 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)	32,400,332.00	8.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	32,400,332.00	8.02

5.5 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	132013	17宝武EB	318,650.00	32,400,332.00	8.02

注:本基金本报告期末仅持有1只债券。

5.6 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。

5.7 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贵金属。

5.8 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权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 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国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1本基金投资的前十名证券的发行主体之一的三钢闽光因定期报告中关于一致行动人的披露依据不足,于2018年9月19日被中国证券监督管理委员会福建监管局采取出具警示函的监管措施。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策的程序。

5.11.2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。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	54,141.77
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	232,133.08
5	应收申购款	18,994.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	305,269.78

5.11.4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。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6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

单位:份

本报告期期初基金份额总额	490,198,714.38
报告期基金总申购份额	9,112,862.34
减:报告期基金总赎回份额	31,720,117.38
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	467,591,459.34

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 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 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期,经基金管理人董事会审议通过,免去李云亮先生督察长、陈瀚先生副总经理、曾长兴先生副总经理职务,聘请曾长兴先生担任公司督察长,聘请满黎先生担任公司副总经理,上述事项已在证监会指定媒体披露。

§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、《金鹰转型动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

3、《金鹰转型动力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。

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

二〇一八年十月二十四日