金鹰技术领先灵活配置混合型证券投资基金
(金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金)

【2015】年度报告摘要

基金管理人:金鹰基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年三月三十日

§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。

基金管理人根据相关法规及本基金合同规定,于2016年3月30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基金合同、招募说明书及其更新。

本报告中财务资料已经审计,中准会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2015年1月1日起至12月31日止。其中,自2015年7月9日起,原《金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金基金合同》、《金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金托管协议》失效,原金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金报告期自2015年1月1日至2015年7月8日止;金鹰技术领先灵活配置混合型证券投资基金报告期自2015年7月9日至2015年12月31日止。

§2 基金简介

2.1基金基本情况(转型前)

基金名称	金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金
基金简称	金鹰中证技术领先指数增强
基金主代码	210007
交易代码	210007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年6月1日
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	20,695,477.24份
基金合同存续期	不定期

注:1.表中"报告期末"指2015年7月8日。

2.2 基金基本情况(转型后)

基金名称	金鹰技术领先灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	金鹰技术领先灵活配置混合
基金主代码	210007
交易代码	210007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年6月1日
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	59,747,822.50份
基金合同存续期	不定期

注:1.表中"报告期末"指2015年12月31日。

2.3基金产品说明(转型前)

投资目标	本基金为股票型指数增强基金,跟踪指数为本基金的跟踪目标,力求将日均跟踪偏离度控制在0.35%以下,年跟踪误差控制在7.75%以下;对于指数增强部分,采取适当的增强策略,力争取得超额标的指数跟踪投资收益。
投资策略	本基金将在基金合同规定的投资范围内,采用"日上而下"的分析视角,综合考量中国宏观经济所处投资时钟的象限,国内股市市场的估值、国内债券市场收益率的期限结构、CPI与PPI变动趋势、外围主要经济体宏观经济与资本市场的运行状况等因素,分析研究股票市场、债券市场、货币市场的预期收益与风险,合理确定并适时动态地调整本基金在股票、债券、现金等金融工具上的投资比例,力争取得超越标的指数的投资收益。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为中证技术领先指数×90%+活期存款利率(税后)×10%。
风险收益特征	本基金为以跟踪指数为主,主动投资为辅的股票型证券投资基金,属于证券投资基金当中收益、风险较高的品种,一般情形下,其风险和预期收益高于混合型、债券型、货币市场基金。
下属分级基金的风险收益特征	本基金为以跟踪指数为主,主动投资为辅的股票型证券投资基金,属于证券投资基金当中收益、风险较高的品种,一般情形下,其风险和预期收益高于混合型、债券型、货币市场基金。

2.4投资产品说明(转型后)

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,投资于技术领先相关主题的上市公司,通过对股票、固定收益和现金类等资产的积极配置,力争使基金分解持有人获得超额收益与长期资本增值。
投资策略	本基金将在基金合同规定的投资范围内,采用"日上而下"的分析视角,综合考量中国宏观经济所处投资时钟的象限,国内股市市场的估值、国内债券市场收益率的期限结构、CPI与PPI变动趋势、外围主要经济体宏观经济与资本市场的运行状况等因素,分析研究股票市场、债券市场、货币市场的预期收益与风险,合理确定并动态调整本基金在股票、债券、现金等金融工具上的投资比例,力争取得超越标的指数的投资收益。 本基金股票资产占基金资产的比例为70%-95%,投资于技术领先相关主题证券比例不低于非现金基金资产的80%,本基金每个交易日持有扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持现金以及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、投资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。
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	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中高等风险水平的投资品种。
下属分级基金的风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中高等风险水平的投资品种。

2.5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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	苏文锋	王永民
	联系电话	020-83292827	010-66594896
	电子邮箱	csmai@gofund.com.cn	fcid@bank-of-china.com
客户服务电话		4006138888,020-83936180	95566
传真		020-83292856	010-66594942

2.6信息披露方式

项目	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gofund.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市天河区珠江东路28号越秀金融大厦30层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

3.1.1 金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金

金额单位:人民币元

3.1.1.1期间数据和指标	报告期(2015年1月1日至2015年7月8日)	2014年	2013年
本期已实现收益	15,579,499.15	16,934,019.22	2,349,772.76
本期利润	10,546,649.39	14,310,839.66	20,814,289.26
加权平均基金份额本期利润	0.4490	0.2293	0.2226
本期加权平均净值利润率	28.77%	23.23%	26.70%
本期基金份额净值增长率	28.23%	23.39%	30.76%
3.1.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配利润	15,377,175.71	4,471,904.69	-18,894,522.96
期末可供分配基金份额利润	0.7430	0.1243	-0.2215
期末基金资产净值	20,695,477.24	40,778,406.93	78,353,266.21
期末基金份额净值	1.000	1.134	0.919
3.1.1.3 累计期末指标	2015年末	2014年末	2013年末
基金份额累计净值增长率	45.35%	13.35%	-8.14%

注:1.表中"报告期末"指2015年7月8日。

3.1.2金鹰技术领先灵活配置混合型证券投资基金

金额单位:人民币元

3.1.2.1 期间数据和指标	报告期(2015年7月9日至2015年12月31日)
本期已实现收益	6,038,702.85
本期利润	4,157,633.90
加权平均基金份额本期利润	0.1017
本期加权平均净值利润率	9.28%
本期基金份额净值增长率	12.90%
3.1.2.2 期末数据和指标	2015年末
期末可供分配利润	10,976,366.76
期末可供分配基金份额利润	0.1837
期末基金资产净值	67,463,545.07
期末基金份额净值	1.129
3.1.2.3 累计期末指标	2015年末
基金份额累计净值增长率	12.90%

注:1.表中"报告期末"指2015年12月31日。

3.2 基金净值表现(转型前)

3.2.1 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
过去三个月	-12.92%	3.02%	-15.79%	3.00%	2.87%	0.02%
过去六个月	23.38%	2.39%	17.74%	2.37%	5.64%	0.02%
过去一年	52.63%	1.87%	44.73%	1.85%	7.90%	0.02%
过去三年	95.58%	1.52%	90.68%	1.50%	4.90%	0.02%
成立至今	45.35%	1.44%	53.62%	1.48%	-8.27%	-0.04%

注:1.金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金于2011年6月1日成立,存续期截止日为2015年7月31日,2015年7月31日起转型为新基金。

2.过去三个月为存续期截止日2015年7月31日前第3个月,即2015年4月9日至2015年7月8日期间,其余以此类推。

3.2.2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的比较

金额单位:人民币元

项目	2015年1月1日至2015年7月8日	2014年1月1日至2014年12月31日	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日	2011年6月1日(基金合同生效日)至2011年12月31日
份额累计净值增长率①	45.35%	13.35%	-8.14%	-8.27%	-0.04%
业绩比较基准收益率③	53.62%	48.27%	44.13%	37.35%	18.79%
①-③	-8.27%	-34.92%	-52.27%	-45.62%	-18.83%

注:1.金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金于2011年6月1日成立,2015年7月9日起转型为新基金。

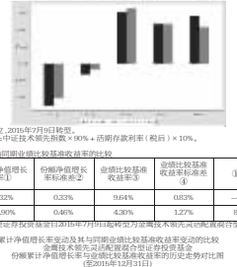
2.本基金合同生效日为2011年6月1日,其他相关财务指标计算至2011年12月31日。

3.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的比较

注:1.金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金于2011年6月1日成立,2015年7月9日起转型。

2.截至转型前金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金的各项投资比例符合本基金基金合同规定的各项比例,期限资产占基金资产净值的比例为80%-95%,其中,不低于80%的基金净资产投资于中证技术领先指数的成分股和准成成分股;债券、现金类资产占基金资产净值的5%,权证、投资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。

3.2.3自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:1.本基金于2011年6月1日成立,2015年7月9日转型。

2.本基金转型前业绩比较基准为:沪深300指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。

3.金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金于2011年6月1日成立,2015年7月9日起转型。

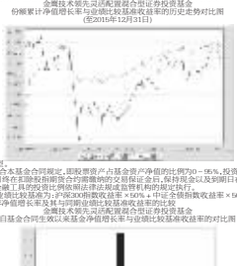
4.根据转型前金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金的各项投资比例符合本基金基金合同规定的各项比例,期限资产占基金资产净值的比例为80%-95%,其中,不低于80%的基金净资产投资于中证技术领先指数的成分股和准成成分股;债券、现金类资产占基金资产净值的5%,权证、投资期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

3.5 过去一年基金收益率与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
过去三个月	5.32%	0.33%	9.64%	0.83%	-4.32%	-0.50%
成立至今	12.90%	0.46%	4.30%	1.27%	8.60%	-0.81%

注:1.金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金自2015年7月1日起转型为金鹰技术领先灵活配置混合型证券投资基金,转型前基金合同生效未满一年。

3.3.2自基金转型日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

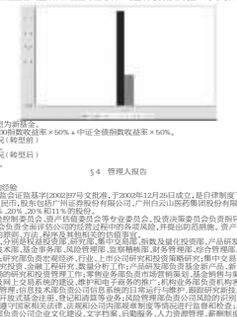


注:1.本基金于2015年7月9日转型。

2.截至转型日基金各项投资比例符合本基金合同规定,期限资产占基金资产净值的比例为70%-95%,投资于技术领先相关主题证券比例不低于非现金基金资产的80%,权证、投资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。

3.2015年7月9日,本基金转型后业绩比较基准为:沪深300指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。

3.3.3 自基金转型日以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:1.本基金于2015年7月9日转型为新基金。

2.转型后业绩比较基准为:沪深300指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。

3.本基金于2015年7月9日起开始运作,2015年7月9日起,本基金基金合同规定的各项投资比例符合本基金基金合同规定的各项比例。

§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情况

金鹰基金管理有限公司经中国证监会证监基字[2002]27号文批准,于2002年12月25日成立,是目前制度下中国证监会批准设立的首批基金管理公司之一。公司注册资本2.6亿元人民币,股东包括广州证券股份有限公司、广州白云山医药集团股份有限公司、美的集团股份有限公司和东证资本投资有限公司,分别持有40%、20%、20%和11%的股份。

公司设立了投资决策委员会、风险控制委员会、资产负债委员会等专业委员会。投资决策委员会负责指导基金资产的运作,确定基本的投资策略和投资组合的原则、范围、风险控制及业务发展等重大事项;风险控制委员会负责全面评估公司的经营和资产负债风险,并提出应采取的风险控制措施;资产负债委员会负责决定基金资产的配置及资产负债结构管理的原则、目标、程序及其他相关的管理事宜。

公司设有下设30个一级部门,分别是权益投资部、研究部、量化投资部、固定收益部、市场业务部、产品研发部、固定收益部、事业发展部、电子商务部、机构业务部、专户投资部、信息技术部、基金事务部、风险管理部、监察稽核部、财务管理部、综合管理部。

权益投资部负责基金投资投资部、研究部负责宏观经济、行业、上市公司研究和投资策略研究;集中交易部负责完成基金证券投资资金、指数及基金投资组合的日常交易、证券结算、基金证券、期货、期权、期货、期权、期货、期权