

金鹰科技创新股票型证券投资基金

[2015] 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:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一五年十月二十七日

§ 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2015年10月23日核对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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	743,028,908.45	77.01
1.1 中股投资		743,028,908.45	77.01
2	固定收益投资	-	-
3	权证	-	-
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	货币市场基金投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他	-	-
	合计	964,369,566.94	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A 农、林、牧、渔业		8,346,306.00	0.03
B 采矿业		-	-
C 制造业		466,949,199.10	49.19
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业		66,479,436.64	6.16
E 建筑业		17,038,984.00	1.80
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		63,502,040.26	5.64
J 金融业		38,734,053.60	4.08
K 房地产业		61,888,240.88	5.62
L 租赁和商务服务业		12,367,149.48	1.30
M 科学研究、技术服务和地质勘查业		-	-
N 水利、环境和公共设施管理业		9,144,370.00	0.96
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		16,079,220.69	1.69
S 综合		-	-
	合计	743,028,908.45	78.28

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	300035	通鼎光通信	4,902,266	63,737,356.51	5.66
2	600446	金证股份	2,105,598	63,502,940.26	5.64
3	000967	冀东水泥	49,095	49,054.28	0.57
4	300147	雪榕股份	2,601,567	45,137,187.45	4.76
5	002694	比亚迪	61,482	37,175,114.82	3.92
6	300328	冠昊生物	989,796	36,424,402.80	3.84
7	600643	建研院	2,186,089	28,790,673.60	3.03
8	300101	振芯科技	1,318,798	28,617,916.60	3.01
9	000042	中洲控股	1,038,251	26,941,688.90	2.84
10	600993	中航动力	648,183	26,494,762.38	2.79

5.4 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债券投资组合

主要财务指标	净值增长率为正的债券投资	净值增长率为负的债券投资	平均到期收益率	平均剩余期限	①-③	②-④
1.本期已实现收益	-506,217,277.04	-	-	-	-	-
2.本期利润	-533,679,406.62	-	-	-	-	-
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3120	-	-	-	-	-
4.期末基金份额净值	949,226,324.13	-	-	-	-	-
5.期末基金份额总额	1,531,118,822.98	-	-	-	-	-

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)扣除相关税费后的余额。

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.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将低于所示列示。

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

主要财务指标	净值增长率为正的债券投资	净值增长率为负的债券投资	平均到期收益率	平均剩余期限	①-③	②-④
1.本期已实现收益	-506,217,277.04	-	-	-	-	-
2.本期利润	-533,679,406.62	-	-	-	-	-
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3120	-	-	-	-	-
4.期末基金份额净值	949,226,324.13	-	-	-	-	-
5.期末基金份额总额	1,531,118,822.98	-	-	-	-	-

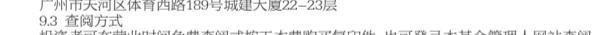
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关税费后的余额。

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.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将低于所示列示。

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

金鹰科技创新股票型证券投资基金 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图对比图 (2015年4月30日至2015年9月30日)



注:1.本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(含中小企业板股票以及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券、银行存款及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会相关规定;

2.业绩比较基准:沪深300指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期间	证券从业年限	说明
方超	基金经理	2015-04-30	-	6

注:1.任辞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《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

3.基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他有关法律法规的规定,勤勉尽责地按照基金合同和基金招募说明书的规定管理运作基金,严格控制风险,努力获取最大利益。本基金报告期内,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

本报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金法》的规定,通过规范化的投资、研究和交易流程,确保公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金法》的规定,通过规范化的投资、研究和交易流程,确保公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

4.3.3 公平交易制度的执行情况

本报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金法》的规定,通过规范化的投资、研究和交易流程,确保公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

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

本报告期内,本基金在成长股方面表现较好,整体涨幅较大,同时对市场的干扰开始消除,市场开始恢复正常,风险溢价收敛,估值回归正常,盈利能力提升,预计四季度有较好的行情演绎。

4.4.2 对宏观经济的展望

本基金在成长股方面表现较好,整体涨幅较大,同时对市场的干扰开始消除,市场开始恢复正常,风险溢价收敛,估值回归正常,盈利能力提升,预计四季度有较好的行情演绎。

4.4.3 对行业配置的展望

本基金在成长股方面表现较好,整体涨幅较大,同时对市场的干扰开始消除,市场开始恢复正常,风险溢价收敛,估值回归正常,盈利能力提升,预计四季度有较好的行情演绎。

4.4.4 对股票选择的展望

本基金在成长股方面表现较好,整体涨幅较大,同时对市场的干扰开始消除,市场开始恢复正常,风险溢价收敛,估值回归正常,盈利能力提升,预计四季度有较好的行情演绎。

4.4.5 对债券选择的展望

本基金在成长股方面表现较好,整体涨幅较大,同时对市场的干扰开始消除,市场开始恢复正常,风险溢价收敛,估值回归正常,盈利能力提升,预计四季度有较好的行情演绎。

4.4.6 对衍生品选择的展望

本基金在成长股方面表现较好,整体涨幅较大,同时对市场的干扰开始消除,市场开始恢复正常,风险溢价收敛,估值回归正常,盈利能力提升,预计四季度有较好的行情演绎。

4.4.7 对资产支持证券选择的展望

本基金在成长股方面表现较好,整体涨幅较大,同时对市场的干扰开始消除,市场开始恢复正常,风险溢价收敛,估值回归正常,盈利能力提升,预计四季度有较好的行情演绎。

4.4.8 对贵金属选择的展望

本基金在成长股方面表现较好,整体涨幅较大,同时对市场的干扰开始消除,市场开始恢复正常,风险溢价收敛,估值回归正常,盈利能力提升,预计四季度有较好的行情演绎。

4.4.9 对权证选择的展望

本基金在成长股方面表现较好,整体涨幅较大,同时对市场的干扰开始消除,市场开始恢复正常,风险溢价收敛,估值回归正常,盈利能力提升,预计四季度有较好的行情演绎。

4.4.10 对股指期货选择的展望

本基金在成长股方面表现较好,整体涨幅较大,同时对市场的干扰开始消除,市场开始恢复正常,风险溢价收敛,估值回归正常,盈利能力提升,预计四季度有较好的行情演绎。

4.4.11 对资产支持票据选择的展望