

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:交通银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年十月二十七日

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2015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,基金的投资业绩并不代表其未来表现。投资者有风险,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。
本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

2.2 基金产品概况

基金名称	金鹰科技创新股票
基金代码	001167
交易代码	001167
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月3日
报告期末基金份额总额	1,531,119,822.38份
投资目标	本基金有有效控制风险并保持良好的流动性前提下,重点投资于科技创新和新兴产业中的优质企业,具有科技和创新属性的股票,上市公司,积极捕捉科技发展和新兴产业带来的投资机会,力争获得超越业绩比较基准的长期资本增值。
投资策略	本基金将通过对宏观经济形势、政策走向、证券市场整体趋势等因素的综合分析,主动调整资产配置,进行积极的风险管理,合理配置权益类资产,债券等资产类资产的比例,最大限度地提高投资组合的收益,提高基金收益。通过“自上而下”及“自下而上”相结合的投资策略,自上而下,把握宏观经济投资组合(1)自上而下分析宏观经济环境,包括GDP、CPI、PPI、通胀、利率、汇率等因素,把握宏观经济(2)自下而上分析行业投资机会,包括行业趋势、管理、商业模式及其提供的产品和服务是否具备科技和创新属性,对企业基本面和估值水平进行综合判断,深度挖掘优质个股,并开展积极的风险管理,在保持资产低风险的基础上,通过资产配置,力争获得良好收益。
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%
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于证券投资基金中较高风险品种,较高预期收益的品种,其预期风险和收益水平高于混合基金、债券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	交通银行股份有限公司

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期 (2015年7月1日至2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-6,761,277.04
2.本期公允价值变动损益	-53,673,406.62
3.本期公允价值变动损益	-0.120
4.本期基金净值	949,228,924.13

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 (%)	净值增长率 标准差	业绩比较基准 收益率	业绩比较基准 收益率标准差	①-③	②-④
本报告期	0.020	-	-	-	-	-

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



4.1 基金管理人简介

姓名	职务	任本基金基金经理的任期	证券从业年限	说明
方刚	基金经理	2015-04-30	6	方刚先生,硕士,曾任招商证券有限公司,现任招商证券有限公司,先后担任研究员、基金经理助理、投资管理部副经理、基金运营部副经理、现任基金运营部副经理。

4.2 基金管理人报告期内为专项说明

4.3 公平交易制度的执行情况

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.6 报告期内基金持有人或或基金资产净值预警说明

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	743,028,906.46	77.01
2	固定收益投资	743,028,906.46	77.01
3	银行存款	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
5	其他金融资产	-	-
6	银行存款和拆借资产合计	106,472,767.70	10.61
7	其他负债	23,967,080.69	2.38
8	合计	964,869,566.04	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	8,846,306.00	0.93
B	采矿业	-	-
C	制造业	466,949,191.10	49.19
D	电力、热力、燃气及生产供应业	56,479,435.54	5.81
E	建筑业	18,378,984.00	1.88
F	交通运输、仓储和邮政业	-	-
G	信息传输、软件和信息技术服务业	53,602,940.20	5.64
H	金融业	38,734,056.00	4.08
I	房地产业	61,889,249.88	6.52
L	租赁和商务服务业	12,367,149.48	1.30
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	16,079,230.69	1.69
S	综合	-	-
合计		743,028,906.46	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	300326	通晓股份	4,802,266	53,737,346.54	5.68
2	600446	金发股份	2,106,586	53,502,940.26	5.64
3	600678	魏桥纺织	7,785,834	49,985,048.28	5.27
4	300147	香农芯创	2,601,567	46,137,147.46	4.78
5	002894	亿纬锂能	619,482	37,176,114.82	3.92
6	300238	冠昊生物	989,796	36,424,492.81	3.84
7	600643	爱建股份	2,186,000	28,799,673.60	3.05
8	300018	聚源科技	1,218,798	28,437,916.68	3.01
9	600542	中国铁建	1,829,281	28,941,888.00	3.05
10	600893	中国电力	448,183	26,454,770.28	2.79

5.4 报告期末按券种分类的债券投资组合

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

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五名资产支持证券投资明细

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

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

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11 投资组合报告附注

5.12 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

5.13 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	686,217.27
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,260,241.03
5	其他应收款	62,782.19
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	5,041.67
9	合计	12,094,262.26

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.15 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	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600446	金发股份	3,963,500.00	0.78	0.78	短期大额资产
2	300110	华仁医药	3,201,000.00	0.63	0.63	短期大额资产

5.16 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.17 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

5.18 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	41,442.34
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	190,796.08
5	其他应收款	1,488,096.24
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,720,244.66

5.19 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.20 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	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300466	聚源科技	3,963,500.00	0.78	0.78	短期大额资产
2	300110	华仁医药	3,201,000.00	0.63	0.63	短期大额资产

5.21 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.22 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

5.23 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	646,033,830.16
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,901,386.51
5	其他应收款	128,712,694.84
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	774,747,911.51

5.24 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.25 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	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000088	华泰证券	549,294	10,063,792.20	1.06	-
2	600081	中信银行	1,000,000	9,780,200.00	1.03	-
3	300622	中润资源	110,000	6,897,000.00	0.72	-
4	600960	新华保险	700,000	6,292,000.00	0.66	-
5	600969	中国铁建	1,000,000	6,010,000.00	0.63	-
6	600353	亚宝药业	500,000	5,540,000.00	0.58	-
7	300656	新威药业	50,000	3,963,000.00	0.41	-
8	000895	双发发展	200,000	3,520,000.00	0.37	-
9	600338	柳州医药	51,400	3,481,222.00	0.36	-
10	300110	华仁医药	300,000	3,201,000.00	0.33	-

5.26 报告期末按券种分类的债券投资组合

5.27 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

5.28 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资产支持证券投资明细

5.29 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

5.30 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

5.31 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.32 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.33 投资组合报告附注

5.34 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

5.35 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	64,439,884.90
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,720,244.66
5	其他应收款	200,000,000.00
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	568,664,063.56

5.36 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	10,063,792.20	1.06
B	采矿业	-	-
C	制造业	44,884,770.00	4.85
D	电力、热力、燃气及生产供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储和邮政业	3,481,222.00	0.37
G	信息传输、软件和信息技术服务业	6,010,000.00	0.64
H	金融业	-	-
I	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		64,439,884.90	6.92

5.37 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	000088	华泰证券	549,294	10,063,792.20	1.06
2	600081	中信银行	1,000,000	9,780,200.00	1.03
3	300622	中润资源	110,000	6,897,000.00	0.72
4	600960	新华保险	700,000	6,292,000.00	0.66
5	600969	中国铁建	1,000,000	6,010,000.00	0.63
6	600353	亚宝药业	500,000	5,540,000.00	0.58
7	300656	新威药业	50,000	3,963,000.00	0.41
8	000895	双发发展	200,000	3,520,000.00	0.37
9	600338	柳州医药	51,400	3,481,222.00	0.36
10	300110	华仁医药	300,000	3,201,000.00	0.33

5.38 报告期末按券种分类的债券投资组合

5.39 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

5.40 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资产支持证券投资明细

5.41 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

5.42 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

5.43 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.44 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.45 投资组合报告附注

5.46 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

5.47 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	64,439,884.90
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,720,244.66
5	其他应收款	200,000,000.00
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	568,664,063.56

5.48 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	10,063,792.20	1.06
B	采矿业	-	-
C	制造业	44,884,770.00	4.85
D	电力、热力、燃气及生产供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储和邮政业	3,481,222.00	0.37
G	信息传输、软件和信息技术服务业	6,010,000.00	0.64
H	金融业	-	-
I	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		64,439,884.90	6.92

5.49 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	000088	华泰证券	549,294	10,063,792.20	1.06
2	600081	中信银行	1,000,000	9,780,200.00	1.03
3	300622	中润资源	110,000	6,897,000.00	0.72
4	600960	新华保险	700,000	6,292,000.00	0.66
5	600969	中国铁建	1,000,000	6,010,000.00	0.63
6	600353	亚宝药业	500,000	5,540,000.00	0.58
7	300656	新威药业	50,000	3,963,000.00	0.41
8	000895	双发发展	200,000	3,520,000.00	0.37
9	600338	柳州医药	51,400	3,481,222.00	0.36
10	300110	华仁医药	300,000	3,201,000.00	0.33

5.50 报告期末按券种分类的债券投资组合