

金鹰产业整合灵活配置混合型证券投资基金

[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：中国光大银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一五年十月二十七日

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。

基金托管人对本基金定期报告、中期报告和年度报告等文本内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人和基金托管人对本报告书内容一致。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。

基金管理人承诺在报告期间不从事内幕交易、勤勉尽责的履行风险管理运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金管理人的过往业绩并不代表未来表现，投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期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

基金简称	金鹰产业整合混合
基金代码	001366
交易代码	001366
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月1日
报告期末基金份额总额	696,941,012.27份
投资目标	本基金在有效控制投资组合风险并保持良好流动性的前提下，努力为股东创造价值，实现长期资本增值。
投资策略	本基金将根据宏观经济的运行状况，在严格控制风险的前提下，精选行业个股，追求基金资产的长期稳定增值。
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	本基金为股票型基金，属于证券投资基金中较高风险品种，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	中国光大银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元		报告期	(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-9,562,464.70		
2.期初利润	-22,692,363.00		
3.期初可供基金份额总额	-0.0311		
4.期末可供基金份额总额	616,867,601.04		
5.期末基金份额净值	0.941		

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；

3.2.2 基金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(%)	净值增长标准差(%)	业绩比较基准收益率标准差(%)	①-③	②-④
过去三个月	-3.09%	0.47%	-16.08%	2.00%	-13.99%

3.2.2 自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015年6月16日至2015年9月30日)

3.2.3 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(%)	净值增长标准差(%)	业绩比较基准收益率标准差(%)	①-③	②-④
过去三个月	-3.09%	0.47%	-16.08%	2.00%	-13.99%

3.2.4 基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的比较

3.2.5 业绩比较基准

3.2.6 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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王晓	权益投资部 总监	2015-06-16	-	16	
于利国	研究部副 总监	2015-06-16	-	6	

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发布的《证券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情况的说明

本报告期内，基金管理人遵守《证券投资基金法》和其他有关法律法规及各项实施准则、《金鹰产业整合灵活配置型证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金，充分保护基金份额持有人的最大利益。本基金报告期内，基金运作合法合规，无出现违法、违规及损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

本报告期内，基金管理人按照《公开公平交易制度指导意见》的要求，根据本公司《公平交易制度》的规定，通过规范化的操作流程、投资和交易流程，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。

4.4 竞争对手管理情况

本报告期内，基金管理人严格按照《公开公平交易制度指导意见》的规定，通过规范化的操作流程、投资和交易流程，执行公平交易原则，未出现不公平交易和利益输送的情况。本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.5 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本基金组合与其他公司管理的其他主动型投资组合未发生同向日内反向交易的情况；与本公司管理的被动型投资组合发生的同向日内反向交易，未发生过成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.6 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

本基金在严格控制风险的前提下，通过灵活配置股票仓位，精选行业个股，追求基金资产的长期稳定增值。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年9月30日，基金份额净值为0.941元，本报告期份额净值增长率率为-3.09%，同期业绩比较基准收益率为-16.08%。

信息披露 Disclosure

金鹰策略配置混合型证券投资基金

[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：中信银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一五年十月二十七日

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、完整性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人对本基金定期报告、中期报告和年度报告等文本内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人承诺在报告期间不从事内幕交易、勤勉尽责的履行风险管理运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金管理人的过往业绩并不代表未来表现，投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期内财务数据未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§ 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、完整性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中行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，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。

基金净值的计算方法及其结果由基金管理人负责。

基金管理人提醒投资者注意，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。

本报告期内财务数据未经审计。

§ 2 报告期末按行业分类的股票投资组合

§ 3 基金产品概况

§ 4 报告期末按行业分类的股票投资组合

§ 5 报告期末按行业分类的股票投资组合

§ 6 报告期末按行业分类的股票投资组合

§ 7 报告期末按行业分类的股票投资组合

§ 8 报告期末按行业分类的股票投资组合

§ 9 报告期末按行业分类的股票投资组合

§ 10 报告期末按行业分类的股票投资组合

§ 11 报告期末按行业分类的股票投资组合

§ 12 报告期末按行业分类的股票投资组合

§ 13 报告期末按行业分类的股票投资组合

§ 14 报告期末按行业分类的股票投资组合

§ 15 报告期末按行业分类的股票投资组合

§ 16 报告期末按行业分类的股票投资组合

§ 17 报告期末按行业分类的股票投资组合

§ 18 报告期末按行业分类的股票投资组合

§ 19 报告期末按行业分类的股票投资组合

§ 20 报告期末按行业分类的股票投资组合

§ 21 报告期末按行业分类的股票投资组合

§ 22 报告期末按行业分类的股票投资组合

§ 23 报告期末按行业分类的股票投资组合

§ 24 报告期末按行业分类的股票投资组合

§ 25 报告期末按行业分类的股票投资组合

§ 26 报告期末按行业分类的股票投资组合

§ 27 报告期末按行业分类的股票投资组合

§ 28 报告期末按行业分类的股票投资组合

§ 29 报告期末按行业分类的股票投资组合

§ 30 报告期末按行业分类的股票投资组合

§ 31 报告期末按行业分类的股票投资组合

§ 32 报告期末按行业分类的股票投资组合

§ 33 报告期末按行业分类的股票投资组合

§ 34 报告期末按行业分类的股票投资组合

§ 35 报告期末按行业分类的股票投资组合

§ 36 报告期末按行业分类的股票投资组合

§ 37 报告期末按行业分类的股票投资组合

§ 38 报告期末按行业分类的股票投资组合

§ 39 报告期末按行业分类的股票投资组合

§ 40 报告期末按行业分类的股票投资组合

§ 41 报告期末按行业分类的股票投资组合

§ 42 报告期末按行业分类的股票投资组合

§ 43 报告期末按行业分类的股票投资组合

§ 44 报告期末按行业分类的股票投资组合

§ 45 报告期末按行业分类的股票投资组合