金鹰行业优势混合型证券投资基金

【2015】第四季度报告

基金管理人:金鹰基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年一月二十一日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月20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2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金鹰行业优势混合
基金主代码	210003
交易代码	210003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年7月1日
报告期末基金份额总额	155,812,932.34份
投资目标	以追求长期资本可持续增值为目的,以深入的基本面分析为基础,通过投资于优势行业当中的优势股票,在充分控制风险的前提下,分享中国经济快速发展的成果,进而实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采用“自上而下”的投资方法,定性分析与定量分析并用,综合分析国内外政治经济环境、政策形势、金融市场走势、行业景气等因素,研判市场时机,结合货币市场、债券市场和股票市场估值等状况,进行资产配置及组合的构建,合理确定基金在股票、债券、现金等资产类别上的投资比例,并随着各类资产风险收益特征的相对变化,适时动态地调整股票、债券和货币市场工具的投资比例,以最大限度地降低投资组合的风险、提高收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%。
风险收益特征	本基金为主动管理的混合型证券投资基金,属于证券投资基金中的风险和预期收益较高品种。一般情形下,其预期风险和收益均高于货币型基金、债券型基金。
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

§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(2015年10月1日-2015年12月31日)
1.本期已实现收益	38,663,249.71
2.本期利润	72,224,384.78
3.加权平均基金份额本期利润	0.4465
4.期末基金资产净值	256,000,474.68
5.期末基金份额净值	1.6430

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。

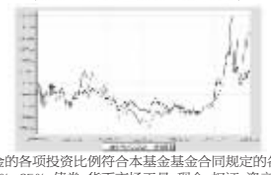
3.2 基金净值表现

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	35.74%	2.16%	13.07%	1.25%	22.67%	0.91%

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

金鹰行业优势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
(2009年7月1日至2015年12月31日)



注:1、截至报告日本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,即本基金股票资产占基金资产净值的比例为60%-95%;债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产净值的比例为5%-40%,权证投资的比例范围占基金资产净值的0-3%;
2、本基金的业绩比较基准为:原为沪深300指数收益率×75%+中信标普国债指数收益率×25%,2015年9月28日起变更为沪深300指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%

§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		
何晓春	权益投资部总监、基金经理	2012-07-26	-	16	何晓春先生,产业经济学博士,16年金融行业从业经验,曾任世纪证券有限责任公司江西分公司筹办组负责人等职,2011年4月加入金鹰基金管理有限公司,现任公司权益投资部总监、金鹰中证500指数分级证券投资基金、金鹰稳健成长混合型证券投资基金、金鹰行业优势混合型证券投资基金、金鹰民族新兴灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
倪超	基金经理	2015-06-11	-	6	倪超先生,硕士,2009年6月加盟金鹰基金管理有限公司,先后任行业研究员,消费品研究小组组长、基金经理助理。现任金鹰行业优势混合型证券投资基金、金鹰保本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《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、《金鹰行业优势股票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

本报告期,本基金管理人按照《证券投资基金管理公司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。

本基金管理人事前规定了严格的股票备选库管理制度、投资权限管理制度、债券库管理制度和集中交易制度等;事中重视交易执行环节的公平交易措施,以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则,通过投资交易系统中的公平交易模块,以尽可能确保公平对待各投资组合;事后加强对不同投资组合的交易价差、收益率的分析,对公平交易执行情况进行检查。本报告期内,公司公平交易制度总体执行情况良好。

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

回顾2015年四季度,清理场外配资得到按期完成,加上人民币在经历八月新汇改后也逐步趋稳,三季度以来的市场过度悲观预期得到了修复,市场迎来一轮反弹。期间上证综指上涨15.9%,深成指上涨26.8%,中小板指数上涨23.8%,创业板指数上涨30.3%。从行业表现看,计算机、基础化工、房地产、通信、纺织服装板块涨幅居前,而钢铁、银行、交通运输、煤炭、石油石化板块涨幅居后。

在市场风险偏好回升的趋势下,本基金主要做了组合均衡配置调整。配置上加大了符合产业发展趋势和转型类个股的配置,重点布局了新能源汽车产业链、电改主题、医疗、智能汽车等。

总体而言,本基金在四季度取得了一定的净值收益,并超越了同期基准收益率。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截止2015年12月31日,基金份额净值为1.6430元,本报告期基金净值增长率为35.74%,同期业绩比较基准增长率为13.07%。

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,国内方面,2016年将是十三五规划的开启年,国家和各个领域,各行业的十三五规划将陆续出台,改革预期不断强化,自下而上看,上市公司并购或将继续活跃。而推进供给侧结构性改革,提升改造“旧动能”,有助于加速传统产能的出清,随之而来的社会冲击以及对市场形成的风险也值得关注。海外市场方面,美联储在12月份开启了近十年来的首次加息,这标志着美国正式开启加息周期,未来的加息节奏仍将对全球经济、特别是新兴国家货币形成影响,其风险因素仍需持续关注。

对于A股市场而言,随着4季度市场较大幅度的反弹,个股短期普遍涨幅较大,客观上有调整的需求,在资产配置荒大背景下,新增资金有入场需求,有望对股市形成利好叠加估值切换因素和各种改革措施的落地,调整后的市场将出现较好的投资机会。新能源汽车、智能汽车、医疗服务、国企改革仍将是未来主要的投资方向。

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	240,504,016.06	90.75
	其中:股票	240,504,016.06	90.75
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	20,485,890.67	7.73
7	其他各项资产	4,020,360.17	1.52
8	合计	265,010,266.90	100.00

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	-	-
C	制造业	177,894,179.67	69.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	30,241,370.13	11.81
E	建筑业	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	20,069,009.66	7.84
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	6,485,505.60	2.53
N	水利、环境和公共设施管理业	5,813,951.00	2.27
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	240,504,016.06	93.95

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	600079	人福医药	1,050,483	23,383,751.58	9.13
2	600969	郴电国际	1,213,341	22,968,545.13	8.97
3	002594	比亚迪	345,823	22,271,001.20	8.70
4	002614	蒙发利	1,061,799	20,588,282.61	8.04
5	001979	招商蛇口	962,081	20,069,009.66	7.84
6	002249	大洋电机	1,383,206	18,341,311.56	7.16
7	002096	南岭民爆	582,400	15,148,224.00	5.92
8	600699	均胜电子	404,264	14,517,120.24	5.67
9	002236	大华股份	342,526	12,639,209.40	4.94
10	002011	盾安环境	575,354	9,619,918.88	3.76

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券

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
本基金本报告期末未持有债券。

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
本基金本报告期末未持有贵金属。

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
本基金本报告期末未持有权证。

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
本基金本报告期末未持有股指期货持仓。

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
本基金报告期末未持有国债期货。

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	154,680.41
2	应收证券清算款	2,442,109.96
3	应收股利	-
4	应收利息	5,194.27
5	应收申购款	1,418,375.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,020,360.17

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600699	均胜电子	14,517,120.24	5.67	因重大事项停牌
2	002011	盾安环境	9,619,918.88	3.76	因重大事项停牌

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	167,228,208.90
报告期基金总申购份额	54,976,059.37
减:报告期基金总赎回份额	66,391,335.93
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	155,812,932.34

§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
本报告期,本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

本报告期,本基金原审计机构中审亚太会计师事务所(特殊普通合伙)广东分所已与众环海华会计师事务所(特殊普通合伙)合并为中审众环会计师事务所(特殊普通合伙),经公司第五届董事会第20次会议决议通过,旗下相关基金的审计机构由“中审亚太会计师事务所(特殊普通合伙)”相应变更为中审众环会计师事务所(特殊普通合伙),此项变更已于2015年12月31日在指定媒体公告,并按规定向证监会备案。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
1、中国证监会批准金鹰行业优势股票型证券投资基金发行及募集的文件。
2、《金鹰行业优势股票型证券投资基金基金合同》。
3、《金鹰行业优势股票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。
6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、季度报告、更新的招募说明书及其他临时公告。

9.2 存放地点
广州市天河区体育西路189号城建大厦22-23层

9.3 查阅方式
投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。
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:4006-135-888,020-83936180
网址:http://www.gefund.com.cn

金鹰基金管理有限公司
二〇一六年一月二十一日

金鹰稳健成长混合型证券投资基金

【2015】第四季度报告

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:二〇一六年一月二十一日

§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2016年1月20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2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金鹰稳健成长混合
基金主代码	210004
交易代码	210004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年4月14日
报告期末基金份额总额	178,419,313.81份
投资目标	以追求长期资本可持续增值为目的,以深入的基本面分析为基础,通过投资于稳健性、成长性或两者兼备的股票,在充分控制风险的前提下,分享中国经济快速发展的成果,进而实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金投资策略充分体现“稳健”与“成长”这两个核心理念,在实际投资过程中采用“自上而下”的投资方法,定性与定量分析相结合,重点考察宏观经济、资本市场、名义利率所处的不同周期阶段,分析判断市场时机,合理确定基金在股票、债券、现金等资产类别上的投资比例,并随着各类资产风险收益特征的相对变化,适时动态地调整股票、债券和货币市场工具的投资比例。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金为主动操作的混合型证券投资基金,属于证券投资基金中的较高收益、较高风险品种。
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

§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(2015年10月1日-2015年12月31日)
1.本期已实现收益	15,861,256.95
2.本期利润	88,184,704.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.2376
4.期末基金资产净值	250,463,401.81
5.期末基金份额净值	1.404

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、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。

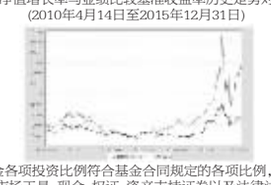
3.2 基金净值表现

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	48.03%	2.52%	13.07%	1.25%	34.96%	1.07%

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

金鹰稳健成长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
(2010年4月14日至2015年12月31日)



注:1、截至报告日本基金各项投资比例符合基金合同规定的各项比例,即股票资产占基金资产的比例为60%~95%;债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%~40%,其中现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,权证投资的比例范围占基金资产净值的0~3%;
2、本基金的业绩比较基准为:原为沪深300指数收益率×75%+中信标普国债指数收益率×25%,2015年9月28日起变更为沪深300指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%

§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		
何晓春	权益投资部总监	2014-11-19	-	16	何晓春先生,产业经济学博士,16年金融行业从业经验,曾任世纪证券有限责任公司江西分公司筹办组负责人等职,2011年4月加入金鹰基金管理有限公司,现任公司权益投资部总监、金鹰中证500指数分级证券投资基金、金鹰稳健成长混合型证券投资基金、金鹰行业优势混合型证券投资基金、金鹰民族新兴灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
陈颖	基金经理	2015-06-11	-	5	陈颖先生,硕士,曾任职于广东省电信规划设计院、中国惠普,历任深圳市瀚信资产管理有限公司研究主管等职,2012年9月加入金鹰基金管理有限公司,先后任研究员、研究小组组长、基金经理助理等。现任金鹰稳健成长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《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、《金鹰稳健成长股票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

本报告期,本基金管理人按照《证券投资基金管理公司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。

本基金管理人事前规定了严格的股票备选库管理制度、投资权限管理制度、债券库管理制度和集中交易制度等;事中重视交易执行环节的公平交易措施,以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则,通过投资交易系统中的公平交易模块,以尽可能确保公平对待各投资组合;事后加强对不同投资组合的交易价差、收益率的分析,对公平交易执行情况进行检查。本报告期内,公司公平交易制度总体执行情况良好。

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

回顾2015年四季度,在场外配资清理基本结束,以及人民币汇率趋稳的背景下,市场出现较大幅度的反弹。期间上证综指上涨15.9%,深成指上涨23.8%,创业板指数上涨30.3%。从行业表现看,计算机、基础化工、房地产、通信、纺织服装板块涨幅居前,而钢铁、银行、交通运输、煤炭、石油石化板块涨幅居后。

四季度本基金持仓仍偏重于进攻性板块,在市场反弹中取得了较好的收益率。

四季度本基金在选股上更加注重精选个股,力争寻找符合产业发展趋势,具有真正核心竞争优势且估值与业绩增长能匹配的成长股。配置上,以新能源汽车产业链、电力改革、国企改革为主。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截止2015年12月31日,基金份额净值为1.404元,本报告期基金净值增长率为48.03%,同期业绩比较基准增长率为13.07%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

16年A股面临格外复杂的宏观经济。国内方面,16年将是十三五规划的开启年,代表未来增长动力的服务业和新兴行业仍是市场结构性机会所在。而推进供给侧结构性改革,有助于加速传统产能的出清,但短期带来的社会冲击以及对市场形成的风险也值得关注。国外方面,美联储在12月份开启了近十年来的首次加息,标志着美国进入加息周期,未来的加息节奏仍将对全球经济、特别是新兴国家货币形成影响,其风险因素仍需持续关注。

对于A股市场而言,随着4季度市场较大幅度的反弹,个股短期涨幅较大,16年的投资将变的更加困难。

展望2016年1季度,我们认为市场在大幅上涨后有着强烈的调整需求,但由于估值切换和新增机构资金入市,调整后的市场将出现较好的投资机会。智能汽车、互联网、国企改革仍将是未来主要的投资方向。

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	225,742,561.88	84.73
	其中:股票	225,742,561.88	84.73
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	24,206,094.77	9.08
7	其他各项资产	16,492,816.35	6.19
8	合计	266,441,473.00	100.00

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	5,907,702.60	2.36
B	采矿业	-	-
C	制造业	219,834,859.28	87.77
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	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	225,742,561.88	90.13

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	600699	均胜电子	674,400	24,217,704.00	9.67
2	002249	大洋电机	1,515,400	20,094,204.00	8.02
3	300080	易成新能	1,788,725	19,264,568.25	7.69
4	000678	襄阳轴承	1,185,400	14,710,814.00	5.87
5	300138	晨光生物	690,190	14,707,948.90	5.87
6	300304	云意电气	478,446	14,162,001.60	5.65
7	002322	理工监测	554,500	14,012,215.00	5.59
8	600367	红星发展	1,090,900	13,821,703.00	5.52
9	300340	科恒股份	353,400	12,835,488.00	5.12
10	002243	通产丽星	727,216	12,348,127.68	4.93

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金报告期末未持有债券。

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
本基金报告期末未持有债券。

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
本基金报告期末未持有贵金属投资。

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
本基金报告期末未持有权证。

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
本基金报告期末未持有股指期货投资。

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
本基金报告期末未持有国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价
无

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	189,230.79
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,347.26
5	应收申购款	16,301,238.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,492,816.35

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600699	均胜电子	24,217,704.00	9.67	重大事项

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	124,195,535.50
报告期基金总申购份额	5,262,618,910.45
减:报告期基金总赎回份额	5,208,395,132.14
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	178,419,313.81

§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
本报告期,本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

本报告期,本基金原审计机构中审亚太会计师事务所(特殊普通合伙)广东分所已与众环海华会计师事务所(特殊普通合伙)合并为中审众环会计师事务所(特殊普通合伙),经公司第五届董事会第20次会议决议通过,旗下相关基金的审计机构由“中审亚太会计师事务所(特殊普通合伙)”相应变更为中审众环会计师事务所(特殊普通合伙),此项变更已于2015年12月31日在指定媒体公告,并按规定向证监会备案。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
1、中国证监会批准金鹰稳健成长股票型证券投资基金发行及募集的文件。
2、《金鹰稳健成长股票型证券投资基金基金合同》。
3、《金鹰稳健成长股票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。
6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、季度报告、更新的招募说明书及其他临时公告。

9.2 存放地点
广州市天河区体育西路189号城建大厦22-23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
二〇一六年一月二十一日

金鹰民族新兴灵活配置混合型证券投资基金

【2015】第四季度报告

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:二〇一六年一月二十一日

§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2016年1月20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2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金鹰民族新兴混合
基金主代码	001298
交易代码	001298
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月2日
报告期末基金份额总额	394,490,427.79份
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,通过对股票、固定收益和现金类等资产的积极灵活配置,重点关注在中华民族崛起过程中推动民族新兴发展的行业和企业,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	本基金将重点关注中华民族崛起过程中推动民族新兴发展的行业和企业,挖掘在经济结构转型、社会文明水平提高、综合经济实力提升等方面带来的投资机会。基金管理人将围绕着民族新兴发展的投资主线,寻找具有成长潜力的公司股票进行配置,重点关注互联网、信息技术、文化传媒、生物医药、节能环保、高端装备制造、新能源、新材料、新能源汽车、智慧城市、现代农业、现代金融服务、信息安全等行业。
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,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。
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 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(2015年10月1日-2015年12月31日)
1.本期已实现收益	-2,286,928.02
2.本期利润	29,270,088.54
3.加权平均基金份额本期利润	0.0622
4.期末基金资产净值	403,463,804.31
5.期末基金份额净值	1.023

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	6.23%	0.40%	11.02%	1.00%	-4.79%	-0.60%

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

金鹰民族新兴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