

# 信息披露 Disclosure

## 金鹰主题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高级管理人员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、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。投资人选择基金时应仔细阅读基金的招募说明书。

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	金鹰主题优势混合
基金代码	210005
交易代码	210005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年1月20日
报告期末基金份额总额	314,305,600.08份

以追求股票长期稳定增长为目标，通过精选个股并配置适当比例的债券类固定收益品种，力争在控制风险的前提下，实现基金资产的长期稳健增值。

本基金将“自下而上”为原则，从行业基本面出发，精选具有核心竞争力的上市公司，挖掘具有持续增长潜力的公司，从而构建本基金的投资组合。

本基金体现了“主题优势”这一核心理念，主要通过分析和把握经济不同阶段的行业投资机会，优选并深挖公司以其所处行业地位、主题投资机会、优化资产配置，降低行业波动对基金的冲击。

业绩比较基准 中证500指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%

风险收益特征 本基金是混合型基金，风险收益特征介于股票型基金与债券型基金之间，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		75,108,083.07
2.本期利润		119,912,081.07
3.期初至报告期末基金期间回报		0.3393
4.期末基金份额净值		463,026,395.07
5.期末可供分配基金份额利润		1,441

注：1.本期已实现收益指本基金本期利息收入、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费用，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

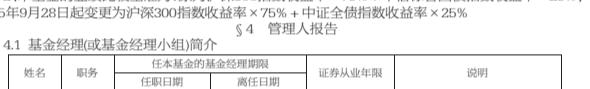
3.2.1 本基金报告期内份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 37.98% 2.00% 12.07% 1.26% 24.00% 1.01%

3.2.2 本基金报告期内份额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

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2010年12月20日至2015年12月31日)



注：1.截至报告日本基金各项投资比例基本符合基金合同规定的各项比例；

2.本基金的业绩比较基准：为沪深300指数收益率×75%+中证国债指数收益率×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 基金管理人或基金经理小组简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期间	证券从业年限	说明
陈立	基金经理	2013-08-16 -	8	本基金基金经理，经济学硕士，证券从业经历8年，曾任华夏基金管理有限公司宏观经济研究员、基金经理助理、基金经理、华夏主题优势混合型证券投资基金基金经理。

注：1.任职期间和任期公司名称因公司名称变更或解聘而调整；

2.证券从业的含义遵从《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合规性情况的说明

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、《金鹰主题优势混合型证券投资基金基金合同》的规定，本着诚信的原则，勤勉尽责的履行管理责任并运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无出现重大违法违规或损害基金合同的行为，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 公平交易机制的执行情况

本报告期内，基金管理人按照《证券投资基金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、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。

4.3.2 公平交易的专项说明

本基金报告期内未发现有明显证据表明基金经理存在不公平交易和利益输送的情况。

4.4 报告期内基金投资策略说明

本基金报告期内未发现有明显证据表明基金经理存在不公平交易和利益输送的情况。

4.5 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本基金报告期内未发现有明显证据表明基金经理存在不公平交易和利益输送的情况。

4.6 报告期内基金管理人报酬情况

本基金报告期内未发现有明显证据表明基金管理人报酬情况存在不公平交易和利益输送的情况。

#### § 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	414,691,860.84	87.68%
其中：股票		414,691,860.84	87.68%
2 固定收益投资		-	-
其中：债券		-	-
资产支持证券		-	-
3 货币市场工具		-	-
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		46,649,833.73	9.89%
7 其他各项资产		10,545,064.54	2.24%
8 合计		471,795,730.11	100.00%

报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2 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		209,760,861.23	46.30%
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业		-	-
E 建筑业		-	-
F 铁路、船舶、航空航天和其他运输设备制造业		68,098,362.12	13.02%
G 交通运输、仓储和邮政业		60,367,295.90	13.32%
H 住宿和餐饮业		28,626,296.00	6.32%
I 信息传输、软件和信息技术服务业		8,639,634.80	1.91%
J 金融业		-	-
K 房屋建筑业		34,074,752.59	7.52%
L 租赁和商务服务业		-	-
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		14,134,693.20	3.12%
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		414,501,860.84	91.52%

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五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000136	通博股份	39,364,466.12	8.62%
2	000630	龙回头	32,504,467.52	7.17%
3	007054	龙江摩托	667,800	1.32%
4	002425	凯撒旅游	976,400	0.20%
5	002348	海伦哲	1,008,064	0.22%
6	600050	浦发银行	561,136	1.16%
7	000002	万科A	900,111	1.81%
8	000342	明阳智能	430,000	0.87%
9	002284	亚太股份	948,362	1.91%
10	000705	浙江永强	1,014,600	1.99%

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五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100001	国债	366,778,052.21	75.00%
2	100002	国债	296,160,930.62	58.00%
3	300342	明阳智能	21,402,792.00	4.34%
4	000002	万科A	21,089,760.59	4.05%
5	000342	明阳智能	21,402,792.00	4.04%

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十名资产支持证券投资明细

本基金报告期内未持有资产支持证券投资。

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黄金白银投资明细

本基金报告期内未持有黄金白银投资。

5.7 报告