

金鹰保本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监事会对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、完整性和及时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,复核报告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。

本报告期财务数据未经审计。

报告期自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	金鹰保本混合
基金主代码	210000
交易代码	210000
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年8月17日
报告期基金份额总额	60,885,867,047份
投资目标	采用资产配置比例均衡策略(CPI),入选长期投资组合,在严格控制投资风险,保证基金资产安全的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金的长期投资策略为:在严格控制投资组合的风格风险、风险调整后“夏普比率”(即“夏普指数”)的基础上,根据宏观经济形势、资金面情况、市场利率、资金供求、资产类别配置、流动性特征等进行资产配置,力争在控制风险的前提下实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	30%银行定期存款利率(税后) + 70%沪深300指数
风险收益特征	本基金为保本混合型基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其长期平均风险收益水平低于股票型基金,但高于货币市场基金。
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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		1,292,881.07
2.本期利润		1,798,722.31
3.加权平均基金份额本期利润		0.02540
4.期末基金资产净值		58,402,120.10
5.期末基金份额净值		1.048

注:1.本期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申购基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.1 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	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
过去三个月	3.00%	0.28%	0.22%	0.01%

3.2.2 本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

金鹰保本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

(2011年6月17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限制, 调整型, 权重占基金资产净值的比例为0%-40%, 其中, 权重比例的范围即为基金资产净值的0%-3%; 债券、资产支持证券、货币市场工具、现金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具的60%-100%, 其中, 现金或到期日在一年以内的政府债券不高于基金资产净值的5%;

2.本基金的业绩比较基准为:3年期银行定期存款利率(税后)。

§ 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
刘勇	本基金基金经理	2015-01-09	—	6
李海	本基金基金经理	2015-01-09	—	10

注:1.在任基金经理在本公司从事基金管理工作时间以任职日期为准。

2.本基金的基金经理遵从《证券投资基金法》、《证券投资基金销售适用性指导意见》及相关规定。

4.2 管理人对报告期内基金运作指标的说明

4.3 管理人对报告期内基金投资策略的说明

4.4 管理人对报告期内基金业绩表现的说明

4.5 管理人对宏观经济的专项说明

4.6 报告期内基金持有人数及基金资产净值变动情况

4.7 管理人对基金投资策略的说明

4.8 管理人对宏观经济的专项说明

4.9 管理人对报告期内基金估值政策的说明

4.10 管理人对报告期内基金摊薄式估值的说明

4.11 管理人对报告期内基金投资组合的分析

4.12 管理人对报告期内基金业绩表现的说明

4.13 管理人对宏观经济的专项说明

4.14 管理人对报告期内基金估值政策的说明

4.15 管理人对报告期内基金摊薄式估值的说明

4.16 管理人对报告期内基金投资组合的分析

4.17 管理人对报告期内基金业绩表现的说明

4.18 管理人对宏观经济的专项说明

4.19 管理人对报告期内基金估值政策的说明

4.20 管理人对报告期内基金摊薄式估值的说明

4.21 管理人对报告期内基金投资组合的分析

4.22 管理人对报告期内基金业绩表现的说明

4.23 管理人对宏观经济的专项说明

4.24 管理人对报告期内基金估值政策的说明

4.25 管理人对报告期内基金摊薄式估值的说明

4.26 管理人对报告期内基金投资组合的分析

4.27 管理人对报告期内基金业绩表现的说明

4.28 管理人对宏观经济的专项说明

4.29 管理人对报告期内基金估值政策的说明

4.30 管理人对报告期内基金摊薄式估值的说明

4.31 管理人对报告期内基金投资组合的分析

4.32 管理人对报告期内基金业绩表现的说明

4.33 管理人对宏观经济的专项说明

4.34 管理人对报告期内基金估值政策的说明

4.35 管理人对报告期内基金摊薄式估值的说明

4.36 管理人对报告期内基金投资组合的分析

4.37 管理人对报告期内基金业绩表现的说明

4.38 管理人对宏观经济的专项说明

4.39 管理人对报告期内基金估值政策的说明

4.40 管理人对报告期内基金摊薄式估值的说明

4.41 管理人对报告期内基金投资组合的分析

4.42 管理人对报告期内基金业绩表现的说明

4.43 管理人对宏观经济的专项说明

4.44 管理人对报告期内基金估值政策的说明

4.45 管理人对报告期内基金摊薄式估值的说明

4.46 管理人对报告期内基金投资组合的分析

4.47 管理人对报告期内基金业绩表现的说明

4.48 管理人对宏观经济的专项说明

4.49 管理人对报告期内基金估值政策的说明

4.50 管理人对报告期内基金摊薄式估值的说明

4.51 管理人对报告期内基金投资组合的分析

4.52 管理人对报告期内基金业绩表现的说明

4.53 管理人对宏观经济的专项说明

4.54 管理人对报告期内基金估值政策的说明

4.55 管理人对报告期内基金摊薄式估值的说明

4.56 管理人对报告期内基金投资组合的分析

4.57 管理人对报告期内基金业绩表现的说明

4.58 管理人对宏观经济的专项说明

4.59 管理人对报告期内基金估值政策的说明

4.60 管理人对报告期内基金摊薄式估值的说明

4.61 管理人对报告期内基金投资组合的分析

4.62 管理人对报告期内基金业绩表现的说明

4.63 管理人对宏观经济的专项说明

4.64 管理人对报告期内基金估值政策的说明

4.65 管理人对报告期内基金摊薄式估值的说明

4.66 管理人对报告期内基金投资组合的分析

4.67 管理人对报告期内基金业绩表现的说明

4.68 管理人对宏观经济的专项说明

4.69 管理人对报告期内基金估值政策的说明

4.70 管理人对报告期内基金摊薄式估值的说明

4.71 管理人对报告期内基金投资组合的分析

4.72 管理人对报告期内基金业绩表现的说明

4.73 管理人对宏观经济的专项说明

4.74 管理人对报告期内基金估值政策的说明

4.75 管理人对报告期内基金摊薄式估值的说明

4.76 管理人对报告期内基金投资组合的分析

4.77 管理人对报告期内基金业绩表现的说明

4.78 管理人对宏观经济的专项说明

4.79 管理人对报告期内基金估值政策的说明

4.80 管理人对报告期内基金摊薄式估值的说明

4.81 管理人对报告期内基金投资组合的分析

4.82 管理人对报告期内基金业绩表现的说明

4.83 管理人对宏观经济的专项说明

4.84 管理人对报告期内基金估值政策的说明

4.85 管理人对报告期内基金摊薄式估值的说明

4.86 管理人对报告期内基金投资组合的分析

4.87 管理人对报告期内基金业绩表现的说明

4.88 管理人对宏观经济的专项说明

4.89 管理人对报告期内基金估值政策的说明

4.90 管理人对报告期内基金摊薄式估值的说明