

## 金鹰量化精选股票型证券投资基金(LOF)

## [2016]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:二〇一七年一月二十日

## § 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。

基金管理人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年1月19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。

报告期自2016年10月1日起至2016年12月31日止。

## § 2 基金产品概况

| 基金简称      | 金鹰量化精选股票型(LOF)  |
|-----------|---|
| 场内简称      |   |
| 基金主代码     | 162107  |
| 交易代码      | 162107  |
| 基金运作方式    | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日   | 2010年6月24日  |
| 报告期基金份额总额 | 106,340,000份  |
| 投资目标      | 本基金主要采用多因子模型进行选股的选择，基于模型框架，基金管理人结合市场环境和股票特征，构建股票组合，力求实现超越市场的收益。本基金将通过量化分析，从基本面、技术面、估值面等多方面对股票进行深入研究，精选个股进行投资，努力为有效控制风险的基础上，实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略      | 本基金主要采用多因子模型进行选股的选择，基于模型框架，基金管理人结合市场环境和股票特征，构建股票组合，力求实现超越市场的收益。本基金将通过量化分析，从基本面、技术面、估值面等多方面对股票进行深入研究，精选个股进行投资，努力为有效控制风险的基础上，实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 业绩比较基准    | 沪深300指数收益率×60%+中证全债指数收益率×20%  |
| 风险收益特征    | 本基金属于股票型基金，风险收益水平高于混合型基金、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     | 交通银行股份有限公司  |

注:根据《关于准予金鹰中证500指数分级证券投资基金变更注册的批复》(证监许可[2016]984号)文件，以开放方式召开本基金的基金份额持有人大会，根据持有人大会决议公告，自基金中证500指数分级证券投资基金基金份额转换基准日的次日起，即2016年8月26日起，《金鹰量化精选股票型证券投资基金(LOF)基金合同》生效，《金鹰中证500指数分级证券投资基金合同》同时失效。

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

| 单位:人民币元 | 主要财务指标       | 报告期           | 报告期        | 报告期           | 报告期          |               |
|---------|--------------|---------------|------------|---------------|--------------|---------------|
|         | 本期期初可供分配利润   | 1,002,394.60  | 本期可供分配利润   | 1,002,394.60  | 本期期末可供分配利润   | 1,002,394.60  |
|         | 本期期初应收股利     | 569,901.44    | 本期应收股利     | 569,901.44    | 本期期末应收股利     | 569,901.44    |
|         | 本期期初可供分配利润总额 | 17,237,390.11 | 本期可供分配利润总额 | 17,237,390.11 | 本期期末可供分配利润总额 | 17,237,390.11 |
|         | 本期期末可供分配利润总额 | 17,237,390.11 |            |               |              |               |

## 3.1 主要财务指标

| 阶段    | 净利润(单位:人民币元) | 净资产收益率(%) | 净利润(单位:人民币元) | 净资产收益率(%) | ①-③  | ②-④   |
|-------|--------------|-----------|--------------|-----------|------|-------|
| 过去三个月 | 260%         | 10%       | 100%         | 0.05%     | 164% | 0.43% |
| 过去一年  | 320%         | 10%       | 100%         | 0.05%     | 316% | 0.43% |
| 过去三年  | 200%         | 10%       | 100%         | 0.05%     | 200% | 0.43% |

## 3.2 基金净值表现

## 3.2.1 本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

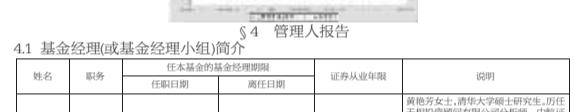
| 阶段     | 净利润增长(%) | 净资产收益率(%) | 净利润增长(%) | 净资产收益率(%) | ①-③  | ②-④   |
|--------|----------|-----------|----------|-----------|------|-------|
| 过去三个季度 | 260%     | 10%       | 100%     | 0.05%     | 164% | 0.43% |
| 过去一年   | 320%     | 10%       | 100%     | 0.05%     | 316% | 0.43% |
| 过去三年   | 200%     | 10%       | 100%     | 0.05%     | 200% | 0.43% |
| 成立以来   | 90%      | 10%       | 100%     | 0.05%     | 90%  | 0.43% |

## 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



## 3.3 金鹰量化精选股票型证券投资基金(LOF)的净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016年8月25日至2016年12月31日)



## 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时间 | 证券从业年限 | 说明  |
|-----|------|-------------|--------|---|
| 黄艳芳 | 基金经理 | 2016-08-26  | 10     | 黄艳芳女士，清华大学硕士研究生，曾任天大智投资产管理有限公司分析师，中证指数有限公司研究员，基金经理，现任金鹰基金管理有限公司基金经理。黄艳芳女士具有丰富的金融行业经验，现任职于金鹰基金管理有限公司量化投资部基金经理，主要负责量化投资工作。黄艳芳女士具有良好的职业操守，具备较强的沟通协调能力和良好的团队合作精神，能够独立完成基金经理的各项工作。 |

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颁布的《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遵守法律法规情况的说明

4.3 本报告期内，本公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方案方面享有平等的机会。

4.4 公司通过规范的交易流程、完善的风险控制机制、有效的交易控制制度、确保公平交易的实施。同时通过对交易系统中的公平交易功能执行交易，不断强化事后监控分析，以尽可能地公平公开原则对各投资组合。

4.5 报告期内，公司对连续四个季度期间内，不同时间窗下(日、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合向交易所的交易名义价进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.6 公平交易制度的执行情况

4.7 公平交易制度的执行情况

4.8 公平交易制度的执行情况

4.9 公平交易制度的执行情况

4.10 公平交易制度的执行情况

4.11 公平交易制度的执行情况

4.12 公平交易制度的执行情况

4.13 公平交易制度的执行情况

4.14 公平交易制度的执行情况

4.15 公平交易制度的执行情况

4.16 公平交易制度的执行情况

4.17 公平交易制度的执行情况

4.18 公平交易制度的执行情况

4.19 公平交易制度的执行情况

4.20 公平交易制度的执行情况

4.21 公平交易制度的执行情况

4.22 公平交易制度的执行情况

4.23 公平交易制度的执行情况

4.24 公平交易制度的执行情况

4.25 公平交易制度的执行情况

4.26 公平交易制度的执行情况

4.27 公平交易制度的执行情况

4.28 公平交易制度的执行情况

4.29 公平交易制度的执行情况

4.30 公平交易制度的执行情况

4.31 公平交易制度的执行情况

4.32 公平交易制度的执行情况

4.33 公平交易制度的执行情况

4.34 公平交易制度的执行情况

4.35 公平交易制度的执行情况

4.36 公平交易制度的执行情况

4.37 公平交易制度的执行情况

4.38 公平交易制度的执行情况

4.39 公平交易制度的执行情况

4.40 公平交易制度的执行情况

4.41 公平交易制度的执行情况

4.42 公平交易制度的执行情况

4.43 公平交易制度的执行情况

4.44 公平交易制度的执行情况

4.45 公平交易制度的执行情况

4.46 公平交易制度的执行情况

4.47 公平交易制度的执行情况

4.48 公平交易制度的执行情况

4.49 公平交易制度的执行情况

4.50 公平交易制度的执行情况

4.51 公平交易制度的执行情况

4.52 公平交易制度的执行情况

4.53 公平交易制度的执行情况

4.54 公平交易制度的执行情况

4.55 公平交易制度的执行情况

4.56 公平交易制度的执行情况

4.57 公平交易制度的执行情况

4.58 公平交易制度的执行情况

4.59 公平交易制度的执行情况

4.60 公平交易制度的执行情况

4.61 公平交易制度的执行情况

4.62 公平交易制度的执行情况

4.63 公平交易制度的执行情况

4.64 公平交易制度的执行情况

4.65 公平交易制度的执行情况

4.66 公平交易制度的执行情况

4.67 公平交易制度的执行情况

4.68 公平交易制度的执行情况

4.69 公平交易制度的执行情况

4.70 公平交易制度的执行情况

4.71 公平交易制度的执行情况

4.72 公平交易制度的执行情况

4.73 公平交易制度的执行情况

4.74 公平交易制度的执行情况

4.75 公平交易制度的执行情况

4.76 公平交易制度的执行情况

4.77 公平交易制度的执行情况

4.78 公平交易制度的执行情况

4.79 公平交易制度的执行情况

4.80 公平交易制度的执行情况

4.81 公平交易制度的执行情况

4.82 公平交易制度的执行情况

4.83 公平交易制度的执行情况