金鹰科技创新股票型证券投资基金

2017年第三季度报告

2017年9月30日
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：二〇一七年十月二十五日

§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2017年10月24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2017年7月1日起至9月30日止。

§2基金产品概况

基金简称	金鹰科技创新股票
基金主代码	001167
交易代码	001167
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月30日
报告期末基金份额总额	1,067,342,751.38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，重点投资于以科技和创新为动力和支撑，具有核心科技或创新优势的优质上市公司，把握相关领域科技发展与创新所带来的投资机会，力争获得超额收益与长期资本增值。
投资策略	本基金将结合对包括宏观经济形势、政策走势、证券市场环境等在内的因素的分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置策略，合理确定基金在股票、债券等各类资产上的投资比例，最大限度地降低投资组合的风险，提高收益。 通过"自上而下"及"自下而上"相结合的方法挖掘优质的上市公司，构建股票投资组合：(1)自上而下地分析行业的增长潜在空间、竞争结构、增长节奏，潜在风险等方面，把握投资机会；(2)自下而上地评判企业的核心科技和创新优势、管理层、治理结构以及其提供的产品和服务是否契合科技创新的大趋势，对企业基本面和估值水平进行综合的研判，深度挖掘优质个股。并秉承稳健优先的原则，在保证投资板风险的基础上谨慎投资债券市场，力图获得良好的收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%
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预期收益、较高预期风险的品种，其预期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	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(2017年7月1日-2017年9月30日)
1.本期已实现收益	54,430,333.14
2.本期利润	57,754,460.23
3.加权平均基金份额本期利润	0.0528
4.期末基金资产净值	754,094,557.49
5.期末基金份额净值	0.707

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。

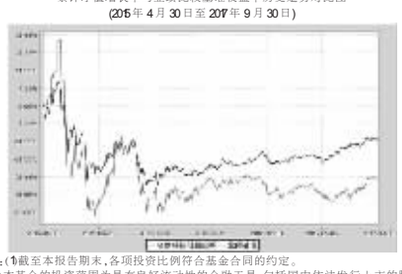
3.2基金净值表现

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	8.10%	1.09%	3.82%	0.47%	4.28%	0.62%

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

金鹰科技创新股票型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年4月30日至2017年9月30日)



注：(1)截至本报告期末，各项投资比例符合基金合同的约定。

(2)本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板以及其他经中国证监会核准上市的股票)，债券、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券、银行存款及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)；

(3)业绩比较基准：沪深300指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%

§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		
方超	基金经理	2015-04-30	-	8	方超先生，中山大学工商管理硕士，曾任职于朗讯科技有限公司、北方电讯科技有限公司。2009年5月加入金鹰基金管理有限公司，先后任TMT研究员、非周期组组长、金鹰中小盘精选证券投资基金基金经理助理、专户投资部投资经理，现任金鹰策略配置混合型证券投资基金、金鹰科技创新股票型基金基金经理。
黄艳芳	基金经理	2017-09-19	-	10	黄艳芳女士，清华大学硕士研究生。历任天相投资顾问有限公司分析师，中航证券资产管理分公司投资主办，量化投资负责人，广州证券股份有限公司资产管理部投资主办。2015年5月加入金鹰基金管理有限公司，任指数及量化投资部数量策略研究员，现任金鹰量化精选股票型证券投资基金(LOF)、金鹰持久增利债券型证券投资基金(LOF)、金鹰多元策略灵活配置混合型证券投资基金、金鹰鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金、金鹰鑫益灵活配置混合型证券投资基金、金鹰添裕纯债债券型证券投资基金、金鹰添盈纯债债券型证券投资基金、金鹰添润纯债债券型证券投资基金、金鹰科技创新股票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，本基金基金合同等法律文件的规定，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

报告期内，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面享有公平的机会。

公司通过规范的投资交易流程、完善的权限管理机制、有效的交易控制制度，确保公平交易的实施。同时通过投资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，以尽可能确保公平对待各投资组合。

报告期，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下(日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

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

三季度市场赚钱效应显著增强，各大指数均实现正收益，周期板块和新能源汽车板块表现抢眼。报告期内，本基金减持了定制家居和新能源汽车个股兑现了收益，增持了部分金融和蓝筹股。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截止2017年9月30日，基金份额净值为0.707元，本报告期份额净值增长率为8.10%，同期业绩比较基准增长率为3.82%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度，经济稳中有降、没有失速风险，供给侧改革进一步推进有望使PPI和核心CPI继续维持在良性发展水平，我们将着眼于2018年的机会进行操作，看好LED产业链、OLED产业链、5G产业链和汽车电子，以及受益于经济良性发展的金融板块。

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	613,051,556.90	80.91
	其中：股票	613,051,556.90	80.91
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	112,619,112.60	14.86
7	其他各项资产	32,053,330.70	4.23
8	合计	757,724,000.20	100.00

注：其他资产包括：交易保证金、应收利息、应收证券清算款、其他应收款、应收申购款。

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	39,793.60	0.01
C	制造业	376,285,243.39	49.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	54,076,611.71	7.17
F	批发和零售业	26,385.45	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,125,184.99	5.19
J	金融业	128,390,419.00	17.03
K	房地产业	14,895,258.00	1.98
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	115,299.99	0.02
R	文化、体育和娱乐业	71,788.86	0.01
S	综合	-	-
	合计	613,051,556.90	81.30

5.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

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	600183	生益科技	3,288,776	50,416,936.08	6.69
2	601288	农业银行	12,307,950	47,016,369.00	6.23
3	600837	海通证券	2,978,000	44,014,840.00	5.84
4	601668	中国建筑	4,741,100	43,997,408.00	5.83
5	300415	伊之密	2,825,609	39,388,989.46	5.22
6	600036	招商银行	1,462,200	37,359,210.00	4.95
7	002206	海利得	5,331,837	36,363,128.34	4.82
8	600176	中国巨石	2,831,786	32,452,267.56	4.30
9	600718	东软集团	1,804,296	30,781,289.76	4.08
10	601600	中国铝业	3,998,200	30,266,374.00	4.01

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

本基金报告期末未持有股指期货。

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。

5.10.3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未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	294,374.85
2	应收证券清算款	31,708,815.50
3	应收股利	-
4	应收利息	25,468.98
5	应收申购款	24,671.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,053,330.70

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	601600	中国铝业	30,266,374.00	4.01	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	1,120,970,152.68
报告期基金总申购份额	13,494,373.72
减：报告期基金总赎回份额	67,121,775.02
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,067,342,751.38

§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

无

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

8.1影响投资者决策的其他重要信息

1.本报告期内，经公司股东会审议通过，聘请刘岩先生担任公司法定代表人职务，并同时免去凌富华先生公司法定代表人职务，该事项已于2017年7月15日在证监会指定媒体披露；

2.本报告期内，经公司股东会审议通过，公司注册地址由"广东省珠海市香洲区吉大九洲大道东段商业银行大厦7/6单元"变更为"广东省珠海市香洲区水湾路246号3栋2单元3D房"。该事项已于2017年7月20日在证监会指定媒体披露。

§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科技创新股票型证券投资基金发行及募集的文件。

2.《金鹰科技创新股票型证券投资基金基金合同》。

3.《金鹰科技创新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、半年度报告、更新的招募说明书及其他临时公告。

9.2存放地点

广东省广州市天河区珠江东路28号越秀金融大厦30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
二〇一七年十月二十五日

金鹰技术领先灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

2017年9月30日
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：二〇一七年十月二十五日

§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2017年10月24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2017年7月1日起至9月30日止。

§2基金产品概况

基金简称	金鹰技术领先灵活配置混合
基金主代码	210007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年7月9日
报告期末基金份额总额	43,587,426.57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，投资于技术领先相关主题的上市公司，通过对股票、固定收益和现金类等资产的积极配置，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	本基金将从宏观经济、宏观政策、证券市场和行业因素等维度进行综合分析，主动判断市场时机，在严格控制投资组合风险的前提下，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票类资产、固定收益类资产、现金类资产等各类资产类别上的投资比例，最大限度的提高收益。本基金投资组合中股票资产占基金资产的比例为0-95%，投资于技术领先相关主题证券比例不低于非现金资产的80%。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准：沪深300指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。
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	中国银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	金鹰技术领先混合A / 金鹰技术领先混合C
下属分级基金的交易代码	210007 / 002196
报告期末下属分级基金的份额总额	24,785,256.61份 / 18,802,169.96份

§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(2017年7月1日-2017年9月30日)	
	金鹰技术领先混合A	金鹰技术领先混合C
1.本期已实现收益	801,710.70	283,496.82
2.本期利润	-59,140.86	-735,788.89
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0032	-0.1245
4.期末基金资产净值	26,642,505.49	20,433,475.46
5.期末基金份额净值	1.075	1.087

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.期末可供分配利润，指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额，不是当期发生数)。

4.上述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

1.金鹰技术领先混合A：

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	1.70%	1.87%	2.60%	0.29%	-0.90%	1.58%

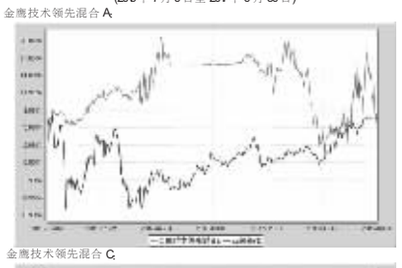
2.金鹰技术领先混合C：

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	2.55%	1.87%	2.60%	0.29%	-0.05%	1.58%

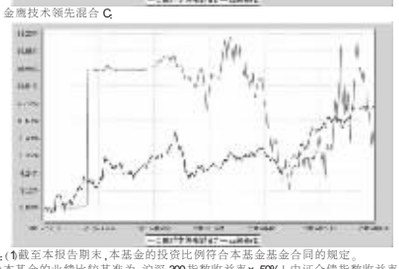
3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

金鹰技术领先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的历史走势对比图
(2015年7月9日至2017年9月30日)

1.金鹰技术领先混合A：



2.金鹰技术领先混合C：



注：(1)本基金合同生效日为2012年12月7日。

(2)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，即投资于定期存款的比例不超过基金资产净值的30%，持有全部资产支持证券，市值不超过基金资产净值的20%，债券正回购的资金余额在每个交易日不超过基金资产净值的20%，以及中国证监会规定的其他比例限制。

(3)本基金的业绩比较基准为：一年期定期存款利率(税后)

§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		
王喆	权益投资部总监、基金经理	2015-08-13	-	18	王喆先生，工商管理硕士。历任汇阳商品交易所分析员、宏源研究发展中心高级行业研究员、宏源证券资产管理部高级投资经理，2010年加入广州证券，担任投资管理部助理投资总监，广州证券红棉1号投资主办等职，2014年11月加入金鹰基金管理有限公司，现任权益投资部总监、金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金、金鹰成份股优选证券投资基金、金鹰技术领先灵活配置混合型证券投资基金、金鹰民族新兴混合型证券投资基金及金鹰改革红利混合型证券投资基金基金经理。
吴德璇	基金经理	2016-12-27	-	5	吴德璇先生，曾任广州证券股份有限公司研究员。2015年1月加入金鹰基金管理有限公司，任研究部研究员、基金经理助理、基金经理职务。现任金鹰技术领先灵活配置混合型证券投资基金、金鹰元素混合型证券投资基金、金鹰元丰保本混合型证券投资基金、金鹰元祺保本混合型证券投资基金、金鹰和中长期信用债债券型证券投资基金、金鹰添享纯债债券型证券投资基金、金鹰现金增益交易型货币市场基金、金鹰添荣纯债债券型证券投资基金、金鹰添惠纯债债券型证券投资基金、金鹰民丰回报定期开放混合型证券投资基金基金经理。
刘丽娟	固定收益部总监、基金经理	2015-07-22	-	10	刘丽娟女士，中南财经政法大学工商管理硕士，历任汇阳商品交易所分析员、宏源研究发展中心高级行业研究员、宏源证券资产管理部高级投资经理，2010年加入广州证券，担任投资管理部助理投资总监，广州证券红棉1号投资主办等职，2014年11月加入金鹰基金管理有限公司，任固定收益部总监。现任金鹰货币市场证券投资基金、金鹰添益纯债债券型证券投资基金、金鹰灵活配置混合型证券投资基金、金鹰元素混合型证券投资基金、金鹰元丰保本混合型证券投资基金、金鹰元祺保本混合型证券投资基金、金鹰和中长期信用债债券型证券投资基金、金鹰添享纯债债券型证券投资基金、金鹰现金增益交易型货币市场基金、金鹰添荣纯债债券型证券投资基金、金鹰添惠纯债债券型证券投资基金、金鹰民丰回报定期开放混合型证券投资基金基金经理。
龙悦芳	基金经理	2017-09-08	-	7	龙悦芳女士，曾任平安证券股份有限公司投资助理、交易员、投资经理等职务。2017年5月加入金鹰基金管理有限公司，现任金鹰货币市场证券投资基金、金鹰添瑞中短债债券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颁布的《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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、本基金基金合同等法律文件的规定，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，基金运作基本合法合规，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

报告期内，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面享有公平的机会。

公司通过规范的投资交易流程、完善的权限管理机制、有效的交易控制制度，确保公平交易的实施。同时通过投资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，以尽可能确保公平对待各投资组合。

报告期，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下(日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

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

2017年三季度，经济基本面方面，宏观经济稳中放缓。8月工业增加值同比增速滑落至6%，一方面是环保限产的影响，另一方面受基数的影响。但从环比数据来看，并未出现明显回落。财政约束下，基建投资放缓延续；房地产新开工增速已经跟随销售回落，投资增速从累计同比来看，回落还不明显，但单月同比增速显示，已经开始调头向下。地产下行压力逐步显现。三季度出口数据显示，出口已经处于平缓回落的过程中。总体来看，在经历了上半年反弹后，平稳放缓的迹象初步显现。通胀在食品CPI触底回升的带动下，也逐步掉头，不过年内暂无通胀压力。

监管政策方面，协调性增强，同业存单监管规则和公募基金流动性新规陆续落地，严监管进入下半程。货币政策依旧维持中性，在社融需求旺盛，银行负债不足，超储率偏低的背景下，银行间资金面的阶段性偏紧成常态。

受流动性制约，债券收益率整体横盘调整，利率曲线进一步平坦化甚至倒挂，信用利差依旧处于历史低位。货币基金在三季度保持充足的流动性，在资金阶段性紧张时期，融出资金。在季末加大对高利率同业存款和存单的配置，在保持组合流动性和安全性的提前下，取得了一定超额收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2017年9月30日，基金A类份额本报告期份额净值收益率为1.0350%，同期业绩比较基准收益率为0.3781%；B类份额本报告期份额净值收益率为1.0569%，同期业绩比较基准收益率为0.3781%。

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2017年四季度，考虑到本轮库存周期基本结束，基建后继乏力，地产投资仍存下行压力下，消费和出口也将放缓，总需求缓步下行趋势相对确定。但这并不意味着，宏观经济会再度失速，过剩产能的出清和房地产库存去化，以及海外需求的复苏，使得国内经济，有底气有空间保持在当前平台区间，经济或在较长时间上下有度。通胀四季度依旧缓和，但需关注预期的变化，PPI将见顶回落。而在去杠杆的大背景下，货币政策暂时不存在转向的基础，依然维持中性适度，但对流动性以及经济结构性引导有望进一步提升。

基于以上判断，我们认为四季度在经济持续下滑，货币政策转向明确前，债券市场仍将保持震荡走势，资金面阶段性紧张仍是常态，短端收益率仍将维持高位。为此，我们整体策略偏谨慎，继续采取稳健操作。在确保组合良好流动性和安全性的前提下，力争有效控制并防范风险，并根据投资者结构变化，结合货币市场流动性情况，适时调整组合各类资产比例和久期，竭力为持有人服务。

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	固定收益投资	6,615,316,639.20	36.42
	其中：债券	6,615,316,639.20	36.42
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	6,222,622,014.40	34.26
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	5,271,694,439.57	29.03
4	其他资产	52,248,399.37	0.29
5	合计	18,161,881,492.54	100.00

注：其他资产包括：交易保证金、应收利息、应收证券清算款、其他应收款、应收申购款等。

5.2报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	2.60
	其中：买断式回购融资	0.01

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	1,166,097,290.85	6.87
	其中：买断式回购融资	-	-

注：上表中报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金本报告期债券正回购的资金余额均未超过基金资产净值的20%。

5.3基金投资组合平均剩余期限

5.3.1投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	94
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	95
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	34

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	5,297,991.00	11.25
C	制造业	27,170,866.96	57.72
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	1,331,148.00	2.83
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	4,570,596.70	9.71
J	金融业	5,391,870.00	11.45
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	43,762,472.66	92.96

5.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未通过港股通投资股票。

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	600961	株冶集团	283,902	2,833,341.96	6.02
2	000807	云铝股份	161,300	2,237,231.00	4.75
3	600050	中国联通	281,700	2,090,214.00	4.44
4	300473	德尔股份	42,000	2,087,400.00	4.43
5	600595	中孚实业	269,000	1,845,340.00	3.92
6	600549	厦门钨业	53,000	1,702,890.00	3.62
7	000688	建新矿业	151,400	1,657,830.00	3.52
8	600111	北方稀土	92,900	1,498,477.00	3.18
9	300059	东方财富	103,000	1,424,490.00	3.03
10	600392	盛和资源	67,300	1,387,053.00	2.95

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投资。

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

本基金本报告期末无权证投资。

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股指期货。

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	15,006.19
2	应收证券清算款	1,121,735.07
3	应收股利	-
4	应收利息	104.67
5	应收申购款	1,637,425.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,774,271.75

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末无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	000688	建新矿业	1,657,830.00	3.52	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

项目	金鹰技术领先混合A	金鹰技术领先混合C
本报告期期初基金份额总额	15,736,413.04	1,203,729.83
报告期基金总申购份额	17,624,086.53	35,204,835.87
减：报告期基金总赎回份额	8,575,242.96	17,606,395.74
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	24,785,256.61	18,802,169.96

§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

无

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

8.1影响投资者决策的其他重要信息

1.本报告期内，经公司股东会审议通过，聘请刘岩先生担任公司法定代表人职务，并同时免去凌富华先生公司法定代表人职务，该事项已于2017年7月15日在证监会指定媒体披露；

2.本报告期内，经公司股东会审议通过，公司注册地址由"广东省珠海市香洲区吉大九洲大道东段商业银行大厦7/6单元"变更为"广东省珠海市香洲区水湾路246号3栋2单元3D房"。该事项已于2