金鹰元丰债券型证券投资基金

(金鹰元丰保本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

2.1 金鹰元丰债券型证券投资基金

基金简称	金鹰元丰债券
基金主代码	210014
交易代码	210014
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年 9 月 20 日
报告期末基金份额总额	187,917,516.98 份
投资目标	通过对宏观经济、资本市场运行趋势的前瞻性研判,预测未来利率水平及其变化趋势,力求准确把握固定收益类、权益类资产的投资机会,在严格控制投资风险的前提下,力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将综合考虑国内外政治经济环境、政策形势、宏观经济与资本市场运行状况,固定收益类与权益类资产风险收益特征,定性分析与定量分析并用,灵活确定大类资产配置比例,并将在实际运作中根据证券市场走势以及本基金业绩表现不断对大类资产配置比例进行调整,以期优化大类资产配置,力争获取超额投资收益。
业绩比较基准	中国债券综合指数(全价)× 90%+ 沪深 300 指数× 10%。
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金当中风险较低的品种,其长期平均风险与预期收益率低于股票型基金、混合型基金,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

2.2 金鹰元丰保本混合型证券投资基金

基金简称	金鹰元丰保本混合
基金主代码	210014
交易代码	210014
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年 1 月 30 日
报告期末基金份额总额	210,027,195.67 份
投资目标	本基金运用投资组合保险策略,在严格控制投资风险、保证本金安全的基础上,力争在保本周期结束时,实现基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金在投资组合管理过程中采取主动投资方法,通过数量化方法严格控制风险,以保障基金资产本金的安全,并通过有效的资产配置策略,获得基金资产的稳健增值。
业绩比较基准	2年期银行定期存款利率(税后)。
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。
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
基金保证人	深圳市高新投集团有限公司

§ 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 9 月 20 日 - 2017 年 9 月 30 日)	报告期(2017 年 7 月 1 日 - 2017 年 9 月 19 日)
1.本期已实现收益	- 1,353,141.85	- 5,247,855.53
2.本期利润	- 295,097.25	6,625,731.87
3.加权平均基金份额本期利润	- 0.0016	0.0102
4.期末基金资产净值	195,464,763.18	218,798,144.83
5.期末基金份额净值	1.0402	1.0418

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 金鹰元丰债券型证券投资基金

(报告期:2017 年 9 月 20 日 - 2017 年 9 月 30 日)

3.2.1.1 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	- 0.17%	0.05%	0.09%	0.02%	- 0.26%	0.03%

注:

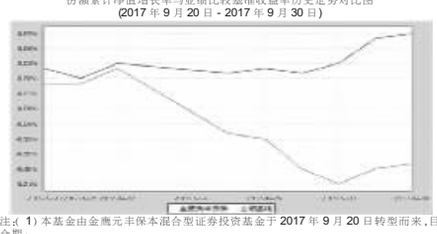
1、金鹰元丰保本混合型证券投资基金的保本存续期截止日为 2017 年 9 月 19 日,2017 年 9 月 20 日起转型为金鹰元丰债券型证券投资基金;

2、转型前,"过去三个月"计算期间为三季度起始日 2017 年 7 月 1 日至转型前基金存续期截止日 2017 年 9 月 19 日;

3、转型后,"过去三个月"计算期间为转型后基金存续期起始日 2017 年 9 月 20 日至三季度结束日 2017 年 9 月 30 日。

3.2.1.2 自基金转型以来基金份额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

金鹰元丰债券型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2017 年 9 月 20 日 - 2017 年 9 月 30 日)



注:(1)本基金由金鹰元丰保本混合型证券投资基金于 2017 年 9 月 20 日转型而来,目前仍在建仓期;

(2)本基金的业绩比较基准是:中国债券综合指数(全价)*90%+ 沪深 300 指数 *10%。

3.2.2 金鹰元丰保本混合型证券投资基金

(报告期:2017 年 7 月 1 日 - 2017 年 9 月 19 日)

3.2.2.1 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	0.87%	0.05%	0.47%	0.00%	0.40%	0.05%

注:

1.金鹰元丰保本混合型证券投资基金的保本存续期截止日为 2017 年 9 月 19 日,2017 年 9 月 20 日起转型为金鹰元丰债券型证券投资基金;

2.转型前,"过去三个月"计算期间为三季度起始日 2017 年 7 月 1 日至转型前基金存续期截止日 2017 年 9 月 19 日;

3.转型后,"过去三个月"计算期间为转型后基金存续期起始日 2017 年 9 月 20 日至三季度结束日 2017 年 9 月 30 日。

3.2.2.2 自基金转型以来基金份额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

金鹰元丰保本混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2017 年 7 月 1 日 - 2017 年 9 月 19 日)

§ 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		
刘丽娟	固定收益部总监,基金经理。	2017- 06- 06	-	10	刘丽娟女士,中南财经政法大学工商管理硕士,历任恒泰证券股份有限公司交易员,投资经理,广州证券股份有限公司资产管理总部固定收益投资总监。2014 年 12 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、金鹰元安混合型证券投资基金、金鹰元丰保本混合型证券投资基金、金鹰元棋保本混合型证券投资基金、金鹰元和保本混合型证券投资基金、金鹰添利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、金鹰添益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、金鹰现金增益交易型货币市场基金、金鹰添享纯债债券型证券投资基金、金鹰添荣纯债债券型证券投资基金、金鹰添恩纯债债券型证券投资基金、金鹰添瑞纯债债券型证券投资基金、金鹰元丰回报定期开放混合型证券投资基金基金经理。
汪伟	基金经理	2017- 09- 21	-	4	汪伟先生,2013 年 7 月至 2014 年 9 月曾任广州证券股份有限公司交易员、投资经理等职务,2014 年 9 月至 2016 年 2 月曾任金鹰基金管理有限公司交易主管,2016 年 3 月至 2017 年 7 月曾任广东南粤银行股份有限公司交易员、宏观分析师等职务,2017 年 7 月加入金鹰基金管理有限公司,现任金鹰元安混合型证券投资基金、金鹰元丰债券型证券投资基金、金鹰元丰债券型证券投资基金基金经理。
吴德瑄	基金经理	2017- 09- 30	-	4	吴德瑄先生,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、金鹰元禧混合型证券投资基金、金鹰元丰债券型证券投资基金、金鹰元安混合型证券投资基金基金经理。

4.2 管理人对投资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细则、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

截至 2017 年 9 月 30 日,本基金(金鹰元丰债券),报告期内(2017 年 9 月 20 日 - 2017 年 9 月 30 日)份额净值为 1.0402 元,本报告期份额净值增长率为 - 0.17%,同期业绩比较基准增长率为 0.09%。

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,得做好经济较长时间上下有度的准备。通胀四季度依旧隐和,但需关注预期的变化,PPI 将见顶回落,货币政策暂时不存在转向的基础,但对流动性以及经济结构性引导有望进一步提升。我们认为四季度债券市场仍将保持震荡走势。

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 金鹰元丰债券型证券投资基金

(报告期:2017 年 9 月 20 日 - 2017 年 9 月 30 日)

5.1.1 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	284,587.59	0.12
	其中:股票	284,587.59	0.12
2	固定收益投资	210,056,532.10	88.76
	其中:债券	210,056,532.10	88.76
	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	5,000,000.00	2.11
	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	17,456,139.34	7.38
7	其他各项资产	3,859,733.98	1.63
8	合计	236,656,993.01	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。

5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.1.2.1 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	284,587.59	0.15
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	284,587.59	0.15

5.1.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期内未通过港股通投资股票。

5.1.3 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	603639	海利尔	1,206	61,216.56	0.03
2	300580	贝斯特	2,489	54,110.86	0.03
3	002840	华统股份	1,814	52,696.70	0.03
4	603628	清源股份	2,581	46,432.19	0.02
5	002838	道恩股份	1,021	39,921.10	0.02
6	300586	美联新材	1,006	30,210.18	0.02

注:本基金本报告期末仅持有 6 只股票。

5.1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	99,435,000.00	50.87
	其中:政策性金融债	99,435,000.00	50.87
4	企业债券	110,621,532.10	56.59
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	210,056,532.10	107.47

5.1.5 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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170205	17国开 05	500,000.00	49,560,000.00	25.35
2	170215	17国开 15	200,000.00	20,086,000.00	10.28
3	170206	17国开 06	200,000.00	19,820,000.00	10.14
4	136452	16南航 02	200,000.00	19,508,000.00	9.98
5	136582	16国联 02	200,000.00	19,432,000.00	9.94

5.1.6 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

本基金本报告期内未持有资产支持证券。

5.1.7 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。

5.1.8 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投资。

5.1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.1.9.1 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。

5.1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.1.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.1.10.2 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。

5.1.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.1.11 投资组合报告附注

5.1.11.1 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。

5.1.11.2 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。

5.1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	8,793.91
2	应收证券清算款	8,938.36
3	应收股利	-
4	应收利息	3,842,001.71
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,859,733.98

5.1.11.4 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。

5.1.11.5 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	300580	贝斯特	54,110.86	0.03	重大事项

5.1.11.6 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。

5.2 金鹰元丰保本混合型证券投资基金

(报告期:2017 年 7 月 1 日 - 2017 年 9 月 19 日)

5.2.1 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	287,322.14	0.07
	其中:股票	287,322.14	0.07
2	固定收益投资	149,564,586.20	37.41
	其中:债券	149,564,586.20	37.41
	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	149,535,050.66	37.40
7	其他各项资产	100,450,737.76	25.12
8	合计	399,837,696.76	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。

5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.1 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	287,322.14	0.13
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	287,322.14	0.13

5.2.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期内未通过港股通投资股票。

5.2.3 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	603639	海利尔	1,206	62,374.32	0.03
2	300580	贝斯特	2,489	54,110.86	0.03
3	603628	清源股份	2,581	52,136.20	0.02
4	002840	华统股份	1,814	51,191.08	0.02
5	002838	道恩股份	1,021	39,512.70	0.02
6	300586	美联新材	1,006	27,996.98	0.01

注:本基金本报告期末仅持有 6 只股票。

5.2.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	149,564,586.20	68.36
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	149,564,586.20	68.36

5.2.5 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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	112420	16潮宏 01	300,000.00	29,619,000.00	13.54
2	1480063	14酒经投债	300,000.00	25,071,000.00	11.46
3	136198	16上药 01	240,000.00	23,520,000.00	10.75
4	136452	16南航 02	200,000.00	19,528,000.00	8.93
5	136582	16国联 02	200,000.00	19,422,000.00	8.88

5.2.6 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

本基金本报告期内未持有资产支持证券。

5.2.7 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。

5.2.8 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投资。

5.2.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.2.9.1 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。

5.2.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.2.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.2.10.1 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。

5.2.10.2 本期国债期货投资评价

无。

5.2.11 投资组合报告附注

5.2.11.1 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。

5.2.11.2 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。

5.2.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	8,793.91
2	应收证券清算款	97,665,102.36
3	应收股利	-
4	应收利息	2,776,841.49
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	100,450,737.76

5.2.11.4 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。

5.2.11.5 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	300580	贝斯特	54,110.86	0.03	重大事项

5.2.11.6 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

6.1 金鹰元丰债券型证券投资基金

单位:份

基金合同生效日的基金份额总额	210,027,195.67
本报告期期初基金份额总额	210,027,195.67
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	22,109,678.69
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	187,917,516.98

6.2 金鹰元丰保本混合型证券投资基金

单位:份

基金合同生效日的基金份额总额	781,278,046.90
本报告期期初基金份额总额	688,194,480.05
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	497,181.78
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	478,664,466.16
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	210,027,195.67

§ 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 716 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、中国证监会批准基金发行及募集的文件。

2、《金鹰稳健成长混合型证券投资基金基金合同》。

3、《金鹰稳健成长混合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

金鹰稳健成长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	1,583,956,061.50 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(2017 年 7 月 1 日 - 2017 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	- 63,877,599.46
2.本期利润	72,902,648.86
3.加权平均基金份额本期利润	0.0436
4.期末基金资产净值	2,267,941,930.19
5.期末基金份额净值	1.432

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。

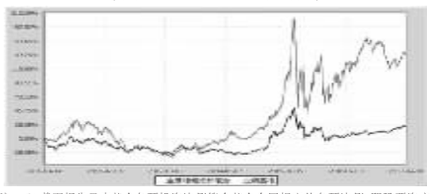
3.2 基金净值表现

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	3.39%	0.94%	3.62%	0.44%	- 0.23%	0.50%

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 2017 年 9 月 30 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%,权证投资的比例应围占基金资产净值的 0～3%;

(2)本基金的业绩比较基准是:中证全债指数收益率 *85%+ 沪深 300 指数收益率 *15%。

§ 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		
刘丽娟	固定收益部总监,基金经理	2016- 08- 19	-	10	刘丽娟女士,中南财经政法大学工商管理硕士,历任恒泰证券股份有限公司交易员,投资经理,广州证券股份有限公司资产管理总部固定收益投资总监。2014 年 12 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、金鹰元安混合型证券投资基金、金鹰元丰保本混合型证券投资基金、金鹰元棋保本混合型证券投资基金、金鹰元和保本混合型证券投资基金、金鹰添利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、金鹰添恩纯债债券型证券投资基金、金鹰添瑞纯债债券型证券投资基金、金鹰元禧混合型证券投资基金、金鹰元丰回报定期开放混合型证券投资基金基金经理。
倪超	基金经理	2017- 06- 27	-	8	倪超先生,厦门大学硕士研究生。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、金鹰元禧混合型证券投资基金、金鹰元棋保本混合型证券投资基金、金鹰元丰回报定期开放混合型证券投资基金基金经理。

4.2 管理人对投资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细则、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