金鹰中小盘精选证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016年3月31日

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：二〇一六年四月二十日

§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年4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。

本报告期自2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金鹰中小盘精选混合
基金主代码	162102
交易代码	162102
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年5月27日
报告期末基金份额总额	599,307,248.53份
投资目标	本基金投资具有较高成长性和良好基本面的中小盘股票，通过积极的投资组合管理，在控制风险的前提下谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采取主动的股票投资策略，在专业化研究的基础上，将系统的选股方法与积极的投资操作相结合，选择具有较高成长性、基本面良好的股票构建股票投资组合，把握投资机会，实现收益。债券投资策略：本基金采取稳健的混合管理投资策略，根据对利率、收益率走势的预测，考虑债券信用等级、期限、品种、流动性等因素，依据修正久期、凸性等指标，构建债券组合。
业绩比较基准	中证700指数收益率*75%+中证全债指数收益率*25%
风险收益特征	本基金属于风险水平适中，预期收益较高的证券投资基金品种。
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

§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(2016年1月1日-2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-122,515,053.87
2.本期利润	-162,115,927.53
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2189
4.期末基金资产净值	614,846,526.81
5.期末基金份额净值	1.0259

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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.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

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	-17.20%	2.11%	-13.52%	2.34%	-3.68%	-0.23%

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

金鹰中小盘精选证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2004年5月27日至2016年3月31日)

注：1.本基金合同于2004年5月27日正式生效；2.由于基金分红及被动频回等原因，截止报告日本基金的个别指标准未符合规定（如股票/总资产、现金/总资产、股票、债券/总资产），但基金管理人已于规定期限内调整完毕。3.本基金业绩比较基准为：中证700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		
于利强	研究部总监、基金经理	2015-01-15	-	7	于利强先生，曾于安永华明会计师事务所任职，历任华禾投资有限责任公司投资经理，银华基金管理有限公司研究员、基金经理助理等职，2015年1月加入金鹰基金管理有限公司，现任研究部总监及金鹰中小盘精选证券投资基金、金鹰元丰保本混合型证券投资基金、金鹰元安保本证券投资基金、金鹰产业整合灵活配置混合型证券投资基金、金鹰改革红利灵活配置混合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》及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

本报告期，本基金管理人按照《证券投资基金管理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。

本基金管理人事前规定了严格的股票备选库管理制度、投资权限管理制度、债券库管理制度和集中交易制度等；事中重视交易执行环节的公平交易措施，以时间优先、价格优先"作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统中的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合；事后加强对不同投资组合的交易价差、收益率的分析，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

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

回顾2016年1季度，尽管宏观经济仍低位徘徊，但那分先导指标出现改善迹象，在降息、降低首付比例和降低交易税费等一系列房地产去库存政策连续推出的背景下，房地产销售出现大幅回升，带动房地产投资结构性改善；在财政政策刺激下，基础设施建设开工出现回升，工程机械销售量和开工小时数同比明显改善；1季度原油价格大幅反弹，同时国内去产能政策推动，带动PPI同比降幅收窄，工业企业利润增速1年以来首次转正。年初由于熔断机制的影响，股票市场出现全面大幅下跌，随着熔断制度取消，经济复苏信号不断加强以及美联储加息推迟等正面因素影响，市场逐步反弹，一季度上证、深证、创业板和中小板分别下跌15.12%、17.45%、17.53%和18.22%。1季度本基金判断市场风险偏好大幅下降，流动性进一步宽松受限，市场处于存量博弈阶段，保持了中性偏低仓位，重点配置了养殖和周期品涨价行业。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2016年3月31日，基金份额净值为1.0259元，本报告期份额净值增长率为-17.20%，同期业绩比较基准收益率为-13.52%。

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2季度，对于经济复苏数据好转市场预期基本趋于一致，在存量博弈背景下，更需关注经济复苏力度能否超预期，我们将加强对基建投资、房地产销售和投资的草根调研跟踪。受食品价格影响，2季度CPI存在短期压力，但估计持续性不强，原油价格上涨以及PPI降幅收窄甚至转正将可能带来实质通胀压力，需要密切关注；此外二季度可能再次进入人民币值窗口期，由于经济复苏增速回升，此时主动贬值将有助于在对资本流出和股市负面作用较小的情况下，提前释放贬值压力，整体上市场风险偏好已经得到一定修复，但仍处于存量博弈阶段，本基金将维持中性仓位的谨慎投资策略，在吸气回升行业中寻找估值合理的投资标的，同时密切关注汇率、流动性环境变化。

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	315,558,635.60	30.86
	其中：股票	315,558,635.60	30.86
2	固定收益投资	206,404,000.00	20.18
	其中：债券	206,404,000.00	20.18
	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	447,062,001.90	43.72
7	其他各项资产	53,610,854.61	5.24
8	合计	1,022,635,492.11	100.00

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	67,001,805.80	10.90
B	采矿业	15,494,113.65	2.52
C	制造业	194,368,417.89	31.61
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	19,638,751.35	3.19
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	19,055,546.91	3.10
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	315,558,635.60	51.32

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	002394	联发股份	3,244,936	50,913,045.84	8.28
2	002714	牧原股份	617,655	37,460,775.75	6.09
3	600873	梅花生物	3,385,646	28,168,574.72	4.58
4	600419	天润乳业	763,844	25,695,712.16	4.18
5	002548	金新农	1,172,652	19,536,382.32	3.18
6	600511	国药股份	692,929	19,505,951.35	3.17
7	600322	天房发展	3,671,589	19,055,546.91	3.10
8	300498	温氏股份	323,800	16,659,510.00	2.71
9	000603	盛达矿业	806,565	15,494,113.65	2.52
10	002557	洽洽食品	845,611	15,381,664.09	2.50

5.4 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	16,314,000.00	2.65
2	央行票据	-	-
3	金融债券	190,090,000.00	30.92
	其中：政策性金融债	190,090,000.00	30.92
4	企业债券	-	-
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	-	-
9	其他	-	-
10	合计	206,404,000.00	33.57

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

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	150211	15国开11	500,000.00	50,040,000.00	8.14
2	150206	15国开06	500,000.00	50,015,000.00	8.13
3	150219	15国开19	500,000.00	50,015,000.00	8.13
4	150215	15国开15	400,000.00	40,020,000.00	6.51
5	010107	21国债(7)	150,000.00	16,314,000.00	2.65

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投资贵金属。

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

本基金本报告期末无股指期货的持仓。

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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货的持仓。

5.10.2 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	826,563.75
2	应收证券清算款	47,239,490.12
3	应收股利	-
4	应收利息	5,275,300.21
5	应收申购款	269,500.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	53,610,854.61

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处于转股期的可转换债券明细。

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	002714	牧原股份	37,460,775.75	6.09	重大事项停牌
2	600873	梅花生物	28,168,574.72	4.58	重大事项停牌
3	600511	国药股份	19,505,951.35	3.17	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

本报告期期初基金份额总额	587,870,670.42
报告期基金总申购份额	2,178,580,640.24
减：报告期基金总赎回份额	2,167,144,062.13
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	599,307,248.53

§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

本报告期，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

无

§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中小盘精选证券投资基金发行及募集的文件。

2.《金鹰中小盘精选证券投资基金基金合同》。

3.《金鹰中小盘精选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

二〇一六年四月二十日

金鹰主题优势混合型证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016年3月31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：二〇一六年四月二十日

§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4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。

本报告期自2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金鹰主题优势混合
基金主代码	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12月20日
报告期末基金份额总额	404,159,892.15份
投资目标	以追求资本可持续增值为目的，以深入的基本面分析为基础，把握主题投资的脉络，在充分控制风险的前提下，分享中国经济快速发展的成果以及企业经营绩效提升所带来的股权溢价，力争实现基金资产的长期可持续稳健增值。
投资策略	本基金坚持"自上而下"为主、"自下而上"为辅的投资视角，在实际投资过程中充分体现"主题优势"这个核心理念，以主题信息分析法把握经济发展不同阶段的主题投资节奏，优选并深挖不同阶段热点主题投资机会，优化资产配置，降低市场波动的冲击，扩大投资收益。
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(2016年1月1日-2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-58,056,786.69
2.本期利润	-72,838,950.21
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1880
4.期末基金资产净值	478,845,136.49
5.期末基金份额净值	1.185

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

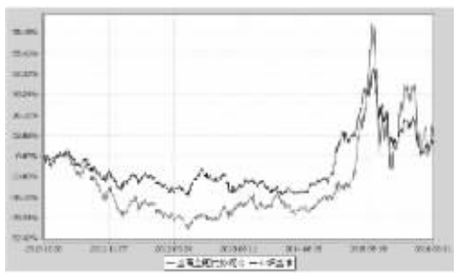
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-17.77%	3.32%	-9.92%	1.82%	-7.85%	1.50%

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

金鹰主题优势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12月20日至2016年3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%+中证全债指数收益率×25%

§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		
陈立	基金经理	2013-08-15	-	9	陈立先生，经济学硕士，证券从业经历9年。曾任银华基金管理有限公司医药行业研究员，2009年6月加盟金鹰基金管理有限公司，先后任行业研究员，非周期组组长、基金经理助理、投资经理。现任金鹰主题优势混合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《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，为基金份额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

本报告期，本基金管理人按照《证券投资基金管理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。

本基金管理人事前规定了严格的股票备选库管理制度、投资权限管理制度、债券库管理制度和集中交易制度等；事中重视交易执行环节的公平交易措施，以"时间优先、价格优先"作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统中的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合；事后加强对不同投资组合的交易价差、收益率的分析，对公平交易执行情况进行检查。本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

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

一季度初，人民币再次出现一轮贬值，投资者对美元加息的担忧上升，市场在熔断因素下出现一轮快速下跌。在3月中下旬，美联储议息会议传达出对加息的谨慎言论，国内稳增长带来经济小周期回升趋势，监管层对资本市场释放出维稳信号，市场出现了一定的反弹。从整个一季度看，上证综指下跌15.1%，深成指下跌17.4%，中小板指数下跌18.2%，创业板指数则下跌了17.5%。行业方面，计算机、传媒、房地产、机械、交运跌幅居前，银行、食品饮料、煤炭、有色、石油石化跌幅相对较小。

本基金在一季度没能及时降仓，在市场系统性下跌中，基金净值也受到影响。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2016年3月31日，基金份额净值为1.185元，本报告期份额净值增长率-17.77%，同期业绩比较基准增长率为-9.92%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

综合市场看，汇率、利率和流动性之间的协调正在朝着偏有利的方向发展。美联储的加息节奏受到内外因素的影响正变得谨慎。国内经济面的回升，加之G20会议的召开，为人民币汇率稳定提供了基础，市场信心对此正步恢复。国内在稳增长政策下，经济有望短周期回升。经过3月中下旬的反弹后，二季度市场整体风险偏好呈中性，判断呈震荡行情。未来走势需要继续观察经济回升力度、稳增长措施的持续性、改革政策的进一步推进。本基金将继续着眼于中长期，重点投资于产业发展空间较热巨大的行业，重点看好体育、教育、传媒、医疗服务、智能驾驶等方向。

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	417,745,654.28	81.82
	其中：股票	417,745,654.28	81.82
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	91,163,681.97	17.86
7	其他各项资产	1,650,217.65	0.32
8	合计	510,559,553.90	100.00

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	8,679,303.90	1.81
C	制造业	194,949,385.93	40.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	36,234.48	0.01
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	55,832,594.74	11.66
H	住宿和餐饮业	30,429,090.46	6.35
I	信息传输、软件和信息技术服务业	58,929,792.56	12.31
J	金融业	-	-
K	房地产业	16,931,125.53	3.54
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	51,958,126.68	10.85
S	综合	-	-
	合计	417,745,654.28	87.24

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	600136	道博股份	612,163	36,950,158.68	7.72
2	300160	秀强股份	748,412	32,406,239.60	6.77
3	600754	锦江股份	742,354	30,429,090.46	6.35
4	002587	奥拓电子	1,847,088	29,534,937.12	6.17
5	601799	星宇股份	806,636	28,764,639.76	6.01
6	300494	盛天网络	336,564	28,305,032.40	5.91
7	600392	盛和资源	2,469,229	25,877,519.92	5.40
8	600650	锦江投资	632,438	24,146,482.84	5.04
9	002395	双象股份	798,168	21,510,627.60	4.49
10	300240	飞力达	976,993	18,855,964.90	3.94

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

本基金本报告期末未持有股指期货投资。

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投资。

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本基金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	783,573.45
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,882.26
5	应收申购款	854,759.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,650,217.65

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

本基金报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况。

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	314,365,560.08
报告期基金总申购份额	142,190,184.60
减：报告期基金总赎回份额	52,395,852.53
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	404,159,892.15

§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

本报告期，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

无

§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主题优势股票型证券投资基金发行及募集的文件。

2.《金鹰主题优势股票型证券投资基金基金合同》。

3.《金鹰主题优势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、更新的招募说明书及其他临时公告。

9.2 存放地点

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

二〇一六年四月二十日

金鹰中证500指数分级证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016年3月31日

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：二〇一六年四月二十日

§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年4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。

本报告期自2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金鹰中证500指数分级		
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	2012年6月5日		
报告期末基金份额总额	16,930,780.68份		
投资目标	本基金为股票型指数基金，以跟踪指数为目标，力求将基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在0.35%以下，年跟踪误差控制在4%以下。		
投资策略	本基金以中证500指数成分股在其指数中的基准权重为基础，在综合考察指数成分股的行业构成与市值占比、各行业内成分股权重的构成与分散程度、成分股流动性与回络信等因素的基础上，采用重点抽样与分层抽样相结合的策略以构建指数化投资组合；在抽样组合内的股票停牌或出现流动性不足等情形时，本基金将根据变化了的新情况，对于抽样组合进行再调整。 本基金投资于股票的资产占基金资产净值的比例为90%～95%，其中，中证500指数成分股和备选成分股占基金资产净值的比例不低于90%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金融工具占基金资产净值的5%～10%，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%，权证投资的比例范围占基金资产净值的0%～3%。		
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为中证500指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%		
风险收益特征	-		
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		
下属分级基金的基金简称	金鹰500A	金鹰500B	金鹰500
下属分级基金的场内简称	金鹰500A	金鹰500B	-
下属分级基金的交易代码	150088	150089	162107
报告期末下属分级基金的份额总额	2,880,674.00份	2,880,674.00份	11,169,432.68份
风险收益特征	本级基金具有低风险、预期收益相对稳定的特征。	本级基金具有高风险、高预期收益的特征。	本级基金为被动跟踪指数的指数型证券投资基金，属于证券投资基金当中收益、风险较高的品种，一般情形下，其风险和预期收益高于混合型、债券型、货币市场基金。

§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(2016年1月1日-2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-1,112,465.27
2.本期利润	-3,863,808.72
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2232
4.期末基金资产净值	17,875,583.44
5.期末基金份额净值	1.0558

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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.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

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	-18.67%	3.11%	-18.20%	3.08%	-0.47%	0.03%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计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

金鹰中证500指数分级证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图