

金鹰产业整合灵活配置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:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年四月二十日

基金管理人及基金托管人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。
基金管理人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2016年4月19日复核了本报告中的财务资料、净值表现和利润分配等事项,保证复核内容真实、准确和完整。
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预示其未来表现,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。
本报告期内基金未发生诉讼。
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

基金名称	金鹰产业整合混合
基金主代码	001366
交易代码	001366
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月16日
报告期末基金份额总额	662,364,407.27份
投资目标	本基金在有效控制投资组合风险并保持良好的流动性前提下,努力把握宏观经济和结构调整中蕴含的长期投资机会,通过资产配置和个股精选,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金在构建和管理基金的投资组合的过程中,以资产配置作为资产配置与个股选择的先行主线,深入挖掘符合产业发展趋势和估值性价比的优质个股,动态调整资产配置。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率×60%+中证全指指数收益率×40%。
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于证券投资基金中预期风险和预期收益较高的品种,其预期风险和预期收益高于货币型基金、债券型基金和股票型基金。
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司

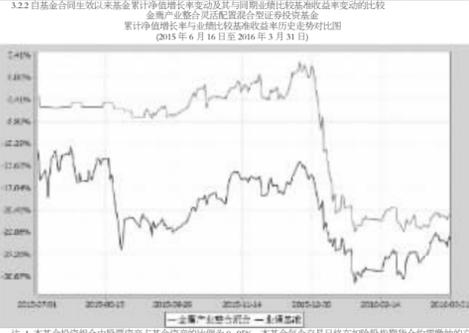
§3 主要财务指标

主要财务指标		报告期
		(2016年1月1日至2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-128,499,078.65	
2.本期利润	-152,811,779.81	
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1926	
4.期末基金份额净值	0.7830	
5.期末基金资产净值	678,830,766.22	
6.期末基金份额净值增长率	0.787	

§4 基金业绩比较基准

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;
注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;
注3:基金净值增长率
注4: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	业绩比较基准收益率②	①-②	①-③	①-④
过去三个月	-22.08%	1.80%	-10.68%	1.94%	-11.40%
过去六个月	-1.40%	1.80%	-0.40%	1.94%	-0.40%



注1:本基金投资组合中股票资产占基金资产净值的比例不低于85%。本基金每个交易日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持现金及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、股指期货及其他金融工具的投资比例按照法律法规的有关规定执行。本基金投资于中国证监会核准上市开放式证券投资基金的比例不超过基金资产净值的80%。当法律法规对投资比例限制发生变更时,基金管理人有权按照变更后的比例进行相应调整。
注2:业绩比较基准:沪深300指数收益率×60%+中证全指指数收益率×40%。
注3:管理人报告

§5 基金管理人及基金托管人简介

姓名	职务	任职日期	最近任期	证券从业年限	说明
王蔚佳	权益投资部副总监、基金经理	2015-06-16	-	17	王蔚佳先生,硕士研究生学历,证券从业资格,曾任招商证券研究所研究员及资产管理部研究员,2014年11月加入金鹰基金管理有限公司,曾任权益部副总监,现任权益部副总监兼基金经理。2015年6月加入金鹰基金管理有限公司,曾任权益部副总监,现任权益部副总监兼基金经理。2015年6月加入金鹰基金管理有限公司,曾任权益部副总监,现任权益部副总监兼基金经理。
于楠	权益投资部副总监、基金经理	2015-06-16	-	7	于楠先生,硕士研究生学历,证券从业资格,曾任招商证券研究所研究员及资产管理部研究员,2014年11月加入金鹰基金管理有限公司,曾任权益部副总监,现任权益部副总监兼基金经理。2015年6月加入金鹰基金管理有限公司,曾任权益部副总监,现任权益部副总监兼基金经理。

§6 开放式基金份额变动

基金名称	基金资产净值(元)	基金份额(份)
金鹰产业整合混合	678,830,766.22	662,364,407.27

注:1.在任职日期和最近任职日期公司公开聘任或解聘日期;
注2:基金经理的公开聘任或解聘日期按照《证券投资基金法》的相关规定;
注3:基金经理的公开聘任或解聘日期按照《证券投资基金法》的相关规定;
注4:基金经理的公开聘任或解聘日期按照《证券投资基金法》的相关规定;
注5:基金经理的公开聘任或解聘日期按照《证券投资基金法》的相关规定;
注6:基金经理的公开聘任或解聘日期按照《证券投资基金法》的相关规定;
注7:基金经理的公开聘任或解聘日期按照《证券投资基金法》的相关规定;
注8:基金经理的公开聘任或解聘日期按照《证券投资基金法》的相关规定;
注9:基金经理的公开聘任或解聘日期按照《证券投资基金法》的相关规定;
注10:基金经理的公开聘任或解聘日期按照《证券投资基金法》的相关规定;

基金管理人:金鹰基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年四月二十日

基金管理人及基金托管人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。
基金管理人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2016年4月19日复核了本报告中的财务资料、净值表现和利润分配等事项,保证复核内容真实、准确和完整。
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预示其未来表现,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。
本报告期内基金未发生诉讼。
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

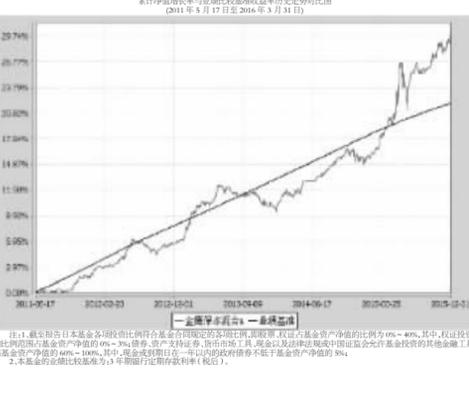
基金名称	金鹰保本混合
基金主代码	210006
交易代码	210006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年8月17日
报告期末基金份额总额	49,128,091.13份
投资目标	采用改良的资产配置策略(CPI),引入货币固定机制,在严格控制投资风险、保证基金资产安全的基础上,力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为改良的资产配置策略(CPI),引入货币固定机制,在严格控制投资风险、保证基金资产安全的基础上,力争实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	3年期定期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为稳健型的保本混合基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期风险和预期收益低于股票基金、混合型基金和债券基金,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	中国光大银行股份有限公司

§3 主要财务指标

主要财务指标		报告期
		(2016年1月1日至2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-86,011.29	
2.本期利润	-1,490,018.64	
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0302	
4.期末基金份额净值	55.6007039	
5.期末基金资产净值	1,211	

§4 基金业绩比较基准

阶段	净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	①-③	①-④
过去三个月	-2.46%	0.31%	-0.76%	0.01%	-3.14%
过去六个月	-3.14%	0.31%	-0.76%	0.01%	-3.14%



注:1.本基金投资于中国证监会核准上市开放式证券投资基金的比例不超过基金资产净值的30%。
注2:本基金业绩比较基准:3年期定期存款利率(税后)。

我们将加强对基建投资、房地产销售和投资的跟踪调研。受商品价格影响,2季度CPI存在短期压力,但估计持续性不强,通胀压力在2016年4月以后有所缓解,通胀压力在2016年4月以后有所缓解,通胀压力在2016年4月以后有所缓解。
4.6 报告期内基金持有人或基金资产净值变动情况
本报告期无诉讼情况说明。

§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)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	209,400,143.46	29.00
2	其中:股票	209,400,143.46	29.00
3	债券投资	-	-
4	其中:国债	-	-
5	金融债	-	-
6	企业债	-	-
7	短期融资券	-	-
8	中期票据	-	-
9	资产支持证券	-	-
10	买入返售金融资产	400,000,325.00	55.39
11	其中:买入返售金融资产-质押式回购	-	-
12	银行存款	111,238,018.70	15.47
13	其他资产	103,313,217.27	14.04
14	合计	722,171,306.43	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	159,279,621.70	23.46
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	-	-
E	建筑业	6,035.76	0.00
F	批发和零售业	30,341,177.00	4.17
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	299,890,369.00	2.90
合计		209,400,143.46	30.85

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	联益股份	2,856,012	44,810,828.28	6.60
2	600673	广汇股份	3,297,513	25,438,308.16	4.49
3	600419	交通银行	30,000,000	20,000,000.00	3.09
4	000641	聚兴能源	1,887,228	20,000,000.00	3.09
5	600777	新潮实业	1,271,700	19,800,000.00	2.93
6	002353	杰瑞股份	999,260	17,576,988.40	2.59
7	002068	绿茵股份	2,718,700	17,400,256.00	2.60
8	002221	华鲁能源	708,200	16,661,472.00	2.45
9	600475	美利纸业	2,560,775	13,099,743.00	2.02
10	002557	润达股份	567,000	10,331,370.00	1.52

5.4 报告期末按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

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

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发生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、处罚的情况。

5.11.2 报告期内本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选证券范围。

5.11.3 其他各项资产构成

名称	金额(元)
1 存出保证金	941,407.49
2 应收证券清算款	-
3 应收股利	-
4 应收利息	88,138.49
5 应收申购款	3,671.29
6 其他应收款	-
7 其他	-
8 合计	1,033,217.27

§6 开放式基金份额变动

基金名称	基金资产净值(元)	基金份额(份)
金鹰保本混合	1,211	49,128,091.13

注:1.在任职日期和最近任职日期公司公开聘任或解聘日期;
注2:基金经理的公开聘任或解聘日期按照《证券投资基金法》的相关规定;
注3:基金经理的公开聘任或解聘日期按照《证券投资基金法》的相关规定;
注4:基金经理的公开聘任或解聘日期按照《证券投资基金法》的相关规定;
注5:基金经理的公开聘任或解聘日期按照《证券投资基金法》的相关规定;
注6:基金经理的公开聘任或解聘日期按照《证券投资基金法》的相关规定;
注7:基金经理的公开聘任或解聘日期按照《证券投资基金法》的相关规定;
注8:基金经理的公开聘任或解聘日期按照《证券投资基金法》的相关规定;
注9:基金经理的公开聘任或解聘日期按照《证券投资基金法》的相关规定;
注10:基金经理的公开聘任或解聘日期按照《证券投资基金法》的相关规定;

基金管理人:金鹰基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年四月二十日

基金管理人及基金托管人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。
基金管理人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2016年4月19日复核了本报告中的财务资料、净值表现和利润分配等事项,保证复核内容真实、准确和完整。
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预示其未来表现,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。
本报告期内基金未发生诉讼。
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

基金名称	金鹰策略配置混合
基金主代码	210008
交易代码	210008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年9月4日
报告期末基金份额总额	232,134,872.84份
投资目标	在追求基金资产长期增值的基础上,制定适当的投资策略,以策略为导向,在充分分散投资的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	“战略”与“战术”的资产配置与基金资产配置,资产配置过程中的重要决策,通过资产配置与基金资产配置,资产配置过程中的重要决策,通过资产配置与基金资产配置,资产配置过程中的重要决策,通过资产配置与基金资产配置。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×75%+中证全指指数收益率×25%
风险收益特征	本基金为主动管理的股票型基金,属于证券投资基金中预期收益与风险较高的品种,一般风险高于其他股票型基金,预期收益高于货币型基金、债券型基金。
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司

§3 主要财务指标

主要财务指标		报告期
		(2016年1月1日至2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-67,396,839.65	
2.本期利润	-61,920,048.98	
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2551	
4.期末基金份额净值	263.11685797	

§4 基金业绩比较基准

阶段	净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	①-③	①-④
过去三个月	-17.08%	2.98%	-9.92%	1.82%	-7.16%
过去六个月	-1.40%	2.98%	-0.92%	1.82%	-1.16%



注:1.本基金投资于中国证监会核准上市开放式证券投资基金的比例不低于85%。
注2:本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率×75%+中证全指指数收益率×25%。
注3:管理人报告

金鹰策略配置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:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年四月二十日

基金管理人及基金托管人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。
基金管理人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2016年4月19日复核了本报告中的财务资料、净值表现和利润分配等事项,保证复核内容真实、准确和完整。
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预示其未来表现,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。
本报告期内基金未发生诉讼。
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

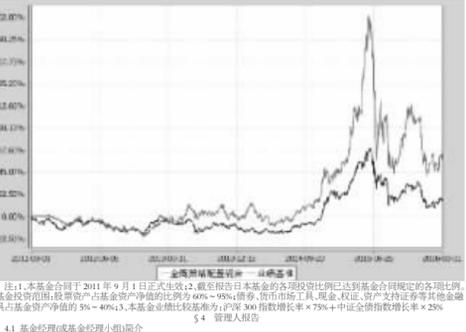
基金名称	金鹰策略配置混合
基金主代码	210008
交易代码	210008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年9月4日
报告期末基金份额总额	232,134,872.84份
投资目标	在追求基金资产长期增值的基础上,制定适当的投资策略,以策略为导向,在充分分散投资的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	“战略”与“战术”的资产配置与基金资产配置,资产配置过程中的重要决策,通过资产配置与基金资产配置,资产配置过程中的重要决策,通过资产配置与基金资产配置,资产配置过程中的重要决策,通过资产配置与基金资产配置。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×75%+中证全指指数收益率×25%
风险收益特征	本基金为主动管理的股票型基金,属于证券投资基金中预期收益与风险较高的品种,一般风险高于其他股票型基金,预期收益高于货币型基金、债券型基金。
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司

§3 主要财务指标

主要财务指标		报告期
		(2016年1月1日至2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-67,396,839.65	
2.本期利润	-61,920,048.98	
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2551	
4.期末基金份额净值	263.11685797	

§4 基金业绩比较基准

阶段	净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	①-③	①-④
过去三个月	-17.08%	2.98%	-9.92%	1.82%	-7.16%
过去六个月	-1.40%	2.98%	-0.92%	1.82%	-1.16%



注:1.本基金投资于中国证监会核准上市开放式证券投资基金的比例不低于85%。
注2:本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率×75%+中证全指指数收益率×25%。
注3:管理人报告

§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)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	237,133,037.58	86.91
2	其中:股票	237,133,037.58	86.91
3	债券投资	-	-
4	其中:国债	-	-
5	金融债	-	-
6	企业债	-	-
7	短期融资券	-	-
8	中期票据	-	-
9	资产支持证券	-	-
10	买入返售金融资产	-	-
11	其中:买入返售金融资产-质押式回购	-	-
12	银行存款	35,194,282.97	12.90
13	其他资产	5,052,227.07	1.81
14	合计	277,379,547.52	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	2,860,865.40	5.20
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	-	-
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	2,860,865.40	5.20

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	300224	正海磁材	79,938	1,462,865.40	2.66
2	600027	华鲁能源	200,000	1,390,000.00	2.54

5.4 报告期末按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	国债	30,160,000.00	54.51
2	金融债	-	-
3	企业债	-	-
4	资产支持证券	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	中期票据	-	-
7	短期融资券	-	-
8	其他	-	-
9	合计	30,160,000.00	54.51

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

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发生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、处罚的情况。
5.11.2 报告期内本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选证券范围。
5.11.3 其他各项资产构成

名称	金额(元)
1 存出保证金	26,146.82
2 应收证券清算款	-
3 应收股利	-
4 应收利息	946,343.15
5 应收申购款	-
6 其他应收款	-
7 其他	