（上接B105版）

法定代表人：蔡咏
联系人：李蔡
电话：0551-2272101
客服电话：95578（仓国）
网址：www.gyzq.com.cn
（105）渤海证券股份有限公司
注册地址：天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
办公地址：天津市南开区宾水西道8号
法定代表人：王春峰
联系人：张彤
电话：022-28451955
客服电话：400-651-5988
网址：www.ewww.com.cn
（106）华泰证券股份有限公司
注册（办公）地址：江苏省南京市江东中路228号
法定代表人：周易
联系人：庞晓芸
电话：0755-82492193
客服电话：95597
网址：www.htsc.com.cn
（107）长江证券股份有限公司
注册（办公）地址：山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
法定代表人：侯巍
联系人：邓颖赟
联系电话：0351-8686796
客服电话：95573
网址：www.i618.com.cn
（108）中信证券（山东）有限责任公司
注册（办公）地址：山东省青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层
法定代表人：姜晓林
联系人：孙秋月
电话：0532-85022026
客服电话：95548
网址：www.zxwt.com.cn
（109）东兴证券股份有限公司
注册（办公）地址：北京市西城区金融大街5号（新盛大厦）12、15层
法定代表人：魏庆华
联系人：汤漫川
电话：010-66555316
客服电话：010-66555835
网址：www.dxzq.net
（110）东吴证券股份有限公司
注册（办公）地址：苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦
法定代表人：范力
联系人：陆晓
电话：0512-62938521
客服电话：0512-96288
网址：www.dwzq.com.cn
（111）信达证券股份有限公司
注册（办公）地址：北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层
法定代表人：张志刚
联系人：尹旭航
电话：010-63081493
客服电话：4008008899
网址：www.cindasc.com
（112）方正证券股份有限公司
注册（办公）地址：湖南长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
法定代表人：雷杰
联系人：邵艳霞
电话：0731-85832507
客服电话：95571（仓国）
网址：www.foundersc.com
（113）长城证券有限责任公司
注册（办公）地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层
法定代表人：丁益
联系人：金夏
电话：0755-83516289
客服电话：400-6666-888
网址：www.cgws.com
（114）光大证券股份有限公司
注册（办公）地址：上海市静安区新闸路 1508 号
法定代表人：薛峰
联系人：李晓晳
电话：021-22169111
客服电话：95525（仓国）、4008888788
网址：www.ebscn.com
（115）广州证券股份有限公司
注册（办公）地址：广东省广州市珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心19-20楼
法定代表人：邱三发
联系人：梁薇
电话：020-88836999-5408
客服电话：95396
网址：www.gzs.com.cn
（116）东北证券股份有限公司
注册（办公）地址：吉林省长春市生态大街6666号
法定代表人　李福春
联系人：安岩岩
电话：0431-85096517
客服电话：953604006-000686
网址：www.nesc.cn
（117）上海证券有限责任公司
注册（办公）地址：上海市黄浦区四川中路213号7楼
法定代表人：李俊杰
联系人：邵珍珍
电话：021-53686262
客服电话：400-891-8918
网址：www.962518.com
（118）新时代证券有限责任公司
注册（办公）地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
法定代表人：刘汝军
联系人：孙恺
电话：010-83561149
客服电话：4006-989898
网址：www.xsdzq.cn
（119）大同证券有限责任公司
注册地址：大同市城区迎宾街15号桐城中央12层
办公地址：山西省太原市长治路111号山西世贸中心A座12、13层
法定代表人：董祥
联系人：薛津
电话：0351-4130322
客服电话：400-7121-212
网址：www.dtsbc.com.cn
（120）国联证券股份有限公司
注册（办公）地址：江苏省无锡市太湖新城金融一街8号 国联金融大厦7-9楼
法定代表人：姚志勇
联系人：沈刚
电话：0510-82831662
客服电话：0510-82588168
网址：http://www.glsc.com.cn
（121）新商证券股份有限公司
注册（办公）地址：浙江省杭州市西湖区杭大路1号黄龙世纪广场A座6、7楼
法定代表人：吴承根
联系人：陈韵
电话：021-64718888-2024
客服电话：95345
网址：http://www.stocke.com.cn
（122）平安证券有限责任公司
注册（办公）地址：深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
法定代表人：詹露阳
联系人：周一涵
电话：021-38637436
客服电话：95511转8
网址：www.stock.pingan.com
（123）华安证券股份有限公司
注册地址：合肥市长江中路357号
办公地址：合肥市阜南路166号
法定代表人：李工
联系人：范超
电话：0551-65161821
客服电话：96518、4008-096-518
网址：www.hazq.com
（124）国海证券股份有限公司
注册地址：广西桂林市辅星路13号
办公地址：广西南宁市滨湖路46号
法定代表人：何春梅
联系人：郑桂鹏
电话：021-20281096
客服电话：0771-5539032
网址：www.ghzq.com.cn
（125）财富证券有限责任公司
注册地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26-28层
办公地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心36层
法定代表人：蔡一兵
联系人：梁令安
电话：0731-88954613
客服电话：95317
网址：www.cfzq.com
（126）东莞证券股份有限公司
注册（办公）地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号
法定代表人：陈照星（代理）
联系人：蒋浩然
电话：0769-22112151
客服电话：95328
网址：http://www.dgzq.com.cn
（127）国都证券有限责任公司
注册（办公）地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层
法定代表人：常喆
联系人：李弢
电话：010-84183331
客服电话：400-818-8118
网址：www.guodu.com
（128）东海证券股份有限公司
注册地址：江苏省常州延陵西路23号投资广场18层
办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人：朱科敏
联系人：王一彦
电话：021-20333333
客服电话：95531；400-8888-588
网址：www.longone.com.cn
（129）国盛证券有限责任公司
注册（办公）地址：江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦
法定代表人：马跃进
联系人：周欣玲
电话：0791-86281305
客服电话：400-822-2111
网址：www.gsstock.com
（130）申万宏源西部证券有限公司
注册（办公）地址：新疆乌市鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
法定代表人：韩志谦
联系人：王怀春
电话：0991-2307105
客服电话：4008000562
网址：www.swhysc.com
（131）中泰证券股份有限公司
注册（办公）地址：山东省济南市市中区经七路 86 号
法定代表人：李玮
联系人：许曼华
电话：021-20315290
客服电话：95538（仓国）
www.zts.com.cn
（132）世纪证券有限责任公司
注册（办公）地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦41楼
法定代表人：姜晓军
联系人：袁媛
电话：0755-83199511
客服电话：0755-83199599
网址：www.csco.com.cn
（133）金元证券股份有限公司
注册地址：海口市南宝路36号证券大厦4楼
办公地址：深圳市深南大道4001号时代金融中心大厦17楼
法定代表人：陆涛
联系人：马贤清
电话：0755-83025022
客服电话：4008-888-228
网址：www.jyzq.cn
（134）中航证券股份有限公司
注册（办公）地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷大道1619号国际金融大厦A座41楼
法定代表人：王宜四
联系人：史江荻
电话：010-64818301
客服电话：400-8866-567
网址：www.avicsec.com
（135）德邦证券股份有限公司
注册地址：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼
办公地址：上海市福山路 500 号城建国际中心 26 楼
法定代表人：姚文平
联系人：刘　熠
联系客服：电话：400-8888-128
网址：www.tebon.com.cn
（136）西部证券股份有限公司
注册（办公）地址：西安市东新街232号信托大厦16-17层
法定代表人：刘建武
联系人：梁承华
电话：029-87406168
客服电话：95582
网址：http://www.westsecu.com
（137）华福证券有限责任公司
注册（办公）地址：福州市鼓楼区温泉街道五四路157号7-8层
法定代表人：黄金琳
联系人：郭相兴
电话：021-20655175
客服电话：96326
网址：http://www.hfzq.com.cn
（138）华龙证券股份有限公司
注册（办公）地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼
法定代表人：李晓安
联系人：邓鹏怡
电话：0931-4890208
客服电话：0931-4890619
网址：www.hlzqgs.com
（139）中国国际金融有限公司
注册（办公）地址：北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
法定代表人：毕明建（代）
联系人：董继继
电话：0755-83770501
客服电话：010-65051166
0755-8319 5000
网址：www.cicc.com.cn
（140）财通证券股份有限公司
注册（办公）地址：杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心
法定代表人：沈继宁
联系人：陶志华
电话：0571-87789160
客服电话：95336，40086-96336
网址：http://www.ctsec.com
（141）上海华信证券有限责任公司
注册地址：上海浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼
办公地址：上海市黄浦区南京西路399号明天广场22楼
法定代表人：郭林
联系人：李颖
电话：86-021-6389-8951
客服电话：（021）38784818
网址：http://www.shhxzq.com
（142）五矿证券有限公司
注册地址：深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心办公楼 47 层 01 单元
办公地址：深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心大厦47、48、49层
法定代表人：赵立功
联系人：王鹏宇
电话：0755-83219194
客服电话：40018-40028
网址：www.wkzq.com.cn
（143）华鑫证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01（b）单元
办公地址：上海市肇嘉浜路 750 号
法定代表人：俞洋
联系人：杨莉娟
电话：021-64376936
客服电话：4008-888-999
网址：www.cfsc.com.cn
（144）中国中投证券有限责任公司
注册（办公）地址：深圳福田区益田路6003号荣超商务中心A座第4、第18-21层
法定代表人：高涛
联系人：万玉琳
电话：0755-82026907
客服电话：95532；400-600-8008
网址：www.china-invs.cn
（145）中山证券有限责任公司
注册及办公地址：深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层
法定代表人：黄扬录
业务联系人：罗艺琳
电话：0755- 82570586
客服电话：4001-022-011
网址：www.zszq.com
（146）日信证券有限责任公司
注册（办公）地址：内蒙古自治区内蒙古呼和浩特市锡林南路18号
法定代表人：孔伯杰
联系人：陈韦杉
电话：010-88086830
客服电话：010-88086830
网址：www.rxzq.com.cn
（147）联讯证券股份有限公司
注册（办公）地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
法定代表人：徐刚
联系人：彭莲
电话：0752-2119700
客服电话：95564
网址：www.lxzq.com.cn
（148）江海证券有限公司
注册（办公）地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人：孙名扬
联系人：周俊
电话：0451-85863726
客服电话：400-666-2288
网址：www.jhzq.com.cn
（149）九州证券股份有限公司
注册地址：青海省西宁市南川工业园区创业路108号
办公地址：北京市朝阳区安立路30号仰山公园东一门2号楼
法定代表人：魏先锋
联系人：张靓蓓
电话：010-57672000、0755-33331188-8807
客服电话：95305
网址：www.jssec.com
（150）国金证券股份有限公司
注册（办公）地址：四川省成都市东城根上街 95 号
法定代表人：冉云
联系人：刘婧漪、贾鹏
电话：028-86690057、028-86690058
客服电话：95310
网址：www.gjzq.com.cn
（151）中国民族证券有限责任公司
注册地址：北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼
办公地址：北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观A座40F-43F
法定代表人：何亚刚
联系点人：李小雅
电话：010-59355930
客服电话：4008895618
网址：www.e5618.com
（152）华宝证券有限责任公司
注册（办公）地址：上海市陆家嘴环路未来资产大厦27层
法定代表人：陈林
联系人：宋歌
电话：021-50122086
客服电话：021-38929908、400-820-9898
网址：www.cnhbstock.com
（153）爱建证券有限责任公司
注册（办公）地址：上海市浦东新区世纪大道1600号32楼
法定代表人：钱华
联系人：王薇
电话：021-32229888-25125
客服电话：4001962502
网址：http://www.ajzq.com
（154）英大证券有限责任公司
注册（办公）地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
法定代表人：吴俊
联系人：吴尔辉
电话：0755-83007159
客服电话：4008-188-688
网址：www.ydsc.com.cn
（155）华融证券股份有限公司
注册（办公）地址：北京市西城区金融大街8号
法定代表人：祝献忠
联系人：李慧灵
电话：010-85556100
客服电话：95390；400-898-9999
网址：www.hrsec.com.cn
（156）财达证券股份有限公司
注册（办公）地址：河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦24层
法定代表人：翟建强
联系人：李卓颖
电话：0311-66008561
客服电话：4006128888
网址：www.s10000.com
（157）天风证券股份有限公司
注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦4楼
办公地址：湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼
法定代表人：余磊
联系人：夏曼
联系电话：028-86712334
客服电话：4008005000
网址：www.tfzq.com
（158）首创证券有限责任公司
注册（办公）地址：北京市西城区德胜门外大街115号德胜尚城E座
法定代表人：吴涛
联系人：刘宇
电话：010-59366070
客服电话：4006200620
网址：http://www.sczq.com.cn/
（159）宏信证券有限责任公司
注册（办公）地址：四川省成都市人民南路二段十八号川信大厦10楼
法定代表人：吴玉明
联系人：杨磊
电话：028-86199041
客服电话：4008-366-366
网址：http://www.hxzq.cn
（160）大平洋证券股份有限公司
注册（办公）地址：云南省昆明市青年路389号志远大厦18层
法定代表人：李长伟
联系人：唐昌田
电话：010-88321717
客服电话：0871-68898130
网址：http://www.tpyzq.com
（161）开源证券股份有限公司
注册（办公）地址：西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层
法定代表人：李刚
联系人：袁伟涛
电话：029-63387289
客服电话：400-860-8866
网址：www.kysec.cn

基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

（二）注册登记机构

名称：金鹰基金管理有限公司
注册地址：广东省珠海市香洲区水湾路246号3栋2单元3D房
办公地址：广东省广州市天河区珠江新城珠江东路28号越秀金融大厦30层
法定代表人：刘岩
电话：020-38283037
传真：020-83282856
联系人：张盛

（三）律师事务所和经办律师

名称：广东岭南律师事务所
住所：广州市新港西路135号中山大学西门科技园601-605室
法定代表人：黄添顺
电话：020-84035397
传真：020-84113152
经办律师：欧阳兵、何官益

（四）会计师事务所和经办注册会计师

名称：中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：武汉市武昌区东湖路169号众环海华大厦2-9层
法定代表人：石文先
电话：027?86770549
传真：027?85424329
邮编：430077?
经办注册会计师：王兵、龚静伟

四、基金的名称

本基金名称：金鹰主题优势混合型证券投资基金
本基金简称：金鹰主题优势混合
本基金代码：210005

五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式

六、基金的投资目标

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。

七、投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的股票、债券、权证，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。股票资产占基金总资产的比例为60%-95%，其中，不低于80%的股票资产将配置于投资主题驱动下的行业与上市公司；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总资产的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%，权证投资的比例范围占基金资产净值的0%-3%。

如将来法律法规或监管机构允许基金投资其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，即可将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

八、投资策略

1、大类资产配置策略

本基金采用“自上而下”的分析视角，综合考量中国宏观经济所处投资时钟的象限、国内股票市场的估值、国内债券市场收益率的期限结构、CPI与PPI变动趋势、外围主要经济体宏观经济与资本市场的运行状况等因素，分析研判货币市场、债券市场与股票市场的预期收益与风险，并据此进行大类资产的配置与组合构建，合理确定本基金在股票、债券、现金等金融工具上的投资比例，并随着各类金融工具风险收益特征的相对变化，适时动态地调整各金融工具的投资比例。

2、股票投资策略

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。本基金所谓“主题”，是指国内外实体经济、政府政策、科学技术、社会变迁、金融市场等层面已经发生或预期将发生的，将导致行业或企业竞争力提升、盈利水平改善的驱动因素，重点关注产业政策、区域振兴、科技进步、经济结构转型、社会结构变迁所带来的投资主题。具体说来，可供本基金配置的投资主题包括但不限于内需增长、消费提振与消费升级、出口增长与结构优化、投资结构与布局改善、社会保障与医疗改革、节能减排、环保、产业转移、产业链优化、新能源、新材料及新科技的应用、城市化的进程、人口老龄化、社会收入分配改革、汇率改革、金融制度的改革和发展、金融工具的创新、经济全球化等等所带来的投资主题。由于这些“投资主题”有着深刻的基本面基础，且将导致相关行业或企业经营状况的改善，故而，将给本基金带来良好的投资机会。

各种投资主题的差异主要体现在：对上市公司经营绩效传导的路径之长短与作用力度之大小、受益于该投资主题的行业与产业之数量、受益于该投资主题的上市公司之数量与质量、可持续性、战略性主题还是战术性主题等等。从证券投资的视角看，对上市公司经营绩效传导的路径短、作用力度大、受益于该主题的行业与产业数量众多、受益于该投资主题的上市公司数量多且质量好、可持续性强的战略性主题，具有明显的比较优势。

一般而言，投资主题是跨行业的，以“消费提振”主题为例，其波及的行业主要有：食品饮料、纺织服装、餐饮旅游、家用电器、汽车制造等等。鉴于投资主题的跨行业特性，本基金根据受益于“主题”的各行业随着经济周期变化的弹性，将“主题”区分为“防御型主题”与“进取型主题”，在宏观经济与证券市场的不同周期阶段，在上述两大类型的主题之间审慎遴选。在“自上而下”遴选投资标的的过程中，遵循“先主题，后行业，再个股”的逻辑顺序。

在具体投资主题、行业（采用申银万国行业分类）与个股的遴选上，通过对投资主题、行业和个股的比较优势进行持续评估，本基金力求准确把握各类重大投资主题所带来的投资机遇，并据此对投资组合当中的行业和个股进行及时调整。

（1）投资主题遴选策略

在宏观经济所处投资时钟的不同象限，以及证券市场运行的不同周期阶段，“防御型主题”与“进取型主题”的比较优势亦不相同。宏观经济与资本市场的上行周期当中，进取型主题具有比较优势；而在宏观经济与资本市场的下行周期当中，防御型主题具有比较优势；为了对可供选择的投资主题进行综合评价，本基金通过定性与定量相结合的方法建立了“金鹰投资主题评价模型”，该模型的主要考量因素包括：投资主题是否源于国际经济环境，是否源于政府财政政策，是否源于央行货币政策，是否源于国家战略，是否源于政府其它特定政策目标，是否源于社会变迁，是否源于国内外政治环境，是否源于科技进步，向实体经济各行业传导的时滞，对实体经济产生牵引的广度、深度、持续时间，证券市场是否存在明确的投资标的，是否源于国内外突发事件、重大事件，投资主题对于实体经济、金融市场的影响是否随着国内外突发事件、重大事件的平息而立即消失等等。

借助“金鹰投资主题评价模型”对于可供选择的投资主题进行评价，筛选出可持续性强、对于实体经济将产生重大影响、对于传导所至的行业与企业经营绩效提升空间较大的投资主题，作为本基金的重点配置方向。

（2）行业配置策略

遴选出重点配置的投资主题之后，根据受益于这些投资主题的程度来筛选本基金重点配置的行业。

本基金采用基本面加权的方法，定量分析与定性分析相结合，建立了“金鹰行业综合评价模型”，定量方面主要依据行业的盈利指标、成长指标、现金流指标、偿债能力指标、营运能力指标、估值指标，定性方面主要依据国际经济环境、全球产业周期、财政政策、货币政策对于行业的影响，政府特定政策目标、国内消费环境的变迁、科技进步、国内外突发事件、重大事件对于行业的影响，行业的盈利前景及成长空间分析等等。“金鹰行业综合评价模型”试图预判与寻找那些具有综合性比较优势的行业，力图使得这些行业的投资收益超越市场当中各行业收益率的平均值。对这些行业进行重点配置，以期提升投资组合的收益率。

在基金投资过程中，行业配置方案建立在整个投研团队的研究支持基础之上，投资决策委员会负责制定行业配置方案，基金经理负责执行行业配置方案，并进行相应的反馈。

（3）个股精选策略

遵循“防御”或者“进取”的投资取向，依据主题配置策略与行业配置策略，本基金在各行业内配置相应的投资标的。

本基金采用基本面加权的方法，建立了“金鹰企业综合评价模型”，该模型主要通过定量分析和定性分析相结合的方式来考察和筛选具有综合性比较优势的品种。定量方面，主要依据盈利能力、成长性、现金流状况、偿债能力、营运能力、估值等等；定性方面主要考虑：公司所处的行业、主营业务以及其它业务对于本基金拟重点配置的投资主题之切合程度与敏感性，所处的行业发展前景良好、主营业务具有持续成长的能力；企业具有核心竞争力，其资源储量、质量、品位在拥有相同资源的上市公司当中的相对排名，综合竞争力在行业内处于领先地位；具有良好的治理结构和财务健康度等；最后结合定量和定性研究以及实地调研，筛选出基本面健康、最具比较优势的个股作为本基金的核心投资标的，进行重点投资。

3、债券投资策略

在资本市场日益国际化的背景下，通过研判债券市场风险收益特征的国际化趋势和国内宏观经济景气周期引发的债券收益率的变化趋势，采取自上而下的策略构造组合。

债券类品种的投资，追求在严格控制风险的基础上获取稳健回报的原则。

（1）本基金采用目标久期管理法作为本基金债券类证券投资的核心策略。通过宏观经济分析平台把握市场利率水平的运行态势，作为组合久期选择的主要依据。

（2）结合收益率曲线变化的预测，采取期限结构配置策略，通过分析和情景测试，确定长、中、短期债券的投资比例。

（3）收益率利差策略是债券资产在类属间的主要配置策略。本基金在充分考虑不同类型债券流动性、税收以及信用风险等因素基础上，进行类属的配置，优化组合收益。

（4）在运用上述策略方法基础上，通过分析个券的剩余期限与收益率的配比状况、信用等级状况、流动性指标等因素，选择风险收益配比最合理的个券作为投资对象，并形成组合。本基金还将采取积极主动的策略，针对市场定价错误和回购套利机会等，在确定存在超额收益的情况下，积极把握市场机会。

（5）根据基金申购、赎回等情况，对投资组合进行流动性管理，确保基金资产的变现能力。

4、权证投资策略

本基金将因为上市公司进行增发、配售以及投资分离交易的可转换公司债券等原因被动获得权证，或者在进行套利交易、避险交易以及权证价值严重低估等情形下将投资权证。

本基金进行权证投资时，将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上，结合股价波动率等参数，运用数量化期权定价模型，确定其合理内在价值，从而构建套利交易、避险交易组合以及合同许可投资比例范围内的价值显著低估的权证品种。

九、业绩比较基准

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%

本基金采用沪深300指数作为股票投资部分的业绩比较基准，主要理由是：（1）沪深300指数是上海和深圳证券交易所第一次联合发布的、反映A股市场整体走势的指数，指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有较强的独立性、代表性和良好的流动性；（2）沪深300指数是一只符合国际标准的优良指数，该指数体现出与市场整体表现较高的相关度，且指数历史表现强于市场平均收益水平，风险调整后收益也较好，具有良好的投资价值；（3）沪深300指数编制方法的透明度较高；且具有较高的市场认同度和未来广泛使用的前景，使基金之间更易于比较。

本基金采用中证全债指数作为债券投资部分的业绩比较基准，主要理由是：（1）中证全债指数是一个综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。具有较广的覆盖面，成分债券的流动性较高；（2）中证全债指数是由中证指数有限公司编制和维护，中证指数有限公司提供的中证系列指数体系具有一定的优势和市场影响力；（3）中证全债指数编制方法的透明度较高；且具有较高的市场认同度和未来广泛使用的前景，使基金之间更易于比较。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十、风险收益特征

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的股票、债券、权证，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。股票资产占基金总资产的比例为60%-95%，其中，不低于80%的股票资产将配置于投资主题驱动下的行业与上市公司；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总资产的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%，权证投资的比例范围占基金资产净值的0%-3%。

因此，本基金风险收益特征从长期来看，其风险和预期收益均高于货币型基金、债券型基金。

十一、基金投资组合报告（未经审计）

本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。

本基金的托管人根据有关法律法规及本基金合同的规定，复核了本报告中的内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截止日为2017年3月31日，本报告中所列财务数据未经审计。

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	292,521,691.10	82.40
	其中：股票	292,521,691.10	82.40
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	47,559,972.67	13.40
7	其他各项资产	14,930,499.90	4.21
8	合计	355,012,163.67	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。

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

（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	181,279,412.39	51.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	90,832,490.41	25.92
F	批发和零售业	130,984.00	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	75,187.56	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	79,131.20	0.02
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	20,060,830.46	5.72
M	科学研究和技术服务业	16,930.16	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	46,724.92	0.01
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	292,521,691.10	83.47

（2）报告期末按行业分类的沪港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。

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	600068	葛洲坝	2,041,500	24,028,455.00	6.86
2	000065	北方国际	647,738	23,189,020.40	6.62
3	002051	中工国际	777,447	22,025,073.51	6.28
4	000928	中钢国际	926,333	21,305,659.00	6.08
5	000921	海信科龙	1,441,730	20,486,983.30	5.85
6	002035	华帝股份	612,800	20,455,264.00	5.84
7	000423	东阿阿胶	264,600	17,357,760.00	4.95
8	600750	江中药业	471,531	17,031,699.72	4.86
9	002384	东山精密	629,392	13,896,975.36	3.97
10	300136	信维通信	404,000	13,877,400.00	3.96

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、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。

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。

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。

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。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（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。

（2）本基金投资股指期货的投资政策

无

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（1）本期国债期货投资政策

无

（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。

（3）本期国债期货投资评价

无

11、投资组合报告附注

（1）本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

（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。

（3）其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	426,480.64
2	应收证券清算款	14,047,308.55
3	应收股利	-
4	应收利息	10,626.44
5	应收申购款	446,084.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,930,499.90

（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）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限股票。

（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。

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

（一）净值增长率比较

本基金合同生效日为2010年12月20日，基金合同生效以来（截至2017年3月31日）的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示：

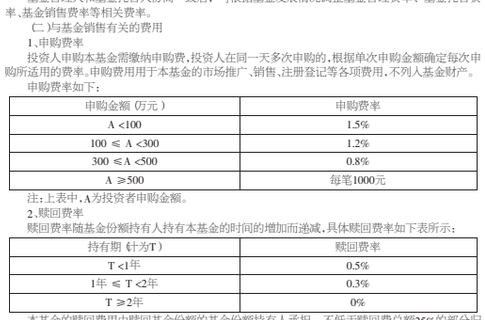
金鹰主题优势混合票型证券投资基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

阶段	份额净值增长率①（%）	份额净值增长率标准差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（%）
2010.12.20-2010.12.31	0.30%	0.23%	-2.37%	1.14%	2.67%	-0.91%
2011.1.1-2011.12.31	-35.39%	1.20%	-18.23%	0.97%	-17.16%	0.23%
2012.1.1-2012.12.31	-5.86%	1.34%	6.86%	0.96%	-12.73%	0.38%
2013.1.1-2013.12.31	11.48%	1.30%	-5.15%	1.05%	16.63%	0.25%
2014.1.1-2.14.6.30	-0.74%	1.17%	-4.57%	0.78%	3.83%	0.39%
2014.1.1-2014.12.31	18.24%	1.29%	39.13%	0.91%	-20.89%	0.38%
2015.1.1-2015.12.31	79.23%	2.93%	6.77%	1.86%	72.46%	1.07%
20.16.1.1-2016.12.31	-31.02%	2.00%	-7.71%	1.05%	-23.31%	0.95%
2017.1.1-2017.3.31	8.45%	0.85%	3.22%	0.39%	5.23%	0.46%
2010.12.20-2017.3.31	7.80%	1.76%	14.50%	1.16%	-6.70%	0.60%

（二）累计净值增长历史走势比较

本基金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如下图所示：

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2017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%

十三、基金的费用

（一）与基金运作相关的费用

1、与基金运作相关的费用种类

（1）基金管理人的管理费；
（2）基金托管人的托管费；
（3）因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）；
（4）基金合同生效以后的信息披露费用；
（5）基金份额持有人大会费用；
（6）基金合同生效以后的会计师费和律师费；
（7）基金资产的资金汇划费用；
（8）按照国家有关法律法规和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

2、与基金运作相关的费用之计提方法、计提标准和支付方式

（1）基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金财产净值的1.5%年费率计提。

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H=E×1.5%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

（2）基金托管人的基金托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。托管费的计算方法如下：

H=E×0.25%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“1、与基金运作相关的费用种类”中第（3）至第（7）项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

3、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金