金鹰科技创新股票型证券投资基金

2017 年第 3 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，在保证投资低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、金鹰添富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 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