金鹰行业优势股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年十月二十四日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月22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2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金鹰行业优势股票
基金主代码	210003
交易代码	210003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年7月1日
报告期末基金份额总额	928,667,965.67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,通过投资于优势行业当中的优势股票,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	本基金采用"自上而下"的投资方法,定性分析与定量分析并用,综合分析国内外政治经济环境、政策形势、金融市场走势、行业景气等因素,研判市场时机,结合货币市场、债券市场和股票市场估值等状况,进行资产配置及组合的构建,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,以最大限度地降低投资组合的风险、提高收益。
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%+中信标普国债指数收益率×25%。
风险收益特征	本基金为主动管理的股票型证券投资基金,属于证券投资基金中的风险和预期收益较高品种。一般情形下,其预期风险和收益均高于货币型基金、债券型基金和混合型基金。
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(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	53,943,318.67
2.本期利润	107,754,341.55
3.加权平均基金份额本期利润	0.1101
4.期末基金资产净值	777,543,717.42
5.期末基金份额净值	0.8373

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。

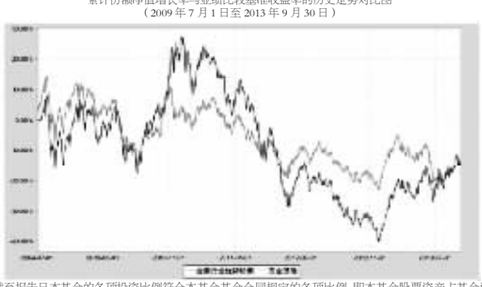
3.2 基金净值表现

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	14.73%	1.23%	7.27%	1.07%	7.46%	0.16%

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

金鹰行业优势股票型证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2009年7月1日至2013年9月30日)



注:1、截至报告日本基金的各项投资比例符合本基金基金合同规定的各项比例,即本基金股票资产占基金资产净值的比例为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净值的比例为5%-40%,权证投资的比例范围占基金资产净值的0-3%;
2、本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×75%+中信标普国债指数收益率×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		
何晓春	公司基金管理部总监,基金经理	2012-7-26	-	14年	何晓春先生,产业经济学博士,14年金融行业从业经验,曾任世纪证券有限责任公司江西分公司筹办组负责人等职,2011年4月加入金鹰基金管理有限公司,现任公司基金管理部副总监,本基金基金经理。

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、《金鹰行业优势股票型证券投资基金基金合同》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

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,必要时启用投资交易系统中的公平交易模块;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,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。

本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易的情况;与本公司管理的被动型投资组合发生的同日反向交易,未发生过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。

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

受美联储QE退出延期、国内政治性维持中性偏紧、IPO重启及十八届三中全会召开等因素的影响,我们对四季度市场表现偏于谨慎,仓位上维持中性水平,配置上将更多着眼于业绩确定性的公司及符合改革转型发展的公司。我们依然坚持估值和新兴成长标的并重的均衡配置策略,对参与主题投资保持谨慎。相比三季度,四季度我们对估值切换认真研究,对行业景气度依然向上的油气设备、环保、自动化设备、生物制药、信息设备、信息服务等细分行业公司,在估值合理的前提下,加大配置力度,并维持对银行、地产、装饰、医药等蓝筹标的仓位。

§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	694,295,967.45	88.51
	其中:股票	694,295,967.45	88.51
2	固定收益投资	10,110,000.00	1.29
	其中:债券	10,110,000.00	1.29
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	29,100,163.65	3.71
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	38,594,259.10	4.92
6	其他各项资产	12,321,353.65	1.57
7	合计	784,421,743.85	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	258,243,538.88	33.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,808,935.46	4.09
E	建筑业	63,053,938.00	8.11
F	批发和零售业	15,189,070.56	1.95
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	49,108,925.40	6.32
J	金融业	153,909,133.06	19.79
K	房地产业	121,805,626.09	15.67
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	1,176,800.00	0.15
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	694,295,967.45	89.29

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	600016	民生银行	7,386,033	70,610,475.48	9.08
2	000002	万 科A	7,487,761	68,363,257.93	8.79
3	002482	广田股份	3,038,744	63,053,938.00	8.11
4	002594	比亚迪	1,437,361	56,574,528.96	7.28
5	600887	伊利股份	1,237,233	55,279,570.44	7.11
6	600079	人福医药	1,384,717	44,920,219.48	5.78
7	000063	中兴通讯	2,480,000	41,168,000.00	5.29
8	600570	恒生电子	1,769,889	38,158,806.84	4.91
9	600837	海通证券	2,982,832	37,315,228.32	4.80
10	000651	格力电器	1,384,500	36,772,320.00	4.73

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	10,110,000.00	1.30
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	10,110,000.00	1.30

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	122198	12能新01	100,000	10,110,000.00	1.30
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

注:本基金本报告期末共持有一只债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证投资。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金报告期末无股指期货的持仓。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策
无。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本基金投资国债期货的投资政策
本基金本报告期无投资国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末无国债期货的持仓。

5.9.3 本基金投资国债期货的投资评价
无。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	304,608.64
2	应收证券清算款	11,491,595.97
3	应收股利	-
4	应收利息	431,033.11
5	应收申购款	94,115.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,321,353.65

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末无处于转股期的可转换债券明细。

5.10.5 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情况。

5.10.6 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	1,030,447,353.18
本报告期基金总申购份额	8,610,968.08
减:本报告期基金总赎回份额	110,390,355.59
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	928,667,965.67

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

单位:份

序号	交易方式	交易日期	交易金额	适用费率
1	赎回	2013-07-16	-14601176.39	0.0050
合计			-14601176.39	

注:根据《关于基金管理公司运用固有资金进行基金投资有关事项的通知》,我公司于2013年7月16日通过代销机构赎回本公司所持有的金鹰行业优势股票型证券投资基金18,156,150.70份基金份额,根据基金招募说明书的有关规定,赎回费率为0.5%。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无影响投资者决策的其他重要信息。

§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行业优势股票型证券投资基金发行及募集的文件。
2、《金鹰行业优势股票型证券投资基金基金合同》。
3、《金鹰行业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
广州市天河区体育西路189号城建大厦22-23层

9.3 查阅方式
投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。
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:4006-135-888,020-83936180
网址:http://www.gefund.com.cn

金鹰基金管理有限公司
二〇一三年十月二十四日

金鹰主题优势股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013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:二〇一三年十月二十四日

§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2013年10月22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2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金鹰主题优势股票
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	799,761,937.53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,以主题情景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%+中信标普国债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金为主动操作的股票型证券投资基金,属于证券投资基金中的高收益、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(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	37,708,711.98
2.本期利润	85,709,713.18
3.加权平均基金份额本期利润	0.1020
4.期末基金资产净值	577,659,595.91
5.期末基金份额净值	0.722

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	16.26%	1.36%	7.27%	1.07%	8.99%	0.29%

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

金鹰主题优势股票型证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2010年12月20日至2013年9月30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%+中信标普国债指数收益率×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		
冼鸿鹏	基金经理	2010-12-20	-	7	冼鸿鹏先生,数量经济学专业硕士,证券从业经历7年。曾任职于广发证券,2007年4月加入金鹰基金管理有限公司,先后担任行业研究员、研究组长、金鹰中小盘精选证券投资基金基金经理助理等职。现任本基金基金经理。
陈立	基金经理	2013-8-15	-	6	陈立,经济学硕士,证券从业经历6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。

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、《金鹰主题优势股票型证券投资基金基金合同》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,必要时启用投资交易系统中的公平交易模块;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,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。

本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易的情况;与本公司管理的被动型投资组合发生的同日反向交易,未发生过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。

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

2013年3季度,国内在经济平稳增长与调整结构之间进行一定的政策平衡,7、8月份国内宏观经济结束连续两个季度的下滑,阶段性出现一定的好转。同时,随着十八届三中全会4季度召开在即,市场深化改革的政策预期强烈。由此带来3季度股票市场的上涨,上证综指上涨9.9%,深成指上涨10.7%,中小板指数上涨17.5%%,创业板指数大幅上涨35.2%。传媒、商贸零售、计算机板块涨幅居前,市场主题投资表现活跃。

本基金在3季度重点配置了医药、食品、传媒等景气度较高的行业,是3季度收益的主要来源。基于市场风格转换的可能阶段性配置了地产、银行等板块,但收益甚微。另外本基金在一些重大主题上也进行了投资,取得一定成效。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年9月30日,基金份额净值为0.722元,本报告期份额净值增长率16.26%,同期业绩比较基准增长率为7.27%。

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4季度,国内投资驱动带来的经济反弹力度有限,深化改革、转型升级才能为经济发展带来中长期的持续动力。海外方面,美国经济仍然处于复苏中,QE退出时机有反复但不改退出趋势,投资者对此已有较充分的预期。4季度将重点关注十八届三中会会的改革举措,由此为明年的投资做好布局。中长期而言,本基金将坚持致力于发掘在经济转型升级重大主题下具有持续增长潜力的优秀公司重点投资。但是,在优质成长股短期估值较高的状况下,本基金将继续平衡估值和盈利增长确定性,动态调整其在基金配置中的比例。

§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	470,538,675.38	80.95
	其中:股票	470,538,675.38	80.95
2	固定收益投资	1,938,844.94	0.33
	其中:债券	1,938,844.94	0.33
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	51,800,000.00	8.91
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	43,860,989.66	7.55
6	其他各项资产	13,167,994.40	2.27
7	合计	581,306,504.38	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	231,281,859.17	40.04
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	9,173,675.64	1.59
G	交通运输、仓储和邮政业	9,822,249.05	1.70
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	90,973,955.38	15.75
J	金融业	28,674,784.59	4.96
K	房地产业	15,481,981.76	2.68
L	租赁和商务服务业	6,540,942.00	1.13
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	27,470,309.99	4.76
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	51,118,917.80	8.85
S	综合	-	-
	合计	470,538,675.38	81.46

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	002065	东华软件	1,135,118	37,322,679.84	6.46
2	600887	伊利股份	811,345	36,250,894.60	6.28
3	002566	益盛药业	1,473,108	34,647,500.16	6.00
4	300291	华录百纳	461,818	26,766,971.28	4.63
5	002236	大华股份	581,477	26,503,721.66	4.59
6	002317	众生药业	956,408	23,135,509.52	4.01
7	300027	华谊兄弟	211,404	16,464,143.52	2.85
8	600016	民生银行	1,700,979	16,261,359.24	2.82
9	600340	华夏幸福	476,662	15,481,981.76	2.68
10	002011	盾安环境	1,539,200	14,453,088.00	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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,938,844.94	0.34
8	其他	-	-
9	合计	1,938,844.94	0.34

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	128002	东华转债	15,602	1,938,844.94	0.34
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
本基金报告期末未持有资产支持债券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
本基金报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 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。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金报告期内未投资股指期货。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本基金投资国债期货的投资政策
本基金报告期内未投资国债期货。

5.9.2 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。

5.9.3 本基金投资国债期货的投资评价
无

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	560,112.67
2	应收证券清算款	12,596,988.71
3	应收股利	-
4	应收利息	9,412.89
5	应收申购款	1,480.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,167,994.40

5.10.4 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处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中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	002065	东华软件	37,322,679.84	6.46	因筹划发行股份购买资产重大事项而停牌
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

5.10.6 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	863,680,887.46
本报告期基金总申购份额	2,519,699.43
减:本报告期基金总赎回份额	66,438,649.36
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	799,761,937.53

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本基金管理人未投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期没有影响投资者决策的其他重要信息。

§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、更新的招股说明书及其他临时公告。

9.2 存放地点
广州市天河区体育西路189号城建大厦22-23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
二〇一三年十月二十四日

金鹰稳健成长股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013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:二〇一三年十月二十四日

§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2013年10月22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2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金鹰稳健成长股票
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	287,929,142.56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%+中信标普国债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金为主动操作的股票型证券投资基金,属于证券投资基金中的高收益、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(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	22,854,357.67
2.本期利润	23,029,201.43
3.加权平均基金份额本期利润	0.0771
4.期末基金资产净值	225,777,249.69
5.期末基金份额净值	0.784

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。

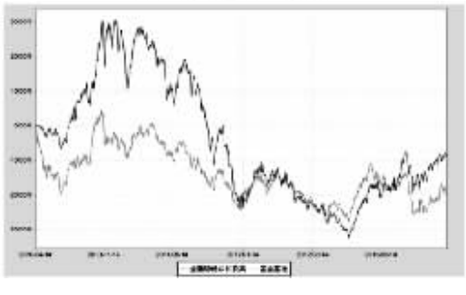
3.2 基金净值表现

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	10.89%	1.10%	7.27%	1.07%	3.62%	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

金鹰稳健成长股票型证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2010年4月14日至2013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%,权证投资的比例范围占基金资产净值的0~3%;
2、本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×75%+中信标普国债指数收益率×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		
冯文光	基金经理	2012-8