金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金

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:交通银行股份有限公司
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。

基金托管人交通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	金鹰红利价值混合
基金主代码	210002
交易代码	210002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年12月4日
报告期末基金份额总额	99,454,032.49份
投资目标	本基金通过对分红能力良好且长期投资价值突出的优质股票投资,为基金资产获取稳定的当期收益和长期增值。
投资策略	本基金采取积极主动式投资管理,通过积极的资产配置策略,深入研究、调研基础上的主动性证券选择和市场时机选择,在合理控制投资风险的前提下,最大限度地获取投资收益。本基金主要投资于分红能力良好且长期价值突出的优质企业,股票资产占基金资产净值比例为30%~80%;现金、债券资产、其他资产以及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20%~70%,其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;权证投资占基金资产净值的比例不超过3%。
业绩比较基准	中证红利指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。
风险收益特征	本基金风险收益特征从长期来看,其风险与预期收益高于债券型基金,低于股票型基金。
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	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(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	7,793,519.21
2.本期利润	16,351,807.97
3.加权平均基金份额本期利润	0.1502
4.期末基金资产净值	104,221,636.15
5.期末基金份额净值	1.0479

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.所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。

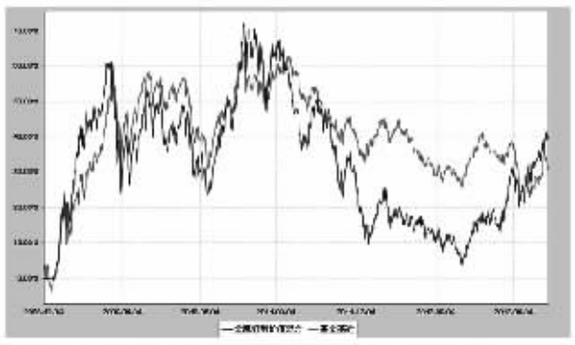
3.2 基金净值表现

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	16.42%	1.01%	5.37%	0.93%	11.05%	0.08%

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

金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金
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
(2008年12月4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已达到基金合同规定的各项比例,股票资产占基金资产比例为30%-80%;现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为20%-70%,其中因流动性管理导致的期末现金或者到期日在一年以内的政府债券低于基金资产净值的5%的情况以及时调整回复;权证投资占基金资产净值的比例不超过3%。2.本基金的业绩比较基准为:中证红利指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。

§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		
朱丹	基金经理	2011-6-11	-	7	朱丹女士,金融学硕士,曾任职于深圳晨星咨询公司,2007年5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、基金经理助理等职,现任本基金基金经理以及金鹰中小盘精选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、《金鹰红利价值灵活配置混合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

2013年3季度市场震荡上行,中小股票表现依旧活跃。上证综指涨9.88%,深证成指涨10.66%,中小盘指数上涨17.46%,创业板指数上涨35.21%。三季度行情略超市场预期,除传媒保持强势外,商贸零售板块也在苏宁云商的带领下后来居上。由于央行及时提供资金,九月底市场资金面不明显紧张,市场也再未出现像六月底的系统性下跌。

本基金三季度维持中等仓位,主要持有通信、医药以及光伏等行业,其余仓位配置仍以自下而上的个股为主。

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1.0479元,本报告期份额净值增长率为16.42%,同期业绩比较基准收益率为5.37%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从三季度看,经济复苏情况超市场预期,但市场并不确定经济已经企稳回升,房地产投资、汽车销售和进出口等指标都有较密切跟踪观察,从三季度市场走势来看,资本市场继续认可经济转型方向的股票。

三季度的行情明显超出我们的预期,但我们对四季度的行情仍然持相对谨慎的看法。今年前三季度的上涨中,一些股票的估值已经呈现较明显的泡沫。IPO放开是大概率的事情,对中小盘股票短期肯定会有冲击。本基金四季度季度计划维持偏低仓位,较多持有通信,光伏和医药等行业。

§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	66,390,488.19	62.71
	其中:股票	66,390,488.19	62.71
2	固定收益投资	1,252,193.37	1.18
	其中:债券	1,252,193.37	1.18
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	31,500,000.00	29.75
	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	2,235,918.60	2.11
6	其他各项资产	4,486,169.36	4.24
7	合计	105,864,769.52	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	50,759,301.40	48.70
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	-	-
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	8,967,846.74	8.60
J	金融业	-	-
K	房地产业	5,053,875.70	4.85
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	1,606,544.35	1.54
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	2,920.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	66,390,488.19	63.70

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	002129	中环股份	307,406	7,639,039.10	7.33
2	002480	新筑股份	382,700	6,161,470.00	5.91
3	600894	广日股份	527,529	5,702,588.49	5.47
4	300030	阳普医疗	316,673	4,569,591.39	4.38
5	000063	中兴通讯	256,106	4,251,359.60	4.08
6	002285	世联地产	268,086	4,007,885.70	3.85
7	300050	世纪鼎利	243,532	3,579,920.40	3.43
8	002364	中恒电气	240,060	3,380,044.80	3.24
9	002065	东华软件	96,367	3,168,546.96	3.04
10	002249	大洋电机	228,300	2,390,301.00	2.29

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	1,012,354.20	0.97
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	239,839.17	0.23
8	其他	-	-
9	合计	1,252,193.37	1.20

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	010303	03国债(3)	10,530	1,012,354.20	0.97
2	128002	东华转债	1,930	239,839.17	0.23
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

注:本基金报告期末持有2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。

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

本基金本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

本报告期末无投资国债期货。

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 本报告期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 本基金本报告期内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	88,565.94
2	应收证券清算款	4,329,872.18
3	应收股利	-
4	应收利息	26,630.55
5	应收申购款	41,100.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,486,169.36

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	600894	广日股份	5,702,588.49	5.47	因重大事项于2013年9月25日停牌,已于2013年10月9日复牌。
2	002065	东华软件	3,168,546.96	3.04	因筹划重大事项于2013年8月23日停牌。
3	002249	大洋电机	2,390,301.00	2.29	因刊登重大事项于2013年9月24日停牌。本股已于2013年10月15日复牌。
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	119,240,650.87
本报告期基金总申购份额	2,215,523.51
减:本报告期基金总赎回份额	22,002,141.89
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	99,454,032.49

§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	-8591373.79	0.0050
合计			-8591373.79	

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红利价值灵活配置混合型证券投资基金8,988,673.14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红利价值灵活配置混合型证券投资基金发行及募集的文件。

2.《金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

3.《金鹰红利价值灵活配置混合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

金鹰成份股优选证券投资基金

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	金鹰成份优选混合
基金主代码	210001
交易代码	210001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年6月16日
报告期末基金份额总额	1,654,637,058.15份
投资目标	通过资产配置和对投资组合的动态调整,在控制投资组合风险的前提下,实现基金的中长期资本增值和获取适当、稳定的现金收益。
投资策略	本基金通过综合分析宏观经济、政策及证券市场的现状和发展趋势的基础上,合理预期各类到资产收益率和风险水平,并据此构建一个包括主要投资于上证180指数成份股和深证100指数成份股、国债等债券及现金等资产的投资组合,适时调整组合中各类到资产的比例,在控制投资组合风险的前提下,实现基金资产的中长期增值和获取适当、稳定的当前收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为75%的成份股加权指数的收益率加上25%的中信标普国债指数的收益率。 成份股加权指数为上证180指数和深证100指数按其各自成份股流通市值加权平均值。
风险收益特征	本基金为风险水平中等偏下、收益水平适中的证券投资基金,基金的收益目标设为α值大于零、风险目标为β值的目标区间为[0.75,1.1]。
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	6,803,541.14
2.本期利润	131,858,522.82
3.加权平均基金份额本期利润	0.0776
4.期末基金资产净值	1,098,484,657.21
5.期末基金份额净值	0.6639

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;

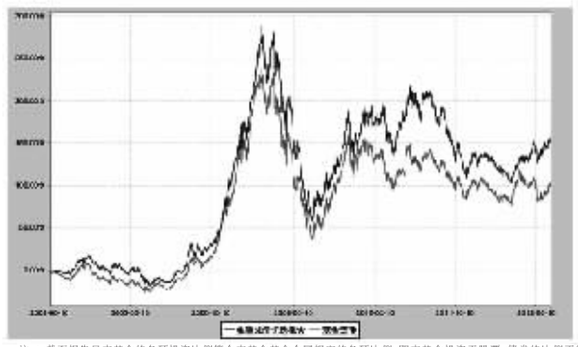
3.2 基金净值表现

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	13.25%	0.92%	7.07%	1.09%	6.18%	-0.17%

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

金鹰成份股优选证券投资基金
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
(2003年6月16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,即本基金投资于股票、债券的比例不得低于基金资产总值的80%,投资于国家债券的比例不得低于基金资产净值的20%;

2.本基金的业绩比较基准为:75%的成份股加权指数的收益率加上25%的中信标普国债指数的收益率。

§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		
林华昱	基金经理	2011-3-1	-	11	林华昱先生2002年10月进入金鹰基金管理有限公司,2004年后开始从事投资研究等工作,先后任交易员、交易主管、基金经理助理等职。2009年10月12日开始担任金鹰成份股优选证券投资基金基金经理助理,协助基金经理管理金鹰成份股优选证券投资基金,现任本基金基金经理以及金鹰中证500指数分级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、《金鹰成份股优选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

2013年第三季度,宏观经济面,经济增长稳中回升,固定资产投资与消费,出口增速同时回升。货币环境相对宽松,社会融资扩张较快,通胀与房价上涨压力加大。相应A股市场表现上,上证综指震荡走高,反弹至2200点附近遭受阻力,全季上涨9.88%,板块表现上,传媒、商业、旅游、信息设备和交通运输等板块领涨,有色、煤炭、钢铁和化工等涨幅靠后,反映对经济增速回升持续性仍然偏悲观。

本季度,关注到经济走稳信号明确,明显加大本基金股票仓位,板块配置方面,增持以石化化工为代表的周期性行业配置,增持信息设备、大众消费品、旅游、医药等行业相关个股,提高仓位与行业配置等契合市场热点,成为跑赢基准关键。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止2013年9月30日,基金份额净值为0.6639元,本报告期份额净值增长率为13.25%,同期业绩比较基准增长率为7.07%。

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2013年第四季度,从经济同步指标观察经济增长能否连续两个季度稳中回升,是预判行情深度的重要窗口。

投资策略上,继续在4G投资、海上油田开发、医药及大众消费品等行业寻找稳定成长、弱化经济周期干扰的个股,并关注铁路、环保、土地等行业制度改革红利与成长,同时密切关注经济回升可持续性而决定周期性行业的配置。

最后需要关注的是,通胀与房价上涨压力对货币政策的约束、美国量化宽松货币政策退出等对流动性的冲击,以及经济增速下滑等带来的系统性风险。

§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	832,307,991.35	75.38
	其中:股票	832,307,991.35	75.38
2	固定收益投资	229,009,000.00	20.74
	其中:债券	229,009,000.00	20.74
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	20,000,150.00	1.81
	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	20,593,571.57	1.86
6	其他各项资产	2,306,559.15	0.21
7	合计	1,104,217,272.07	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	29,664,000.00	2.70
B	采矿业	122,945,385.32	11.19
C	制造业	549,482,592.91	50.02
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	28,025,221.50	2.55
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	39,074,660.34	3.56
K	房地产业	13,399,651.60	1.22
L	租赁和商务服务业	49,716,479.68	4.53
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	832,307,991.35	75.77

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	000625	长安汽车	7,002,245	72,123,123.50	6.57
2	600597	光明乳业	3,007,005	70,935,247.95	6.46
3	600498	烽火通信	3,529,141	65,500,856.96	5.96
4	600583	海油工程	8,100,000	59,940,000.00	5.46
5	002570	贝因美	1,199,919	49,916,630.40	4.54
6	601888	中国国旅	1,199,722	49,716,479.68	4.53
7	600073	上海梅林	3,921,860	42,120,776.40	3.83
8	600196	复星医药	2,999,941	41,669,180.49	3.79
9	601808	中海油服	2,049,926	36,365,687.24	3.31
10	600600	青岛啤酒	799,975	34,278,928.75	3.12

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	158,561,000.00	14.43
2	央行票据	-	-
3	金融债券	70,448,000.00	6.41
	其中:政策性金融债	70,448,000.00	6.41
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	229,009,000.00	20.85

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	080216	08国开16	700,000	70,448,000.00	6.41
2	130002	13附息国债02	500,000	49,895,000.00	4.54
3	019013	10国债13	500,000	48,810,000.00	4.44
4	130014	13附息国债14	300,000	30,006,000.00	2.73
5	019113	11国债13	300,000	29,850,000.00	2.72

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

本基金本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 本基金本报告期内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	186,953.92
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,102,205.23
5	应收申购款	17,400.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,306,559.15

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存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末十名股票中不存在流通受限的情况。

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	1,726,434,250.10
本报告期基金总申购份额	4,000,461.39
减:本报告期基金总赎回份额	75,797,653.34
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,654,637,058.15

§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成份股优选证券投资基金发行及募集的文件。

2.《金鹰成份股优选证券投资基金基金合同》。

3.《金鹰成份股优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

金鹰中小盘精选证券投资基金

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:交通银行股份有限公司
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。

基金托管人交通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	1,768,606,085.22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%+中信标普国债指数收益率*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(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	30,111,352.73
2.本期利润	107,119,157.81
3.加权平均基金份额本期利润	0.0578
4.期末基金资产净值	1,467,017,512.15
5.期末基金份额净值	0.8295

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	7.50%	0.99%	12.32%	1.03%	-4.82%	-0.04%

3.2.2 自基