

金鷹中证500 指数分级证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6月30日

基金管理人:金鷹基金管理有限公司
基金管理人:交通银行股份有限公司
报告披露日期:二〇一四年七月十九日

1.1 重要提示
基金管理人承诺基金及基金财产不存在虚假记载、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。
基金管理人交通银行股份有限公司根据中国证监会规定,于2014年7月15日发布了本基金的财务数据、净值表现和投资组合报告。

1.2 基金产品概况
基金名称:金鹰中证500指数分级
基金代码:162107
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日期:2012年8月1日

1.3 主要财务指标和基金净值表现
1.1 本期已实现收益:482,954.79
1.2 本期利润:190,460.05
1.3 加权平均基金份额本期利润:0.0115
1.4 期末基金资产净值:16,230,820.67
1.5 期末基金份额净值:1.0217

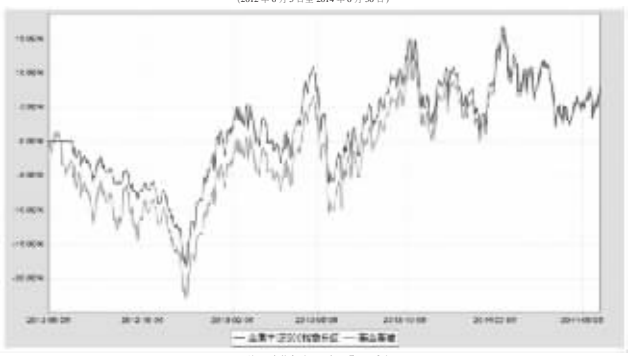


图1:本基金自成立以来的基金资产净值和基金份额净值走势图

2.1 报告期内本基金的投资策略
本基金为股票指数基金,以跟踪指数为目标,力求基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。
本基金以中证500指数成分股在报告期内的权重为基准,在综合考虑跟踪误差和成份股流动性等因素的基础上,采用动态权重法与分层抽样相结合的策略构建投资组合,并根据组合内股票停牌或出现流动性不足等情况时,对基金资产进行适当调整。

2.2 报告期内本基金的投资组合报告
截至2014年6月30日,本基金投资组合符合基金合同约定,本基金投资组合符合基金合同约定,本基金投资组合符合基金合同约定。
截至2014年6月30日,本基金投资组合符合基金合同约定,本基金投资组合符合基金合同约定,本基金投资组合符合基金合同约定。

2.3 报告期内本基金的风险管理
本基金为股票指数基金,跟踪误差是衡量基金跟踪标的偏离程度的重要指标。本基金通过跟踪误差的分解,对跟踪误差的来源进行分析和控制,并采取相应的风险控制措施,确保基金跟踪标的的准确性。

2.4 基金管理人承诺
基金管理人承诺基金及基金财产不存在虚假记载、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。
基金管理人交通银行股份有限公司根据中国证监会规定,于2014年7月15日发布了本基金的财务数据、净值表现和投资组合报告。

基金管理人:金鷹基金管理有限公司
基金管理人:交通银行股份有限公司
报告披露日期:二〇一四年七月十九日

1.1 重要提示
基金管理人承诺基金及基金财产不存在虚假记载、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。
基金管理人交通银行股份有限公司根据中国证监会规定,于2014年7月15日发布了本基金的财务数据、净值表现和投资组合报告。

1.2 基金产品概况
基金名称:金鷹主题优势股票型
基金代码:121005
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日期:2010年12月20日

1.3 主要财务指标和基金净值表现
1.1 本期已实现收益:312,003,909.93
1.2 本期利润:6,008,413.41
1.3 加权平均基金份额本期利润:0.0071
1.4 期末基金资产净值:555,910,976.56
1.5 期末基金份额净值:0.675



图1:本基金自成立以来的基金资产净值和基金份额净值走势图

2.1 报告期内本基金的投资策略
本基金为股票型基金,主要投资于具有良好发展前景的上市公司股票,追求基金资产的长期增值。
本基金采用自上而下的投资策略,在宏观、中观和微观三个层面进行分析和决策,构建投资组合,并根据市场变化进行动态调整。

2.2 报告期内本基金的投资组合报告
截至2014年6月30日,本基金投资组合符合基金合同约定,本基金投资组合符合基金合同约定,本基金投资组合符合基金合同约定。

基金管理人:金鷹基金管理有限公司
基金管理人:交通银行股份有限公司
报告披露日期:二〇一四年七月十九日

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

金鷹中证技术领先指数增强型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6月30日

基金管理人:金鷹基金管理有限公司
基金管理人:交通银行股份有限公司
报告披露日期:二〇一四年七月十九日

1.1 重要提示
基金管理人承诺基金及基金财产不存在虚假记载、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。
基金管理人交通银行股份有限公司根据中国证监会规定,于2014年7月15日发布了本基金的财务数据、净值表现和投资组合报告。

1.2 基金产品概况
基金名称:金鷹中证技术领先指数增强型
基金代码:121006
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日期:2010年6月29日

1.3 主要财务指标和基金净值表现
1.1 本期已实现收益:1,447,660.56
1.2 本期利润:1,344,187.27
1.3 加权平均基金份额本期利润:0.0196
1.4 期末基金资产净值:63,126,201.11
1.5 期末基金份额净值:0.9344



图1:本基金自成立以来的基金资产净值和基金份额净值走势图

2.1 报告期内本基金的投资策略
本基金为股票指数基金,以跟踪指数为目标,力求基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。
本基金以中证技术领先指数成分股在报告期内的权重为基准,在综合考虑跟踪误差和成份股流动性等因素的基础上,采用动态权重法与分层抽样相结合的策略构建投资组合,并根据组合内股票停牌或出现流动性不足等情况时,对基金资产进行适当调整。

2.2 报告期内本基金的投资组合报告
截至2014年6月30日,本基金投资组合符合基金合同约定,本基金投资组合符合基金合同约定,本基金投资组合符合基金合同约定。

2.3 报告期内本基金的风险管理
本基金为股票指数基金,跟踪误差是衡量基金跟踪标的偏离程度的重要指标。本基金通过跟踪误差的分解,对跟踪误差的来源进行分析和控制,并采取相应的风险控制措施,确保基金跟踪标的的准确性。

2.4 基金管理人承诺
基金管理人承诺基金及基金财产不存在虚假记载、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。
基金管理人交通银行股份有限公司根据中国证监会规定,于2014年7月15日发布了本基金的财务数据、净值表现和投资组合报告。

基金管理人:金鷹基金管理有限公司
基金管理人:交通银行股份有限公司
报告披露日期:二〇一四年七月十九日

1.1 重要提示
基金管理人承诺基金及基金财产不存在虚假记载、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。
基金管理人交通银行股份有限公司根据中国证监会规定,于2014年7月15日发布了本基金的财务数据、净值表现和投资组合报告。

1.2 基金产品概况
基金名称:金鷹主题优势股票型
基金代码:121005
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日期:2010年12月20日

1.3 主要财务指标和基金净值表现
1.1 本期已实现收益:312,003,909.93
1.2 本期利润:6,008,413.41
1.3 加权平均基金份额本期利润:0.0071
1.4 期末基金资产净值:555,910,976.56
1.5 期末基金份额净值:0.675



图1:本基金自成立以来的基金资产净值和基金份额净值走势图

2.1 报告期内本基金的投资策略
本基金为股票型基金,主要投资于具有良好发展前景的上市公司股票,追求基金资产的长期增值。
本基金采用自上而下的投资策略,在宏观、中观和微观三个层面进行分析和决策,构建投资组合,并根据市场变化进行动态调整。

2.2 报告期内本基金的投资组合报告
截至2014年6月30日,本基金投资组合符合基金合同约定,本基金投资组合符合基金合同约定,本基金投资组合符合基金合同约定。

基金管理人:金鷹基金管理有限公司
基金管理人:交通银行股份有限公司
报告披露日期:二〇一四年七月十九日

1.1 重要提示
基金管理人承诺基金及基金财产不存在虚假记载、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。
基金管理人交通银行股份有限公司根据中国证监会规定,于2014年7月15日发布了本基金的财务数据、净值表现和投资组合报告。

1.2 基金产品概况
基金名称:金鷹中证技术领先指数增强型
基金代码:121006
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日期:2010年6月29日

1.3 主要财务指标和基金净值表现
1.1 本期已实现收益:1,447,660.56
1.2 本期利润:1,344,187.27
1.3 加权平均基金份额本期利润:0.0196
1.4 期末基金资产净值:63,126,201.11
1.5 期末基金份额净值:0.9344

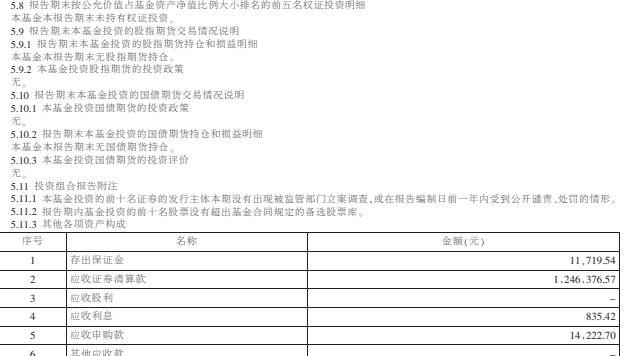


图1:本基金自成立以来的基金资产净值和基金份额净值走势图

2.1 报告期内本基金的投资策略
本基金为股票指数基金,以跟踪指数为目标,力求基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。
本基金以中证技术领先指数成分股在报告期内的权重为基准,在综合考虑跟踪误差和成份股流动性等因素的基础上,采用动态权重法与分层抽样相结合的策略构建投资组合,并根据组合内股票停牌或出现流动性不足等情况时,对基金资产进行适当调整。

2.2 报告期内本基金的投资组合报告
截至2014年6月30日,本基金投资组合符合基金合同约定,本基金投资组合符合基金合同约定,本基金投资组合符合基金合同约定。

2.3 报告期内本基金的风险管理
本基金为股票指数基金,跟踪误差是衡量基金跟踪标的偏离程度的重要指标。本基金通过跟踪误差的分解,对跟踪误差的来源进行分析和控制,并采取相应的风险控制措施,确保基金跟踪标的的准确性。

2.4 基金管理人承诺
基金管理人承诺基金及基金财产不存在虚假记载、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。
基金管理人交通银行股份有限公司根据中国证监会规定,于2014年7月15日发布了本基金的财务数据、净值表现和投资组合报告。

基金管理人:金鷹基金管理有限公司
基金管理人:交通银行股份有限公司
报告披露日期:二〇一四年七月十九日

1.1 重要提示
基金管理人承诺基金及基金财产不存在虚假记载、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。
基金管理人交通银行股份有限公司根据中国证监会规定,于2014年7月15日发布了本基金的财务数据、净值表现和投资组合报告。

1.2 基金产品概况
基金名称:金鷹主题优势股票型
基金代码:121005
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日期:2010年12月20日

1.3 主要财务指标和基金净值表现
1.1 本期已实现收益:312,003,909.93
1.2 本期利润:6,008,413.41
1.3 加权平均基金份额本期利润:0.0071
1.4 期末基金资产净值:555,910,976.56
1.5 期末基金份额净值:0.675

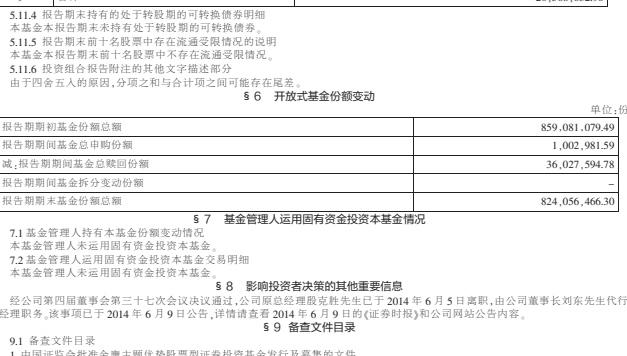


图1:本基金自成立以来的基金资产净值和基金份额净值走势图

2.1 报告期内本基金的投资策略
本基金为股票型基金,主要投资于具有良好发展前景的上市公司股票,追求基金资产的长期增值。
本基金采用自上而下的投资策略,在宏观、中观和微观三个层面进行分析和决策,构建投资组合,并根据市场变化进行动态调整。

2.2 报告期内本基金的投资组合报告
截至2014年6月30日,本基金投资组合符合基金合同约定,本基金投资组合符合基金合同约定,本基金投资组合符合基金合同约定。