

金鷹核心资源股票型证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014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:二〇一四年十月二十四日

1.1 重要提示
基金管理人及基金托管人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。
基金管理人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2014年10月21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,也不保证基金份额持有人本金不受损失或本金不受损失。
基金的投资有风险,投资者在作出投资决策前请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。
本报告日期为2014年7月1日起至9月30日止。

基金简称	金鹰核心资源股票
基金代码	310009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年5月23日
报告期末基金份额总额	10,826,646.78份
投资目标	本基金为追求长期增值目的,以深入的基本面分析为基础,通过投资于具有成长性的个股,充分挖掘个股的成长潜力,分享中国宏观经济成长及个股成长带来的长期增值收益。
投资策略	本基金采用“自上而下”的分析框架,综合宏观环境、证券市场、政策预期等因素的影响,重点把握宏观经济中周期轮动的机会,确定行业、个股的投资方向,并通过对行业、个股的深入研究与估值分析,精选具有长期增值潜力的个股,构建投资组合,并随着各阶段宏观经济环境的变化,适时调整投资组合,谋求基金资产的长期增值收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*75%+中债国债综合收益率*25%
风险收益特征	本基金为追求长期增值目的股票型基金,属于证券投资基金中较高风险、较高收益的品种,其预期风险和预期收益高于货币型基金、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	交通银行股份有限公司

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)	单位:人民币元
1.本期实现收益	1,273,318.84	
2.本期利润	1,544,019.11	
3.本期公允价值变动损益	0.2232	
4.期末基金净值	21,628,794.34	
5.期末基金份额净值	1.98	

注:1.本期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.本期利润为本期实现收益加上公允价值变动收益,扣除相关费用后的余额;
3.公允价值变动损益指由于公允价值变动而产生的损益;
4.期末基金净值指期末基金份额净值乘以期末基金份额总额。

3.2 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)	单位:人民币元
1.本期实现收益	1,273,318.84	
2.本期利润	1,544,019.11	
3.本期公允价值变动损益	0.2232	
4.期末基金净值	21,628,794.34	
5.期末基金份额净值	1.98	

注:1.本期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.本期利润为本期实现收益加上公允价值变动收益,扣除相关费用后的余额;
3.公允价值变动损益指由于公允价值变动而产生的损益;
4.期末基金净值指期末基金份额净值乘以期末基金份额总额。

3.3 基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比

阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准③	①-③	②-③
过去三个月	23.82%	10.0%	10.0%	0.67%	13.52%
过去六个月	32.23%	16.0%	16.0%	0.87%	0.36%

注:1.本基金投资于2012年7月23日正式成立。
2.本基金各阶段对比期间前资产净值与基金净值之比均为99%-99%,基金净值增长率与业绩比较基准收益率之差为-0.01%、-0.01%、-0.01%、-0.01%、-0.01%、-0.01%。
3.本基金各阶段对比期间前资产净值与基金净值之比均为99%-99%,基金净值增长率与业绩比较基准收益率之差为-0.01%、-0.01%、-0.01%、-0.01%、-0.01%、-0.01%。

4.1 基金管理人(或基金管理人)简介

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:二〇一四年十月二十四日

5.1 重要提示

基金管理人及基金托管人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。
基金管理人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2014年10月21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,也不保证基金份额持有人本金不受损失或本金不受损失。
基金的投资有风险,投资者在作出投资决策前请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。
本报告日期为2014年7月1日起至9月30日止。

5.2 基金产品概况

基金简称	金鹰中证500指数
基金代码	310010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月15日
报告期末基金份额总额	11,851,986.68份
投资目标	本基金为跟踪标的指数,以跟踪标的指数为目标,力争实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.5%,年化跟踪误差不超过2%。
投资策略	本基金以中证500指数成份股中的流动性较好的股票为主要投资对象,综合考虑成份股的流动性、可投资性、估值水平等因素,构建一个贴近标的指数表现的股票组合,并根据标的指数成份股及其权重,对投资组合进行动态调整,力求实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.5%,年化跟踪误差不超过2%。
业绩比较基准	中证500指数收益率*95%+银行活期存款利率*5%
风险收益特征	本基金为跟踪标的指数的被动型股票基金,属于证券投资基金中较高风险、较高收益的品种,其预期风险和预期收益高于货币型基金、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	交通银行股份有限公司

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)	单位:人民币元
1.本期实现收益	934,997.94	
2.本期利润	3,125,603.17	
3.本期公允价值变动损益	0.2321	
4.期末基金净值	14,877,699.19	
5.期末基金份额净值	1.2551	

注:1.本期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,本期利润为本期实现收益加上公允价值变动收益,扣除相关费用后的余额;
2.公允价值变动损益指由于公允价值变动而产生的损益;
3.期末基金净值指期末基金份额净值乘以期末基金份额总额。

3.2 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)	单位:人民币元
1.本期实现收益	934,997.94	
2.本期利润	3,125,603.17	
3.本期公允价值变动损益	0.2321	
4.期末基金净值	14,877,699.19	
5.期末基金份额净值	1.2551	

注:1.本期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,本期利润为本期实现收益加上公允价值变动收益,扣除相关费用后的余额;
2.公允价值变动损益指由于公允价值变动而产生的损益;
3.期末基金净值指期末基金份额净值乘以期末基金份额总额。

3.3 基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比

阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准③	①-③	②-③
过去三个月	22.86%	0.96%	23.88%	-0.91%	-0.01%
过去六个月	32.23%	1.92%	33.25%	-1.02%	-0.01%

注:1.本基金投资于2012年6月15日正式成立。
2.本基金各阶段对比期间前资产净值与基金净值之比均为99%-99%,基金净值增长率与业绩比较基准收益率之差为-0.01%、-0.01%、-0.01%、-0.01%、-0.01%、-0.01%。
3.本基金各阶段对比期间前资产净值与基金净值之比均为99%-99%,基金净值增长率与业绩比较基准收益率之差为-0.01%、-0.01%、-0.01%、-0.01%、-0.01%、-0.01%。

4.1 基金管理人(或基金管理人)简介

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:二〇一四年十月二十四日

5.1 重要提示

基金管理人及基金托管人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。
基金管理人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2014年10月21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,也不保证基金份额持有人本金不受损失或本金不受损失。
基金的投资有风险,投资者在作出投资决策前请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。
本报告日期为2014年7月1日起至9月30日止。

5.2 基金产品概况

基金简称	金鹰中证500指数
基金代码	310010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月15日
报告期末基金份额总额	11,851,986.68份
投资目标	本基金为跟踪标的指数,以跟踪标的指数为目标,力争实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.5%,年化跟踪误差不超过2%。
投资策略	本基金以中证500指数成份股中的流动性较好的股票为主要投资对象,综合考虑成份股的流动性、可投资性、估值水平等因素,构建一个贴近标的指数表现的股票组合,并根据标的指数成份股及其权重,对投资组合进行动态调整,力求实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.5%,年化跟踪误差不超过2%。
业绩比较基准	中证500指数收益率*95%+银行活期存款利率*5%
风险收益特征	本基金为跟踪标的指数的被动型股票基金,属于证券投资基金中较高风险、较高收益的品种,其预期风险和预期收益高于货币型基金、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	交通银行股份有限公司

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)	单位:人民币元
1.本期实现收益	934,997.94	
2.本期利润	3,125,603.17	
3.本期公允价值变动损益	0.2321	
4.期末基金净值	14,877,699.19	
5.期末基金份额净值	1.2551	

注:1.本期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,本期利润为本期实现收益加上公允价值变动收益,扣除相关费用后的余额;
2.公允价值变动损益指由于公允价值变动而产生的损益;
3.期末基金净值指期末基金份额净值乘以期末基金份额总额。

3.2 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)	单位:人民币元
1.本期实现收益	934,997.94	
2.本期利润	3,125,603.17	
3.本期公允价值变动损益	0.2321	
4.期末基金净值	14,877,699.19	
5.期末基金份额净值	1.2551	

注:1.本期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,本期利润为本期实现收益加上公允价值变动收益,扣除相关费用后的余额;
2.公允价值变动损益指由于公允价值变动而产生的损益;
3.期末基金净值指期末基金份额净值乘以期末基金份额总额。

3.3 基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比

阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准③	①-③	②-③
过去三个月	22.86%	0.96%	23.88%	-0.91%	-0.01%
过去六个月	32.23%	1.92%	33.25%	-1.02%	-0.01%

注:1.本基金投资于2012年6月15日正式成立。
2.本基金各阶段对比期间前资产净值与基金净值之比均为99%-99%,基金净值增长率与业绩比较基准收益率之差为-0.01%、-0.01%、-0.01%、-0.01%、-0.01%、-0.01%。
3.本基金各阶段对比期间前资产净值与基金净值之比均为99%-99%,基金净值增长率与业绩比较基准收益率之差为-0.01%、-0.01%、-0.01%、-0.01%、-0.01%、-0.01%。

4.1 基金管理人(或基金管理人)简介

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:二〇一四年十月二十四日

5.1 重要提示

基金管理人及基金托管人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。
基金管理人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2014年10月21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,也不保证基金份额持有人本金不受损失或本金不受损失。
基金的投资有风险,投资者在作出投资决策前请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。
本报告日期为2014年7月1日起至9月30日止。

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	-	-
B	矿业	-	-
C	制造业	10,945,278.78	84.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	662,568.00	2.80
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	信息技术、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	1,653,734.52	7.00
O	医药、健康和医药制造业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
S	合计	22,251,642.30	94.17

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	002514	宝通科技	116,244	1,809,200.52	7.91
2	600230	华锐风电	61,255	1,292,610.00	5.70
3	600891	银轮泵业	123,540	1,292,228.40	5.47
4	002041	巨化股份	117,300	1,283,077.00	5.31
5	000768	中航飞机	66,000	1,098,900.00	4.65
6	300055	三川股份	87,774	1,045,500.00	4.49
7	600182	华仪股份	64,800	1,043,452.00	4.42
8	002338	诺普信	18,931	1,020,911.99	4.27
9	600562	国电电力	24,900	1,006,640.00	4.32
10	300274	阳光电源	50,800	1,000,760.00	4.24

注:1.本基金投资于2012年7月23日正式成立。
2.本基金各阶段对比期间前资产净值与基金净值之比均为99%-99%,基金净值增长率与业绩比较基准收益率之差为-0.01%、-0.01%、-0.01%、-0.01%、-0.01%、-0.01%。
3.本基金各阶段对比期间前资产净值与基金净值之比均为99%-99%,基金净值增长率与业绩比较基准收益率之差为-0.01%、-0.01%、-0.01%、-0.01%、-0.01%、-0.01%。

4.1 基金管理人(或基金管理人)简介

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:二〇一四年十月二十四日

5.1 重要提示

基金管理人及基金托管人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。
基金管理人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2014年10月21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,也不保证基金份额持有人本金不受损失或本金不受损失。
基金的投资有风险,投资者在作出投资决策前请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。
本报告日期为2014年7月1日起至9月30日止。

5.2 基金产品概况

基金简称	金鹰中证500指数
基金代码	310010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月15日
报告期末基金份额总额	11,851,986.68份
投资目标	本基金为跟踪标的指数,以跟踪标的指数为目标,力争实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.5%,年化跟踪误差不超过2%。
投资策略	本基金以中证500指数成份股中的流动性较好的股票为主要投资对象,综合考虑成份股的流动性、可投资性、估值水平等因素,构建一个贴近标的指数表现的股票组合,并根据标的指数成份股及其权重,对投资组合进行动态调整,力求实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.5%,年化跟踪误差不超过2%。
业绩比较基准	中证500指数收益率*95%+银行活期存款利率*5%
风险收益特征	本基金为跟踪标的指数的被动型股票基金,属于证券投资基金中较高风险、较高收益的品种,其预期风险和预期收益高于货币型基金、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	交通银行股份有限公司

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)	单位:人民币元
1.本期实现收益	934,997.94	
2.本期利润	3,125,603.17	
3.本期公允价值变动损益	0.2321	
4.期末基金净值	14,877,699.19	
5.期末基金份额净值	1.2551	

注:1.本期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,本期利润为本期实现收益加上公允价值变动收益,扣除相关费用后的余额;
2.公允价值变动损益指由于公允价值变动而产生的损益;
3.期末基金净值指期末基金份额净值乘以期末基金份额总额。

3.2 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)	单位:人民币元
1.本期实现收益	934,997.94	
2.本期利润	3,125,603.17	
3.本期公允价值变动损益	0.2321	
4.期末基金净值	14,877,699.19	
5.期末基金份额净值	1.2551	

注:1.本期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,本期利润为本期实现收益加上公允价值变动收益,扣除相关费用后的余额;
2.公允价值变动损益指由于公允价值变动而产生的损益;
3.期末基金净值指期末基金份额净值乘以期末基金份额总额。

3.3 基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比

阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准③	①-③	②-③
过去三个月	22.86%	0.96%	23.88%	-0.91%	-0.01%
过去六个月	32.23%	1.92%	33.25%	-1.02%	-0.01%

注:1.本基金投资于2012年6月15日正式成立。
2.本基金各阶段对比期间前资产净值与基金净值之比均为99%-99%,基金净值增长率与业绩比较基准收益率之差为-0.01%、-0.01%、-0.01%、-0.01%、-0.01%、-0.01%。
3.本基金各阶段对比期间前资产净值与基金净值之比均为99%-99%,基金净值增长率与业绩比较基准收益率之差为-0.01%、-0.01%、-0.01%、-0.01%、-0.01%、-0.01%。

4.1 基金管理人(或基金管理人)简介

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:二〇一四年十月二十四日

5.1 重要提示

基金管理人及基金托管人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。
基金管理人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2014年10月21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,也不保证基金份额持有人本金不受损失或本金不受损失。
基金的投资有风险,投资者在作出投资决策前请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。
本报告日期为2014年7月1日起至9月30日止。