

金鷹成份股优选证券投资基金

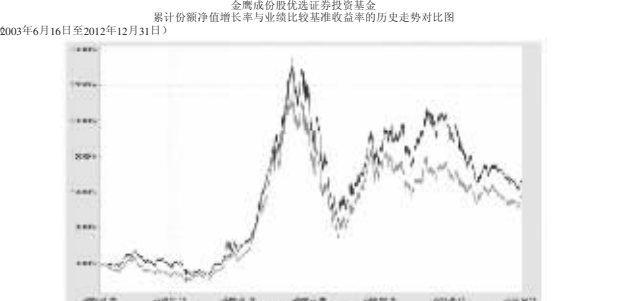
2012 第四季度报告

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:二〇一三年一月二十一日

§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1月18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。
基金的投资业绩并不代表其未来表现,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告所载数据截至2012年10月31日止。

基金简称	金鹰成份股优选混合
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	1,825,518,902.94份
投资目标	通过资产配置和对投资组合的主动调整,在控制投资组合风险的前提下,实现基金资产的中长期资本增值并获取适当、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运行趋势的基础上,合理预期各类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指数成份股和沪深300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、稳定的当期收益。
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。
风险收益特征	成份股加权指数为上证180指数和沪深300指数按其各自成份股流通市值加权平均。
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

3.1 主要财务指标	3.2 主要财务指标和基金净值表现
单位:人民币元	单位:人民币元
主要财务指标	报告期(2012年10月1日—2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-24,793,421.04
2.本期利润	25,922,136.05
3.加权平均基金份额本期利润	0.0141
4.期末基金资产净值	1,034,877,231.09
5.期末基金份额净值	0.5669
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	
2.本报告期末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	
3.2.2 自基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较	



注:1.截至报告日本基金的各项投资比例符合本基金合同规定的各项比例,即股票资产占基金资产净值的比例为85%-95%,其中,投资于上证180指数成份股和沪深300指数成份股的比例不低于基金资产净值的50%。
2.截至报告日本基金的各项投资比例符合本基金合同规定的各项比例,即股票资产占基金资产净值的比例为85%-95%,其中,投资于上证180指数成份股和沪深300指数成份股的比例不低于基金资产净值的50%。
3.截至报告日本基金的各项投资比例符合本基金合同规定的各项比例,即股票资产占基金资产净值的比例为85%-95%,其中,投资于上证180指数成份股和沪深300指数成份股的比例不低于基金资产净值的50%。

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
林华显	基金经理	2011-3-1	-	10	林华显先生2009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工作,先后担任资产管理部、交易部、基金经理助理等职务。2009年10月12日起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。现任金鹰基金管理有限公司基金经理。

§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1月18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。
基金的投资业绩并不代表其未来表现,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告所载数据截至2012年10月31日止。

§2 基金产品概况
基金简称:金鹰中证技术领先指数增强
基金主代码:210007
交易代码:210007
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2011年6月1日
报告期末基金份额总额:99,895,855.26份

投资目标:本基金为股票型指数增强基金,跟踪指数为本基金的首要目标,力求实现对中证技术领先指数的有效跟踪;对于指数增强部分,采取适当的增强策略,力争取得超越标的指数的投资回报。

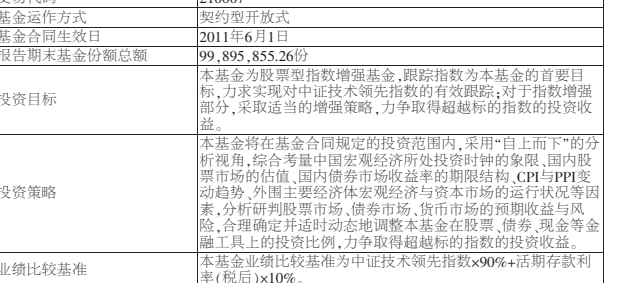
投资策略:本基金将在基金合同规定的投资范围内,采用“自上而下”的分析视角,综合考虑中国宏观经济所处发展阶段、国内股票市场的估值、国内债券市场收益率的期限结构、CPI与PPI变动趋势、分析研判股票市场、债券市场、货币市场的预期收益与风险,合理确定并适时动态调整本基金在股票、债券、现金等金融工具上的投资比例,力争取得超越标的指数的投资收益。

业绩比较基准:本基金业绩比较基准为中证技术领先指数×90%+活期存款利率(税后)×10%。

风险收益特征:本基金为股票型指数增强基金,主动投资为辅的股票型证券投资基金,属于证券投资基金中高风险、波动性较高的品种,一般情形下,其风险和预期收益高于混合型、债券型、货币型基金。

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

3.1 主要财务指标	3.2 主要财务指标和基金净值表现
单位:人民币元	单位:人民币元
主要财务指标	报告期(2012年10月1日—2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-296,685.06
2.本期利润	654,901.82
3.加权平均基金份额本期利润	0.0064
4.期末基金资产净值	70,180,520.54
5.期末基金份额净值	0.7025
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	
2.本报告期末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	
3.2.2 自基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较	



注:1.截至报告日本基金的各项投资比例符合本基金合同规定的各项比例,即股票资产占基金资产净值的比例为85%-95%,其中,投资于上证180指数成份股和沪深300指数成份股的比例不低于基金资产净值的50%。
2.截至报告日本基金的各项投资比例符合本基金合同规定的各项比例,即股票资产占基金资产净值的比例为85%-95%,其中,投资于上证180指数成份股和沪深300指数成份股的比例不低于基金资产净值的50%。
3.截至报告日本基金的各项投资比例符合本基金合同规定的各项比例,即股票资产占基金资产净值的比例为85%-95%,其中,投资于上证180指数成份股和沪深300指数成份股的比例不低于基金资产净值的50%。

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
张永东	基金经理	2012-2-16	-	9	张永东先生,工学博士,FRM(金融风险管理师),证券从业经历9年,中山大学数学与计算科学学院兼职研究员,广发证券博士后工作站研究人员,广发证券发展研究中心金融工程组负责人,华南理工大学副教授,硕士研究生导师以及广发基金、天治基金、民生证券金融工程组负责人等职。2010年7月加入金鹰基金管理有限公司,现任金融工程部总监、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。

3.1 主要财务指标	3.2 主要财务指标和基金净值表现
单位:人民币元	单位:人民币元
主要财务指标	报告期(2012年10月1日—2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-296,685.06
2.本期利润	654,901.82
3.加权平均基金份额本期利润	0.0064
4.期末基金资产净值	70,180,520.54
5.期末基金份额净值	0.7025
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	
2.本报告期末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	
3.2.2 自基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较	

注:1.截至报告日本基金的各项投资比例符合本基金合同规定的各项比例,即股票资产占基金资产净值的比例为85%-95%,其中,投资于上证180指数成份股和沪深300指数成份股的比例不低于基金资产净值的50%。
2.截至报告日本基金的各项投资比例符合本基金合同规定的各项比例,即股票资产占基金资产净值的比例为85%-95%,其中,投资于上证180指数成份股和沪深300指数成份股的比例不低于基金资产净值的50%。
3.截至报告日本基金的各项投资比例符合本基金合同规定的各项比例,即股票资产占基金资产净值的比例为85%-95%,其中,投资于上证180指数成份股和沪深300指数成份股的比例不低于基金资产净值的50%。

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
张永东	基金经理	2012-2-16	-	9	张永东先生,工学博士,FRM(金融风险管理师),证券从业经历9年,中山大学数学与计算科学学院兼职研究员,广发证券博士后工作站研究人员,广发证券发展研究中心金融工程组负责人,华南理工大学副教授,硕士研究生导师以及广发基金、天治基金、民生证券金融工程组负责人等职。2010年7月加入金鹰基金管理有限公司,现任金融工程部总监、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。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	713,497,508.69	54.73
其中:股票	713,497,508.69	54.73	
2	固定收益投资	551,192,110.00	42.28
其中:债券	551,192,110.00	42.28	
3	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	17,608,523.12	1.35
8	其他各项资产	21,259,796.90	1.63
9	合计	1,303,557,938.71	100.00

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔	-	-
B	采掘业	45,199,000.00	4.27
C	制造业	131,355,754.31	12.69
D	食品饮料	17,664,000.00	1.71
E	纺织服装、皮革	14,970,000.00	1.45
F	木材、家具	-	-
G	造纸、印刷	-	-
H	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
I	金属、非金属	16,480,000.00	1.59
J	机械、设备、仪器	31,070,728.50	3.00
K	电子设备、IT	51,171,025.81	4.94
L	医药、生物制品	-	-
M	其他	-	-
N	电力、煤气及水的生产和供应业	193,255,683.02	18.67
O	建筑业	99,633,553.31	9.57
P	交通运输、仓储业	53,460,000.00	5.17
Q	信息技术业	18,208,000.00	1.76
R	房地产业	86,668,728.03	8.48
S	金融、保险业	83,859,786.00	8.10
T	其他	-	-
U	社会服务业	43,724,966.72	4.23
V	传播与文化产业	28,112,335.30	2.72
W	合计	713,497,508.69	68.95

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	601628	中国人寿	2,499,990	53,499,786.00	5.17
2	600011	华能国际	7,197,031	51,386,801.34	4.97
3	000539	粤电力A	8,600,937	50,917,547.04	4.92
4	600833	海油工程	7,700,000	45,199,000.00	4.37
5	601117	中国石化	5,306,428	43,724,966.72	4.23
6	601669	中国水电	9,000,000	34,380,000.00	3.32
7	000625	长安汽车	4,672,290	31,070,728.50	3.00
8	601009	南京银行	3,300,000	30,360,000.00	2.93
9	601111	中国铁建	5,000,000	30,000,000.00	2.90
10	600196	复星医药	2,759,869	28,951,025.81	2.80

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	128,177,600.00	12.39
2	央行票据	-	-
3	金融债券	103,280,000.00	9.98
其中:政策性金融债	103,280,000.00	9.98	
4	企业债券	269,188,560.00	26.01
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	50,545,950.00	4.88
9	合计	551,192,110.00	53.26

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	1,000,000	103,280,000.00	9.98
2	126011	08石化债	742,910	71,319,360.00	6.89
3	130062	11国开03	500,000	50,545,950.00	4.88
4	019202	12国债02	500,000	50,020,000.00	4.83
5	019103	10国债13	500,000	48,067,600.00	4.64

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,270,840.38
2	应收证券清算款	9,727,675.99
3	应收股利	-
4	应收利息	10,228,980.50
5	应收申购款	32,300.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,259,796.90

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,270,840.38
2	应收证券清算款	9,727,675.99
3	应收股利	-
4	应收利息	10,228,980.50
5	应收申购款	32,300.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,259,796.90

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,270,840.38
2	应收证券清算款	9,727,675.99
3	应收股利	-
4	应收利息	10,228,980.50
5	应收申购款	32,300.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,259,796.90

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,270,840.38
2	应收证券清算款	9,727,675.99
3	应收股利	-
4	应收利息	10,228,980.50
5	应收申购款	32,300.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,259,796.90

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,270,840.38
2	应收证券清算款	9,727,675.99
3	应收股利	-
4	应收利息	10,228,980.50
5	应收申购款	32,300.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,259,796.90

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	65,703,220.42	92.72
其中:股票	65,703,220.42	92.72	
2	固定收益投资	24,561.60	0.03
其中:债券	24,561.60	0.03	
3	资产支持证券	-	-
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	3,491,731.28	4.93
7	其他各项资产	1,642,102.77	2.32
8	合计	70,671,616.07	100.00

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔	-	-
B	采掘业	769,127.00	1.10
C	制造业	52,353,931.15	74.60
D	食品饮料	-	-
E	纺织服装、皮革	-	-
F	木材、家具	-	-
G	造纸、印刷	-	-
H	石油、化学、塑胶、塑料	1,641,650.40	2.34

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	000030	湘虹控股	58,900	558,372.00	0.80
2	000400	许继电气	22,100	544,765.00	0.78
3	601633	长城汽车	21,800	516,660.00	0.74
4	002294	信立泰	13,300	509,390.00	0.73
5	600557	康缘药业	23,900	497,120.00	0.71
6	000180	科大讯飞	16,200	490,860.00	0.70
7	300070	长高电新	12,100	485,210.00	0.69
8	000661	长春高新	7,900	482,690.00	0.69
9	300122	智飞生物	14,500	481,400.00	0.69
10	000625	长安汽车	70,300	467,495.00	0.67

金鹰稳健成长股票型证券投资基金

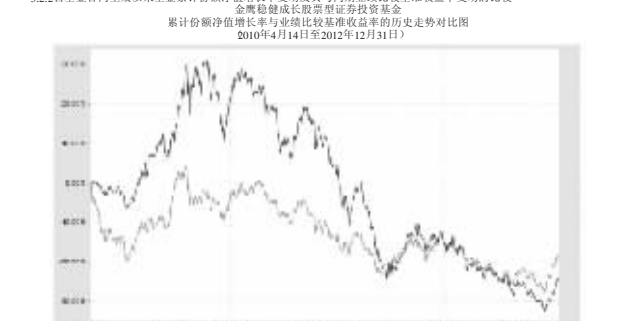
2012 第四季度报告

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:二〇一三年一月二十一日

§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1月17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。
基金的投资业绩并不代表其未来表现,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告所载数据截至2012年10月31日止。

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1月14日
报告期末基金份额总额	360,466,522.69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增值增值。
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,定性定量分析相结合,重点考察宏观经济、资本市场、上市公司所处的不同周期阶段,判断分析市场时机,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	本基金为主动操作型的股票型证券投资基金,属于证券投资基金中的高风险、高收益品种。
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

3.1 主要财务指标	3.2 主要财务指标和基金净值表现
单位:人民币元	单位:人民币元
主要财务指标	报告期(2012年10月1日—2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-23,836,672.46
2.本期利润	7,051,995.15
3.加权平均基金份额本期利润	0.0194
4.期末基金资产净值	235,405,133.32
5.期末基金份额净值	0.653
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	
2.本报告期末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	
3.2.2 自基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较	



注:1.截至报告日本基金的各项投资比例符合本基金合同规定的各项比例,即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、现金等资产占基金资产净值的比例不超过40%。
2.截至报告日本基金的各项投资比例符合本基金合同规定的各项比例,即股票资产占基金资产净值的比例为60%-9