

金鹰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
基金管理人和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,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
基金合同当事人承诺不承担虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
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。
本报告期自2012年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

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的现金收益。

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,合理预期各类资产的收益水平,并据此构建投资组合。包括主要投资于上证180成份股和深证100指数的股票、债券等金融工具的资产组合,适时调整组合中各类别资产的比例,在控制投资组合风险的前提下,实现基金资产的中长期增长和获取适当的现金收益。

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%的中长期国债指数的收益率。

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总市值的权重平均值。

本基金为风险水平等偏下,收益水平适中的证券投资基金,基金的收益指标为α值大于零,风险目标为β值的目标区间(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

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 0.5569

注:1.本期已实现收益指基金利息收入、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.期末可供分配利润,即期末可供分配基金份额之和。

4.基金净值是指基金资产净值除以基金份额总数。

5.期末可供分配基金份额净值=基金可供分配利润/基金份额总数。

6.本基金的业绩比较基准为75%的成份股加权指数的收益率。

7.本基金的净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比如图

2003年6月16日至2012年12月31日



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.本基金的绩效比较基准为75%的成份股加权指数的收益率。

3.基金管理人报告

4.1 基金经理 金鹰基金管理有限公司简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

林华显 基金经理 2011-3-1 - 10 林华显先生2002年10月进入金鹰基金管理有限公司,2003年后开始从事投资研究工作,2005年1月开始担任金鹰基金管理有限公司基金经理助理,2009年10月12日担任基金经理,2012年担任基金经理,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货币基金基金经理。

注:1.任职日期和离任日期均指公司公告的任职日期或解聘日期。
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

本基金报告期内,基金管理人严格遵守《证券法》、《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定,在基金管理过程中严格遵守基金财产保管制度、基金销售制度和基金交易制度,集中投资交易行为,规范基金投资运作,以风险调整后的收益最大化为目标,在严格控制风险的前提下,努力追求基金资产的增值。

4.3 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金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,未发现本基金在交易过程中存在不公平交易的情况。

4.4 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.5 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.6 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.7 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.8 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.9 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.10 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.11 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.12 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.13 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.14 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.15 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.16 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.17 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.18 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.19 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.20 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.21 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.22 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.23 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.24 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.25 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.26 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.27 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.28 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.29 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.30 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.31 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.32 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.33 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.34 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.35 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.36 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.37 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.38 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.39 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.40 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.41 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.42 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.43 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.44 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.45 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.46 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.47 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.48 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.49 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.50 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.51 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.52 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人公平交易制度符合《证券投资基金公平交易制度指导意见》的规定。

4.53 公平交易制度的执行情况

<p