

金鹰策略配置股票型证券投资基金

[2013] 年 度 报 告 摘 要

基金管理人:金鹰基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告发布日期:二〇一四年三月二十六日
1.9重要提示及目录

基金管理人的董事、监事、高级管理人员在报告期间内没有发生损害基金财产或严重损害基金持有人利益的行为,并对基金财产的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本基金报告期所载的财务数据未经审计,但根据基金合同,基金财产净值的计算方法符合基金合同的规定,并由基金托管人复核。报告期间内,基金投资组合的变化情况,详见“2.基金投资组合情况”部分。

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,投资人在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期报告期止日为2013年12月31日。

2.9基金简介

基金简称:金鹰策略配置基金
基金代码:210008
基金类型:股票型
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
基金管理人:金鹰基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告期基金总份额:130,996,651.63份

2.2基金产品说明

投资目标:在对股票市场进行深入分析的基础上,制定适当的 投资策略,以通过股票投资操作,在充分把握市场风格的前提下, 分享中国经济快速发展的成果和企业经营绩效提升所带给的股权收益,力争实现基金净值的持续增长。

投资策略:“防守+”与“进攻”的组合策略。本基金进行大类资产配置, 行业配置调整中的进攻策略, 通过行业配置调整, 在行业配置调整中的防守策略, 稳固收益, 通过行业配置调整中的防守策略, 稳固收益, 通过行业配置调整中的进攻策略, “防守+”策略。投资组合的构建, 将是本基金在充分把握市场风格的前提下, 分享中国经济快速发展的成果和企业经营绩效提升所带给的股权收益, 力争实现基金净值的持续增长。

业绩比较基准:沪深300指数*75%+中信标债指数*25%

本基金为开放式基金, 所谓的定期报告是指基金的定期报告, 属于向基金投资者说明基金的损益情况及基金风险特征。

2.3基金管理人和基金托管人

名称:金鹰基金管理有限公司
住所:深圳市南山区粤海街道海天二路23号盈海中心B座15层
办公地址:深圳市南山区粤海街道海天二路23号盈海中心B座15层
法定代表人:朱建芳
联系人:方力
联系电话:020-83285267
电子邮箱:cs@jyfund.com.cn
客户服务电话:4006155888/020-8395180
传真:010-65569812

2.4销售机构及网点

基金管理人直销的管理人互联网网址: http://www.jyfund.com.cn

基金管理人直销的管理人网点地址: 广州市天河区体育西路198号盈海大厦22-23层

§ 3主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元			
3.1.1期间数据和指标	2013年	2012年	2011年9月1日至2011年12月31日
本期已实现收益	49,081,904.80	-50,890,334.77	-5,993,605.97
本期利润	36,814,716.00	-21,162,533.44	-17,355,990.36
加权平均基金份额本期利润	0.1669	-0.0668	-0.0329
基金份额本期滚存收益率	12.45%	-7.37%	-4.51%
3.1.2期初数据和指标	2013年末	2012年末	2011年末
期初基金份额净值	-0.0054	-0.1853	-0.0451
期初基金份额总额	130,294,024.42	244,553,624.05	368,074,998.37
期初基金份额净值	0.9946	0.8843	0.9549
1.本期基金于2013年9月1日成立,存续期不足三年。报告截止日2013年12月31日,基金份额净值0.9946元,基金份额总额130,294,024.42份。			
2.本期已实现收益扣除非基金收入、投资收益、其后收入(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;本期利润计算公式详见“2.4.1利润的计算”。			
3.加权平均基金份额本期利润=本期利润/期末基金总份额,基金净值滚存收益率=沪深300指数收益率×100%+中信标债指数收益率×25%。			
4.本期可供分配利润,期末未分配利润未与本期利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。			
5.本期可供分配利润=期初基金份额净值×(1+基金净值滚存收益率)×(1+基金可供分配利润的年化增长率为25%)。			
6.基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图	(2011年9月1日至2013年12月31日)		

7.3.1基金净值表现

7.3.2基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.3基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.4基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.5基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.6基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.7基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.8基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.9基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.10基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.11基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.12基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.13基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.14基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.15基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.16基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.17基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.18基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.19基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.20基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.21基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.22基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.23基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.24基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.25基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.26基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.27基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.28基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.29基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.30基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.31基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.32基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.33基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.34基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.35基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.36基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.37基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.38基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.39基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.40基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.41基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.42基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.43基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.44基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.45基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.46基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.47基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至2013年12月31日)

7.3.48基金净值表现长与业绩比较基准净值走势对比图

(2011年9月1日至20