

金鹰中证500指数分级证券投资基金

2014第一季度报告

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:二〇一四年四月二十二日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事及高级管理人员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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年4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。

本报告告期财务数据未经审计。

本基金报告期2014年1月1日起至3月31日止。

§ 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 约定开放式

基金合同生效日 2012年6月5日

报告期末基金份额总额 16,641,045.499份

投资目标 本基金为股票型指数基金，以跟踪指数为目标，力求将基金净值增长率与业绩比较基准之间的跟踪误差控制在0.5%以内，长期跟踪误差控制在4%以内。

本基金以中证500指数成分股在其指数中的基准权重为基础，在综合考察指数成分股的行业属性与占比、各行业内的权重分布、个股的基本面情况、个股的流通性与估值等因素的基础上，根据指数成份股的出现波动或不景气等情况，本基金将定期优化其配置，对指数组合进行再调整。

本基金的投资对象为具有良好流动性的金融工具，包括股票、债券、货币市场工具、现金、货币支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。占基金资产净值的比例50%-95%，其中，现金或到期日在一年以内政府债券的比例不低于基金资产净值的5%，现金投资的比例范围占基金资产净值的0%-3%。

业绩比较基准 本基金业绩比较基准为中证500指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%

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

下属二级基金的基金简称 金鹰500A 金鹰500B 金鹰500C

报告期末下属三级基金的份额总额 150088 150089 162107

下级二级基金的基金代码 676,072份 676,072份 676,072份

下级二级基金的基金名称 金鹰500A 金鹰500B 金鹰500C

报告期末下属三级基金的份额总额 15,288,901.49份 15,288,901.49份 15,288,901.49份

下级二级基金的基金代码 150088 150089 162107

下级二级基金的基金名称 金鹰500A 金鹰500B 金鹰500C

报告期末下属三级基金的份额总额 15,288,901.49份 15,288,901.49份 15,288,901.49份

下级二级基金的基金代码 676,072份 676,072份 676,072份

下级二级基金的基金名称 金鹰500A 金鹰500B 金鹰500C

报告期末下属三级基金的份额总额 15,288,901.49份 15,288,901.49份 15,288,901.49份

下级二级基金的基金代码 676,072份 676,072份 676,072份

下级二级基金的基金名称 金鹰500A 金鹰500B 金鹰500C

报告期末下属三级基金的份额总额 15,288,901.49份 15,288,901.49份 15,288,901.49份

下级二级基金的基金代码 676,072份 676,072份 676,072份

下级二级基金的基金名称 金鹰500A 金鹰500B 金鹰500C

报告期末下属三级基金的份额总额 15,288,901.49份 15,288,901.49份 15,288,901.49份

下级二级基金的基金代码 676,072份 676,072份 676,072份

下级二级基金的基金名称 金鹰500A 金鹰500B 金鹰500C

报告期末下属三级基金的份额总额 15,288,901.49份 15,288,901.49份 15,288,901.49份

下级二级基金的基金代码 676,072份 676,072份 676,072份

下级二级基金的基金名称 金鹰500A 金鹰500B 金鹰500C

报告期末下属三级基金的份额总额 15,288,901.49份 15,288,901.49份 15,288,901.49份

下级二级基金的基金代码 676,072份 676,072份 676,072份

下级二级基金的基金名称 金鹰500A 金鹰500B 金鹰500C

报告期末下属三级基金的份额总额 15,288,901.49份 15,288,901.49份 15,288,901.49份

下级二级基金的基金代码 676,072份 676,072份 676,072份

下级二级基金的基金名称 金鹰500A 金鹰500B 金鹰500C

报告期末下属三级基金的份额总额 15,288,901.49份 15,288,901.49份 15,288,901.49份

下级二级基金的基金代码 676,072份 676,072份 676,072份

下级二级基金的基金名称 金鹰500A 金鹰500B 金鹰500C

报告期末下属三级基金的份额总额 15,288,901.49份 15,288,901.49份 15,288,901.49份

下级二级基金的基金代码 676,072份 676,072份 676,072份

下级二级基金的基金名称 金鹰500A 金鹰500B 金鹰500C

报告期末下属三级基金的份额总额 15,288,901.49份 15,288,901.49份 15,288,901.49份

下级二级基金的基金代码 676,072份 676,072份 676,072份

下级二级基金的基金名称 金鹰500A 金鹰500B 金鹰500C

报告期末下属三级基金的份额总额 15,288,901.49份 15,288,901.49份 15,288,901.49份

下级二级基金的基金代码 676,072份 676,072份 676,072份

下级二级基金的基金名称 金鹰500A 金鹰500B 金鹰500C

报告期末下属三级基金的份额总额 15,288,901.49份 15,288,901.49份 15,288,901.49份

下级二级基金的基金代码 676,072份 676,072份 676,072份

下级二级基金的基金名称 金鹰500A 金鹰500B 金鹰500C

报告期末下属三级基金的份额总额 15,288,901.49份 15,288,901.49份 15,288,901.49份

下级二级基金的基金代码 676,072份 676,072份 676,072份

下级二级基金的基金名称 金鹰500A 金鹰500B 金鹰500C

报告期末下属三级基金的份额总额 15,288,901.49份 15,288,901.49份 15,288,901.49份

下级二级基金的基金代码 676,072份 676,072份 676,072份

下级二级基金的基金名称 金鹰500A 金鹰500B 金鹰500C

报告期末下属三级基金的份额总额 15,288,901.49份 15,288,901.49份 15,288,901.49份

下级二级基金的基金代码 676,072份 676,072份 676,072份

下级二级基金的基金名称 金鹰500A 金鹰500B 金鹰500C

报告期末下属三级基金的份额总额 15,288,901.49份 15,288,901.49份 15,288,901.49份

下级二级基金的基金代码 676,072份 676,072份 676,072份

下级二级基金的基金名称 金鹰500A 金鹰500B 金鹰500C

报告期末下属三级基金的份额总额 15,288,901.49份 15,288,901.49份 15,288,901.49份

下级二级基金的基金代码 676,072份 676,072份 676,072份

下级二级基金的基金名称 金鹰500A 金鹰500B 金鹰500C

报告期末下属三级基金的份额总额 15,288,901.49份 15,288,901.49份 15,288,901.49份

下级二级基金的基金代码 676,072份 676,072份 676,072份

下级二级基金的基金名称 金鹰500A 金鹰500B 金鹰500C

报告期末下属三级基金的份额总额 15,288,901.49份 15,288,901.49份 15,288,901.49份

下级二级基金的基金代码 676,072份 676,072份 676,072份

下级二级基金的基金名称 金鹰500A 金鹰500B 金鹰500C

报告期末下属三级基金的份额总额 15,288,901.49份 15,288,901.49份 15,288,901.49份

下级二级基金的基金代码 676,072份 676,072份 676,072份

下级二级基金的基金名称 金鹰500A 金鹰500B 金鹰500C

报告期末下属三级基金的份额总额 15,288,901.49份 15,288,901.49份 15,288,901.49份

下级二级基金的基金代码 676,072份 676,072份 676,072份

下级二级基金的基金名称 金鹰500A 金鹰500B 金鹰500C

报告期末下属三级基金的份额总额 15,288,901.49份 15,288,901.49份 15,288,901.49份

下级二级基金的基金代码 676,072份 676,072份 676,072份

下级二级基金的基金名称 金鹰500A 金鹰500B 金鹰500C

报告期末下属三级基金的份额总额 15,288,901.49份 15,288,901.49份 15,288,901.49份

下级二级基金的基金代码 676,072份 676,072份 676,072份

下级二级基金的基金名称 金鹰500A 金鹰500B 金鹰500C

报告期末下属三级基金的份额总额 15,288,901.49份 15,288,901.49份 15,288,901.49份

下级二级基金的基金代码 676,072份 676,072份 676,072份

下级二级基金的基金名称 金鹰500A 金鹰500B 金鹰500C

报告期末下属三级基金的份额总额 15,288,901.49份 15,288,901.49份 15,288,901.49份

下级二级基金的基金代码 676,072份 676,072份 676,072份

下级二级基金的基金名称 金鹰500A 金鹰500B 金鹰500C

报告期末下属三级基金的份额总额 15,288,901.49份 15,288,901.49份 15,288,901.49份

下级二级基金的基金代码 676,072份 676,072份 676,072份

下级二级基金的基金名称 金鹰500A 金鹰500B 金鹰500C

报告期末下属三级基金的份额总额 15,288,901.49份 15,288,901.49份 15,288,901.49份

下级二级基金的基金代码 676,072份 676,072份 676,072份

下级二级基金的基金名称 金鹰500A 金鹰500B 金鹰500C

报告期末下属三级基金的份额总额 15,288,901.49份 15,288,901.49份 15,288,901.49份

下级二级基金的基金代码 676,072份 676,072份 676,072份

下级二级基金的基金名称 金鹰5