金鹰中证500指数分级证券投资基金

【2014】第三季度报告

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:二〇一四年十月二十四日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事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10月23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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金鹰中证500指数分级
基金主代码	162107
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月5日
报告期末基金份额总额	11,851,986.88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日均跟踪偏离度控制在0.35%以下,年跟踪误差控制在4%以下。
投资策略	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构成与市值占比、各行业内成分股权重的构成与分散程度、成分股流动性与贝塔值等因素的基础上,采用重点抽样与分层抽样相结合的策略以构建指数化投资组合;若抽样组合内的股票停牌或出现流动性不足等情形时,本基金将根据变化了的新情况,对于抽样组合进行再调整。 本基金投资于股票的资产占基金资产净值的比例为90%~95%,其中,中证500指数成分股和备选成分股占基金资产净值的比例不低于90%;债券、货币市场工具、现金、权证、资产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5%~10%,其中,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,权证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

下属三级基金的基金简称	金鹰500A	金鹰500B	金鹰500
下属三级基金的交易代码	150088	150089	162107
报告期末下属三级基金的份额总额	609,740份	609,740份	10,632,506.88份
下属三级基金的风险收益特征	本级基金具有低风险、预期收益相对稳定的特征。	本级基金具有高风险、高预期收益的特征。	本级基金为被动跟踪指数的指数型证券投资基金,属于证券投资基金当中收益、风险较高的品种。一般情形下,其风险和预期收益高于混合型、债券型、货币市场基金。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)
1.本期已实现收益	934,997.94
2.本期利润	3,132,603.31
3.加权平均基金份额本期利润	0.2321
4.期末基金资产净值	14,877,699.19
5.期末基金份额净值	1.2553

注:1.本期已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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。2.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

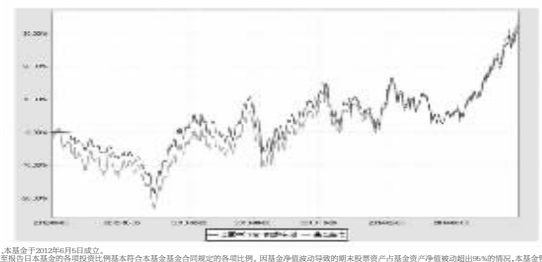
3.2 基金净值表现

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

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	22.86%	0.90%	23.88%	0.91%	-1.02%	-0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

金鹰中证500指数分级证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2012年6月5日至2014年9月30日)



注:1.本基金于2012年6月5日成立。
2.截至报告日本基金的各项投资比例符合本基金基金合同规定的各项比例。因基金净值波动导致的期末股票资产占基金资产净值被动超出95%的情况,本基金管理人已于规定期限内进行了调整。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
张永东	基金经理	2012-6-7	-	11	张永东先生,工学博士,FRM(金融风险管理师),证券从业经历11年,中山大学数学与计算科学学院兼职研究生导师,曾任广发证券和中山大学联合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、硕士生导师以及广发基金、天治基金、益民基金金融工程负责人等职。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技术领先指数增强型证券投资基金基金经理。
林华显	基金经理	2012-6-5	-	12	林华显先生2002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等工作,先后任交易员、交易主管、基金经理助理等职。2009年10月12日开始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,现任本基金基金经理以及金鹰成份股优选证券投资基金基金经理。

注:1.任职日期和离任日期指公司公告聘任或解聘日期;
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

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》和其他有关法律法规及其各项实施准则、《金鹰中证500指数分级证券投资基金基金合同》的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作合法合规,无出现重大违法违规或违反基金合同的行为,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期,本基金管理人按照《证券投资基金管理公司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,通过规范化的投资、研究和交易流程,确保公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

本基金管理人事前规定了严格的股票备选库管理制度、投资权限管理制度、债券库管理制度和集中交易制度等;事中重视交易执行环节的公平交易措施,以"时间优先、价格优先"作为执行指令的基本原则,必要时启用投资交易系统中的公平交易模块;事后加强对不同投资组合的交易价差、收益率的分析,以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内,公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合发生的同日反向交易,未发生过成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

在报告期内,本基金的跟踪标的中证500指数大涨25.25%,因基金规模较小造成证费率较高、基金规模不稳定等因素对指数跟踪效果造成了较大的影响,本基金日均跟踪偏离度0.0287%、年化跟踪误差0.58%控制在投资目标限定范围内。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2014年9月30日,基金份额净值为1.2553元,本报告期份额净值增长率22.86%,同期业绩比较基准增长率为23.88%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金为股票型指数基金,以跟踪指数为目标,本基金将继续坚持采用量化策略进行指数复制和风险管理,适时对投资组合进行再平衡调整,在控制跟踪误差在限定范围内的同时,辅以有限度的主动性增强投资,力争获取适度的增强收益。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	14,176,746.75	91.47
	其中:股票	14,176,746.75	91.47
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
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	1,312,898.83	8.47
7	其他资产	9,965.37	0.06
8	合计	15,499,610.95	100.00

注:其他资产包括:交易保证金、应收利息、应收证券清算款、其他应收款、应收申购款。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 指数投资按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	259,346.77	1.74
B	采矿业	439,945.15	2.96
C	制造业	8,582,968.13	57.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	323,570.02	2.17
E	建筑业	376,307.38	2.53
F	批发和零售业	983,911.36	6.61
G	交通运输、仓储和邮政业	405,151.68	2.72
H	住宿和餐饮业	22,660.00	0.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	764,765.58	5.14
J	金融业	245,836.58	1.65
K	房地产业	996,213.44	6.70
L	租赁和商务服务业	221,938.70	1.49
M	科学研究和技术服务业	59,582.88	0.40
N	水利、环境和公共设施管理业	127,041.52	0.85
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	142,258.20	0.96
S	综合	114,410.06	0.77
	合计	14,065,907.45	94.54

5.2.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	110,839.30	0.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	信息传输、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	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	110,839.30	0.75

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1期末指数投资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	600570	恒生电子	2,963	124,979.34	0.84
2	600490	鹏欣资源	5,143	87,636.72	0.59
3	601099	太平洋	8,400	82,572.00	0.56
4	000998	隆平高科	5,098	76,826.86	0.52
5	600879	航天电子	4,852	75,982.32	0.51
6	000559	万向钱潮	5,532	73,464.96	0.49
7	600765	中航重机	2,745	71,644.50	0.48
8	002405	四维图新	2,759	68,864.64	0.46
9	600418	江淮汽车	5,150	65,456.50	0.44
10	002022	科华生物	2,326	62,662.44	0.42

5.3.2期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	002252	上海莱士	2,530	110,839.30	0.75
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本报告期无贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货的持仓。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本基金投资国债期货的投资政策

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末无国债期货持仓。

5.10.3 本基金投资国债期货的投资评价

无

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,789.09
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	410.57
5	应收申购款	4,765.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,965.37

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5.1期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

期末前十名股票中无流通受限情况

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

期末积极投资前五名股票中无流通受限情况

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

期末积极投资前五名股票中无流通受限情况

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	金鹰500A	金鹰500B	金鹰500
报告期期初基金份额总额	591,895.00	591,895.00	14,702,875.26
报告期期间基金总申购份额	-	-	2,925,619.06
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-	6,960,297.44
报告期期间基金拆分变动份额	17,845.00	17,845.00	-35,690.00
报告期期末基金份额总额	609,740.00	609,740.00	10,632,506.88

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期,本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期,本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

1.经公司第四届董事会第三十九次会议审议通过且经中国证券监督管理委员会许可[2014]797号文核准批复,公司于2014年8月7日正式聘请刘岩先生担任金鹰基金管理有限公司总经理,原董事长刘东先生不再代行总经理职责。该事项已于2014年8月8日进行了公告。

2.公司第四届董事会于2014年9月26日任期届满,根据公司章程规定,公司于2014年9月26日召开了2014年第一次临时股东会议,选举公司第五届董事会成员为王静女士、王毅先生、刘岩先生、刘国常先生(独立董事)、吴晓珠先生(独立董事)、凌嘉华先生(独立董事)、谢石松先生(独立董事)、温婉容女士、程宁女士。原公司董事长刘东先生不再担任董事及董事长职务。该事项已于2014年10月11日公告。经公司第五届董事会第一次会议决议通过,由刘岩总经理代为履行董事长职责,该事项已于2014年10月9日进行了公告。

3.本基金自《公开募集证券投资基金运作管理办法》2014年8月8日实施以来,截至2014年9月30日,基金资产净值已连续三十八个工作日低于6000万元。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1.中国证监会批准金鹰中证500指数分级证券投资基金发行及募集的文件。

2.《金鹰中证500指数分级证券投资基金基金合同》。

3.《金鹰中证500指数分级证券投资基金托管协议》。

4.金鹰基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程。

5.基金托管人业务资格批件和营业执照。

6.本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、季度报告、更新的招募说明书及其他临时公告。

9.2 存放地点

广州市天河区体育西路189号城建大厦22-23层

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅或按工本费购买复印件,也可登录本基金管理人网站查阅,本基金管理人网址:http://www.gefund.com.cn。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人客户服务中心,客户服务中心电话:4006-135-888或020-82936180。

金鹰基金管理有限公司
二〇一四年十月二十四日

金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金

【2014】第三季度报告

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:二〇一四年十月二十四日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事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2014年10月23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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至9月30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	53,285,916.40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收益。
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,综合考量中国宏观经济所处投资时钟的象限、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、外围主要经济体宏观经济与资本市场的运行状况等因素,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地调整本基金在股票、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	本基金为以跟踪指数为主,主动投资为辅的股票型证券投资基金,属于证券投资基金当中收益、风险较高的品种,一般情形下,其风险和预期收益高于混合型、债券型、货币市场基金。
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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)
1.本期已实现收益	2,927,956.17
2.本期利润	10,954,378.59
3.加权平均基金份额本期利润	0.1763
4.期末基金资产净值	59,343,738.93
5.期末基金份额净值	1.1137

注:1.本期已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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;
2.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

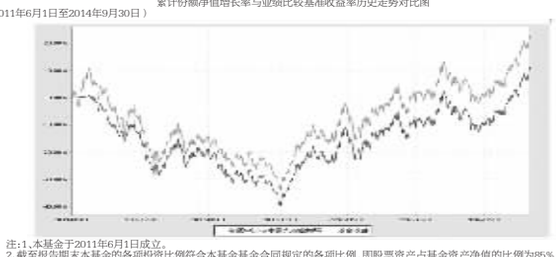
3.2 基金净值表现

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

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	19.19%	0.91%	18.00%	0.88%	1.19%	0.03%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2011年6月1日至2014年9月30日)



注:1.本基金于2011年6月1日成立。
2.截至报告期末本基金的各项投资比例符合本基金基金合同规定的各项比例,国股票资产占基金资产净值的比例为85%-95%,其中,不低于80%的基金净资产将投资于中证技术领先指数的成分股和备选成分股;债券、货币市场工具、现金、权证、资产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5%-15%,其中,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,权证投资的比例范围占基金资产净值的0%-3%;
3.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%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
张永东	金融工程部总监、基金经理	2012-2-16	-	11	张永东先生,工学博士,FRM(金融风险管理师),证券从业经历11年,中山大学数学与计算科学学院兼职研究生导师,曾任广发证券和中山大学联合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、硕士生导师以及广发基金、天治基金、益民基金金融工程负责人等职。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。

注:1.任职日期和离任日期指公司公告聘任或解聘日期;
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

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》和其他有关法律法规及其各项实施准则、《金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金基金合同》的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作合法合规,未影响本基金资产和基金份额持有人的利益,未出现其他重大违法违规或违反基金合同的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期,本基金管理人按照《证券投资基金管理公司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,通过规范化的投资、研究和交易流程,确保公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

本基金管理人事前规定了严格的股票备选库管理制度、投资权限管理制度、债券库管理制度和集中交易制度等;事中重视交易执行环节的公平交易措施,以"时间优先、价格优先"作为执行指令的基本原则,必要时启用投资交易系统中的公平交易模块;事后加强对不同投资组合的交易价差、收益率的分析,以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内,公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合发生的同日反向交易,未发生过成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

三季度在国内部分经济数据表现偏弱的趋势下,以地产为代表的稳经济措施陆续出台,这有助于国内经济的软着陆和各项改革措施的推进。概括而言,稳经济措施叠加改革预期带来三季度市场的一轮上涨行情。期间上证综指上涨15.4%,深成指上涨10.0%,中小板指数上涨16.9%,创业板指数上涨9.7%。军工、农业、服装、交运板块涨幅居前,银行、家电、传媒、食品饮料涨幅相对落后。

本基金继续配置医药、计算机、通信、电子等中长期高景气行业,适度参与了国企改革、军工板块,但未予以重配,拖累了三季度本基金的表现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014 年9月30日,基金份额净值为0.731元,本报告期份额净值增长率8.3%,同期业绩比较基准增长率为10.10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前中国经济进入钢塔长速度换档期、结构调整阵痛期、前期刺激政策消化期的"三期叠加"阶段,在经济新常态下,重大改革和转型升级为同存在较好的投资机会。展望4季度,稳经济措施解决了市场对经济下行的担忧,各项深化改革方案的出台使市场风险偏好有所上升,预计市场仍存在机会,本基金将保持医药、计算机等行业的重点配置,同时积极关注发掘新的主题和转型机会。当然四季度也要关注海外市场波动、股票发行注册制等可能对市场形成的风险。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	380,243,194.46	84.79
	其中:股票	380,243,194.46	84.79
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
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	38,962,637.23	8.69
7	其他资产	29,256,794.99	6.52
8	合计	448,462,626.68	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,087,925.03	1.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	信息传输、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	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,087,925.03	1.83

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1期末指数投资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	002252	上海莱士	16,512	723,390.72	1.22
2	600490	鹏欣资源	35,850	610,884.00	1.03
3	600765	中航重机	21,600	563,760.00	0.95
4	002204	大连重工	39,993	486,314.88	0.82
5	600435	北方导航	19,200	476,160.00	0.80
6	000768	中航飞机	26,300	437,895.00	0.74
7	002153	石基信息	5,900	414,003.00	0.70
8	601106	中国一重	110,500	398,905.00	0.67
9	600316	洪都航空	14,400	389,952.00	0.66
10	000559	万向钱潮	29,340	389,635.20	0.66

5.3.2期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	002308	威创股份	31,890	295,301.40	0.50
2	300124	汇川技术	9,263	278,723.67	0.47
3	600498	烽火通信	16,300	257,540.00	0.43
4	601126	四方股份	14,922	256,359.96	0.43
5	-	-	-	-	-

注:本基金本报告期末股票积极投资仅持有四只股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货持仓。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本基金投资国债期货的投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货持仓。

5.10.3 本基金投资国债期货的投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 报告期内基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	7,296.93
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,000.00
5	应收申购款	75,537.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	83,834.71

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5.1期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000768	中航飞机	437,895.00	0.74	因筹划非公开发行股票,自2014年9月24日起停牌。
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	67,554,553.74
报告期期间基金总申购份额	2,508,118.90
减:报告期期间基金总赎回份额	16,776,756.24
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	53,285,916.40

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期,本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期,本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

1.经公司第四届董事会第三十九次会议审议通过且经中国证券监督管理委员会许可[2014]797号文核准批复,公司于2014年8月7日正式聘请刘岩先生担任金鹰基金管理有限公司总经理,原董事长刘东先生不再代行总经理职责。该事项已于2014年8月8日进行了公告。

2.公司第四届董事会于2014年9月26日任期届满,根据公司章程规定,公司于2014年9月26日召开了2014年第一次临时股东会议,选举公司第五届董事会成员为王静女士、王毅先生、刘岩先生、刘国常先生(独立董事)、吴晓珠先生(独立董事)、凌嘉华先生、谢石松先生(独立董事)、温婉容女士、程宁女士。原公司董事长刘东先生不再担任董事及董事长职务。该事项已于2014年10月11日公告。经公司第五届董事会第一次会议决议通过,由刘岩总经理代为履行董事长职责,该事项已于2014年10月9日进行了公告。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1.中国证监会批准金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金发行及募集的文件。

2.《金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金基金合同》。

3.《金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金托管协议》。

4.金鹰基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程。

5.基金托管人业务资格批件和营业执照。

6.本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、季度报告、更新的招募说明书及其他临时公告。

9.2 存放地点

广州市天河区体育西路189号城建大厦22-23层

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅或按工本费购买复印件,也可登录本基金管理人网站查阅,本基金管理人网址:http://www.gefund.com.cn。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人客户服务中心,客户服务中心电话:4006-135-888或020-82936180。

金鹰基金管理有限公司
二〇一四年十月二十四日

金鹰主题优势股票型证券投资基金

【2014】第三季度报告

基金管理人:金鹰基金管理有限公司
基金托