

金鹰成份股优选证券投资基金

[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

1.1 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承诺在本报告上签字的人员已阅读并理解了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证报告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。

基金合同中有关费用的说明未经过审计。

本报告期自2014年7月1日起至2014年9月30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	1,430,161,863.58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，实现基金资产的增值和稳定收益。
报告期投资组合变动情况	本基金通过定期分析宏观经济、政策环境市场的变化和投资趋势的基础上，结合对宏观经济、政策环境、市场变化的预期，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，实现基金资产的增值和稳定收益。
投资策略	本基金通过定期分析宏观经济、政策环境市场的变化和投资趋势的基础上，结合对宏观经济、政策环境、市场变化的预期，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，实现基金资产的增值和稳定收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为75%的股票指数加权指数的收益加上25%的中信标普债基指数的收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为75%的股票指数加权指数的收益加上25%的中信标普债基指数的收益。
风险收益特征	本基金为风险水平中等偏高，收益介于该类证券投资基金、基金的收益目标和风险等级大于等于大类，风险目标和风险等级为中等的区间内(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

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	28,922,619.54			
2.本期利润	63,491,667.38			
3.加权平均基金份额净值	0.0425			
4.期末基金份额净值	0.6547			

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；

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；

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率为75%，其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率③ ①-③ ②-④

过去三个月 7.05% 6.67% 9.92% 0.67% -2.87% 0.00%

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

阶段 净值增长率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率③ ①-③ ②-④

过去三个月 7.05% 6.67% 9.92% 0.67% -2.87% 0.00%

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

阶段 净值增长率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率③ ①-③ ②-④

过去三个月 7.05% 6.67% 9.92% 0.67% -2.87% 0.00%

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

阶段 净值增长率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率③ ①-③ ②-④

过去三个月 7.05% 6.67% 9.92% 0.67% -2.87% 0.00%

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

阶段 净值增长率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率③ ①-③ ②-④

过去三个月 7.05% 6.67% 9.92% 0.67% -2.87% 0.00%

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

阶段 净值增长率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率③ ①-③ ②-④

过去三个月 7.05% 6.67% 9.92% 0.67% -2.87% 0.00%

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

阶段 净值增长率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率③ ①-③ ②-④

过去三个月 7.05% 6.67% 9.92% 0.67% -2.87% 0.00%

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

阶段 净值增长率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率③ ①-③ ②-④

过去三个月 7.05% 6.67% 9.92% 0.67% -2.87% 0.00%

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

阶段 净值增长率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率③ ①-③ ②-④

过去三个月 7.05% 6.67% 9.92% 0.67% -2.87% 0.00%

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

阶段 净值增长率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率③ ①-③ ②-④

过去三个月 7.05% 6.67% 9.92% 0.67% -2.87% 0.00%

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

阶段 净值增长率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率③ ①-③ ②-④

过去三个月 7.05% 6.67% 9.92% 0.67% -2.87% 0.00%

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

阶段 净值增长率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率③ ①-③ ②-④

过去三个月 7.05% 6.67% 9.92% 0.67% -2.87% 0.00%

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

阶段 净值增长率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率③ ①-③ ②-④

过去三个月 7.05% 6.67% 9.92% 0.67% -2.87% 0.00%

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

阶段 净值增长率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率③ ①-③ ②-④

过去三个月 7.05% 6.67% 9.92% 0.67% -2.87% 0.00%

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

阶段 净值增长率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率③ ①-③ ②-④

过去三个月 7.05% 6.67% 9.92% 0.67% -2.87% 0.00%

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

阶段 净值增长率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率③ ①-③ ②-④

过去三个月 7.05% 6.67% 9.92% 0.67% -2.87% 0.00%

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

阶段 净值增长率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率③ ①-③ ②-④

过去三个月 7.05% 6.67% 9.92% 0.67% -2.87% 0.00%

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

阶段 净值增长率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率③ ①-③ ②-④

过去三个月 7.05% 6.67% 9.92% 0.67% -2.87% 0.00%

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

阶段 净值增长率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率③ ①-③ ②-④

过去三个月 7.05% 6.67% 9.92% 0.67% -2.87% 0.00%

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

阶段 净值增长率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率③ ①-③ ②-④

过去三个月 7.05% 6.67% 9.92% 0.67% -2.87% 0.00%

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

阶段 净值增长率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率③ ①-③ ②-④

过去三个月 7.05% 6.67% 9.92% 0.67% -2.87% 0.00%

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

阶段 净值增长率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率③ ①-③ ②-④

过去三个月 7.05% 6.67% 9.92% 0.67% -2.87% 0.00%

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

阶段 净值增长率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率③ ①-③ ②-④

过去三个月 7.05% 6.67% 9.92% 0.67% -2.87% 0.00%

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

阶段 净值增长率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率③ ①-③ ②-④

过去三个月 7.05% 6.67% 9.92% 0.67% -2.87% 0.00%

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

阶段 净值增长率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率③ ①-③ ②-④

过去三个月 7.05% 6.67% 9.92% 0.67% -2.87% 0.00%

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

阶段 净值增长率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率③ ①-③ ②-④

过去三个月 7.05% 6.67% 9.92% 0.67% -2.87% 0.00%

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

阶段 净值增长率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率③ ①-③ ②-④

过去三个月 7.05% 6.67% 9.92% 0.67% -2.87% 0.00%

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

阶段 净值增长率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率③ ①-③ ②-④

过去三个月 7.05% 6.67% 9.92% 0.67% -2.87% 0.00%

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