

金鹰中证500指数分级证券投资基金

[2015] 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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年十一月二十七日
重要提示
基金管理人的董事及高级管理人员不存虚假记载、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责任。
本基金的管理人根据有关法律法规及基金合同的规定,编制并披露基金报告,报告内容涉及基金的运作情况,但基金管理人保证一定披露基金的经营状况,但不保证基金收益。
基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本基金报告期自2015年7月1日至2015年9月30日。

本报告期末基金份额总额:25,564,941.00份

报告期末基金资产净值:87,489.40元

基金份额净值:0.034元

注:本报告期股票投资比例因中证500指数成份股调整及股票停牌,未及时卖出而被持有的股票。

6.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

投资目标 本基金为股票型指数基金,以跟踪中证500指数为目标,力求将基金净值增长率与业绩比较基准的偏离度控制在±1%以内。

投资策略 本基金在中证500指数成份股在指数中的权重基础上,在综合考虑指数成份股的行业属性与市值占比、各行业的内部构成权重的构成与分布程度、成分股的流动性与贝塔系数等指标的基础上,结合对行业景气度的判断,综合考虑股票的流动性与贝塔系数等指标,对行业进行调整。

业绩比较基准 中证500指数成份股的综合收益×90%+短期利率×10%。

风险收益特征 本基金的预期风险和预期收益均高于股票型基金,风险收益特征与中证500指数成份股的预期风险和预期收益特征相似。

基金管理人 金鹰基金管理有限公司

基金托管人 中国工商银行股份有限公司

基金名称 金鹰中证500指数分级证券投资基金

基金代码 162107

交易代码 162107

基金运作方式 购买开放式

基金合同生效日 2012年6月6日

报告期末基金份额总额 25,564,941.00份

报告期末基金资产净值:87,489.40元

基金份额净值:0.034元

注:本报告期股票投资比例因中证500指数成份股调整及股票停牌,未及时卖出而被持有的股票。

6.2.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

投资目标 本基金为股票型指数基金,以跟踪中证500指数为目标,力求将基金净值增长率与业绩比较基准的偏离度控制在±1%以内。

投资策略 本基金在中证500指数成份股在指数中的权重基础上,在综合考虑指数成份股的行业属性与市值占比、各行业的内部构成权重的构成与分布程度、成分股的流动性与贝塔系数等指标的基础上,结合对行业景气度的判断,综合考虑股票的流动性与贝塔系数等指标,对行业进行调整。

业绩比较基准 中证500指数成份股的综合收益×90%+短期利率×10%。

风险收益特征 本基金的预期风险和预期收益均高于股票型基金,风险收益特征与中证500指数成份股的预期风险和预期收益特征相似。

基金管理人 金鹰基金管理有限公司

基金托管人 中国工商银行股份有限公司

基金名称 金鹰中证500指数分级证券投资基金

基金代码 162107

交易代码 162107

基金运作方式 购买开放式

基金合同生效日 2012年6月6日

报告期末基金份额总额 25,564,941.00份

报告期末基金资产净值:87,489.40元

基金份额净值:0.034元

注:本报告期股票投资比例因中证500指数成份股调整及股票停牌,未及时卖出而被持有的股票。

6.2.4 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 (报告期:2015年7月1日-2015年9月30日)

1.本期已实现收益 -20,969,867.01

2.本期利润 -27,240,160.11

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0033

4.期末基金资产净值 26,549,896.27

5.期末基金份额净值 0.0096

6.期末可供分配基金份额利润 10,000,355.16

7.期末可供分配基金份额总额 4,476,780.00份

8.期末可供分配比例 0.0009

9.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

10.期末可供分配金额 0.0000

11.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

12.期末可供分配金额 0.0000

13.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

14.期末可供分配金额 0.0000

15.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

16.期末可供分配金额 0.0000

17.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

18.期末可供分配金额 0.0000

19.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

20.期末可供分配金额 0.0000

21.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

22.期末可供分配金额 0.0000

23.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

24.期末可供分配金额 0.0000

25.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

26.期末可供分配金额 0.0000

27.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

28.期末可供分配金额 0.0000

29.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

30.期末可供分配金额 0.0000

31.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

32.期末可供分配金额 0.0000

33.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

34.期末可供分配金额 0.0000

35.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

36.期末可供分配金额 0.0000

37.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

38.期末可供分配金额 0.0000

39.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

40.期末可供分配金额 0.0000

41.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

42.期末可供分配金额 0.0000

43.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

44.期末可供分配金额 0.0000

45.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

46.期末可供分配金额 0.0000

47.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

48.期末可供分配金额 0.0000

49.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

50.期末可供分配金额 0.0000

51.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

52.期末可供分配金额 0.0000

53.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

54.期末可供分配金额 0.0000

55.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

56.期末可供分配金额 0.0000

57.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

58.期末可供分配金额 0.0000

59.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

60.期末可供分配金额 0.0000

61.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

62.期末可供分配金额 0.0000

63.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

64.期末可供分配金额 0.0000

65.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

66.期末可供分配金额 0.0000

67.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

68.期末可供分配金额 0.0000

69.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

70.期末可供分配金额 0.0000

71.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

72.期末可供分配金额 0.0000

73.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

74.期末可供分配金额 0.0000

75.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

76.期末可供分配金额 0.0000

77.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

78.期末可供分配金额 0.0000

79.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

80.期末可供分配金额 0.0000

81.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

82.期末可供分配金额 0.0000

83.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

84.期末可供分配金额 0.0000

85.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

86.期末可供分配金额 0.0000

87.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

88.期末可供分配金额 0.0000

89.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

90.期末可供分配金额 0.0000

91.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

92.期末可供分配金额 0.0000

93.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

94.期末可供分配金额 0.0000

95.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

96.期末可供分配金额 0.0000

97.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

98.期末可供分配金额 0.0000

99.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

100.期末可供分配金额 0.0000

101.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

102.期末可供分配金额 0.0000

103.期末可供分配基金份额 4,476,780.00份

104.期末可供分配金额 0.0000