金鹰主题优势股票型证券投资基金

2014 年第 2 季度报告

2014 年 6 月 30 日

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： 二〇一四年七月十九日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 7 月 15 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 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金鹰主题优势股票
基金主代码	210005
交易代码	210005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月20日
报告期末基金份额总额	824,056,466.30份
投资目标	以追求资本可持续增值为目的，以深入的基本面分析为基础，把握主题投资的脉络，在充分控制风险的前提下，分享中国经济快速发展的成果以及企业经营绩效提升所带来的股权溢价，力争实现基金资产的长期可持续稳健增值。
投资策略	本基金坚持“自上而下”为主、“自下而上”为辅的投资视角，在实际投资过程中充分体现“主题优势”

	这个核心理念，以主题情景分析法把握经济发展不同阶段的主题投资节奏，优选并深挖不同阶段热点主题投资机会，优化资产配置，降低市场波动的冲击，扩大投资收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×75%＋中信标普国债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金为主动操作的股票型证券投资基金，属于证券投资基金中的高收益、高风险品种。
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

§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4月1日-2014年6月30日)
1.本期已实现收益	-12,003,909.93
2.本期利润	6,008,613.41
3.加权平均基金份额本期利润	0.0071
4.期末基金资产净值	555,930,976.56
5.期末基金份额净值	0.675

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、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

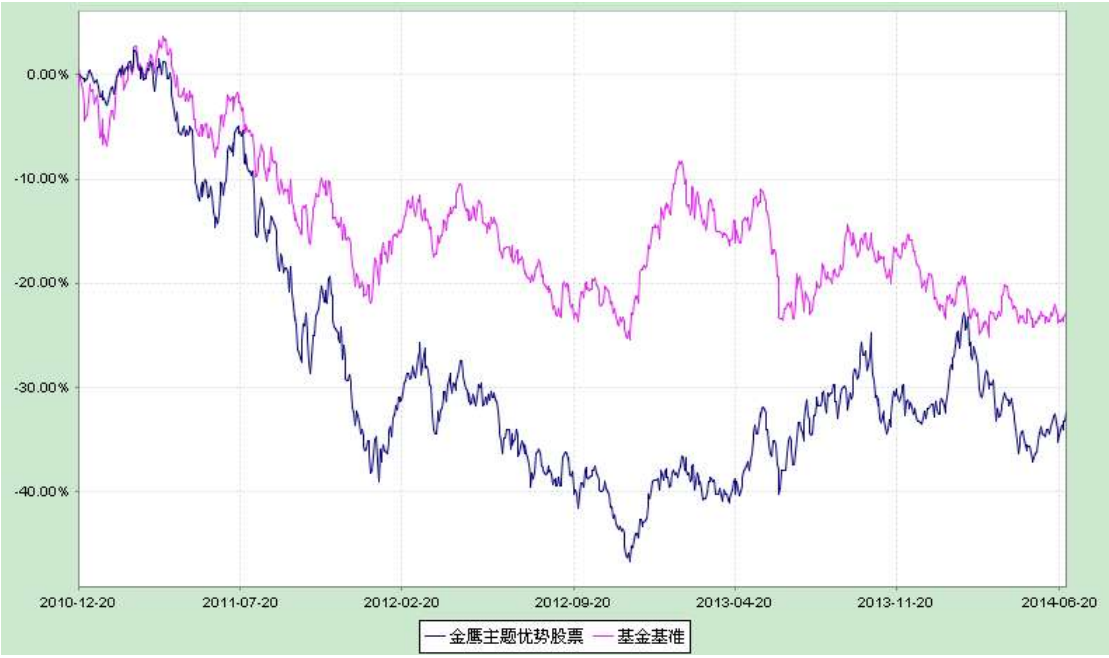
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.20%	0.94%	1.00%	0.66%	0.20%	0.28%

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

金鹰主题优势股票型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2010 年 12 月 20 日至 2014 年 6 月 30 日）



注：1、截至报告日本基金各项投资比例基本符合基金合同规定的各项比例；

2、本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×75%＋中信标普国债指数收益率×25%。

§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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
冼鸿鹏	基金经理	2010-12-20	-	8	冼鸿鹏先生，数量经济学专业硕士，证券从业经历8年。曾任职于广发证券，2007年4月加入金鹰基金管理有限公司，先后担任行业研究员、研究组长、金鹰中小盘精选证券投资基金基金经理助理等职。现任本基金基金经理。
陈立	基金经理	2013-8-15	-	7	陈立，经济学硕士，证券从业经历7年。曾任银华基金管理有限公司医药行业研究员，2009年6 月加盟金鹰基金管理有限公司，先后任行业研究员，非周期组组长、基金经理助理、投资经理。

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、《金鹰主题优势股票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，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未发生过同日反向交易的情况；与本公司管理的被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

2 季度股票市场整体表现窄幅波动的特征。报告期内上证综指上涨 0.7%，深成指上涨 2.1%。创业板指数在经历一轮下跌后反弹，2 季度整体上涨了 5.8%。2 季度市场投资主线是安全（军事、信息、能源等）、互联网化、转型与并购等。板块表现上，军工、计算机、通信、传媒、电子涨幅居前，交运、零售、食品饮料、服装、房地产表现居后。市场继续呈现存量资金博弈特征，景气度较好的医药、食品等板块内部估值也出现了较大的分化。

本基金在 2 季度以中低仓位操作为主，方向上继续配置医药、计算机等中长期景气板块以及转型升级较为明确的轻工板块，适度参与了一些主题投资。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值为 0.675 元，本报告期份额净值增长率 1.20%，同期业绩比较基准增长率为 1.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

海外市场方面，美国经济表现依然良好，预计逐步采取收紧货币的政策。但欧洲和日本经济则受到通缩困扰，将继续采取宽松的货币政策。国内市场方面，政府启动微刺激和定向降准等措施，相对于历史上的大规模全面刺激政策，一定程度上有助于缓解经济出现快速下滑的势头，稳定市场预期，另一方面也可以避免中国投资效率恶化和经济结构扭曲。但房地产下行压力 2 季度开始加大，是经济下行的风险因素。

本基金在投资思路上依然看好那些顺应转型升级、持续高景气行业的中长期价值。继续配置医药、食品板块中的成长股。在安全、互联网化、转型等主线背景下寻找计算机、通信、电子等板块的重大投资机会。择机适度参与国企改革、军工等主题投资。

§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	388,252,889.88	67.99
	其中：股票	388,252,889.88	67.99
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	88,300,000.00	15.46
	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	73,962,318.55	12.95
7	其他资产	20,568,632.96	3.60

8	合计	571,083,841.39	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	214,167,470.41	38.52
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	26,254.40	0.00
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	135,370,489.73	24.35
J	金融业	21,856,430.34	3.93
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	2,654,445.00	0.48
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	14,177,800.00	2.55
S	综合	-	-
	合计	388,252,889.88	69.84

5.3 报告期末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	002065	东华软件	1,750,818	35,226,458.16	6.34
2	300326	凯利泰	683,990	25,635,945.20	4.61
3	600016	民生银行	3,519,554	21,856,430.34	3.93
4	600050	中国联通	6,606,500	21,338,995.00	3.84
5	300273	和佳股份	668,193	20,513,525.10	3.69
6	300005	探路者	1,138,953	17,585,434.32	3.16
7	600271	航天信息	831,053	17,344,076.11	3.12
8	002228	合兴包装	1,727,854	16,898,412.12	3.04
9	300299	富春通信	1,239,252	15,887,210.64	2.86
10	002380	科远股份	628,539	15,864,324.36	2.85

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债券。

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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 本基金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	588,888.77
2	应收证券清算款	19,953,103.07
3	应收股利	-
4	应收利息	24,666.91

5	应收申购款	1,974.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,568,632.96

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 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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

报告期期初基金份额总额	859,081,079.49
报告期期间基金总申购份额	1,002,981.59
减：报告期期间基金总赎回份额	36,027,594.78
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	824,056,466.30

§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

经公司第四届董事会第三十七次会议决议通过，公司原总经理殷克胜先生已于 2014 年 6 月 5 日离职，由公司董事长刘东先生代行总经理职务。该事项已于 2014 年 6 月 9 日公告，详情请查看 2014 年 6 月 9 日的《证券时报》和公司网站公告内容。

§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主题优势股票型证券投资基金发行及募集的文件。

2、《金鹰主题优势股票型证券投资基金基金合同》。

3、《金鹰主题优势股票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、更新的招股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 020-83936180。

金鹰基金管理有限公司

二〇一四年七月十九日