华夏财富宝货币市场基金

【2014】第一季度报告

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年四月二十二日

§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1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华夏财富宝货币
基金主代码	000343
交易代码	000343
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年10月25日
报告期末基金份额总额	82,165,470,279.27份
投资目标	在力求安全性的前提下,追求稳定的绝对回报。
投资策略	本基金主要通过采取资产配置策略、个券选择策略、银行存款投资策略、利用短期市场机会的灵活策略等投资策略以实现投资目标。
业绩比较基准	七天通知存款税后利率。
风险收益特征	本基金为货币市场基金,基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
基金管理人	华夏基金管理有限公司
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1月1日-2014年3月31日)
1.本期已实现收益	632,847,768.84
2.本期利润	632,847,768.84
3.期末基金资产净值	82,165,470,279.27

注:①本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

②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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

③本基金按日结转份额。

3.2 基金净值表现

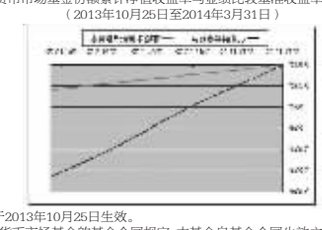
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.5382%	0.0022%	0.3329%	0.0000%	1.2053%	0.0022%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏财富宝货币市场基金份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013年10月25日至2014年3月31日)



注:①本基金合同于2013年10月25日生效。

②根据华夏财富宝货币市场基金的基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二部分(二)投资范围、(四)投资限制的有关约定。

§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		
曲波	本基金的基金经理、固定收益部总经理助理	2013-10-25	-	11年	清华大学工商管理学硕士。2003年7月加入华夏基金管理有限公司,曾任交易管理部交易员、华夏现金增利证券投资基金基金经理助理等。

注:①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

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 管理人对投资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《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规,本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内,本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内,未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量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

1季度,央行货币政策紧缩程度相对2013年下半年有所缓和,除春节前一周外,资金面整体较为宽裕,银行间7天回购利率在春节后一度降低至2.5%左右的较低水平。各类短期债券表现优异,到期收益率普遍下行50bp以上。本报告期,市场上货币基金的规模均较快增长,表现抢眼,各货币基金多首选投资于流动性好、收益较高的同业存款。

报告期内,本基金规模大幅度增加,在资产配置上绝大部分为短期存款,且剩余期限较短、期限匹配较好。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年3月31日, 本基金本报告期份额净值收益率为1.5382%, 同期业绩比较基准收益率为0.3329%,本基金的业绩比较基准为七天通知存款税后利率。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2季度,经济基本面仍不乐观,货币政策将仍偏友好。但由于2季度各种对资金面不利的因素较多,如财政缴款影响、外汇占款增长不乐观以及半年末时点因素等,资金面的波动性将较1季度高。同时,由于货币基金的规模在1季度快速膨胀,未来将面临更加复杂的监管环境。如何在复杂多变的市场环境中把握好流动性、收益性和风险性之间的平衡,将是所有货币基金的管理人面临的重大问题。

2季度,本基金将维持较高仓位的高流动性短期存款,做好期限匹配,在保证流动性的前提下争取获得较好的投资收益。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任,本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司"为信任奉献回报"的经营理念,规范运作,审慎投资,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	4,324,268,757.76	5.14
	其中:债券	4,324,268,757.76	5.14
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	4,692,700,000.00	5.57
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	74,148,761,397.75	88.08
4	其他各项资产	1,021,417,382.76	1.21
5	合计	84,187,147,538.27	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	1.60	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	1,981,893,323.05	2.41
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

报告期债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	57
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	78
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	33

报告期内投资组合平均剩余期限情况的说明

本基金合同约定:"基金投资组合的平均剩余期限不超过120天",本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	24.99	2.41
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	35.01	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	40.28	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.08	-
4	90天(含)—180天	0.21	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	0.73	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	101.22	2.41

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,324,268,757.76	5.26
	其中:政策性金融债	4,324,268,757.76	5.26
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	4,324,268,757.76	5.26
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	69,792,887.90	0.08

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	110234	11国开34	13,150,000	1,314,083,114.82	1.60
2	130218	13国开18	10,000,000	999,476,771.72	1.22
3	070205	07国开05	10,000,000	999,424,267.63	1.22
4	140204	14国开04	6,000,000	601,590,836.14	0.73
5	130248	13国开48	1,400,000	140,034,869.55	0.17
6	130214	13国开14	1,100,000	110,004,449.88	0.13
7	130236	13国开36	700,000	69,932,140.50	0.09
8	100236	10国开36	700,000	69,792,887.90	0.08
9	130232	13国开32	200,000	19,929,419.62	0.02
10	-	-	-	-	-

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.01%
报告期内偏离度的最低值	-0.00%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.00%

5.7 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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明

鉴于货币市场基金的特性,本基金采用摊余成本法计算基金资产净值,即本基金按持有债券投资的票面利率或商定利率每日计提应收利息,并按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价,以摊余的成本计算基金资产净值。

为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按市场利率或交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离,从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果,基金管理人采用"影子定价",即于每一计价日采用市场利率和交易价格对基金持有的计价对象进行重新评估,当基金资产净值与其他可参考公允价值指标产生重大偏离的,应按其他公允价值指标对组合的账面价值进行调整,调整差额确认为"公允价值变动损益",并按其他公允价值指标进行后续计量。如基金份额净值恢复至1.00元,可恢复使用摊余成本法估算公允价值。如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映基金资产公允价值的,基金管理人可根据具体情况,在与基金托管人商议后,按最能反映基金资产公允价值的方法估值。

5.8.2本报告期内本基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券,未发生该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

5.8.4 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	4,874.90
2	应收证券清算款	31,880.10
3	应收利息	618,757,789.92
4	应收申购款	402,622,837.84
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,021,417,382.76

5.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.5.1 本报告期内没有需特别说明的证券投资决策程序。

5.8.5.2 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

本报告期期初基金份额总额	1,064,670,460.95
本报告期基金总申购份额	130,123,569,135.96
减:本报告期基金总赎回份额	49,022,769,317.64
本报告期期末基金份额总额	82,165,470,279.27

§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

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内披露的主要事项

2014年1月22日发布关于华夏财富宝货币市场基金限制申购业务、暂停转换转入业务等事项的公告。

2014年2月12日发布关于限制华夏财富宝货币市场基金大额申购业务的公告。

2014年2月12日发布华夏基金管理有限公司公告。

2014年2月22日发布华夏基金管理有限公司关于暂停开放式基金网上下单转账支付业务的公告。

8.2 其他相关信息

华夏基金管理有限公司成立于1998年4月9日,是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京,在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司,在香港及深圳设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批QDII基金管理人、境内首只ETF基金管理人,以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人,香港子公司是首批RQFII基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

2014年3月,在《中国证券报》主办的"第十一届中国基金业金牛奖"的评选中,华夏基金第八次荣获年度"金牛基金管理公司奖",所管理的基金荣获6个单项奖:华夏现金增利货币荣获"2013年度货币市场金牛基金奖",华夏中小板ETF荣获"2013年度指数型金牛基金奖",华夏经典混合荣获"2013年度混合型金牛基金奖",华夏回报混合荣获"三年期混合型金牛基金奖",华夏大盘精选混合、华夏策略混合荣获"五年期混合型金牛基金奖"。

在客户服务方面,1季度,华夏基金继续以客户需求为导向,努力提高客户资金管理便利性:(1)华夏财富宝货币在微信理财通开通了申购和赎回等业务,方便投资者进行现金管理;(2)华夏现金增利货币在本公司电子交易平台部分支付渠道实现了基金份额变化实时可见,且可见即可用,提高投资者的交易效率;(3)开通了华夏基金百度轻应用,满足投资者服务渠道多样化的需求。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

9.1.1中国证监会核准基金募集的文件;

9.1.2《华夏财富宝货币市场基金合同》;

9.1.3《华夏财富宝货币市场基金托管协议》;

9.1.4法律意见书;

9.1.5基金管理人业务资格批件、营业执照;

9.1.6基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司
二〇一四年四月二十二日

金鹰保本混合型证券投资基金

【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:中国工商银行股份有限公司
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4月21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1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金鹰保本混合
基金主代码	210006
交易代码	210006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年5月17日
报告期末基金份额总额	320,573,973.95份
投资目标	采用改进的固定比例组合保险策略(CPPI),引入收益锁定机制,在严格控制投资风险、保证本金安全的基础上,力争在保本期结束时,实现基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金的保本策略为改进的固定比例组合保险策略(CPPI),是本基金投资运作过程中的核心策略;投资策略采用"自上而下"的投资视角,根据宏观经济与资本市场运行状况、固定收益类与权益类资产风险收益特性、基金净资产、价值底线、定性分析与定量分析并用,灵活动态地选取适当的风险乘数,以期对固定收益类与权益类资产之间的配置额进行优化调节,力争在确保本金安全的前提下,获取投资收益。
业绩比较基准	3年期银行定期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为积极配置的保本混合型基金,属于证券投资基金当中的低风险品种,其长期平均风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金,但高于货币市场基金。
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金保证人	广州国际集团有限公司

§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1月1日-2014年3月31日)
1.本期已实现收益	3,071,717.67
2.本期利润	3,121,830.54
3.加权平均基金份额本期利润	0.0094
4.期末基金资产净值	355,789,430.30
5.期末基金份额净值	1.110

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

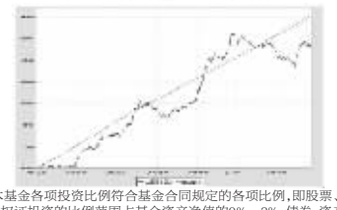
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.82%	0.13%	1.07%	0.01%	-0.25%	0.12%

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

金鹰保本混合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

(2011年5月17日至2014年3月31日)



注:1、截至报告日本基金各项投资比例符合基金合同规定的各项比例,即股票、权证占基金资产净值的比例为0%~40%,其中,权证投资的比例范围占基金资产净值的0%~3%;债券、资产支持证券、货币市场工具、现金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60%~100%,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%;

2、本基金的业绩比较基准为:3年期银行定期存款利率(税后)。

§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		
邱新红	基金经理	2011-5-17	-	11	邱新红先生,美国卡内基梅隆大学计算金融专业硕士,证券从业年限11年。曾任职于美国太平洋投资管理公司(PIMCO),担任投资组合经理助理。2008年3月到2010年6月担任Bayview资产管理公司的投资经理,负责债券投资组合管理。2010年8月加入金鹰基金管理有公司,任职债券研究员,现任固定收益投资部总监、本基金、金鹰持久回报分级债券型证券投资基金、金鹰元丰保本混合型证券投资基金、金鹰元安保本混合型证券投资基金、金鹰元盛分级债券型发起式证券投资基金基金经理。
洪利平	基金经理	2013-4-12	-	5	洪利平女士,西南财经大学硕士,证券从业年限5年,曾任职于生命人寿保险股份有限公司,任债券交易员;2010年7月加入金鹰基金管理有限公司,现任本基金、金鹰货币市场证券投资基金及金鹰元丰保本混合型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 管理人对投资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、《金鹰保本混合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

回顾2014年一季度,随着国内经济数据的下行, A股出现了整体回落,以创业板为主的小市值股票回落显著。由于市场对稳增长的政策的预期,蓝筹股开始企稳。一季度随着资金面的相对宽松债券市场有不错表现,尤其是中短端债券收益率下降幅度较大,如1年期AAA评级短融在1季度收益率下降了100BP左右。由于市场对未来货币政策非常大的不确定性,长端利率还处在历史高位。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年3月31日,基金份额净值为1.110元,本报告期份额净值增长率为0.82%,同期业绩比较基准增长率为1.07%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于目前的债市环境,我们看好二季度的债券市场。虽然一季度短端利率随着流动性改善显著下行,但是整体上债券的收益率处在历史高位,并没有充分反映未来经济进一步下行带来的衰退性宽松。我们认为债券收益率还有很大的向下空间。随着二季度稳增长政策的出台和实施,我们认为二季度A股市场低估值大盘蓝筹股会有相对收益,小盘成长股会进入较长的调整时期。

§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	20,582,107.09	5.22
	其中:股票	20,582,107.09	5.22
2	固定收益投资	268,480,648.50	68.12
	其中:债券	268,480,648.50	68.12
	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	90,908,501.98	23.07
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	40,908,306.98	11.50
6	银行存款和结算备付金合计	4,948,396.03	1.26
7	其他资产	9,214,402.10	2.34
8	合计	394,134,055.70	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	20,582,107.09	5.78
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	20,582,107.09	5.78

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	002444	巨星科技	899,860	7,963,761.00	2.24
2	002521	齐峰新材	699,916	5,949,286.00	1.67
3	300128	锦富新材	446,427	4,575,876.75	1.29
4	002048	宁波华翔	199,922	2,093,183.34	0.59
5	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

注:本基金本报告期末只持有4只股票投资。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	38,308,000.00	10.77
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	196,791,648.50	55.31
5	企业短期融资券	3,018,000.00	0.85
6	中期票据	30,363,000.00	8.53
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	268,480,648.50	75.46

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1182254	11甘公投MTN1	300,000	30,363,000.00	8.53
2	122086	11正泰债	300,000	29,994,000.00	8.43
3	122080	11康美债	280,250	27,828,825.00	7.82
4	122803	11滁州债	200,000	20,322,000.00	5.71
5	130014	13附息国债14	200,000	20,026,000.00	5.63

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	73,046.18
2	应收证券清算款	2,000,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	7,140,958.89
5	应收申购款	397.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,214,402.10

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	343,035,958.74
报告期期间基金总申购份额	136,582.45
减:报告期期间基金总赎回份额	22,598,567.24
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	320,573,973.95

§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

本报告期没有影响投资者决策的其他重要信息。

§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保本混合型证券投资基金发行及募集的文件。

2、《金鹰保本混合型证券投资基金基金合同》。

3、《金鹰保本混合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
二〇一四年四月二十二日

金鹰策略配置股票型证券投资基金

【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:中信银行股份有限公司
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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年4月21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1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金鹰策略配置股票
基金主代码	210008
交易代码	210008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年9月1日
报告期末基金份额总额	106,006,230.04份
投资目标	在对基本面进行深入分析的基础上,制定适当的投资策略,以策略指导投资运作,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	"防御"与"进取"的权衡与取舍是本基金进行大类资产配置、行业配置过程中的重要决策依据。通过对宏观经济处投资时钟象限的判断、对股票市场与资金市场之间资利空间的测度,综合考察国内外宏观经济、财政政策与货币政策新动向、资本市场运行状况,对"防御"与"进取"目标适时、适度地有所侧重,将是本基金在投资策略上的现实选择。
业绩比较基准	沪深300指数增长率×75%+中信标普国债指数增长率×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预期收益与风险较高的品种。一般情形下,其风险和预期收益均高于货币型基金、债券型基金和混合型基金。
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司

§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1月1日-2014年3月31日)
1.本期已实现收益	3,794,556.89
2.本期利润	-2,009,389.98
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0171
4.期末基金资产净值	100,938,989.99
5.期末基金份额净值	0.9522

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