金鹰元盛分级债券型发起式证券投资基金

【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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月22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	金鹰元盛
基金主代码	162108
基金运作方式	契约型
基金合同生效日	2013年5月2日
报告期末基金份额总额	1,067,645,349.43份
投资目标	在严格控制投资风险的前提下,通过积极主动的投资管理,力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报,实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金资产配置采用自上而下的投资视角,定性分析与定量分析并用,结合国内外政治经济环境、宏观政策、利率变化等,合理确定基金在普通债券、货币市场工具等资产类别上的投资比例,并随着各类资产风险收益特征的相对变化,适时动态地调整本基金投资于普通债券、货币市场工具等资产的比例与期限结构。
业绩比较基准	中国债券综合财富指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金当中风险较低的品种,其长期平均风险与预期收益率低于股票型基金、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	中国建设银行股份有限公司
下属两级基金的基金简称	元盛A / 元盛B
下属两级基金的交易代码	162109 / 150132
报告期末下属两级基金的份额总额	116,577,627.98份 / 951,067,721.45份
下属两级基金的风险收益特征	自基金合同生效之日起2年内,元盛A的预期收益稳定、风险低。 / 自基金合同生效之日起2年内,元盛B由于具有一定的杠杆倍数,其预期收益与风险较高。

§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	5,042,950.10
2.本期利润	30,820,871.88
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0289
4.期末基金资产净值	1,041,378,288.91
5.期末基金份额净值	0.975

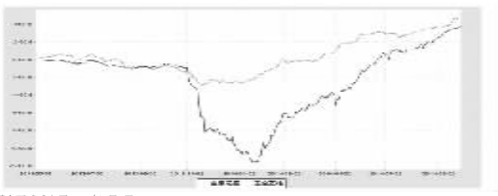
注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额;
2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;
3、基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

主要财务指标	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	2.96%	0.19%	1.65%	0.07%	1.31%	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



注:1、本基金正式成立于2013年5月2日;
2、本基金建仓期为合同生效后6个月,建仓期结束时各项资产配置比例已基本符合本基金合同的有关规定。

3、本基金主要投资于固定收益类证券,包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债(含分离交易可转债)、资产支持证券、短期融资券、回购、货币等固定收益类产品,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益证券品种(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金对固定收益类金融工具的投资比例不低于基金资产的80%,其中中小企业私募债券的投资比例不超过基金资产的20%。

3.3 其他指标

截至本报告期末,本基金元盛A与元盛B份额配比为0.1226;根据本基金合同规定,元盛A本期约定年收益为4.5%。

§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
邱新红	基金经理	2013-5-2	-	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以及金鹰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、《金鹰元盛分级债券型发起式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

随着央行下调正回购利率以及相对宽松的资金环境,3季度长期限债券收益率显著下降,10年国债、政策性金融债下降30BP左右,5年期AA评级无担保城投收益率下降40BP左右,而短端收益率变动不大。金鹰元盛分级基金在三季度的投资中逐步降低了基金杠杆,但我们仍然看好四季度的债市行情,基金杠杆仍相对较高;在资产配置方面主要为中高等级信用债。

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0.975元,本报告期份额净值增长率为2.96%,同期业绩比较基准增长率为1.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为经济下行压力仍较大,"稳增长"政策基调下,资金面将以平稳为主,我们仍然相对看好四季度的债券市场的表现,部分债券品种仍有不错的配置价值,绝对收益相对较高的中高等级信用债仍有不错的持有价值。我们仍然对高收益低评级债券持规避态度,随着信用债发债主体的逐步扩大,未来实质违约风险的可能会逐步暴露,因此我们对低等级债券仍然持谨慎态度。

§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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	2,751,599,333.00	91.39
	其中:债券	2,751,599,333.00	91.39
	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	129,576,901.35	4.30
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	129,576,901.35	4.30
6	银行存款和结算备付金合计	63,820,229.75	2.12
7	其他资产	65,857,126.56	2.19
8	合计	3,010,853,590.66	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金报告期末未持有股票。

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
本基金报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按券种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	9,516,000.00	0.91
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	2,671,861,333.00	256.57
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	70,222,000.00	6.74
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	2,751,599,333.00	264.23

5.5 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	122711	12郑新债	1,172,070	124,825,455.00	11.99
2	124196	13烟城建	1,198,980	120,473,510.40	11.57
3	122840	11临汾债	1,084,440	113,215,536.00	10.87
4	124106	12邯郸债	1,100,010	113,191,029.00	10.87
5	124292	13溧城建	1,000,000	99,880,000.00	9.59

5.6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序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投资。

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 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	109,252.22
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	65,747,874.34
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	65,857,126.56

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
本基金本报告期末未持有股票投资。

5.11.6 其他需说明的重要事项
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 基金份额变动

单位:份

项目	元盛A	元盛B
报告期期初基金份额总额	116,577,627.98	951,067,721.45
报告期期间总申购份额	-	-
减:报告期期间总赎回份额	-	-
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	116,577,627.98	951,067,721.45

§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

单位:份

项目	元盛A	元盛B
报告期期初管理人持有的本基金份额	5227606.30	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	5227606.30	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.49%	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
无

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	5,227,606.30	0.49%	5,227,606.30	0.49%	3年
基金管理人高级管理人员	2,847,014.06	0.27%	3,860,779.04	0.36%	3年
基金经理等人员	210,035.10	0.02%	210,035.10	0.02%	3年
基金管理人股东	4,000,540.00	0.37%	4,000,540.00	0.37%	3年
其他	4,739,232.11	0.44%	7,873,425.30	0.44%	3年
合计	17,024,427.57	1.59%	21,172,385.74	1.98%	3年

注:本基金管理人、股东以及相关从业人员作为发起人认购的份额已经全部冻结,因折算等原因会引起发起份额总数发生调整,以本基金管理人最新公布的数据为准。

§9 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董事。新一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)、吴晓味先生(独立董事)、凌富华先生、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。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录
1、中国证监会批准金鹰元盛分级债券型发起式证券投资基金发行及募集的文件。
2、《金鹰元盛分级债券型发起式证券投资基金基金合同》。
3、《金鹰元盛分级债券型发起式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。

10.2 存放地点
广州市天河区体育西路189号城建大厦22-23层

10.3 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
二〇一四年十月二十四日

金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金

【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: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	金鹰元泰信用债债券	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年11月29日	
报告期末基金份额总额	29,609,691.45份	
投资目标	在严格控制投资风险、保持较高流动性的前提下,力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报,进而实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金大类资产配置采用自上而下的投资视角,定性分析与定量分析并用,结合国内外政治经济环境、政策形势、金融市场走势(尤其是未来利率的变化趋势),分析判断市场时机,合理确定基金在债券、股票、货币等资产类别上的投资比例,并随着各类资产风险收益特征的相对变化,适时动态地调整本基金投资于债券、股票、货币市场工具的比例与期限结构。	
业绩比较基准	中债企业债总全价指数收益率×80%+中国国债总全价指数收益率×20%	
风险收益特征	本基金为积极配置的债券型基金,属于证券投资基金当中风险较低的品种,其长期平均风险与预期收益率低于股票型基金、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	交通银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	金鹰元泰信用债A	金鹰元泰信用债C
下属两级基金的交易代码	210010	210011
报告期末下属两级基金的份额总额	13,794,837.58份	15,814,853.87份

§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)	
	金鹰元泰信用债A	金鹰元泰信用债C
1.本期已实现收益	290,149.19	306,024.06
2.本期利润	453,125.50	477,954.73
3.加权平均基金份额本期利润	0.0207	0.0180
4.期末基金资产净值	15,056,411.82	17,129,762.13
5.期末基金份额净值	1.0915	1.0831

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、期末可供分配利润,指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

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

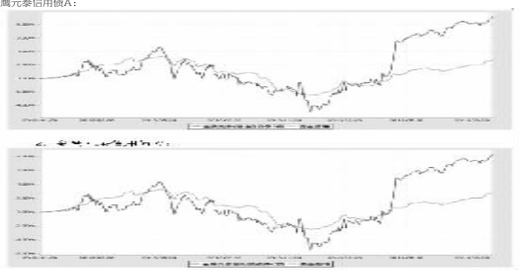
1、金鹰元泰信用债A:

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	2.13%	0.14%	1.16%	0.06%	0.97%	0.08%

2、金鹰元泰信用债C:

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	2.03%	0.14%	1.16%	0.06%	0.87%	0.08%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计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



注:1、本基金合同于2014年8月27日正式生效;2、按基金合同规定,本基金自基金合同生效起三个月内为建仓期,截止报告日本基金的各项投资比例基本符合基金合同规定的各项比例。3、本基金业绩比较基准为:中证700指数收益率*75%+中信标普国债指数收益率*25%。

注:1、本基金合同生效日期为2012年11月29日。
2、截至报告日本基金的投资比例符合本基金基金合同规定,即本基金对固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的80%,其中对信用债券的投资比例不低于固定收益类资产的80%;对股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的20%,其中,权证投资的比例范围占基金资产净值的0-3%。
3、本基金的业绩比较基准为:中债企业债总全价指数收益率×80%+中债国债总全价指数收益率×20%

§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
张俊杰	基金经理	2013-9-23	-	7	张俊杰先生,厦门大学金融工程硕士,证券从业年限7年,2007年7月至2013年4月任职于平安证券有限责任公司,历任衍生产品部金融工程研究员、固定收益事业部高级经理,债券研究员等;2013年4月加入金鹰基金管理有限公司。现任本基金基金经理。

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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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、《金鹰元泰精选信用债债券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

报告期内,上证指数上涨15.40%,深成指上涨10.04%,中小板综指上涨23.41%,创业板指上涨9.69%,其中上证指数和中小板综指更是创出4年来的季度最高涨幅。三季度市场情绪高涨,外围股市继续向好,二季度微刺激政策开始发挥效应,流动性也相对宽松,进一步增强投资人的做多信心,增量资金进场迹象明显,各行业、板块轮番上涨。报告期内本基金积极做多,在稳定持有核心资产的基础上,提高换手率,紧跟市场节奏,取得较好的收益。过去两年的结构性牛市能生了诸多牛股,通过积极有效的主动选股和仓位管理,我们取得了一定的绝对回报,也持续跑赢业绩基准,但最新的基金净值距离历史高位仍有6%的距离需要我们去努力赚登。感谢持有人长期以来的信任和支持,尤其是认同我们的投资风格并在2011、2012年陪伴我们一起走过熊市的持有人,您们的信任和支持一直是我们做好投资的动力,尽一切所能为您们奉献正回报也一直被我们视为天职。

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0.9883元,本报告期份额净值增长率为16.61%,同期业绩比较基准收益率为16.36%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,外围市场波动可能加大,国内经济仍将继续维持低速稳定局面,考虑到资金面、政策面以及市场估值因素,我们维持市场发生严重系统性风险概率较低的判断,预计市场仍将延续今年以来的投资格局,资产注入投资主题以及进入估值切换期的成长性行业仍会是主流资金配置方向。本基金坚持跟随经济转型方向,本基金坚持跟随经济转型方向,本基金坚持自上选股的投资策略,仍将重点持有业绩持续较高增长的行业及公司和市场空间巨大的转型企业股票,适当增加医药、医疗类资产配置,对"能源革命"下的清洁能源、新能源汽车、节能技术等投资主题持续予以高度关注。

§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	3,249,100.00	6.78
	其中:股票	3,249,100.00	6.78
2	固定收益投资	41,538,571.40	86.73
	其中:债券	41,538,571.40	86.73
	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	2,312,030.69	4.83
7	其他资产	791,848.96	1.65
8	合计	47,891,551.05	100.00

5.2 报告期末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	-	-
B	采矿业	1,096,300.00	3.41
C	制造业	1,170,000.00	3.64
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	982,800.00	3.05
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	3,249,100.00	10.09

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	002202	金风科技	100,000	1,170,000.00	3.64
2	000571	新大洲A	190,000	1,096,300.00	3.41
3	002441	众业达	42,000	982,800.00	3.05
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

注:本基金报告期末仅持有3只股票。

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	2,005,800.00	6.23
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	39,532,771.40	122.83
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	41,538,571.40	129.06

5.5 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	122051	10石化01	200,000	19,912,000.00	61.87
2	122825	11景德镇	67,630	7,074,098.00	21.98
3	122214	12大秦债	69,630	6,975,533.40	21.67
4	126018	08江铜债	60,000	5,569,200.00	17.30
5	019322	13国债22	20,000	2,005,800.00	6.23

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
本报告期本基金无贵金属投资。

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
本基金本报告期末未持有权证。

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
本基金本报告期末未持有股指期货投资。

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 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	52,566.41
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	726,813.76
5	应收申购款	12,468.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	791,848.96

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本报告期末未持有处于转股期债券。

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

项目	金鹰元泰信用债A	金鹰元泰信用债C
报告期期初基金份额总额	25,689,945.65	41,193,815.43
报告期期间基金总申购份额	5,327,037.94	8,185,052.26
减:报告期期间基金总赎回份额	17,222,146.01	33,564,013.82
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	13,794,837.58	15,814,853.87

§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董事。新一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)、吴晓味先生(独立董事)、凌富华先生、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元泰精选信用债债券型证券投资基金发行及募集的文件。
2、《金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金基金合同》。
3、《金鹰元泰精选信用债债券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
二〇一四年十月二十四日

金鹰中小盘精选证券投资基金

【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: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	金鹰中小盘精选混合
基金主代码	162102
交易代码	162102
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年5月27日
报告期末基金份额总额	1,755,068,553.69份
投资目标	本基金投资具有较高成长性和良好基本面的中小盘股票,通过积极的投资组合管理,在控制风险的前提下谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略