金鹰行业优势股票型证券投资基金

【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: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 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	金鹰行业优势股票
基金主代码	210003
交易代码	210003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年7月1日
报告期末基金份额总额	677,664,806.90份
投资目标	以追求长期资本可持续增值为目的,以深入的基本面分析为基础,通过投资于优势行业当中的优势股票,在充分控制风险的前提下,分享中国经济快速发展的成果,进而实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采用"自上而下"的投资方法,定性分析与定量分析并用,综合分析国内外政治经济环境、政策形势、金融市场走势、行业景气等因素,研判市场时机,结合货币市场、债券市场和股票市场估值等状况,进行资产配置及组合的构建,合理确定基金在股票、债券、现金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,适时动态地调整股票、债券和货币市场工具的投资比例,以最大限度地降低投资组合的风险,提高收益。
业绩比较基准	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%。
风险收益特征	本基金为主动管理的股票型证券投资基金,属于证券投资基金中的风险和预期收益较高品种。一般情形下,其预期风险和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	34,160,961.58
2.本期利润	48,050,295.36
3.加权平均基金份额本期利润	0.0652
4.期末基金资产净值	564,119,540.30
5.期末基金份额净值	0.8324

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。

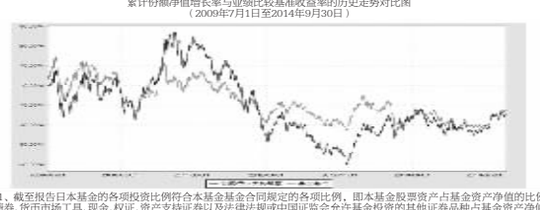
3.2 基金净值表现

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	8.39%	0.87%	10.10%	0.67%	-1.71%	0.20%

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

金鹰行业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
(2009年7月1日至2014年9月30日)



注:1、截至报告日本基金的各项投资比例符合本基金基金合同规定的各项比例,即本基金股票资产占基金资产净值的比例为60%-95%;债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产净值的比例为5%-40%,权证投资的比例范围占基金资产净值的0-3%;
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		
何晓春	公司权益投资部总监,基金经理	2012-7-26	-	15年	何晓春先生,产业经济学博士,15年金融行业从业经验,曾任东莞宏远期货经纪有限公司郑州代表处负责人,东莞宏远期货经纪有限公司副总经理、总经理,江南期货有限责任公司总经理助理、总经理、董事长,广永期货有限责任公司总裁,瑞龙期货有限责任公司总经理,世纪证券有限责任公司江西分公司筹办组负责人等职,2011年4月加入金鹰基金管理有限公司,现任公司权益投资部总监、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 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、《金鹰行业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年第三季度,创业板指数经过了7月份的调整之后,进入了8、9月份震荡上扬的阶段,在全球风险偏好显著抬升及国内货币环境边际改善的预期推动下,整个三季度市场呈现一定力度的反弹。在经济回落加速背景下,政府逐步展开了一系列逆周期管理的微刺激政策,叠加沪港通正式运行临近的预期,权重板块开始呈现企稳迹象,指数呈现窄幅波动。三季度行业和股票表现分化依旧明显。除国防军工板块依旧表现抢眼之外、二季度表现较差的交通运输、纺织服装、农林牧渔等板块表现强劲,市场呈现了一定的行业轮动的特征,而银行、家电等传统板块表现最弱。从市场风格看,成长股涨幅仍继续大幅超越低估值蓝筹,纵观三季度个股,业绩预期并未成为市场关注重心,小市值、转型预期及事件驱化等题材类个股表现突出。主题投资方面,通用航空、土地流转、太阳能发电、国企改革、核能核电重启等方向得到市场的追捧,本基金由于较少参与主题投资,基金业绩增长表现一般。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止2014年9月30日,基金份额净值为0.8324元,本报告期基金净值增长率为8.39%,同期业绩比较基准增长率为10.10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

四季度从宏观上看,国内货币政策在CPI低位运行的环境下大概率回维持中性偏松,流动性将会有一定的边际改善。政府出台房地产及地方政府发债新政表达了比较强的托底意图。海外美国QE的退出对经济及金融市场的冲击将逐渐显现,而国内沪港通的实施也将对市场带来变化。短期看,环保、轨道交通、新能源等方面的投资依然会加大。结构性行情可能是未来证券市场运行的主要特点,由于经济的转型升级及国企改革的有利政策环境,政策和题材性的行情也会层出不穷,但考虑到三季度有些主题及概念已经出现一定的泡沫,市场可能会出现回调。基于以上分析,本基金在仓位上将适度灵活,配置上以低估值蓝筹(金融、地产、大众消费品、医药等)和业绩增长确定性极强的细分行业龙头股为重点,长期看好新能源汽车和具有核心竞争力的科技类公司,积极参与国企改革的主题。

§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	523,909,632.66	91.15
	其中:股票	523,909,632.66	91.15
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	10,000,000.00	1.74
	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	40,662,220.79	7.07
7	其他资产	181,223.24	0.03
8	合计	574,753,076.69	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	-	-
C	制造业	245,555,954.83	43.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	55,586,860.24	9.85
E	建筑业	9,882,246.32	1.75
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	17,932,200.00	3.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,524,300.00	1.87
J	金融业	126,038,137.35	22.34
K	房地产业	57,507,534.98	10.19
L	租赁和商务服务业	882,398.94	0.16
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	523,909,632.66	92.87

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	600969	郴电国际	3,458,832	55,583,430.24	9.85
2	002594	比亚迪	1,068,080	52,154,346.40	9.25
3	600016	民生银行	8,330,106	51,979,861.44	9.21
4	600079	人福医药	1,780,272	49,171,112.64	8.72
5	002698	博实股份	1,774,879	47,744,245.10	8.46
6	000002	万 科A	5,086,311	46,692,334.98	8.28
7	002249	大洋电机	2,482,643	35,129,398.45	6.23
8	600030	中信证券	2,363,099	31,476,478.68	5.58
9	600298	安琪酵母	1,438,503	27,374,712.09	4.85
10	601628	中国人寿	1,680,000	26,124,000.00	4.63

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组合。

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

本基金本报告期末无投资贵金属。

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

本基金本报告期末无国债期货持仓。

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 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	158,188.06
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,132.93
5	应收申购款	14,902.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	181,223.24

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末无处于转股期的可转换债券明细。

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的情况。

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	769,741,006.13
报告期期间基金总申购份额	4,658,827.11
减:报告期期间基金总赎回份额	96,735,026.34
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	677,664,806.90

§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日正式聘请刘尚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)、吴晓球先生(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行业优势股票型证券投资基金发行及募集的文件。

2、《金鹰行业优势股票型证券投资基金基金合同》。

3、《金鹰行业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、更新的招募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:4006-135-888,020-83936180

网址:http://www.gefund.com.cn

金鹰基金管理有限公司
二〇一四年十月二十四日

金鹰元安保本混合型证券投资基金

【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:广发银行股份有限公司
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。

基金托管人广发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	金鹰元安保本混合
基金主代码	000110
交易代码	000110
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年5月20日
报告期末基金份额总额	115,204,932.88份
投资目标	本基金运用投资组合保险策略,严格控制投资风险,在为符合保本条件的投资金额提供保本保障的基础上,力争在保本周期到期时实现基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金在投资组合管理过程中采取主动投资方法,通过数量化方法严格控制风险,并通过有效的资产配置策略,动态调整安全资产和风险资产的投资比例,以确保保本周期到期时实现基金资产的稳健增值。
业绩比较基准	2年期银行定期存款利率(税后) 在基金合同生效日,业绩比较基准为中国人民银行公布的、该日适用的2年期银行定期存款利率(税后);并随着2年期银行定期存款利率的调整而动态调整。
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,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	广发银行股份有限公司
基金保证人	中海信达担保有限公司

§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	2,484,958.81
2.本期利润	5,608,573.82
3.加权平均基金份额本期利润	0.0441
4.期末基金资产净值	127,288,711.00
5.期末基金份额净值	1.1049

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)。

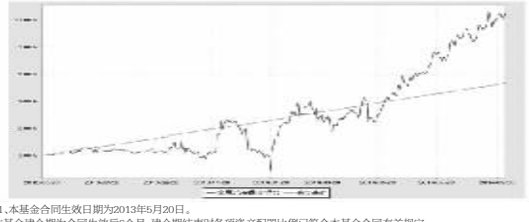
3.2 基金净值表现

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

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	4.18%	0.27%	0.96%	0.01%	3.22%	0.26%

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

金鹰元安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
(2013年5月20日至2014年9月30日)



注:1、本基金合同生效日期为2013年5月20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符合本基金合同有关规定。
3、本基金的业绩比较基准为:2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	2013-5-20	-	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。
杨刚	基金经理	2014-9-30	-	18	杨刚先生,硕士,1996年7月至2001年4月就职于大鹏证券综合研究所,历任高级研究员和部门主管;2001年5月至2009年3月就职于平安证券综合研究所,先后负责行业研究、宏观策略研究及协助研究所管理工作,历任高级研究员、部门主管和副所长;2009年4月至2010年4月就职于平安证券资产管理部,担任执行总经理;2010年5月加入金鹰基金管理有限公司,担任研究发展部研究总监。现任本基金基金经理。

注:1、本报告期,本基金新增杨刚先生担任本基金基金经理,与邱新红先生共同管理本基金;
2、任职日期和离任日期指公司公告聘任或解聘日期;
3、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、《金鹰元安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

本基金三季度抓住了债券市场的延续牛市行情,在货币政策宽松和经济数据疲软的大背景下,本基金在操作上延续适度的杠杆操作,资产配置方面选择中高等级信用债为重点投资品种的策略,以持有为主,维持杠杆操作。

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1.1049元,本报告期份额净值增长率为4.18%,同期业绩比较基准增长率为0.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

鉴于内需疲弱、PPI持续回落等因素,反映经济仍存下行压力,加上货币政策的持续宽松,四季度债券市场收益率将维持稳中下行的格局。但不排除政策因素导致的经济短期反弹。本基金的操作将维持目前的持有中高等级信用品种的策略。

§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	26,182,375.56	12.45
	其中:股票	26,182,375.56	12.45
2	固定收益投资	154,744,930.10	73.60
	其中:债券	154,744,930.10	73.60
	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	20,000,150.00	9.51
	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	5,013,131.16	2.38
7	其他资产	4,316,049.81	2.05
8	合计	210,256,636.63	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	-	-
C	制造业	26,182,375.56	20.57
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	26,182,375.56	20.57

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	002630	华西能源	533,413	11,735,086.00	9.22
2	600869	智慧能源	638,036	6,673,856.56	5.24
3	002514	宝馨科技	399,900	6,430,392.00	5.05
4	300034	钢研高纳	58,800	1,300,656.00	1.02
5	300396	迪瑞医疗	500	40,150.00	0.03
6	300402	宝色股份	500	2,235.00	0.00
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

注:本基金本报告期末共持有六只股票。

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	央行票据	-	-
3	金融债券	9,994,000.00	7.85
	其中:政策性金融债	9,994,000.00	7.85
4	企业债券	144,750,930.10	113.72
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	154,744,930.10	121.57

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	112181	13广发01	512,570	50,795,687.00	39.91
2	124197	10朝资01	300,000	30,066,000.00	23.62
3	112111	12深机01	248,890	24,948,733.60	19.60
4	122515	12庆城投	119,990	12,310,974.00	9.67
5	122036	09沪张江	100,000	10,026,000.00	7.88

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

本基金本报告期末无国债期货持仓。

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 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	71,573.50
2	应收证券清算款	494,140.59
3	应收股利	-
4	应收利息	3,700,830.76
5	应收申购款	49,504.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,316,049.81

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002630	华西能源	11,735,086.00	9.22	因筹划重大事项,存在不确定性,为维护投资者利益于2014年9月29日期停牌。
2	002514	宝馨科技	6,430,392.00	5.05	因筹划重大事项,存在不确定性,为维护投资者利益于2014年9月24日期停牌。
3	300402	宝色股份	2,235.00	0.00	首次公开发行股票暂未上市流通。
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

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	136,943,129.37
报告期期间基金总申购份额	490,548.92
减:报告期期间基金总赎回份额	22,228,745.41
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	115,204,932.88

§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日正式聘请刘尚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、刘国常先生(独立董事)、吴晓球先生(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安保本混合型证券投资基金发行及募集的文件。

2、《金鹰元安保本混合型证券投资基金基金合同》。

3、《金鹰元安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、更新的招募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,也可登录基金管理人网站查阅,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

金鹰元丰保本混合型证券投资基金

【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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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	金鹰元丰保本混合
基金主代码	210014
交易代码	210014
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年1月30日
报告期末基金份额总额	213,975,743.72份
投资目标	本基金运用投资组合保险策略,在严格控制投资风险,保证本金安全的基础上,力争在保本周期结束时,实现基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金在投资组合管理过程中采取主动投资方法,通过数量化方法严格控制风险,以保障基金资产本金的安全,并通过有效的资产配置策略,获得基金资产的稳健增值。
业绩比较基准	2年期银行定期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为保本混合型基金,属于证券投资基金中的低风险品种。
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
基金保证人	中海信达担保有限公司

注:本基金第二个保本期由广州越秀金融控股集团有限公司提供不可撤销连带责任保证。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3