金鹰红利价值灵活配置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: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	金鹰红利价值混合
基金主代码	210002
交易代码	210002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年12月4日
报告期末基金份额总额	96,269,872.57份
投资目标	本基金通过对分红能力良好且长期投资价值突出的优质股票投资,为基金资产获取稳定的当期收益和长期增值。
投资策略	本基金采取积极主动式投资管理,通过积极的资产配置策略,深入研究、调研基础上的主动性证券选择和市场时机选择,在合理控制投资风险的前提下,最大限度地获取投资收益。本基金主要投资于分红能力良好且长期价值突出的优质企业,股票资产占基金资产净值比例为30%-80%;现金、债券资产、其他资产以及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20%—70%,其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;权证投资占基金资产净值的比例不超过3%。
业绩比较基准	中证红利指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。
风险收益特征	本基金风险收益特征从长期来看,其风险与预期收益高于债券型基金,低于股票型基金。
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

§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	9,654,667.50
2.本期利润	17,006,049.27
3.加权平均基金份额本期利润	0.1978
4.期末基金资产净值	128,128,751.83
5.期末基金份额净值	1.3309

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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。2.所述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。

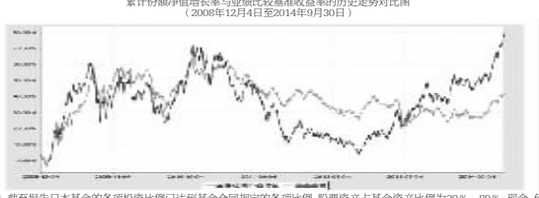
3.2 基金净值表现

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	17.81%	0.72%	10.88%	0.52%	6.93%	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

金鹰红利价值灵活配置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
(2008年12月4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已达到基金合同规定的各项比例,股票资产占基金资产比例为30%-80%;现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为20%-70%,其中因流动性管理导致的期末现金或者到期日在一年以内的政府债券低于基金资产净值的5%的情况以及时调整回复;权证投资占基金资产净值的比例不超过3%。2.本基金的业绩比较基准为:中证红利指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。

§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		
朱丹	基金经理	2011-6-11	-	8	朱丹女士,金融学硕士,曾任职于深圳晨星咨询公司,2007年5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、基金经理助理等职,现任本基金基金经理以及金鹰中小盘精选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颁布的《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、《金鹰红利价值灵活配置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

报告期内市场大幅上行,上证综指上涨15.40%,深证成指上涨10.04%,中小板综指上涨16.90%,创业板指数上涨9.69%。以央行定向降准为代表的"微刺激"政策表明宏观调控在减速、转型、调结构的同时也开始注重保持经济的平稳运行,这一信号提升了市场的做多情绪,A股市场随之在5月中下旬触底反弹,结构性投资机会纷呈,主题投资大行其道,军工、计算机行业表现尤为出色。本基金三季度保持较高的股票仓位,重点配置机器人、信息安全和环保主题类的成长股,取得一定的成效。

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1.3309元,本报告期份额净值增长率为17.81%,同期业绩比较基准收益率为10.88%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在三季度市场大幅上涨的背景下,我们预测四季度市场的机会会减少,主题性炒作会逐步降温,而一些业绩真实增长的股票又会重新得到市场重视。总体来说,我们对于我国经济转型以及社会发展的中长期前景保持乐观和信心,符合转型方向的行业仍然是本基金中长期投资的重点领域,我们重点关注移动互联网给各行各业带来的变革,以及能源革命在清洁能源、新能源汽车、节能技术等领域中所涌现的投资机会,并将继续持有并择机增配与这些投资方向相关的个股。

§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	78,404,979.74	57.62
	其中:股票	78,404,979.74	57.62
2	固定收益投资	5,839,650.50	4.29
	其中:债券	5,839,650.50	4.29
	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	7,560,997.44	5.56
7	其他资产	44,271,971.00	32.53
8	合计	136,077,598.68	100.00

注:其他资产包括:交易保证金、应收利息、应收证券清算款、其他应收款、应收申购款。

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	61,918,527.10	48.33
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	3,582,815.34	2.80
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	12,695,837.30	9.91
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	207,800.00	0.16
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	78,404,979.74	61.19

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	002345	潮宏基	770,962	7,524,589.12	5.87
2	600894	广日股份	550,000	7,447,000.00	5.81
3	002169	智光电气	559,931	5,856,878.26	4.57
4	300377	赢时胜	74,930	5,239,105.60	4.09
5	000903	云内动力	731,200	5,191,520.00	4.05
6	002539	新都化工	300,000	5,160,000.00	4.03
7	002444	巨星科技	299,935	3,899,155.00	3.04
8	000581	威孚高科	145,929	3,807,287.61	2.97
9	300324	旋极信息	75,130	3,778,287.70	2.95
10	000997	新大陆	138,600	3,678,444.00	2.87

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	5,839,650.50	4.56
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	5,839,650.50	4.56

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	010107	21国债(7)	31,980	3,255,564.00	2.54
2	010303	03国债(3)	27,050	2,584,086.50	2.02
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

注:本基金报告期末持有21国债(7)。

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

本基金报告期无持有贵金属。

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

本报告期末本基金未持有权证。

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

本基金本报告期末无股指期货的持仓。

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

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金报告期末国债期货持仓。

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 本基金投资的前十名股票未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	67,259.47
2	应收证券清算款	33,688,820.99
3	应收股利	-
4	应收利息	77,551.32
5	应收申购款	10,438,339.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	44,271,971.00

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

报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

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	96,838,431.02
报告期期间基金总申购份额	26,184,468.71
减:报告期期间基金总赎回份额	26,753,027.16
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	96,269,872.57

§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红利价值灵活配置混合型证券投资基金发行及募集的文件。

2、《金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

3、《金鹰红利价值灵活配置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、半年度报告、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

金鹰货币市场证券投资基金

【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	金鹰货币	
基金主代码	210012	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年12月7日	
报告期末基金份额总额	531,167,175.16份	
投资目标	在力求保持基金资产本金的安全性和资产高流动性的基础上,力争获得超过基金业绩比较基准的稳定收益。	
投资策略	本基金结合"自上而下"和"自下而上"的研究方法对各类可投资资产进行合理的配置和选择。	
业绩比较基准	税后一年期定期存款利率(即(一年期定期存款利率×(1-利息税率))。	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本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	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	金鹰货币A	金鹰货币B
下属两级基金的交易代码	210012	210013
报告期末下属两级基金的份额总额	218,225,926.42份	312,941,248.74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)	
	金鹰货币A	金鹰货币B
1.本期已实现收益	2,784,597.46	6,080,691.34
2.本期利润	2,784,597.46	6,080,691.34
3.期末基金资产净值	218,225,926.42	312,941,248.74

注:1、所述基金业绩制表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。

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,由于货币市场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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

1、 金鹰货币A

主要财务指标	净值收益率①	净值收益率标准差②	净值收益率与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	1.1391%	0.0077%	0.7562%	0.0000%	0.3829%	0.0077%

注:本基金收益分配是按日结转份额。

2、 金鹰货币B

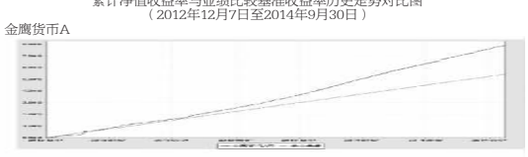
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.2001%	0.0077%	0.7562%	0.0000%	0.4439%	0.0077%

注:本基金收益分配是按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

金鹰货币市场证券投资基金
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2012年12月7日至2014年9月30日)

1、 金鹰货币A



注:1、本基金合同生效日期为2012年12月7日。

2、截至报告日本基金的各项投资比例基本符合本基金基金合同规定,即投资于定期存款的比例不超过基金资产净值的30%;持有全部资产支持证券,市值不超过基金资产净值的20%;债券正回购的资金余额在每个交易日不超过基金资产净值的20%;以及中国证监会规定的其他比例限制。

3、本基金的业绩比较基准为:一年期定期存款利率(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		
洪利平	基金经理	2013-7-11	-	5	洪利平女士,西南财经大学金融学硕士毕业,证券从业经历5年。曾任职于生命人寿保险股份有限公司,2010年7月加入金鹰基金管理公司,任职债券研究员,现任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及本基金基金经理。

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、《金鹰货币市场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,基金运作基本合法合规,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

二季度在各种微刺激政策的拉动下,经济较快复苏。但三季度随着政府财政支出增速的下滑,基建投资减速,同时房地产疲弱,经济下行风险显著加大、相反地,债市呈现先调整再走牛的格局。7月份,经济反弹预期较强,而由于缴准、分红、缴税和IPO等因素导致资金面持续紧张,债市一度出现明显调整。随后经济预期重新走弱,债市延续今年以来的牛市进程,并在9月份5000亿SLF投放和央行第二次下调正回购利率的举措下得到强化。

今年以来存款利率下降尤为明显,季度内我们逐步降低存款的配置比例,重仓债券。在季末和7月份资金面相对偏紧的时点,我们尽量拉长债券持仓的久期,使得整体组合收益取得较好的业绩。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年9月30日,基金A类份额本报告期份额净值收益率为1.1391%,同期比较基准收益率为0.7562%;B类份额本报告期份额净值收益率为1.2001%,同期比较基准收益率为0.7562%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

短期内,经济下行压力仍然较大。内需明显不足,出口面临不确定性。长期内,房价已悄然迎来趋势性拐点,人口增速下滑,经历30年高速发展的中国经济可能正在步入经济发展的"新常态",增长中枢走低。为避免经济短期内大幅下滑,降低融资成本,货币政策已然转向,央行有意引导市场利率下行。同时,通胀保持低位水平,货币政策仍然有进一步放松的空间,债市收益率可能继续下滑。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

姓名	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	458,389,898.19	74.91
	其中:债券	458,389,898.19	74.91
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	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	146,796,070.01	23.99
4	其他资产	6,764,621.48	1.11
5	合计	611,950,589.68	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	11.46
	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	79,999,760.00 / 15.06
	其中:买断式回购融资	- / -

注:上表中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基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内本货币市场基金没有出现债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的情况。

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	108
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	109
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	30

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内投资组合平均剩余期限无超过120天的情况。

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	38.54	15.06
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	10.90	-
2	30天(含)—60天	13.18	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	24.47	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	9.45	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	28.29	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	113.94	15.06

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	摊余成本(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	87,898,957.21	16.55
	其中:政策性金融债	87,898,957.21	16.55
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	370,490,940.98	69.75
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	458,389,898.19	86.30
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	57,898,277.78	10.90

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

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	041464036	14张资产CP001	500,000	50,272,360.44	9.46
2	011499025	14鲁商SCP001	500,000	50,008,334.94	9.41
3	071440003	14东吴证券CP003	500,000	49,988,457.27	9.41
4	110402	11农发02	500,000	49,941,165.77	9.40
5	071407006	14中信建投CP006	400,000	40,018,448.68	7.53
6	041464055	14连城投CP002	300,000	30,005,369.41	5.65
7	110257	11国开57	300,000	30,000,679.43	5.65
8	071423005	14长城证券CP005	300,000	29,997,581.28	5.65
9	071430005	14财通证券CP005	300,000	29,995,674.65	5.65
10	041454035	14大连建投CP001	300,000	29,986,837.62	5.65

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	0.2008%
报告期内偏离度的最低值	0.0665%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1272%

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

本基金目前投资工具的估值方法如下:

(1)基金持有的债券(包括票据)购买时采用实际支付款(包含交易费用)确定初始成本,按实际利率计算其摊余成本及各期利息收入,每日计提收益;

(2)基金持有的回购以成本列示,按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息;合同利率与实际利率差异较小的,也可采用合同利率计算确定利息收入;

(3)基金持有的银行存款以本金列示,按实际协议利率逐日计提利息。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的方法估值。

如有新增事项,按国家最新规定估值。

5.8.2 本基金本报告期内不存在剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券摊余成本超过当日基金资产净值20%的情况。

5.8.3 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。

5.8.4 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	6,756,369.94
4	应收申购款	8,251.54
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	6,764,621.48

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	金鹰货币A	金鹰货币B
报告期期初基金份额总额	185,289,838.53	489,822,452.60
报告期期间基金总申购份额	391,294,943.17	684,171,625.66
减:报告期期间基金总赎回份额	358,358,855.28	861,052,829.52
报告期期末基金份额总额	218,225,926.42	312,941,248.74

注:总申购份额包含因份额升降级导致的强制调增份额,总赎回份额包含因份额升降级导致的强制调减份额。

§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货币市场证券投资基金发行及募集的文件。

2、《金鹰货币市场证券投资基金基金合同》。

3、《金鹰货币市场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

金鹰稳健成长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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金鹰稳健成长股票
基金主代码	210004
交易代码	210004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年4月14日
报告期末基金份额总额	230,715,676.74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,通过投资于稳健性、成长性或两者兼备的股票,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	本基金投资策略充分体现"稳健"与"成长"这两个核心理念。在实际投资过程中采用"自上而下"的投资方法,定性与定量分析相结合,重点考察宏观经济、资本市场、名义利率所处的不同周期阶段,分析判断市场时机,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。
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