

金鹰货币市场证券投资基金 [2015]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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年四月二十一日
§ 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2015年4月17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2015年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

主要财务指标	报告期(2015年1月1日-2015年3月31日)
净值收益率	1.34%±0.02%
净值收益率标准差	0.00%
期间平均净值	1.34%±0.02%
最近七日年化收益率	1.45%±0.03%
报告期末基金份额总额	210002
报告期末基金资产净值	149,662,790.00
报告期末可供分配基金份额总额	149,662,790.00
报告期末可供分配金额	149,662,790.00

注:1. 所述基金业绩报酬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	报告期(2015年1月1日-2015年3月31日)
净值收益率	1.34%±0.02%
净值收益率标准差	0.00%
期间平均净值	1.34%±0.02%
最近七日年化收益率	1.45%±0.03%
报告期末基金份额总额	1,131,000
报告期末基金资产净值	1,130,999.99
报告期末可供分配基金份额总额	1,130,999.99
报告期末可供分配金额	1,130,999.99

注:本基金管理人对赎回费是按日转换转份额。

2. 金鹰货币B

主要财务指标	报告期(2015年1月1日-2015年3月31日)
净值收益率	-0.09%
净值收益率标准差	0.00%
期间平均净值	1.00%
最近七日年化收益率	0.00%
报告期末基金份额总额	1,130,999.99
报告期末基金资产净值	1,130,999.99
报告期末可供分配基金份额总额	1,130,999.99
报告期末可供分配金额	1,130,999.99

注:本基金收益分配方式选择按日转换转份额。

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

基金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2015年3月31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. 直至报告期内本基金的各项投资比例符合本基金合同规定，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：一年定期存款利率(税后)

3.4 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时间	说明
孙利军	基金经理	2013-7-11	6

注:1. 任职日期和离任日期均指公司公告聘任或解聘日期；
2. 证券从业人员含义从《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细则，本基金管理人未因违反基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则和维护基金资产，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

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他有关法律法规及其各

项实施细则，本基金管理人未因违反基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则和

维护基金资产，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。

4.3.2 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，本基金管理人未因违反基金合同的规定，通过规避监管、事后加强对不同投资组合的交易价格、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，

公司公平交易制度执行情况良好。

4.4 报告期内基金的绩效表现

2015年一季度经济下行压力较大，经济增长出现较大幅度下滑。社会用电量、铁路货运量均低速增长。物价稳定，1月份和2月份同比增速仅为0.8%和1.4%，而PPI仍处于通缩区间。

货币政策有效，但力度偏弱，货币市场的流动性较去年年底有一定改善，但整个一季度一直

处于相对偏紧的状态。

本基金收益率大幅上升，我们重仓债券，并尽量拉长债券久期，在今年一季度

组合收益率明显好于当期基金资产净值20%的情况。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金报告期内，经济运行总体平稳，宏观政策稳健，货币市场资金面宽松，流动性充足，

金融市场运行平稳，股票市场波动较小，债市收益率整体呈震荡上行趋势，债市整体表现较为平稳，收益率可能继续上行。我们将根据投资者结构变化，结合市场形势，适时

调整存款和现券的投资比例，竭力为持有人服务。

4.6 报告期内基金的经营情况

4.6.1 投资组合报告

4.6.2 报告期内基金的利润分配情况

4.6.3 报告期内基金的费用概算

4.6.4 报告期内基金的税收情况

4.6.5 报告期内基金的费用情况

4.6.6 报告期内基金的其他重要信息

4.7 投资组合报告

4.7.1 投资组合报告的编制原则及方法

4.7.2 本报告期末基金资产组合

4.7.3 本报告期末持有的金融工具

4.7.4 报告期内基金的资产支持证券

4.7.5 报告期内基金的国债

4.7.6 报告期内基金的资产支持证券

4.7.7 报告期内基金的资产支持证券

4.7.8 报告期内基金的资产支持证券

4.7.9 报告期内基金的资产支持证券

4.7.10 报告期内基金的资产支持证券

4.7.11 报告期内基金的资产支持证券

4.7.12 报告期内基金的资产支持证券

4.7.13 报告期内基金的资产支持证券

4.7.14 报告期内基金的资产支持证券

4.7.15 报告期内基金的资产支持证券

4.7.16 报告期内基金的资产支持证券

4.7.17 报告期内基金的资产支持证券

4.7.18 报告期内基金的资产支持证券

4.7.19 报告期内基金的资产支持证券

4.7.20 报告期内基金的资产支持证券

4.7.21 报告期内基金的资产支持证券

4.7.22 报告期内基金的资产支持证券

4.7.23 报告期内基金的资产支持证券

4.7.24 报告期内基金的资产支持证券

4.7.25 报告期内基金的资产支持证券

4.7.26 报告期内基金的资产支持证券

4.7.27 报告期内基金的资产支持证券

4.7.28 报告期内基金的资产支持证券

4.7.29 报告期内基金的资产支持证券

4.7.30 报告期内基金的资产支持证券

4.7.31 报告期内基金的资产支持证券

4.7.32 报告期内基金的资产支持证券

4.7.33 报告期内基金的资产支持证券

4.7.34 报告期内基金的资产支持证券

4.7.35 报告期内基金的资产支持证券

4.7.36 报告期内基金的资产支持证券

4.7.37 报告期内基金的资产支持证券

4.7.38 报告期内基金的资产支持证券

4.7.39 报告期内基金的资产支持证券

4.7.40 报告期内基金的资产支持证券

4.7.41 报告期内基金的资产支持证券

4.7.42 报告期内基金的资产支持证券

4.7.43 报告期内基金的资产支持证券

4.7.44 报告期内基金的资产支持证券

4.7.45 报告期内基金的资产支持证券

4.7.46 报告期内基金的资产支持证券

4.7.47 报告期内基金的资产支持证券

4.7.48 报告期内基金的资产支持证券

4.7.49 报告期内基金的资产支持证券

4.7.50 报告期内基金的资产支持证券

4.7.51 报告期内基金的资产支持证券

4.7.52 报告期内基金的资产支持证券

4.7.53 报告期内基金的资产支持证券

4.7.54 报告期内基金的资产支持证券

4.7.55 报告期内基金的资产支持证券

4.7.56 报告期内基金的资产