金鹰稳健成长股票型证券投资基金

【2015】第二季度报告

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:二〇一五年七月十八日

§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2015年7月16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4月1日起至6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	101,620,651.19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高收益、高风险品种。
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

§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(2015年4月1日-2015年6月30日)
1.本期已实现收益	49,490,365.86
2.本期利润	19,589,948.15
3.加权平均基金份额本期利润	0.1845
4.期末基金资产净值	190,534,374.25
5.期末基金份额净值	1.875

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

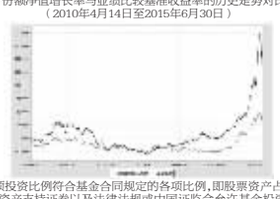
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	19.27%	3.26%	8.67%	1.96%	10.60%	1.30%

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

金鹰稳健成长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

(2010年4月14日至2015年6月30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,即股票资产占基金资产的比例为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的5%~40%,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%,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	权益投资部总监	2014-11-19	-	16年	何晓春先生,产业经济学博士,16年金融行业从业经验,曾任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、金鹰中证500指数分级证券投资基金、金鹰行业优势股票型证券投资基金、金鹰民族新兴灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
陈颖	基金经理	2015-6-11	-	5	曾任职于广东省电信规划设计院、中国惠普,历任深圳市瀚信资产管理有限公司研究主管等职,2012年9月加入金鹰基金管理有限公司,先后任研究员、研究小组组长、基金经理助理等。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 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、《金鹰稳健成长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,通过投资交易系统中的公平交易模块,以尽可能确保公平对待各投资组合;事后加强对不同投资组合的交易价差、收益率的分析,对公平交易执行情况进行检查。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,未发生过或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

2015年2季度,A股主板指数先扬后抑,在经过4月和5月初的上涨后,走出了剧烈的下跌行情,而中小板和创业板指也走出了类似于主板指数的行情。期间上证指数上涨14.12%,深成指上涨8.95%,中小板指上涨15.32%,创业板指上涨22.42%。在4-5月,以计算机、通信、传媒为主的新兴产业在1季度大幅上涨的基础上继续大幅拉升,并带动金融地产等蓝筹板块的上涨,其中以互联网+为代表的新兴产业受到了市场杠杆资金的狂热追捧,但在进入六月以来,随着对金融市场杠杆的调控,市场出现了急速的单边下跌。本基金2季度仍然偏重于配置成长股,并在4-5月份取得了较好的业绩增长,进入6月后虽然进行了部分仓位调整,但仍然在市场的快速下跌过程中受到了一定的净值损失,总体而言,本基金在2季度取得了一定的净值收益,并超越了同期基准收益率。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止2015年6月30日,基金份额净值为1.875元,本报告期基金净值增长率为19.27%,同期业绩比较基准增长率为8.67%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

A股面临的宏观经济环境方面,积极财政政策继续发力,以政府为信用为主体作为债权人置换地方债,经济有望企稳回升;对于A股市场而言,在政府"紧信用、松货币、宽财政"这三大政策要素的有效执行下,经济复苏带来的传统行业盈利增长和万众创新带来新经济活力和商业模式,逐步消化高估值,A股市场在分化中有望迎来真正的牛市下半场。

展望2015年3季度,我们认为随着A股市场去杠杆的持续进行,短期市场出现流动性危机,股指仍有下行风险。考虑到本次牛市的三大支撑因素(利率下行、改革预期、新经济快速发展)没有发生根本性变化,短期快速调整是对过去一年快速上涨所累积风险的释放,预计市场在经历快速下跌、流动性问题改善后,市场投资机会将明显增加。我们认为短期政府救市将有效改善市场的流动性危机,在市场无风险利率下行和刺激经济政策出台的大背景下,资本市场仍将是经济发展和改革的重要工具,国企改革和新兴产业仍将是未来两个主要投资方向。考虑到短期快速下跌后市场人气需要一定的时间进行修复,因而在3季度我们将在保持合理仓位的前提下,精选安全边际较高、符合未来投资方向的个股。

§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	179,318,111.23	84.62
	其中:股票	179,318,111.23	84.62
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	-	-
	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	25,940,155.00	12.24
7	其他资产	6,644,430.56	3.14
8	合计	211,902,696.79	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	155,360,564.63	81.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,895,306.60	6.77
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,012,000.00	0.53
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	10,050,240.00	5.27
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	179,318,111.23	94.11

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	300080	新大新材	1,490,920	17,682,311.20	9.28
2	600699	均胜电子	440,000	16,856,400.00	8.85
3	002249	大洋电机	1,285,400	16,478,828.00	8.65
4	601208	东材科技	1,386,000	15,828,120.00	8.31
5	002614	蒙发利	732,000	13,051,560.00	6.85
6	600969	郴电国际	633,676	12,895,306.60	6.77
7	002546	新联电子	371,450	10,382,027.50	5.45
8	600640	号百控股	348,000	10,050,240.00	5.27
9	300340	科恒股份	273,400	8,940,180.00	4.69
10	002292	奥飞动漫	199,874	7,453,301.46	3.91

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。

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。

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投资。

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	125,980.13
2	应收证券清算款	5,578,098.30
3	应收股利	-
4	应收利息	5,224.91
5	应收申购款	935,127.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,644,430.56

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

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	002546	新联电子	10,382,027.50	5.45	重大事项
2	002292	奥飞动漫	7,453,301.46	3.91	重大事项
3	-	-	-	-	-
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	115,245,035.94
报告期期间基金总申购份额	78,268,265.87
减:报告期期间基金总赎回份额	91,892,650.62
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	101,620,651.19

§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

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

报告期无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稳健成长股票型证券投资基金发行及募集的文件。

2、《金鹰稳健成长股票型证券投资基金基金合同》。

3、《金鹰稳健成长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或020-83936180。

金鹰基金管理有限公司
二〇一五年七月十八日

金鹰行业优势股票型证券投资基金

【2015】第二季度报告

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:二〇一五年七月十八日

§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2015年7月16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4月1日起至6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	183,023,642.84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(2015年4月1日-2015年6月30日)
1.本期已实现收益	111,511,427.22
2.本期利润	65,526,744.77
3.加权平均基金份额本期利润	0.2434
4.期末基金资产净值	268,295,458.47
5.期末基金份额净值	1.4659

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

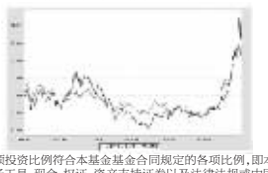
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	10.95%	2.88%	8.67%	1.96%	2.28%	0.92%

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2015年6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	权益投资部总监	2012-7-26	-	16	何晓春先生,产业经济学博士,16年金融行业从业经验,曾任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、金鹰中证500指数分级证券投资基金、金鹰稳健成长股票型证券投资基金、金鹰民族新兴灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
倪超	基金经理	2015-6-11	-	6	2009年6月加盟金鹰基金管理有限公司,先后任行业研究员、消费品研究小组组长、基金经理助理。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 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,通过投资交易系统中的公平交易模块,以尽可能确保公平对待各投资组合;事后加强对不同投资组合的交易价差、收益率的分析,对公平交易执行情况进行检查。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,未发生过或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

2015年2季度,A股主板指数先扬后抑,在经过4月和5月初的上涨后,走出了剧烈的下跌行情,而中小板和创业板指也走出了类似于主板指数的行情。期间上证指数上涨14.12%,深成指上涨8.95%,中小板指上涨15.32%,创业板指上涨22.42%。在4-5月,以计算机、通信、传媒为主的新兴产业在1季度大幅上涨的基础上继续大幅拉升,并带动金融地产等蓝筹板块的上涨,其中以互联网+为代表的新兴产业受到了市场杠杆资金的狂热追捧,但在进入六月以来,随着对金融市场杠杆的调控,市场出现了急速的单边下跌。本基金2季度主要配置行业龙头和互联网+为代表的成长股,并在4-5月份取得了较好的业绩增长,进入六月后进行部分仓位调整和实施均衡配置策略,但仍然受到了一定的损失,总体而言,本基金在2季度取得了一定的净值收益,并超越了同期基准收益率。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止2015年6月30日,基金份额净值为1.4659元,本报告期基金净值增长率为10.95%,同期业绩比较基准增长率为8.67%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

A股面临的宏观经济环境方面,随着积极财政政策和宽松货币政策持续发力,经济有望企稳回升;对于A股市场而言,在政府"紧信用、松货币、宽财政"这三大政策要素的有效执行下,经济复苏带来的传统行业盈利增长和万众创新带来新经济活力和商业模式,逐步消化高估值,A股市场在分化中有望迎来真正的牛市下半场。

展望2015年3季度,我们认为随着政府增量资金的持续入市推稳,A股有望止跌回升,但由于杠杆和整体市场信心恢复仍需时间,整体市场风险偏好的下降是确定性的事件,而这将影响我们未来一段时间内的资产配置和选股策略,我们把确定性放在非常重要的位置。

投资机会方面,我们会从中长期角度战略布局以下方向:1、被因势利导的新兴行业:新能源、环保、中国制造2025;2、需求激发创造的新经济活力(万众创新),互联网家装;互联网金融;新医疗;新娱乐。3、全球技术嫁接中国需求市场和资本市场。

以一个季度为时间周期,我们主要把握未来一个季度市场将要发生的确定性事件,包括国将公布中报高增长的公司;9月底的阅兵事件性主题机会;经济好转和通胀预期带来的投资机会;国企改革陆续推进带来的相关标的机会。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内无应当说明的预警事项。

§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	248,284,407.20	87.51
	其中:股票	248,284,407.20	87.51
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	-	-
	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	23,650,066.31	8.34
7	其他资产	11,775,050.62	4.15
8	合计	283,709,524.13	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	122,998,396.39	45.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	24,019,247.45	8.95
E	建筑业	7,932,888.00	2.96
F	批发和零售业	4,469,000.00	1.67
G	交通运输、仓储和邮政业	8,426,808.00	3.14
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	28,090,653.96	10.47
K	房地产业	52,347,413.40	19.51
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	248,284,407.20	92.54

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	000024	招商地产	961,000	35,086,110.00	13.08
2	002614	蒙发利	1,442,022	25,711,252.26	9.58
3	002249	大洋电机	1,936,086	24,820,622.52	9.25
4	600969	郴电国际	1,180,307	24,019,247.45	8.95
5	600079	人福医药	636,425	23,579,546.25	8.79
6	002594	比亚迪	378,330	20,896,165.90	7.79
7	601166	兴业银行	1,160,000	20,010,000.00	7.46
8	000002	万 科A	1,188,795	17,261,303.40	6.43
9	600872	中炬高新	409,000	9,476,530.00	3.53
10	002011	盾安环境	635,354	9,206,279.46	3.43

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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 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	394,286.42
2	应收证券清算款	11,263,406.01
3	应收股利	-
4	应收利息	5,103.40
5	应收申购款	112,254.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,775,050.62

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

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	000024	招商地产	35,086,110.00	13.08	重大事项
2	600872	中炬高新	9,476,530.00	3.53	重大事项
3	-	-	-	-	-
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	393,696,104.11
报告期期间基金总申购份额	30,506,643.48
减:报告期期间基金总赎回份额	241,179,104.75
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	183,023,642.84

§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

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

报告期无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,也可按工本费购买复印件。

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
二〇一五年七月十八日

金鹰元安保本混合型证券投资基金

【2015】第二季度报告

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:二〇一五年七月十八日

§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2015年7月16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4月1日起至6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	1,605,554,789.61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,其长期评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	广州越秀金融控股集团有限公司

注:本基金于2015年5月28日转入第二个保本周期。第二个保本周期由广州越秀金融控股集团有限公司为担保人,在担保范围、担保限额、担保期间内,担保人承担不可撤销的连带清偿责任。

§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(2015年4月1日-2015年6月30日)
1.本期已实现收益	18,899,183.52
2.本期利润	22,775,685.88
3.加权平均基金份额本期利润	0.0306
4.期末基金资