景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014年9月30日

基金管理人:景顺长城基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月24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。

基金托管人中国农业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	景顺长城内需贰号股票
基金主代码	260109
交易代码	260109
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年10月11日
报告期末基金份额总额	6,497,907,937.89份
投资目标	本基金通过优先投资于内需拉动型行业中的优势企业,分享中国经济和行业的快速增长带来的最大收益,实现基金资产的长期、可持续的稳定增值。
投资策略	股票投资部分以"内需拉动型"行业的优势企业为主,以成长、价值及稳定收入为基础,在合适的价位买入具有高成长性的成长型股票,价值被市场低估的价值型股票,以及能提供稳定收入的收益型股票。债券投资部分着重本金安全性和流动性。
业绩比较基准	沪深综合指数总市值加权指数×80%+中国债券总指数×20%。
风险收益特征	本基金是风险程度较高的投资品种。
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§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	9,353,643.32
2.本期利润	622,999,728.14
3.加权平均基金份额本期利润	0.0896
4.期末基金资产净值	7,904,908,147.84
5.期末基金份额净值	1.217

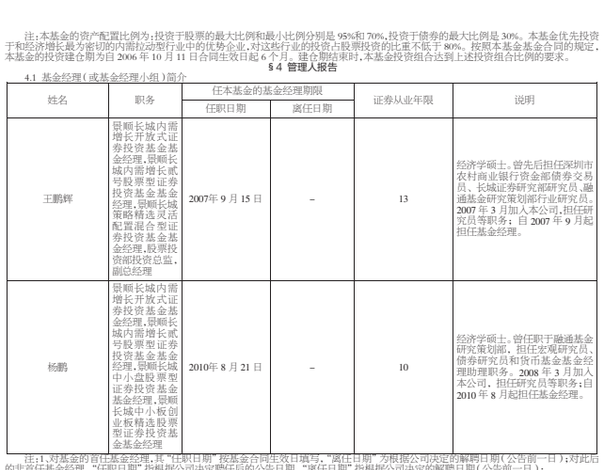
注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	7.89%	1.12%	13.83%	0.64%	-5.94%	0.48%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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:本基金的资产配置比例为:投资于股票的最大比例和最小比例分别是95%和70%,投资于债券的最大比例是30%。本基金优先投资于和经济增长最为密切的内需拉动型行业中的优势企业,对这些行业的投资占股票投资的比重不低于80%。按照本基金基金合同的规定,本基金的投资建仓期为自2006年10月11日合同生效日起6个月。建仓期结束时,本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

§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		
王鹏辉	景顺长城内需增长开放式证券投资基金基金经理,景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金基金经理,景顺长城策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理,股票投资部投资总监,副总经理	2007年9月15日	-	13	经济学硕士。曾先后担任深圳市农村商业银行资金部债券交易员、长城证券研究部研究员、融通基金研究策划部行业研究员。2007年3月加入本公司,担任研究员等职务;自2007年9月起担任基金经理。
杨鹏	景顺长城内需增长开放式证券投资基金基金经理,景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金基金经理,景顺长城中小盘股票型证券投资基金基金经理,景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金基金经理	2010年8月21日	-	10	经济学硕士。曾任职于融通基金研究策划部,担任宏观研究员、债券研究员和货币基金基金经理助理职务。2008年3月加入本公司,担任研究员等职务;自2010年8月起担任基金经理。

注:1、对基金的首任基金经理,其"任职日期"按基金合同生效日填写。"离任日期"为根据公司决定的解聘日期(公告前一日);对此后的非首任基金经理,"任职日期"指根据公司决定聘任后的公告日期,"离任日期"指根据公司决定的解聘日期(公告前一日);
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《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,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,基金运作整体合法合规,未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

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,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见(2011年修订)》、完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为专项说明

本基金于本报告期内未发现异常交易行为。

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

在经历过往几年的反反复复之后,中国经济增长模式转型已经形成共识,中国经济转型的紧迫性日益增加。中国经济需要新一轮的改革,改革、调整和创新将指动中国经济进入新一轮不同以往的增长期。短期内受房地产行业的影响,经济下行,政府推出了一系列相应措施稳定经济。

市场对宏观经济预期充分,指数大幅下跌可能性较低,电动汽车行业处于爆发的起点。基于此两点,本基金在3季度增加了仓位比例,继续增加电动汽车产业链的配置比例。电动汽车产业处于发展的初期,未来空间巨大,产业链中的优势企业有机会快速发展壮大。其他行业配置比例小幅调整。组合更加重视治理结构和企业管理水平,未来将增加治理结构和管理优秀企业的配置比例,提升组合内在活力,以应对中国经济转型期指数杂的经济形势。

望未来,中国经济增长方式转型的过程中将涌现出一批又一批优秀企业,这将为我们提供良好的投资机会。本基金将精选具有长期增长潜力的优秀企业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2014年3季度,本基金份额净值增长率为7.89%,低于业绩比较基准收益率5.94%。

§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	7,258,513,484.18	90.79
	其中:股票	7,258,513,484.18	90.79
2	固定收益投资	136,552,061.20	1.71
	其中:债券	136,552,061.20	1.71
	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	158,410,811.21	1.98
	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	341,839,379.64	4.28
7	其他资产	99,759,369.99	1.25
8	合计	7,995,075,106.22	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	6,745.23	0.00
C	制造业	6,501,130,744.55	82.24
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	7,190,188.88	0.09
J	金融业	399,852,941.41	5.06
K	房地产业	228,753,976.35	2.89
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	121,578,887.76	1.54
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	7,258,513,484.18	91.82

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	002594	比亚迪	12,153,207	593,441,097.81	7.51
2	300124	汇川技术	14,825,129	446,088,131.61	5.64
3	600525	长园集团	23,109,022	312,433,977.44	3.95
4	600699	均胜电子	11,887,824	299,573,164.80	3.79
5	002048	宁波华翔	16,999,745	293,415,598.70	3.71
6	000895	双汇发展	8,044,060	269,958,653.60	3.42
7	000538	云南白药	5,100,073	261,480,742.71	3.31
8	002460	赣锋锂业	12,429,732	245,611,504.32	3.11
9	002249	大洋电机	16,681,765	236,046,974.75	2.99
10	300001	特锐德	11,062,274	232,750,244.96	2.94

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	130,267,000.00	1.65
	其中:政策性金融债	130,267,000.00	1.65
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	6,285,061.20	0.08
8	其他	-	-
9	合计	136,552,061.20	1.73

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	140404	14农发04	500,000	50,125,000.00	0.63
2	140429	14农发29	500,000	50,115,000.00	0.63
3	140317	14进出17	300,000	30,027,000.00	0.38
4	113003	重工转债	45,930	6,285,061.20	0.08

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。
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。
5.9 报告期末本基金投的股指期货交易情况说明
5.9.1 报告期末本基金投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
根据本基金基金合同约定,本基金投资范围不包括股指期货。
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 本期国债期货投资政策
根据本基金基金合同约定,本基金投资范围不包括国债期货。
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 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1
1、江西赣锋锂业股份有限公司(下称"赣锋锂业",股票代码:002460)于2014年8月29日收到江西证监局《关于对江西赣锋锂业股份有限公司及相关当事人采取出具警示函措施的决定》,因其在信息披露和内幕信息知情人登记方面违反了相关法律法规,江西证监局对其及相关当事人采取出具警示函的监管措施。
本基金投研人员分析认为,该公司收到警示函,主要源于该公司管理层在内幕信息知情人的信息报备上不完整及该公司未在股价异动公告及停牌公告中披露资产收购事项,确实存在信息披露方面的问题。但本 基金对于赣锋锂业的投资主要基于新能源汽车发展对锂需求的拉动及公司的资源及加工的能力,与公司收购并无关联,且事先也并不知晓该并购事项。而且该公司收到警示函后经过了一系列整改,有利于完善其信息披露制度及其长期发展。该公司在锂产业的布局及其生产能力将使其保持在未来锂电池发展中的竞争力。
本基金经理依据基金合同及公司投资管理制度,在投资授权范围内,经正常投资决策程序对赣峰锂业进行了投资。
2、其余九名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。
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 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,545,039.50
2	应收证券清算款	92,119,789.99
3	应收股利	-
4	应收利息	3,604,728.30
5	应收申购款	2,489,812.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	99,759,369.99

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113003	重工转债	6,285,061.20	0.08

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的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	7,177,571,324.05
报告期期间基金总申购份额	483,829,731.64
减:报告期期间基金总赎回份额	1,163,493,117.80
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	6,497,907,937.89

注:总申购份额含转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§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
基金管理人本期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
基金管理人本期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

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
1、中国证监会批准景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金设立的文件;
2、《景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金基金合同》;
3、《景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金招募说明书》;
4、《景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金托管协议》;
5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程;
6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。
9.2 存放地点
以上各查文件存放在本基金管理人的办公场所。
9.3 查阅方式
投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司
2014年10月24日

金鹰成份股优选证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014年9月30日

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	金鹰成份优选混合
基金主代码	210001
交易代码	210001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年6月16日
报告期末基金份额总额	1,430,161,863.58份
投资目标	通过资产配置和对投资组合的动态调整,在控制投资组合风险的前提下,实现基金的中长期资本增值和获取适当、稳定的现金收益。
投资策略	本基金通过综合分析宏观经济、政策及证券市场的现状和发展趋势的基础上,合理预期各类别资产收益率和风险水平,并据此构建一个包括主要投资于上证180指数成份股和深证100指数成份股、国债等债券及现金等资产的投资组合,适时调整组合中各类别资产的比例,在控制投资组合风险的前提下,实现基金资产的中长期增值和获取适当、稳定的当前收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为75%的成份股加权指数的收益率加上25%的中信标普国债指数的收益率。 成份股加权指数为上证180指数和深证100指数按其各自成份股流通市值加权平均值。
风险收益特征	本基金为风险水平中等偏下、收益水平适中的证券投资基金,基金的收益目标设为α值大于零,风险目标为β值的目标区间为[0.75,1.1]。
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	28,922,619.54
2.本期利润	63,491,667.38
3.加权平均基金份额本期利润	0.0425
4.期末基金资产净值	936,289,240.81
5.期末基金份额净值	0.6547

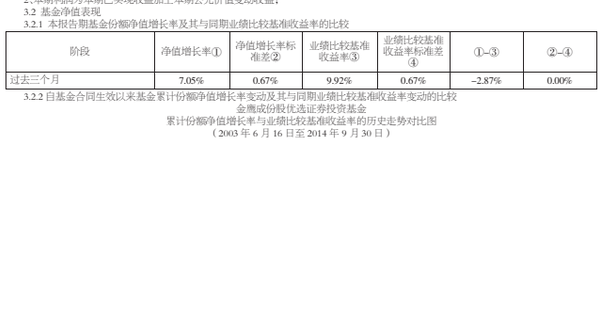
注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额;
2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;

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	7.05%	0.67%	9.92%	0.67%	-2.87%	0.00%

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、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,即本基金投资于股票、债券的比例不得低于基金资产总值的80%,投资于国家债券的比例不得低于基金资产净值的20%;
2、本基金的业绩比较基准为:75%的成份股加权指数的收益率加上25%的中信标普国债指数的收益率。

§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		
林华昱	基金经理	2011-3-1	-	12	林华昱先生2002年10月进入金鹰基金管理有限公司,2004年后开始从事投资研究等工作,先后任交易员、交易主管、基金经理助理等职。2009年10月12日开始担任金鹰成份股优选证券投资基金基金经理助理,协助基金经理管理金鹰成份股优选证券投资基金,现任本基金基金经理以及金鹰中证500指数分级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、《金鹰成份股优选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,本基金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

本基金管理人判断指数上行趋势的延续性和市行情,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等安全性较高的品种。

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0.6547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9.92%。

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2014年第四季度,经济增长平稳性、通胀与流动性等成为预判市场行情的重要变量。

投资策略上,聚焦移动互联网信息服务、文化娱乐、医药、大众消费品及环境等行业寻找稳定成长、弱化经济周期干扰的个股,同时关注产业升级、进口替代中持续高研发投入并以新材料、新技术等新产品逆经济周期成长的个股。

最后需要关注的是,社会融资渠道信用违约风险扩大、经济增长乏力、猪周期对通胀助推以及外围金融市场动荡等可能带来的系统性风险。

§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	689,403,389.52	71.97
	其中:股票	689,403,389.52	71.97
2	固定收益投资	193,342,700.00	20.18
	其中:债券	193,342,700.00	20.18
	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	53,855,840.43	5.62
7	其他资产	21,276,887.22	2.22
8	合计	957,878,817.17	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	19,673,939.52	2.10
B	采矿业	-	-
C	制造业	424,403,453.54	45.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,243,576.50	2.91
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	164,291,348.48	17.55
J	金融业	28,203,781.00	3.01
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	20,271,290.48	2.17
S	综合	5,316,000.00	0.57
	合计	689,403,389.52	73.63

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	000625	长安汽车	6,000,000	82,200,000.00	8.78
2	002230	科大讯飞	2,203,055	68,955,621.50	7.36
3	002405	四维图新	2,169,765	54,157,334.40	5.78
4	600276	恒瑞医药	1,399,851	51,892,476.57	5.54
5	600597	光明乳业	3,107,111	50,894,478.18	5.44
6	002450	康得新	1,291,321	40,185,909.52	4.29
7	002317	众生药业	1,704,629	36,001,764.48	3.85
8	600196	复星医药	1,500,000	28,560,000.00	3.05
9	002563	森马服饰	818,267	26,290,918.71	2.81
10	600008	首创股份	3,199,945	24,639,576.50	2.63

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	72,526,700.00	7.75
2	央行票据	-	-
3	金融债券	120,816,000.00	12.90
	其中:政策性金融债	120,816,000.00	12.90
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	193,342,700.00	20.65

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	080216	08国开16	500,000	50,740,000.00	5.42
2	019013	10国债13	500,000	49,460,000.00	5.28
3	140204	14国开04	300,000	30,072,000.00	3.21
4	019322	13国债22	230,000	23,066,700.00	2.46
5	140212	14国开12	200,000	20,022,000.00	2.14

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 本基金本报告期内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	355,455.49
2	应收证券清算款	17,883,610.19
3	应收股利	-
4	应收利息	3,003,976.85
5	应收申购款	33,844.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,276,887.22

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
本基金本报告期末不存在流通受限的情况。
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	1,544,857,769.96
报告期期间基金总申购份额	3,274,289.91
减:报告期期间基金总赎回份额	117,970,196.29
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	1,430,161,863.58

§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成份股优选证券投资基金发行及募集的文件。
2、《金鹰成份股优选证券投资基金基金合同》。
3、《金鹰成份股优选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

金鹰元安保本混合型证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014年9月30日

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