金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金

2014 第四季度 报告

2014年12月31日

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:二〇一五年一月二十二日

§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2015年1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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金鹰元泰信用债债券	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年11月29日	
报告期末基金份额总额	11,870,796.60份	
投资目标	在严格控制投资风险、保持较高流动性的前提下,力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报,进而实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金大类资产配置采用自上而下的投资视角,定性分析与定量分析并用,结合国内外政治经济环境、政策形势、金融市场走势(尤其是未来利率的变化趋势),分析判断市场时机,合理确定基金在债券、股票、货币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,适时动态地调整本基金投资于债券、股票、货币市场工具的比例与期限结构。	
业绩比较基准	中债企业债总全价指数收益率×80%+中国国债总全价指数收益率×20%	
风险收益特征	本基金为积极配置的债券型基金,属于证券投资基金当中风险较低的品种,其长期平均风险与预期收益率低于股票型基金、混合型基金,但高于货币市场基金。	
基金管理人	金鹰基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	金鹰元泰信用债A	金鹰元泰信用债C
下属分级基金的交易代码	210010	210011
报告期末下属分级基金的份额总额	5,813,068.26份	6,057,728.34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10月1日-2014年12月31日)	
	金鹰元泰信用债A	金鹰元泰信用债C
1.本期已实现收益	207,068.97	269,196.62
2.本期利润	47,369.70	26,543.82
3.加权平均基金份额本期利润	0.0039	0.0013
4.期末基金资产净值	6,404,613.10	6,614,554.19
5.期末基金份额净值	1.1018	1.0919

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

1.金鹰元泰信用债A:

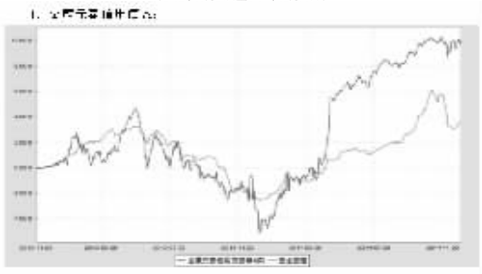
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.94%	0.20%	0.83%	0.20%	0.11%	0.00%

2.金鹰元泰信用债C:

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	0.81%	0.20%	0.83%	0.20%	-0.02%	0.00%

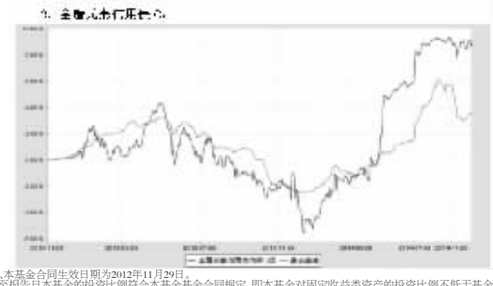
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金
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
(2012年11月29日至2014年12月31日)



3.2.3 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

金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金
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
(2012年11月29日至2014年12月31日)



注:1.本基金合同生效日期为2012年11月29日。
2.截至报告日本基金的投资比例符合本基金基金合同规定,即本基金对固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的80%,其中对信用债券的投资比例不低于固定收益类资产的80%;对股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的20%,其中,权证投资的比例范围占基金资产净值的0~3%。
3.本基金的业绩比较基准为:中债企业债总全价指数收益率×80%+中债国债总全价指数收益率×20%

§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		
张俊杰	基金经理	2013-9-23	-	7	张俊杰先生,厦门大学金融工程硕士,证券从业年限7年,2007年7月至2013年4月任职于平安证券有限责任公司,历任衍生产品部金融工程研究员、固定收益事业部高级经理,债券研究员等;2013年4月加入金鹰基金管理有限公司,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 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、《金鹰元泰精选信用债债券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》的规定,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的权益。

本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,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。

4.3.2 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

在报告期内,本基金的跟踪标的中证500指数涨幅为8.27%,因基金规模较小造成固定费率较高、基金规模不稳定等因素对指数跟踪效果造成了较大的影响,本基金日均跟踪偏离度0.0803%,年化跟踪误差2.73%控制在投资目标限定范围内。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2014年12月31日,基金份额净值为1.3275元,本报告期份额净值增长率5.75%,同期业绩比较基准增长率为7.88%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金为股票型指数基金,以跟踪指数为目标,本基金将继续坚持采用量化策略进行指数复制和风险管理,适时对投资组合进行再平衡调整,力求将跟踪误差控制在投资目标限定范围内,获取与跟踪标的指数相近的收益率。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金自2014年11月4日起,截至2014年12月31日已连续42个工作日资产净值低于五千万。

§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	16,492,790.83	89.25
	其中:股票	16,492,790.83	89.25
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	1,530,582.25	8.28
7	其他资产	455,977.94	2.47
8	合计	18,479,351.02	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

5.2.1 按申万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	304,258.06	1.72
B	采矿业	543,812.94	3.08
C	制造业	9,308,499.21	52.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	499,610.99	2.83
E	建筑业	500,029.04	2.83
F	批发和零售业	1,104,730.46	6.25
G	交通运输、仓储和邮政业	671,533.06	3.80
H	住宿和餐饮业	32,643.00	0.18
I	信息传输、软件和信息技术服务业	896,568.86	5.07
J	金融业	428,360.55	2.42
K	房地产业	1,336,460.82	7.56
L	租赁和商务服务业	254,003.84	1.44
M	科学研究和技术服务业	67,084.56	0.38
N	水利、环境和公共设施管理业	116,149.32	0.66
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	204,110.44	1.15
S	综合	171,153.13	0.97
	合计	16,439,008.28	93.01

5.2.2 积极投资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	1,058.40	0.01
B	采矿业	772.17	0.00
C	制造业	40,203.70	0.23
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	4,882.70	0.03
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	3,449.88	0.02
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,470.81	0.01
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	944.89	0.01
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	53,782.55	0.30

注:积极投资股票是指申证500指数成份股调整及股票停牌,未及时卖出而被动持有的股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1期末指数投资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	601099	太平洋	14,200	201,924.00	1.14
2	300059	东方财富	4,800	134,208.00	0.76
3	300168	万达信息	2,100	97,020.00	0.55
4	600266	北京城建	3,800	89,908.00	0.51
5	000998	隆平高科	4,298	84,627.62	0.48
6	600169	太原重工	9,700	84,584.00	0.48
7	000883	湖北能源	11,100	82,917.00	0.47
8	600694	大商股份	1,700	81,481.00	0.46
9	600755	厦门国贸	6,914	78,128.20	0.44
10	600820	隧道股份	9,266	76,537.16	0.43

5.3.2期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	000627	天茂集团	6,246	25,608.60	0.14
2	600570	恒生电子	63	3,449.88	0.02
3	002190	成飞集成	82	2,624.00	0.01
4	000987	广州友谊	99	2,004.75	0.01
5	002049	同方国芯	80	1,920.00	0.01

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

本报告期末无贵金属投资。

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。

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 本报告期本基金投资的前十名证券10石化01的发行主体中国石油化工股份有限公司在最近一年内因输油管泄漏爆炸事件,部分董事、监事、高级管理人员受到国务院处罚。

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 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	38,166.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	436,197.07
5	应收申购款	398.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	474,762.56

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末未持有处于转股期债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中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。

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

项目	金鹰元泰信用债A	金鹰元泰信用债C
报告期期初基金份额总额	13,794,837.58	15,814,853.87
报告期期间基金总申购份额	6,904,809.20	21,064,987.12
减:报告期期间基金总赎回份额	14,886,578.52	30,822,112.65
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	5,813,068.26	6,057,728.34

§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

1.经公司第五届董事会第四次会议审议通过,免去郭容辰女士公司副总经理职务,该事项已于2014年12月25日公告,并已按规定报中国证券投资基金业协会备案。

2.经公司第五届董事会第四次会议审议通过,聘任李云亮先生担任公司副总经理职务,该事项已于2014年12月26日公告,并已按规定报中国证券投资基金业协会备案。

3.经公司第五届董事会第五次会议决议通过,经中国证券监督管理委员会证监许可[2014]1401号核准,聘任凌富华先生担任公司董事长,该事项已于2015年1月10日公告,并已按规定报广东证监局备案。按照公司章程相关规定,"董事长为公司法定代表人"。我公司总经理刘岩先生不再代行董事长职务。

§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泰精选信用债债券型证券投资基金发行及募集的文件。

2.《金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金基金合同》。

3.《金鹰元泰精选信用债债券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
二〇一五年一月二十二日

金鹰中证500指数分级证券投资基金

2014 第四季度 报告

2014年12月31日

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:二〇一五年一月二十二日

§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2015年1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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金鹰中证500指数分级		
场内简称	金鹰500A、金鹰500B		
基金主代码	162107		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012年6月5日		
报告期末基金份额总额	13,314,519份		
投资目标	本基金为股票型指数基金,以跟踪指数为目标,力求将基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在0.35%以下,年跟踪误差控制在4%以下。		
投资策略	本基金以中证500指数成分股在其指数中的基准权重为基础,在综合考察指数成分股的行业构成与市值占比、各行业内成分股权重的构成与分散程度、成分股流动性与贝塔值等因素的基础上,采用重点抽样与分层抽样相结合的策略以构建指数化投资组合;若抽样组合内的股票停牌或出现流动性不足等情形时,本基金将根据变化了的新情况,对于抽样组合进行再调整。 本基金投资于股票的资产占基金资产净值的比例为90%-95%,其中,中证500指数成分股和备选成分股占基金资产净值的比例不低于90%;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金融工具占基金资产净值的5%-10%,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%。		
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为中证500指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%		
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		
下属分级基金的基金简称	金鹰500A	金鹰500B	金鹰500
下属分级基金场内简称			
下属分级基金的交易代码	150088	150089	162107
报告期末下属分级基金的份额总额	2,184,647份	2,184,647份	8,945,225份
下属分级基金的风险收益特征	本级基金具有低风险、预期收益相对稳定的特征。	本级基金具有高风险、高预期收益的特征。	本级基金为被动跟踪指数的指数型证券投资基金,属于证券投资基金当中收益、风险较高的品种,一般情形下,其风险和预期收益高于混合型、债券型、货币市场基金。

§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10月1日-2014年12月31日)
1.本期已实现收益	2,193,483.85
2.本期利润	981,728.79
3.加权平均基金份额本期利润	0.0689
4.期末基金资产净值	17,675,175.91
5.期末基金份额净值	1.3275

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。

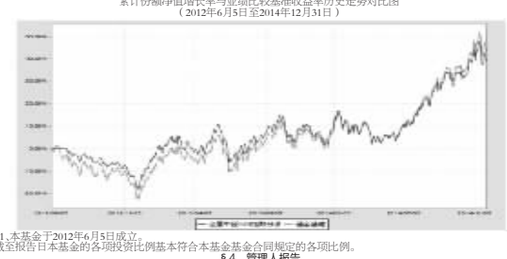
3.2 基金净值表现

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	5.75%	1.30%	7.88%	1.37%	-2.13%	-0.07%

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

金鹰中证500指数分级证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2012年6月5日至2014年12月31日)



注:1.本基金于2012年6月5日成立。
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的各项比例。

§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		
张永东	基金经理	2012-6-7	2014-12-10	11	张永东先生,工学博士,FRM(金融风险管理师),证券从业经历11年,中山大学数学与计算科学学院兼职研究生导师,曾任广发证券和中山大学联合博士后工作站研究人员、广发证券发展研究中心金融工程组负责人、华南理工大学副教授、硕士生导师以及广发基金、天治基金、益民基金金融工程负责人等职。2010年7月加入金鹰基金管理有限公司。
林华昱	基金经理	2012-6-5	-	12	林华昱先生2002年10月进入金鹰基金管理有限公司,2004年后开始从事指数研究等工作。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成份股优选证券投资基金基金经理。

注:1.本基金基金经理张永东先生已于2014年12月10日离任,目前本基金由林华昱单独管理;
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、《金鹰中证500指数分级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

在报告期内,本基金的跟踪标的中证500指数涨幅为8.27%,因基金规模较小造成固定费率较高、基金规模不稳定等因素对指数跟踪效果造成了较大的影响,本基金日均跟踪偏离度0.0803%,年化跟踪误差2.73%控制在投资目标限定范围内。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2014年12月31日,基金份额净值为1.3275元,本报告期份额净值增长率5.75%,同期业绩比较基准增长率为7.88%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金为股票型指数基金,以跟踪指数为目标,本基金将继续坚持采用量化策略进行指数复制和风险管理,适时对投资组合进行再平衡调整,力求将跟踪误差控制在投资目标限定范围内,获取与跟踪标的指数相近的收益率。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金自2014年11月4日起,截至2014年12月31日已连续27个工作日资产净值低于五千万。

§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	16,492,790.83	89.25
	其中:股票	16,492,790.83	89.25
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	1,530,582.25	8.28
7	其他资产	455,977.94	2.47
8	合计	18,479,351.02	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

5.2.1 按申万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	304,258.06	1.72
B	采矿业	543,812.94	3.08
C	制造业	9,308,499.21	52.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	499,610.99	2.83
E	建筑业	500,029.04	2.83
F	批发和零售业	1,104,730.46	6.25
G	交通运输、仓储和邮政业	671,533.06	3.80
H	住宿和餐饮业	32,643.00	0.18
I	信息传输、软件和信息技术服务业	896,568.86	5.07
J	金融业	428,360.55	2.42
K	房地产业	1,336,460.82	7.56
L	租赁和商务服务业	254,003.84	1.44
M	科学研究和技术服务业	67,084.56	0.38
N	水利、环境和公共设施管理业	116,149.32	0.66
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	204,110.44	1.15
S	综合	171,153.13	0.97
	合计	16,439,008.28	93.01

5.2.2 积极投资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	1,058.40	0.01
B	采矿业	772.17	0.00
C	制造业	40,203.70	0.23
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	4,882.70	0.03
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	3,449.88	0.02
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,470.81	0.01
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	944.89	0.01
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	53,782.55	0.30

注:积极投资股票是指申证500指数成份股调整及股票停牌,未及时卖出而被动持有的股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1期末指数投资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	601099	太平洋	14,200	201,924.00	1.14
2	300059	东方财富	4,800	134,208.00	0.76
3	300168	万达信息	2,100	97,020.00	0.55
4	600266	北京城建	3,800	89,908.00	0.51
5	000998	隆平高科	4,298	84,627.62	0.48
6	600169	太原重工	9,700	84,584.00	0.48
7	000883	湖北能源	11,100	82,917.00	0.47
8	600694	大商股份	1,700	81,481.00	0.46
9	600755	厦门国贸	6,914	78,128.20	0.44
10	600820	隧道股份	9,266	76,537.16	0.43

5.3.2期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	000627	天茂集团	6,246	25,608.60	0.14
2	600570	恒生电子	63	3,449.88	0.02
3	002190	成飞集成	82	2,624.00	0.01
4	000987	广州友谊	99	2,004.75	0.01
5	002049	同方国芯	80	1,920.00	0.01

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

本报告期末无贵金属投资。

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

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 报告期内本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 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	7,417.43
2	应收证券清算款	435,760.46
3	应收股利	-
4	应收利息	2,918.63
5	应收申购款	9,881.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	455,977.94

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。

5.11.5.1期末指数投资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	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300168	万达信息	97,020.00	0.55	重大事项
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-

5.11.5.2 期末积极投资前五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	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000627	天茂集团	25,608.60	0.14	重大事项
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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

项目	金鹰500A	金鹰500B	金鹰500
报告期期初基金份额总额	609,740.00	609,740.00	10,632,506.88
报告期期间基金总申购份额	-	-