金鹰保本混合型证券投资基金

2015 第一季度 报告

2015年3月31日

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年4月20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

基金简称	金鹰保本混合
基金主代码	210006
交易代码	210006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年5月17日
报告期末基金份额总额	78,387,531.43份
投资目标	采用改进的固定比例组合保险策略(CPPI),引入收益锁定机制,在严格控制投资风险、保证本金安全的基础上,力争在保本期结束时,实现基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金的保本策略为改进的固定比例组合保险策略(CPPI),是本基金投资运作过程中的核心策略;投资策略采用"自上而下"的投资视角,根据宏观经济与资本市场运行状况,固定收益类与权益类资产风险收益特性、基金净资产、价值底线,定性分析与定量分析并用,灵活动态地选取适当的风险乘数,以期对固定收益类与权益类资产之间的配置额进行优化调节,力争在确保本金安全的前提下,获取投资收益。
业绩比较基准	3年期银行定期存款利率(税后)
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,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	中国工商银行股份有限公司
基金保证人	广州越秀金融控股集团有限公司

§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1月1日-2015年3月31日)
1.本期已实现收益	2,249,187.90
2.本期利润	2,220,656.69
3.加权平均基金份额本期利润	0.0235
4.期末基金资产净值	82,104,678.54
5.期末基金份额净值	1.047

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

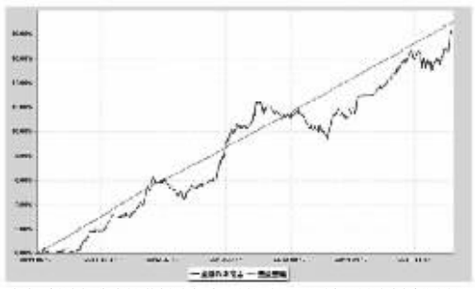
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.35%	0.18%	0.98%	0.01%	1.37%	0.17%

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

金鹰保本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

(2011年5月17日至2015年3月31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、权证占基金资产净值的比例为0%~40%,其中,权证投资的比例范围占基金资产净值的0%~3%;债券、资产支持证券、货币市场工具、现金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60%~100%,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%;
2、本基金的业绩比较基准为:3年期银行定期存款利率(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	2013-4-12	-	6	洪利平女士,西南财经大学硕士,证券从业年限6年,曾任职于生命人寿保险股份有限公司,任债券交易员;2010年7月加入金鹰基金管理有限公司,现任本基金、金鹰货币市场证券投资基金、金鹰元丰保本混合型证券投资基金、金鹰元盛分级债券型发起式证券投资基金基金经理。
李涛	固定收益投资部副总监	2015-1-9	-	10	李涛,硕士,历任光大银行总行资金部货币市场自营投资业务主管、中银国际证券研究部宏观研究员、广州证券资产管理总部投研总监。2014年11月加入金鹰基金管理有限公司,现任本基金、金鹰持久增利债券型证券投资基金(LOF)、金鹰元安保本混合型证券投资基金、金鹰元丰保本混合型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 管理人对投资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、《金鹰保本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年一季度市呈现先涨后跌的震荡走势。在经济数据偏弱同时年初债券供给缓慢释放的情况下,年初1月份和2月份债券市场延续了2014年12月下旬以来的回升走势。但是基于对政府稳增长目标明确,宽松财政和信贷投放逐渐发力的判断,我们在这一过程中逐步降低组合仓位和久期。进入3月份,随着万亿地方政府债务置换政策的出台,宽松财政政策进入实施阶段,我们在短期内迅速完成降低组合仓位和久期的调整,有效规避了债券市场3月份的调整。

股票市场方面,经历了去年四季度大盘指数的迅猛上升后,今年一季度大盘指数上涨势头趋稳,上证综指涨幅为16%。与此同时,创业板、中小板在去年四季度大体走平情况下,一季度上演了大幅飙升的行情,涨幅分别达到59%和47%,牛市氛围下的大小盘轮涨趋势显著。

本基金基于稳健的投资策略,保持了相对略低的股票仓位,导致整体组合收益率水平略低。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年3月31日,基金份额净值为1.047元,本报告期份额净值增长率为2.35%,同期业绩比较基准增长率为0.98%,超越基准137个BP。

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2015年二季度,政策有望持续保持宽松,信贷数据的持续快增,出口的回暖,地产销售的复苏等,经济环比回升力度将明显加大,通胀指标在1季度偏弱水平上也将出现温和回升。

2015年二季度本基金在债券投资方面,我们认为:债券供给方面,随着利率债发行高峰的到来,特别是地方政府债务置换的巨大增量,将推动利率债收益率水平维持在一个略高的区间之内震荡,同时,非上市公司债进入发行阶段,企业债的审批和发行方式也逐步理顺,资产证券化的备案制已经落地,信用债的供给也将迅速扩大;债券需求方面,美联储加息时点和加息力度预期弱化,美元指数开始进入高位震荡,外汇流入和流出的力量将逐渐平衡,央行将配合宽松财政政策维持目前中性略显宽松的货币环境,在债券收益率曲线将继续呈现陡峭型变化,市场经过一定幅度的调整之后,中长期债券将开始体现配置价值,我们将根据经济数据的变化和供给释放的节奏,逐步提升债券仓位,小幅提升久期。

股票市场方面,居民财富大类资产配置中加大权益资产比例的过程并未结束,同时宽松的政策环境和企稳的宏观经济仍能对股市提供稳定的支撑。但新股发行速度将继续加快,而港股在新政催生下"虹吸"效应也将给A股市场中高估值板块带来压力。因此,二季度股市可能呈现出震荡加剧、风格轮动的市场新特征。对此,基金经理将保持高度的关注和警惕,通过仓位的均衡配置和适度的波段操作以应对市场可能的超预期波动。

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	2,412,000.00	2.88
	其中:股票	2,412,000.00	2.88
2	固定收益投资	71,612,585.70	85.51
	其中:债券	71,612,585.70	85.51
	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	7,000,000.00	8.36
	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	1,091,659.29	1.30
7	其他资产	1,633,555.51	1.95
8	合计	83,749,800.50	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	2,412,000.00	2.94
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	-	-
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	-	-
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	2,412,000.00	2.94

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	600309	万华化学	100,000	2,412,000.00	2.94
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

注:本基金本报告期末仅持有一只股票。

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	10,002,000.00	12.18
	其中:政策性金融债	10,002,000.00	12.18
4	企业债券	37,357,885.70	45.50
5	企业短期融资券	20,071,000.00	24.45
6	中期票据	-	-
7	可转债	4,181,700.00	5.09
8	其他	-	-
9	合计	71,612,585.70	87.22

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	124588	14济宁债	101,000	10,628,230.00	12.94
2	122521	12筑金阳	101,000	10,388,860.00	12.65
3	1480391	14常房债	100,000	10,326,000.00	12.58
4	011499040	14辽成大SCP002	100,000	10,039,000.00	12.23
5	011445002	14三峡SCP002	100,000	10,032,000.00	12.22

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股指期货投资。
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	17,999.83
2	应收证券清算款	32,992.93
3	应收股利	-
4	应收利息	1,579,189.73
5	应收申购款	3,373.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,633,555.51

5.11.4 报告期未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

报告期期初基金份额总额	107,372,920.57
报告期期间基金总申购份额	1,033,956.68
减:报告期期间基金总赎回份额	30,019,345.82
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	78,387,531.43

§7 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。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1、中国证监会批准金鹰保本混合型证券投资基金发行及募集的文件。
2、《金鹰保本混合型证券投资基金基金合同》。
3、《金鹰保本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、更新的招募说明书及其他临时公告。

8.2 存放地点
广州市天河区体育西路189号城建大厦22-23层

8.3 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
二〇一五年四月二十一日

金鹰成份股优选证券投资基金

2015 第一季度 报告

2015年3月31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

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	1,122,254,073.85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、稳定的当期收益。
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(2015年1月1日-2015年3月31日)
1.本期已实现收益	64,614,896.83
2.本期利润	233,959,052.59
3.加权平均基金份额本期利润	0.1932
4.期末基金资产净值	978,762,813.82
5.期末基金份额净值	0.8721

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

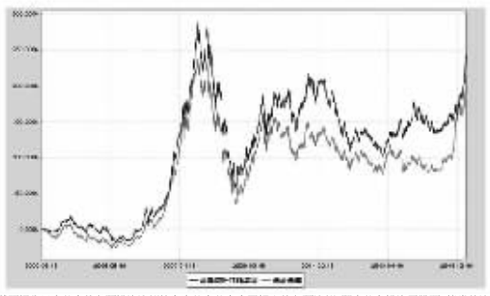
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	28.86%	1.23%	10.42%	1.39%	18.44%	-0.16%

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

金鹰成份股优选证券投资基金

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

(2003年6月16日至2015年3月31日)



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		
王喆	权益投资部副总监	2015-3-6	-	16	历任沈阳商品交易所期货市场及大宗商品趋势分析师、宏源证券分析师、投资经理,广州证券投资经理、投资总监等职,2014年11月加入金鹰基金管理有限公司,现任权益投资部副总监,本基金及金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
林华显	基金经理	2011-3-1	2015-3-28	12	林华显先生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。

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 管理人对投资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

一季度,宏观经济持续下行,货币政策不断放松,流动性宽松。A股市场成为国内资金大类资产配置的主要方向。

一季度市场继续大幅上行,而市场风格再度向小盘成长股切换。其中创业板区间涨幅高达58.7%,远远领先上证综指15.8%的涨幅。以互联网为代表的新技术产业得到市场广泛的认同,而互联网等新技术应用对传统产业的改造升级,更是引起无限的遐想,成为市场不断挖掘的对象。资金驱动的市场特征明显。但随着场外资金不断涌入,市场整体估值水平也有了明显的提高,估值结构性泡沫开始显现。

本季度,根据市场变化,逐渐调整的行业配置方向,降低了金融等大盘蓝筹股的配置,同时增加了信息技术互联网等板块的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止2015年3月31日,基金份额净值为0.8721元,本报告期份额净值增长率为28.86%,同期业绩比较基准增长率为10.42%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度资金整体仍会继续流入的趋势,但随着市场估值水平的不断提高,阶段性调整的压力也会不断加大。因此我们在操作中将保持一定的弹性,灵活控制股票持仓比例。在资产配置方面,以经济转型作为长期资产配置的主要方向,同时增加食品、医药等防御型板块的配置。

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	746,355,224.32	75.36
	其中:股票	746,355,224.32	75.36
2	固定收益投资	203,621,883.20	20.56
	其中:债券	203,621,883.20	20.56
	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	10,930,212.25	1.10
7	其他资产	29,471,542.13	2.98
8	合计	990,378,861.90	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	405,805,471.75	41.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,132,000.00	0.32
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	235,299,247.20	24.04
J	金融业	31,455,250.00	3.21
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	25,467,832.56	2.60
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	18,234,000.00	1.86
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	26,961,422.81	2.75
S	综合	-	-
	合计	746,355,224.32	76.25

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	4,200,000	96,978,000.00	9.91
2	002230	科大讯飞	1,763,055	91,678,860.00	9.37
3	002405	四维图新	2,009,765	81,998,412.00	8.38
4	600597	光明乳业	2,207,111	50,410,415.24	5.15
5	600276	恒瑞医药	899,851	41,483,131.10	4.24
6	600521	华海药业	2,249,868	39,417,687.36	4.03
7	002563	森马服饰	818,267	38,360,356.96	3.92
8	600718	东软集团	1,150,000	32,326,500.00	3.30
9	600196	复星医药	1,249,994	30,987,351.26	3.17
10	002317	众生药业	1,204,633	30,694,048.84	3.14

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	102,569,883.20	10.48
2	央行票据	-	-
3	金融债券	101,052,000.00	10.32
	其中:政策性金融债	101,052,000.00	10.32
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	203,621,883.20	20.80

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	51,090,000.00	5.22
2	019013	10国债13	500,000	49,895,000.00	5.10
3	140230	14国开30	300,000	29,958,000.00	3.06
4	019321	13国债21	267,000	26,780,100.00	2.74
5	018001	国开1301	252,780	25,894,783.20	2.65

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
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	250,711.62
2	应收证券清算款	24,454,520.09
3	应收股利	-
4	应收利息	4,298,836.15
5	应收申购款	467,474.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,471,542.13

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	000625	长安汽车	96,978,000.00	9.91	重大事项
2	600597	光明乳业	50,410,415.24	5.15	重大事项
3	600196	复星医药	30,987,351.26	3.17	重大事项
4	002317	众生药业	30,694,048.84	3.14	重大事项
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	1,275,592,154.38
报告期期间基金总申购份额	7,709,461.88
减:报告期期间基金总赎回份额	161,047,542.41
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	1,122,254,073.85

§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
二〇一五年四月二十一日

金鹰策略配置股票型证券投资基金

2015 第一季度 报告

2015年3月31日

基金管理人:金鹰基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年4月20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

基金简称	金鹰策略配置股票
基金主代码	210008
交易代码	210008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年9月1日
报告期末基金份额总额	59,410,347.52份
投资目标	在对基本面进行深入分析的基础上,制定适当的投资策略,以策略指导投资运作,在充分控制风险的前提下,分享中国经济快速发展的成果以及企业经营绩效提升