华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金

2015 第一季度 报告

2015年3月31日

基金管理人:华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2015年4月21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。本报告中的财务资料未经审计。本报告期自2015年1月1日起至2015年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞丰汇债券
交易代码	000421
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年12月11日
报告期末基金份额总额	520,883,660.63份
投资目标	在合理控制风险的基础上,追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采用以下投资策略①1.类属资产配置策略:综合考虑各证券市场的资金供求状况、波动性水平以及走势的相关性,在基金合同约定比例的范围内,动态调整基金大类资产的配置比例;2.债券投资策略:本基金将在对宏观经济走势、利率变化趋势、收益率曲线形态变化和发债主体基本面分析的基础上,综合运用久期管理策略、期限结构配置策略、骑乘策略、息差策略等主动投资策略,选择合适的时机和品种构建债券组合。3.新股认购策略: 本基金将深入研究上市公司新股的基本面因素、收益率、中签率以及股票市场整体估值水平,发掘新股的内在价值,综合考虑基金资产的周转率、成本费用
业绩比较基准	中债综合指数
风险收益特征	本基金属于债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金,高于货币市场基金。
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	华泰柏瑞丰汇债券A	华泰柏瑞丰汇债券C
下属分级基金的交易代码	000421	000422
报告期末下属分级基金的份额总额	474,108,252.30份	46,775,408.33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(2015年1月1日 - 2015年3月31日)	
	华泰柏瑞丰汇债券A	华泰柏瑞丰汇债券C
1.本期已实现收益	5,782,958.75	595,555.70
2.本期利润	12,062,243.81	1,263,706.96
3.加权平均基金份额本期利润	0.0143	0.0126
4.期末基金资产净值	481,478,702.76	47,434,929.83
5.期末基金份额净值	1.016	1.014

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

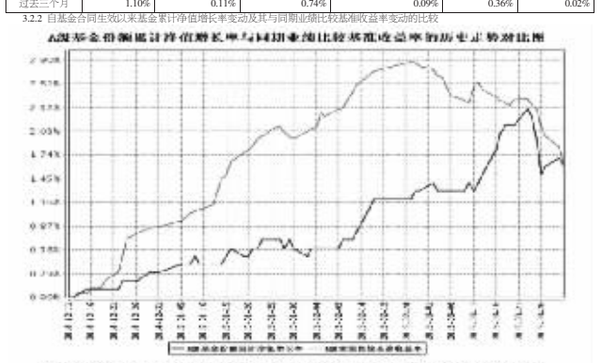
华泰柏瑞丰汇债券A

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	1.30%	0.11%	0.74%	0.09%	0.56%	0.02%

华泰柏瑞丰汇债券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	1.10%	0.11%	0.74%	0.09%	0.36%	0.02%

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:1.图示日期为2013年12月11日至2015年3月31日。
2.按基金合同规定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期,截至报告日本基金处于建仓期。

§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		
陈东	固定收益部副总监、本基金的基金经理	2014年12月11日	-	8年	陈东先生,硕士,曾任深圳发展银行(现已更名为平安银行)总行金融市场部固定收益与衍生品交易员,负责本外币理财产品的资产管理工作;中国工商银行总行金融市场部人民币债券交易员,负责银行账户的自营债券投资工作。2012年9月加入华泰柏瑞基金管理有限公司。2012年11月起任华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金基金经理,2013年9月起任华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金的基金经理,2013年11月起任华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金的基金经理,2014年12月起任华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金的基金经理,2015年1月起任固定收益部副总监。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
报告期内本基金的运作符合相关法律、法规以及基金合同的约定,不存在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
报告期内,本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求,通过科学完善的制度及流程,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核,在交易过程中启用投资交易系统中的公平交易模块,确保公平交易的实施。同时,风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。
本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好。
4.3.2 异常交易行为专项说明
报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本报告期内无下列情况:所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%。
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,尽管市场存在较强的政策放松预期,但银行间市场资金面仍然保持偏紧的状态,直至3月份才有所缓和。债券收益率总体呈现先下后上的走势,3月之前受政策放松预期的影响呈下降走势,3月在预期兑现后呈上升态势。权益市场则受资金积极入市的影响,整体表现较好,但初值产品受转股溢价率水平过高的影响整体表现偏弱。
投资策略上,基金以短久期品种为配置主体,并以一定仓位配置了转债资产,把握了转债市场的上涨机会。
4.4.2 报告期内基金的业绩表现
截至本报告期末,本基金A类和B类份额净值分别为1.016元和1.014元,分别上涨1.30%和1.10%,同期本基金的业绩比较基准上涨0.74%。
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,债券市场预计将呈现整体震荡与短期受政策刺激上涨并存的局面;权益产品则受资金热情的影响,可能仍存在一定的上涨机会。
策略上,债券部分将保持短久期的特征,并把握长久期品种的阶段性机会;权益上,将继续以一定仓位参与转债市场的潜在上涨机会。
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
无。

§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	9,029,152.22	1.23
	其中:股票	9,029,152.22	1.23
2	固定收益投资	706,483,903.50	95.93
	其中:债券	706,483,903.50	95.93
	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	5,345,046.95	0.73
7	其他资产	15,624,432.08	2.12
8	合计	736,482,534.75	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	9,029,152.22	1.71
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	9,029,152.22	1.71

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	600875	东方电气	416,666	9,029,152.22	1.71

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	58,390,800.00	11.04
	其中:政策性金融债	58,390,800.00	11.04
4	企业债券	83,205,802.30	15.73
5	企业短期融资券	499,990,000.00	94.53
6	中期票据	-	-
7	可转债	64,897,301.20	12.27
8	其他		
9	合计	706,483,903.50	133.57

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	018001	国开1301	570,000	58,390,800.00	11.04
2	011599041	15昆钢SCP001	500,000	50,085,000.00	9.47
3	011599040	15南方水泥SCP002	500,000	50,050,000.00	9.46
4	011574001	15陕煤化SCP001	500,000	50,020,000.00	9.46
5	041561006	15晋焦煤	500,000	50,005,000.00	9.45

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
注: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
注: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
注: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国债期货交易情况说明
5.9.1 本期国债期货投资政策
注:本基金本报告期末未持有国债期货。
5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
注:本基金本报告期末未持有国债期货。
5.9.3 本期国债期货投资评价
注:本基金本报告期末未持有国债期货。
5.10 投资组合报告附注
5.10.1
报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
5.10.2
基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。
5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	81,856.77
2	应收证券清算款	9,496,886.13
3	应收股利	-
4	应收利息	6,015,669.30
5	应收申购款	30,019.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,624,432.08

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:截至本报告期末,本基金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

项目	华泰柏瑞丰汇债券A	华泰柏瑞丰汇债券C
报告期期初基金份额总额	951,334,388.43	161,714,480.45
报告期期间基金总申购份额	101,235,279.93	305,337.40
减:报告期期间基金总赎回份额	578,461,416.06	115,244,409.52
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	474,108,252.30	46,775,408.33

§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
注:无。
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
注:无。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1、本基金的中国证监会批准募集文件
2、本基金的《基金合同》
3、本基金的《招募说明书》
4、本基金的《托管协议》
5、基金管理人业务资格批件、营业执照
6、本基金的公告
8.2 存放地点
上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层
8.3 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。
投资者对本报告如有疑问,可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。
客户服务热线:400-888-0001(免长途费)021-3878 4638
公司网址:www.huatai-pb.com

华泰柏瑞基金管理有限公司
2015年4月21日

金鹰主题优势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	金鹰主题优势股票
基金主代码	210005
交易代码	210005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月20日
报告期末基金份额总额	438,155,177.99份
投资目标	以追求资本可持续增值为目的,以深入的基本面分析为基础,把握主题投资的脉络,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所带来的股权溢价,力争实现基金资产的长期可持续稳健增值。
投资策略	本基金坚持"自上而下"为主、"自下而上"为辅的投资视角,在实际投资过程中充分体现"主题优势"这个核心理念,以主题情景分析法把握经济发展不同阶段的主题投资节奏,优选并深挖不同阶段热点主题投资机会,优化资产配置,降低市场波动的冲击,扩大投资收益。
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

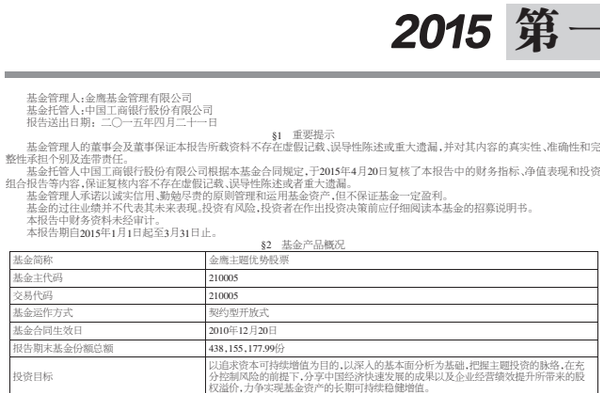
主要财务指标	报告期(2015年1月1日-2015年3月31日)
1.本期已实现收益	69,208,367.92
2.本期利润	140,928,899.52
3.加权平均基金份额本期利润	0.3025
4.期末基金资产净值	490,537,007.86
5.期末基金份额净值	1.120

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	39.30%	1.80%	11.16%	1.37%	28.14%	0.43%

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

金鹰主题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
(2010年12月20日至2015年3月31日)



注:1、截至报告日本基金各项投资比例基本符合基金合同规定的各项比例;
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		
陈立	基金经理	2013-8-15	-	8	陈立,经济学硕士,证券从业经历8年。曾任银华基金管理有限公司医药行业研究员,2009年6月加盟金鹰基金管理有限公司,先后任行业研究员、非周期组组长、基金经理助理、投资经理。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》及其他有关法律法规及其各项实施准则、《金鹰主题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。
本基金管理人对基金管理公司的其他主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
一季度在央行进一步降息、改革持续推进等多因素推动下,A股市场继续大幅上涨。上证综指上涨16%,深成指上涨19%,中小板指数大涨47%,创业板指数涨幅更达到59%。行业方面,计算机、传媒、通信、餐饮旅游、轻工涨幅居前,银行、非银金融、煤炭、食品饮料、电力及公用事业涨幅居后。
本基金在一季度整体保持较高仓位,重点投资顺应经济转型升级有持续增长潜力的投资机会,包括医药、互联网化带来的创新以及对传统行业的渗透、节能环保等,同时基于降息带来社会融资成本下行和流动性改善,本基金也兼顾Beta行业的投资机会。
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1.120元,本报告期份额净值增长率39.30%,同期业绩比较基准增长率为11.16%。
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
国内方面,尽管经济短期下行的压力在增大,但随着进一步降准降息的宽松货币政策推出,市场真实利率有望继续下降。同时,以债务置换为代表的积极财政政策推出,地方融资平台所形成的债务风险也在下降。市场总体风险偏好将上升,经济有望重建平衡。海外方面,美元升值对汇率和大宗商品的冲击依然是重点关注的变量。
展望二季度,经济有托底、真实利率下降、改革红利不断落实依然是支持市场上行的动力。市场经历一季度大幅上涨后,波动的风险加大,但整体的趋势依然有望向好。看好医疗健康、互联网技术应用与渗透、节能环保等转型升级方向的投资机会。适时关注宽松政策下Beta行业的配置机会。主题方面关注国企改革、信息安全、"一带一路"、军工等。
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	398,926,652.42	78.44
	其中:股票	398,926,652.42	78.44
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	72,824,540.52	14.32
7	其他资产	36,842,075.20	7.24
8	合计	508,593,268.14	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	154,443,566.50	31.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,746,125.00	2.60
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	8,732,775.87	1.78
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	150,431,414.58	30.67
J	金融业	14,372,244.00	2.93
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	25,877,320.17	5.28
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	32,323,206.30	6.59
S	综合	-	-
	合计	398,926,652.42	81.32

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	300183	东软载波	537,480	36,699,134.40	7.48
2	600446	金证股份	251,559	30,639,886.20	6.25
3	002657	中科金财	379,200	28,174,560.00	5.74
4	002177	御银股份	2,026,946	23,350,417.92	4.76
5	600391	成发科技	469,700	20,807,710.00	4.24
6	600757	长江传媒	1,589,091	20,467,492.08	4.17
7	300170	汉得信息	536,896	20,407,416.96	4.16
8	000661	长春高新	137,900	15,839,194.00	3.23
9	600399	抚顺特钢	462,000	15,158,220.00	3.09
10	603019	中科曙光	210,003	14,693,909.91	3.00

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	579,918.18
2	应收证券清算款	8,999,759.86
3	应收股利	-
4	应收利息	13,188.77
5	应收申购款	27,249,208.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	36,842,075.20

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	300183	东软载波	36,699,134.40	7.48	重大事项
2	-	-	-	-	-
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	504,350,594.96
报告期期间基金总申购份额	85,675,103.62
减:报告期期间基金总赎回份额	151,870,520.59
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	438,155,177.99

§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主题优势股票型证券投资基金发行及募集的文件。
2、《金鹰主题优势股票型证券投资基金基金合同》。
3、《金鹰主题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、更新的招股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

金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金

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	金鹰中证技术领先指数增强
基金主代码	210007
交易代码	210007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年6月1日
报告期末基金份额总额	20,440,294.20份
投资目标	本基金为股票型指数增强基金,跟踪指数为本基金的首要目标,力求实现对中证技术领先指数的有效跟踪;对于指数增强部分,采取适当的增强策略,力争取得超越标的指数的投资收益。
投资策略	本基金将在基金合同规定的投资范围内,采用"自上而下"的分析视角,综合考量中国宏观经济所处投资时钟的象限、国内股票市场的估值、国内债券市场收益率的期限结构、CPI与PPI变动趋势、外围主要经济体宏观经济与资本市场的运行状况等因素,分析研判股票市场、债券市场、货币市场的预期收益与风险,合理确定并适时动态地调整本基金在股票、债券、现金等金融工具上的投资比例,力争取得超越标的指数的投资收益。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为中证技术领先指数×90%+活期存款利率(税后)×10%。
风险收益特征	本基金为以跟踪指数为主,主动投资为辅的股票型证券投资基金,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。
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

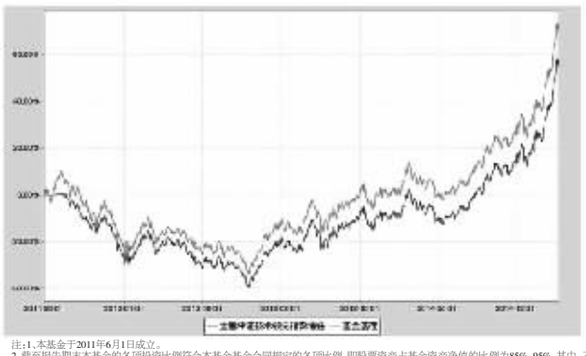
主要财务指标	报告期(2015年1月1日-2015年3月31日)
1.本期已实现收益	6,577,746.61
2.本期利润	12,516,963.90
3.加权平均基金份额本期利润	0.4175
4.期末基金资产净值	32,266,970.44
5.期末基金份额净值	1.5786

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	39.27%	1.31%	37.83%	1.26%	1.44%	0.05%

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

金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2011年6月1日至2015年3月31日)



注:1、本基金于2011年6月1日成立。
2、截至报告期末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,即股票资产占基金资产净值的比例为85%-95%,其中,不低于80%的基金净资产将投资于中证技术领先指数的成分股和备选成分股;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%-15%,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%;
3、本基金业绩比较基准为中证技术领先指数×90%+活期存款利率(税后)×10%。

§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	公司权益投资部总监	2014-12-10	-	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及金鹰稳健成长股票型证券投资基金、金鹰行业优势股票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》及其他有关法律法规及其各项实施准则、《金鹰中证技术领先指数增强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,未影响本基金资产和基金份额持有人的利益,未出现其他重大违法违规或违反基金合同的行为。
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