

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:二〇一三年八月二十六日

重要提示及目录

1.1 重要提示
基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字确认，并由董事长签发。

基金管理人和托管人承诺以诚实信用、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及其摘要。

本半年度报告摘要将简要描述报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。
本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	金鹰保本混合	基金代码	210006
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	二〇一三年八月二十六日		
		重要提示及目录	
1.1 重要提示			

基金管理人和托管人承诺以诚实信用、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及其摘要。

本半年度报告摘要将简要描述报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至6月30日止。

2.2 基金产品说明

采用改进的固定比例保险机制(CPPI)，引入收益锁定机制，在严格控制投资风险、保障基金安全的基础上，力争在保本到期结束时，实现基金资产的稳健增值。

本基金的保本策略为固定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“上管下”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的风险溢价水平，动态地选取适当的保险金额，以期在锁定收益的同时，分享股票市场的投资收益。

本基金通过定期调整保险金额，从而进行优化调整，力求在确保基金安全的前提下，获取更多的投资收益。

3.1 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	金鹰基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
姓名	苏文锋	赵会军
联系电话	020-83286267	010-66105799
电子邮箱	esmail@gefund.com.cn	custody@icbc.com.cn

客户服务电话 4006135888, 020-83936180

传真 020-83282856

010-66105798

2.4 信息披露方式

管理人互联网网址 http://www.gefund.com.cn

基金半年度报告备置地点 广州市天河区体育西路189号城建大厦22-23层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	金鹰基金管理有限公司	广州市天河区体育西路189号城建大厦22-23层
基金保证人	广州国际集团有限公司	广州市越秀区东风中路509号建银大厦5楼
会计师事务所	立信会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区南京东路61号四楼

3.1 主要财务指标和基金净值表现

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标 报告期(2013年1月1日至2013年6月30日)

本期已实现收益 23,107,731.22

本期利润 26,896,073.16

加权平均基金份额本期利润 0.0594

本期基金份额净值增长率 5.46%

3.1.2 期末数据和指标 报告期末(2013年6月30日)

本期可供分配基金份额利润 0.1185

期末基金份额净值 456,706,302.38

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.本基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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 份额净值增长 率(%)(1) 份额净值增 长率(%)(2) 业绩比较基 准收益率差(3) 业绩比较基 准收益率(4) ①-③ ②-④

过去一个月 -0.36% 0.15% 0.35% 0.02% -0.71% 0.13%

过去三个月 1.45% 0.15% 1.08% 0.01% 0.37% 0.14%

过去六个月 5.46% 0.17% 2.16% 0.02% 3.30% 0.15%

过去一年 5.76% 0.14% 4.41% 0.01% 1.35% 0.13%

自基金合同生 效起至今 12.00% 0.12% 10.48% 0.01% 1.52% 0.11%

注:本基金的业绩比较基准为3年期银行定期存款利率(税后)。

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

金鹰保本混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率走势对比图(2011年5月17日至2013年6月30日)

3.2.3 管理人报告期内本基金运作情况的专项说明

3.3 管理人对报告期内本基金运作的总体评价

3.4 管理人对基金未来估值方法的特别说明

3.5 管理人对本基金定期报告编制的说明

3.6 管理人对中期报告编制的说明

3.7 管理人对本报告期基金业绩的说明

3.8 管理人对本报告期基金费用的说明

3.9 管理人对本报告期利润分配的说明

3.10 管理人对本报告期基金费用的说明

3.11 管理人对本报告期基金收益的说明

3.12 管理人对本报告期基金费用的说明

3.13 管理人对本报告期基金费用的说明

3.14 管理人对本报告期基金费用的说明

3.15 管理人对本报告期基金费用的说明

3.16 管理人对本报告期基金费用的说明

3.17 管理人对本报告期基金费用的说明

3.18 管理人对本报告期基金费用的说明

3.19 管理人对本报告期基金费用的说明

3.20 管理人对本报告期基金费用的说明

3.21 管理人对本报告期基金费用的说明

3.22 管理人对本报告期基金费用的说明

3.23 管理人对本报告期基金费用的说明

3.24 管理人对本报告期基金费用的说明

3.25 管理人对本报告期基金费用的说明

3.26 管理人对本报告期基金费用的说明

3.27 管理人对本报告期基金费用的说明

3.28 管理人对本报告期基金费用的说明

3.29 管理人对本报告期基金费用的说明

3.30 管理人对本报告期基金费用的说明

3.31 管理人对本报告期基金费用的说明

3.32 管理人对本报告期基金费用的说明

3.33 管理人对本报告期基金费用的说明

3.34 管理人对本报告期基金费用的说明

3.35 管理人对本报告期基金费用的说明

3.36 管理人对本报告期基金费用的说明

3.37 管理人对本报告期基金费用的说明

3.38 管理人对本报告期基金费用的说明

3.39 管理人对本报告期基金费用的说明

3.40 管理人对本报告期基金费用的说明

3.41 管理人对本报告期基金费用的说明

3.42 管理人对本报告期基金费用的说明

3.43 管理人对本报告期基金费用的说明

3.44 管理人对本报告期基金费用的说明

3.45 管理人对本报告期基金费用的说明

3.46 管理人对本报告期基金费用的说明

3.47 管理人对本报告期基金费用的说明

3.48 管理人对本报告期基金费用的说明

3.49 管理人对本报告期基金费用的说明

3.50 管理人对本报告期基金费用的说明

3.51 管理人对本报告期基金费用的说明

3.52 管理人对本报告期基金费用的说明

3.53 管理人对本报告期基金费用的说明

3.54 管理人对本报告期基金费用的说明

3.55 管理人对本报告期基金费用的说明

3.56 管理人对本报告期基金费用的说明

3.57 管理人对本报告期基金费用的说明

3.58 管理人对本报告期基金费用的说明

3.59 管理人对本报告期基金费用的说明

3.60 管理人对本报告期基金费用的说明

3.61 管理人对本报告期基金费用的说明

3.62 管理人对本报告期基金费用的说明

3.63 管理人对本报告期基金费用的说明

3.64 管理人对本报告期基金费用的说明

3.65 管理人对本报告期基金费用的说明

3.66 管理人对本报告期基金费用的说明

3.67 管理人对本报告期基金费用的说明

3.68 管理人对本报告期基金费用的说明

3.69 管理人对本报告期基金费用的说明

3.70 管理人对本报告期基金费用的说明

3.71 管理人对本报告期基金费用的说明

3.72 管理人对本报告期基金费用的说明

3.73 管理人对本报告期基金费用的说明

3.74 管理人对本报告期基金费用的说明