金鹰元丰保本混合型证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

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

1 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同意，并由董事长签发。

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2013年8月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月30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	金鹰元丰保本混合
基金主代码	210014
交易代码	210014
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年1月30日
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	749,341,150.08份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金运用投资组合保险策略，在严格控制投资风险、保证本金安全的基础上，力争在保本周期结束时，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，以保障基金资产本金的安全，并通过有效的资产配置策略，获得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)。
风险收益特征	本基金为保本混合型基金，属于证券投资基金中的低风险品种。

2.3 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
信息披露负责人	姓名	苏文锋	赵会军
	联系电话	020-83282627	010-66105799
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006135888，020-83936180	95588
传真		020-83282856	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	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	中海信达担保有限公司	北京市朝阳区东三环中路7号财富中心写字楼3101室
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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

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30日(基金合同生效日)至2013年6月30日)
本期已实现收益	10,405,991.09
本期利润	6,012,992.76
加权平均基金份额本期利润	0.0078
本期基金份额净值增长率	0.80%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0077
期末基金资产净值	755,093,865.62
期末基金份额净值	1.008

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。

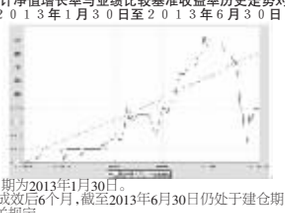
3.2 基金净值表现

3.2.1 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
过去一个月	-0.98%	0.20%	0.31%	0.01%	-1.29%	0.19%
过去三个月	0.40%	0.15%	0.95%	0.01%	-0.55%	0.14%
自基金合同生效起至今	0.80%	0.13%	1.60%	0.01%	-0.80%	0.12%

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

金鹰元丰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历史走势对比图
（2013年1月30日至2013年6月30日）



注：1、本基金合同生效日期为2013年1月30日。

2、本基金建仓期为合同成效后6个月，截至2013年6月30日仍处于建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例应符合本基金合同有关规定。

3、本基金的业绩比较基准为：2年期银行定期存款利率（税后）。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

金鹰基金管理有限公司经中国证监会证监基字〔2002〕97号文批准，于2002年12月25日成立，是自律制度下中国证监会批准设立的首批基金管理公司之一。公司注册资本2.5亿元人民币，股东包括广州证券有限责任公司、广州药业股份有限公司、广东美的电器股份有限公司和东亚联丰投资管理有限公司，分别持有49%、20%、20%和11%的股份。

公司设立了投资决策委员会、风险控制委员会、资产估值委员会等专业委员会。投资决策委员会负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。风险控制委员会负责全面评估公司的经营过程中的各项风险，并提出防范措施。资产估值委员会负责依照基金合同和基金估值制度的规定，确定基金资产估值的原则、方法、程序及其他相关的估值事宜。

公司目前下设十三个部门，分别是：基金管理部、研究发展部、集中交易部、金融工程部、产品研发部、固定收益投资部、市场拓展部、机构客户部、专户投资部、品牌电子商务部、运作保障部、监察稽核部、综合管理部。基金管理部负责根据投资决策委员会制定的投资决策进行基金投资；研究发展部负责宏观经济、行业、上市公司研究和投资策略研究；集中交易部负责完成基金经理投资指令；金融工程部负责金融工程研究、数量分析工作；产品研发部负责基金新产品、新业务的研究和设计工作；固定收益投资部负责固定收益证券以及债券、货币市场的研究和投资管理工作；市场拓展部负责市场营销策划、基金销售与渠道管理、客户服务等业务；机构客户部负责机构客户的开发、维护与管理；专户投资部负责特定客户资产的投资和管理；品牌电子商务部负责公司品牌宣传、媒介关系及广告管理、电子商务的营销策划及业务推广等；运作保障部负责公司信息系统的日常运行与维护，跟踪研究新技术，进行相应的技术系统规划与开发、基金运计核算、估值、开放式基金注册、登记和清算等业务；监察稽核部负责对公司和基金运作以及公司员工遵守国家相关法律、法规和公司内部规章制度等情况进行监督和检查；综合管理部负责公司企业文化建设、文字档案、公司财务、后勤服务、人力资源管理、薪酬制度、人员培训、人事档案等综合事务管理。

截至2013年6月30日，公司共管理金鹰成份优选证券投资基金、金鹰中小盘精选证券投资基金、金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金、金鹰行业优势股票型证券投资基金、金鹰稳健成长股票型证券投资基金、金鹰主题优势股票型证券投资基金、金鹰保本混合型证券投资基金、金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金、金鹰策略配置股票型证券投资基金、金鹰持久回报分级债券型证券投资基金、金鹰核心资源股票型证券投资基金、金鹰中证500指数分级证券投资基金、金鹰元泰精选信用债证券投资基金、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以及金鹰元安保本混合型证券投资基金17只开放式基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邱新红	基金经理	2013-01-30	-	10年	邱新红先生，美国卡内基梅隆大学计算金融专业硕士，证券从业年限10年。曾任职于美国太平洋投资管理公司(PIMCO)，担任投资组合经理助理。2008年3月到2010年6月担任Bayview资产管理公司的投资经理，负责债券投资组合管理。2010年8月加入金鹰基金管理有公司，任职债券研究员，现任固定收益投资部总监、本基金、金鹰持久回报分级债券型证券投资基金、金鹰保本混合型证券投资基金、金鹰元安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。
洪利平	基金经理	2013-01-30	-	4年	洪利平女士，西南财经大学硕士，证券从业年限4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及金鹰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、《金鹰元丰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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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，必要时启用投资决策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 管理人对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

2013年上半年中国债券市场走出一波"小牛"行情，大部分时间，收益率延续下行趋势。10年国债收益率下行10BP，10年国开债收益率下行30BP，5年高等级企业债收益率下行25BP，中低等级的企业债则下行50BP左右。然而6月下旬，银行间资金危机全面爆发，短期回购利率飙升到前所未有的历史高位，债市短期承受巨大压力。

2013年上半年，中国市场在经济复苏乏力的共识和流动性冲击下，市场经历了大幅的波动，并出现比较明显的下跌。整体看，上半年上证指数下跌12.78%，深证综指下跌15.60%，沪深300下跌12.78%。但结构分化比较严重，中小板指数上涨5.19%，创业板指数大幅上涨41.72%。

债券投资上，基本以持有为主，但是对信用恶化的个债进行了坚决卖出，对于资质优良的信用债则采取持有策略。权益类投资上，本基金采取了灵活的操作策略，根据市场的趋势性行情采取了积极的择时操作，并在市场下跌时保持较低的股票仓位。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年6月30日，公司共管理金鹰成份优选证券投资基金、金鹰中小盘精选证券投资基金、金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金、金鹰行业优势股票型证券投资基金、金鹰稳健成长股票型证券投资基金、金鹰主题优势股票型证券投资基金、金鹰保本混合型证券投资基金、金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金、金鹰策略配置股票型证券投资基金、金鹰持久回报分级债券型证券投资基金、金鹰核心资源股票型证券投资基金、金鹰中证500指数分级证券投资基金、金鹰元泰精选信用债证券投资基金、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以及金鹰元安保本混合型证券投资基金17只开放式基金。

截至报告期末2013年6月30日，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券余额款625,000,000.00元，于2013年7月1日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	10,693,395.38	0.77
	其中：股票	10,693,395.38	0.77
2	固定收益投资	1,270,685,648.80	91.91
	其中：债券	1,270,685,648.80	91.91
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	30,000,165.00	2.17
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	45,423,753.71	3.29
6	其他各项资产	25,733,938.62	1.86
7	合计	1,382,536,901.51	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	10,693,395.38	1.42
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	10,693,395.38	1.42

7.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002241	歌尔声学	139,984	5,080,019.36	0.67
2	002353	杰瑞股份	59,906	4,133,514.00	0.55
3	002011	盾安环境	145,943	1,479,862.02	0.20

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	002317	众生药业	5,004,873.91	0.66
2	002241	歌尔声学	4,926,427.30	0.65
3	002353	杰瑞股份	4,118,400.04	0.55
4	002011	盾安环境	3,818,856.67	0.51
5	300273	和佳股份	3,494,188.62	0.46
6	300198	纳川股份	1,999,730.00	0.26
7	600765	中航重机	1,994,634.00	0.26
8	600521	华海药业	1,006,398.00	0.13

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	002317	众生药业	5,077,245.43	0.67
2	300273	和佳股份	4,977,148.51	0.66
3	600765	中航重机	2,340,914.19	0.31
4	300198	纳川股份	2,102,369.00	0.28
5	002011	盾安环境	2,064,890.14	0.27
6	600521	华海药业	1,049,356.00	0.14

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本(成交)总额	26,363,508.54
卖出股票的收入(成交)总额	17,611,923.27

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	39,157,743.00	5.19
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	1,101,951,905.80	145.94
5	企业短期融资券	109,744,000.00	14.53
6	中期票据	19,832,000.00	2.63
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,270,685,648.80	168.28

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	1080020	10宁河西债	1,000,000	102,300,000.00	13.55
2	126011	08石化债	729,360	70,966,728.00	9.40
3	122984	09六城投	600,000	62,814,000.00	8.32
4	122229	12国控01	590,000	59,442,500.00	7.87
5	1180169	11莆国资债	500,000	52,590,000.00	6.96

7.7 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

本基金报告期内未持有资产支持证券。

7.8 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

本基金报告期未未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

7.9.2 本报告期内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。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	97,155.60
2	应收证券清算款	1,350,923.58
3	应收股利	-
4	应收利息	24,285,661.42
5	应收申购款	198.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,733,938.62

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期未未持有处于转股期的可转换债券。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.9.6 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。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
5,257	142,541.59	0.00	0.00%	749,341,150.08	100.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	992.84	0.0001%

注：1、截至本报告期末，本基金管理人高管、基金投资和研究部门负责人持有该基金份额总量的数量区间为0。

2、截至本报告期末，本基金基金经理持有该基金份额总量的数量区间为0。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2013年1月30日)基金份额总额	781,278,046.90
本报告期基金总申购份额	1,490,557.68
减：本报告期基金总赎回份额	33,427,454.50
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	749,341,150.08

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期基金管理人的无重大人事变动；

2、本报告期基金托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金报告期内没有改变基金投资策略。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚等情况

本基金报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东海证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
长江证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
广州证券	1	6,391,302.19	14.53%	5,697.88	14.63%	-
天风证券	1	13,576,307.96	30.87%	12,013.92	30.84%	-
方正证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
东莞证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
西南证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
民生证券	1	24,007,821.66	54.59%	21,244.53	54.53%	-
合计	8	43,975,431.81	100.00%	38,956.33	100.00%	-

注：本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单位作为本基金的专用交易单位。本基金专用交易单位的选择标准如下：

①经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

②具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

③具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

本基金专用交易单位的选择程序如下：

①本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单位的证券经营机构。

②基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单位租用协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东海证券	0.00	0.00%	85,000,000.00	0.36%	0.00	0.00%
长江证券	21,354,807.61	3.17%	81,000,000.00	0.34%	0.00	0.00%
广州证券	160,574,252.88	23.80%	17,774,600,000.00	75.14%	0.00	0.00%
天风证券	9,114.57	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
方正证券	450,982,578.99	66.85%	4,692,200,000.00	19.84%	0.00	0.00%
东莞证券	2,831,956.49	0.42%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
西南证券	38,878,658.25	5.76%	1,017,000,000.00	4.30%	0.00	0.00%
民生证券	0.00	0.00%	6,000,000.00	0.03%	0.00	0.00%
合计	674,631,368.79	100.00%	23,655,800,000.00	100.00%	0.00	0.00%

11 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资组决策的其他重要信息。

金鹰基金管理有限公司
二〇一三年八月二十六日

金鹰元丰保本混合型证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：金鹰元丰保本混合型证券投资基金

报告截止日：2013年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2013年6月30日
资 产：		
银行存款		1,180,464.63
结算备付金		44,243,289.08
存出保证金		97,155.60
交易性金融资产		1,281,379,044.18
其中：股票投资		10,693,395.38
基金投资		-
债券投资		1,270,685,648.80
资产支持证券投资		-
衍生金融资产		-
买入返售金融资产		30,000,165.00
应收证券清算款		1,350,923.58
应收利息		24,285,661.42
应收股利		-
应收申购款		198.02
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		1,382,536,901.51
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年6月30日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债		-
卖出回购金融资产款		625,000,000.00
应付证券清算款		-
应付赎回款		1,169,121.36
应付管理人报酬		754,469.14
应付托管费		125,744.85
应付销售服务费		-
应付交易费用		46,231.58
应交税费		37,873.97
应付利息		218,187.98
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债		91,407.01
负债合计		627,443,035.89
所有者权益：		
实收基金		749,341,150.08
未分配利润		5,752,715.54
所有者权益合计		755,093,865.62
负债和所有者权益总计		1,382,536,901.51

6.2 利润表

会计主体：金鹰元丰保本混合型证券投资基金

本报告期：2013年1月30日（基金合同生效日）至2013年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期 2013年1月30日(基金合同生效日)至2013年6月30日
一、收入		16,523,182.37
1.利息收入		16,937,326.91
其中：存款利息收入		376,052.98
债券利息收入		12,991,996.29
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		3,569,277.64
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以"-"填列)		3,796,912.91
其中：股票投资收益		1,904,303.43
基金投资收益		-
债券投资收益		1,867,631.98
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		24,977.50
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）		-4,392,998.33
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		181,940.88
减：二、费用		10,510,189.61
1.管理人报酬		3,843,661.67
2.托管费		640,610.25
3.销售服务费		-
4.交易费用		67,825.47
5.利息支出		5,865,864.91
其中：卖出回购金融资产支出		5,865,864.91
6.其他费用		92,227.31
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		6,012,992.76
减：所得税费用		-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		6,012,992.76

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金鹰元丰保本混合型证券投资基金

本报告期：2013年1月30日（基金合同生效日）至2013年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月30日(基金合同生效日)至2013年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	781,278,046.90	-	781,278,046.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,012,992.76	6,012,992.76
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-31,936,896.82	-260,277.22	-32,197,174.04
其中：1.基金申购款	1,490,557.68	7,773.10	1,498,330.78
2.基金赎回款	-33,427,454.50	-268,050.32	-33,695,504.82
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	749,341,150.08	5,752,715.54	755,093,865.62

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：殷克胜，主管会计工作负责人：殷克胜，会计机构负责人：傅军

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

金鹰元丰保本混合型证券投资基金（简称"本基金"），经中国证券监督管理委员会（简称"中国证监会"）基金部函〔2013〕58号文《关于金鹰元丰保本混合型证券投资基金备案确认的函》批准，于2013年1月30日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定，保本周期为18个月，保证人为中海信达担保有限公司，基金第一个保本周期届满时，在符合保本基金存续条件下，本基金继续存续并进入下一保本周期，该保本周期的具体起讫日期、保本和担保安排以本基金管理人届时公告为准；否则，本基金变更为非保本的债券型基金，基金名称相应变更为"金鹰元丰债券型证券投资基金"。如果本基金不符合法律法规和《基金合同》对基金的存续要求，则本基金将按照《基金合同》的规定终止。本基金首次设立募集规模为781,278,046.90份基金份额。本基金募集期间自2012年12月24日起至2013年1月24日止，净销售额为781,039,673.49元，认购资金在认购期间的银行利息238,373.41元折算成基金资产。上述资金已于2013年1月28日全额划入本基金在基金托管人中国工商银行股份有限公司开立的本基金托管专户。验资机构为立信会计师事务所（特殊普通合伙）。本基金的基金管理人为金鹰基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释（统称"企业会计准则"），中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、关于发布《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>（试行）》等问题的通知及其他中国证监会颁布的相关规定而编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本半年度报告中财务报表的编制遵守了企业会计准则及其他有关规定，真实、完整地反映了本基金于2013年6月30日的财务状况以及2013年1月30日至6月30日期间的经营成果和净值变动情况。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日至12月31日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

①金融资产分类

金融资产应当在初始确认时划分为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项，以及可供出售金融资产。金融资产分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。

本基金将持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）于初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金将持有的其他金融资产划分为贷款和应收款项，包括银行存款和各类应收款项等。

②金融负债分类

金融负债应当在初始确认时划分为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债两类。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

基金初始确认金融资产或金融负债，应当按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票投资、债券投资等，以及不作为有效套期工具的衍生金融工具，相关的交易费用在发生时计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，相关交易费用在发生时计入初始确认金额。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量。

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，其中包括同时结转的公允价值变动收益。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已