2.1基金基本情况

设告期末基金份额总1 2基金产品说明

3基金管理人和基金托管人

设策略 /绩比较基本

自息披露负责人

_{传真} 4信息披露方式

期基金份額净值增长率 3.1.2 期末数据和指标

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、推确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签及。 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2014年3月25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

§ 2基金简介

远明节及具更新。 本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。 本报告期自2013年1月30日起至12月31日止。

「州市天河区体育西路180号 § 3主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 3.1主要会计数据和财务指标

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

3.3自基金合同生效以来基金的利润分配情况 本基金报告期内未进行利润分配。

邱新红

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记的说明 本报告期内、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、 顺元丰保本混合型证券投资基金基合同》的规定,本替或实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金 《产严格控制风险的基础上》为基金份额持有人谋求成大利益。本程与期内,基金运作合法合规,无出 1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 4.3:2、平文参测的废和控制方法

36重从人的公司处理公司。2007年交易情况的专项院明 4.31公平交易制度和控制方法 为了保证本基金管理人的各类投资者和委托人享受到平等的资产管理服务,保证本基金管理人管理 为了保证本基金管理人的各类投资者合法权益。本基金管理人根据(中华人民共和国证券投资基金 法》《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》。《证券投资基金管理公司公平交易制度》并严格执行。 同时,本基金管理人自士开发了公平交易数量分析系统,该系统能够实现对公司旗下任意两个资产 管理账户在一定期间内支急相同证券的支统不安。 管理账户在一定期间内支急相同证券的支统不安。 特别是一个一定期间内支急相同证券的支统不安。 特别是一个一定期间内支急相同证券的支统不安。 有一个工作。 第二个一定期间内支急相同证券的支统不安。 第二个一定期间内支急相同证券的支统不安。 第二个一定期间内支急相同证券的支统不安。 第二个一定期间内支急相同证券的支统不安。 第二个一定期间内支急相同证券的支统不安。 第二个一定期间内支。 第二个一定期间, 第二个一定期间, 第二个一定期间, 第二个一定期间, 第二个一定期间的, 第二个一定用户的, 第二个一定

金鷹元丰保本混合型证券投资基金 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走 (2013年1月30日至2013年12月31日

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; 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,计人费用后实际收益水平要低于所 字:
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(为期潮,不是当期发生数)。
4. 本基金于2013年1月30日成立,截至报告期末本基金合同生效未满一年,无上年度可比期间数据。
3.2基金净值表现。

222 自其全会同生效以求其全份领要计净值增长索恋办及其与同期业绩比较其准收益索恋动的目

1、本基金合同生效日期为2013年1月30日。 2.本基金融仓期为合同成效后6个月,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。 3.23 自基金合同生效以来基金每年净值管长率及其与同用业绩比较基准收益率的比较 金融元丰保本混合型证券投资基金 合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

医子比啉还以有里大週編。 基金管理人承诺以读实信用,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 说明书及其更新。

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」 力争在保本周期结束时,实现基金资产的稳健增值。 :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 :,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 健顺值

金额单位:人民币元

2011年末

部新红先生,美国卡内基梅隆大学; 金融专业硕士,证券从业年限10年。

知的其他事项_

金额单位:人民币元

金额单位:人民币元

7.4.10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 8.8投资组合报告



金鹰元丰保本混合型证券投资基金

易市价,确定公允价格。 首次发行未上市的股票,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按成本估

基金增加和转出基金的实收基金减少。

值。
(3)长期停陳股票的估值
已停腺股票且潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的,则相应股票采用指数收益法确定其次全价值。指数收益法是指对于需要进行估值的股票,在估值日以及开发布的相应交易的电价。指数收益法是指对于需要进行估值的股票,在估值日以及开发布的相应交易。然后根据此收益率计算该股票当日的公允价值。

正文查看该审计报告全文。 § 7年度财务报表 71资立负债表

资产	附注号	本期末	单位:人
资产:		2013年12月31日	2012年12月31日
银行存款 结算备付金	7.4.7.1	3,845,924.48	
存出保证金		43,617,521.25	
交易性金融资产	7.170	117,254.80	
文の仕並継页厂 其中,股票投资	7.4.7.2	1,241,644,047.58 7,607,062.38	
		7,607,062.38	
基金投资 债券投资			
		1,234,036,985.20	
资产支持证券投资 衍生金融资产		_	
	7.4.7.3	_	
买人返售金融资产	7.4.7.4	103,979,995.97	
应收证券清算款		_	
应收利息	7.4.7.5	31,103,456.14	
应收股利 应收申购款		_	
		2,135.12	
递延所得税资产 ************************************		_	
其他资产		_	
资产总计		1,424,310,335.34	- to the state of
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
负债:			
短期借款		-	
交易性金融负债		_	
衍生金融负债	7.4.7.3	-	
卖出回购金融资产款		739,500,000.00	
应付证券清算款		3,082,864.27	
应付赎回款		396,058.84	
应付管理人报酬		706,767.43	
应付托管费		117,794.56	
应付销售服务费		_	
应付交易费用	7.4.7.6	35,603.96	
应交税费		141,818.87	
应付利息		65,204.16	
应付利润		-	
递延所得税负债		_	
其他负债	7.4.7.7	330,062.11	
负债合计		744,376,174.20	
所有者权益;			
shalfe #8 A		404 225 454 42	

本基金于2013年1月30日成立,截至报告期末本基金合同生效未满一年,无上年度可比期间数据

1		1 800	单位:人
項目	附注号	本期 2013年1月30日至2013年12月31 日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入		13,885,301.33	-
1.利息收入		42,664,348.97	-
其中:存款利息收入	7.4.7.10	767,206.61	-
债券利息收入		36,803,706.37	-
资产支持证券利息收入		-	-
买人返售金融资产收入		5,093,435.99	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-7,557,649.18	-
其中;股票投资收益	7.4.7.11	1,883,363.04	0.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	-9,465,989.72	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	7.4.7.13	24,977.50	-
3,公允价值变动收益(损失以"-"号 填列)	7.4.7.14	-21,680,569.02	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.15	459,170.56	-
减:二、费用		27,852,158.81	-
1.管理人报酬		8,223,154.72	-
2.托管费		1,370,525.73	-
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.16	158,411.33	-
5.利息支出		17,738,110.37	-
其中: 卖出回购金融资产支出		17,738,110.37	-
6.其他费用	7.4.7.17	361,956.66	-
三、利润总额(亏损总额以"-"号填 列)		-13,966,857.48	-
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-13,966,857.48	_

7.3所有者权益(基金净值)变动表 今计主体,全魔元主保本混合型证券投资基金

項目	2013	本期 平1月30日至2013年12月:	31 ⊟
	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)	-	-13,966,857.48	-13,966,857.48
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)	-86,942,590.48	-434,437.80	-87,377,028.28
其中:1.基金申购款	1,756,017.53	8,380.81	1,764,398.34
2.基金赎回款	-88,698,608.01	-442,818.61	-89,141,426.62
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)	694,335,456.42	-14,401,295.28	679,934,161.14

国工商银行股份有限公司。
74公会计报录的编制基础
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
转貨业务捐引》,中国证签金制定的《关于进一步规范证券投资基金信值业务的指导意见》《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管
到办法》、关于发布(证券投资基金信息披露等 281、概数第 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。
74.3遵循企业会计准则及其他有关规定的审明
本基金本生度报告中纳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主企12月31日的财务状况以及2013年1月30日至12月31日期间的经营成果和净值变动情况。
本财务报表以本基金并经经营为基础列根。
74.4重要会计政策和会计估计

7.4.4.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。 7.4.4.2记账本位市 本基金记账本位市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

7/10全融资立和全融负债的公米

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人当期损益的金融资产、持有至到 贫、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。 本基金將持有的股票投资、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目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

产列示外、以公允价值计量且其公允价值变动口人预益的金融资产在资产负值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别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
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。
7444全融资产和合融负债的对场确认。后读计量和终止确认
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,应当按据取得时的公分价值作为切始确认金额。划分为以公允价值计量且基实动计入当期损益的金融资产的股票投资。债券投资等,以及不作为有效等即工程的行之金融工具。相关的交易费用在安生时计入当期损益的金融资产的股票投资、债券投资等,以及不作为有效等即工程的结合金融工具。相关的交易费用在安生时计入当期损益的金融资产的股票投资。债券投资等,以及不作为有效等即工度的行生金融工具。相关的交易费用在安生时计入当期损益的金融资产的股票投资。债券投资等,以及不能为自然企品的债人,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。对于本基金的以允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的金融资产或金融负债的公允价值变。

认有关负债。 本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下: ()股票投资 买人股票于成交日确认为股票投资。股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用人账。 因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价,于股权分置改革方案实施后的股票复牌日, 冲藏股票投资成本。 实出股票于成交日确认股票投资收益,出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。 (2)供给成本。

卖出股票于成交目确认股票投资收益,出售股票的成争按整构加收工产均每 1 从2 山至中4。(2)值券投资 买人证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣 除交易费用人账,填中所包含的债券应收利息单独核算,不构成债券投资成本。 买入未上市债券和银行间间业估验交易的债券于成交日确认为债券投资成本。 按成交易费用人账,其中所包含的债券应收利息单独核算,不构成债券投资成本。 实人零息债券被同到期一次性生本付息的附值。债券,根据其发行价、到期价和发行期限计算应收利 息,按上述会计处理方法核算。 卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券投资收益。 卖出未上市债券和银行间间业市场交易的债券于成交日确认债券投资收益。 卖出品券的成本按移动加权平均法结转。 (3)权证书格

(3)权证投资 实人权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本,按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后人

配股权证及由股权分置改革而被动获得的权证,在确认日记录所获分配的权证数量,该类权证初始 成本为零。 卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益,出售权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(4)分离交易可转债 申购新按行的分离交易可转债于获得日,按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的 物格购买分离交易可转债于获得日,按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的 明分离权证确定的成本确认债券成本。 上市点,上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算。 (6)国则协议分

稅主。 根据財政部。国家稅务总局財稅字(2005)107号文《关于股息紅利有关个人所得稅政策的补充通知》 的規定,自2005年6月13日起,对证券投资基金从上市公司分配取得的股息紅利所得,按照財稅(2005) 102号文规定,非敵义务人在代訊代繳个人所得稅的、減按50%計算应與稅仍得額; 根据財政部、国家稅分息局對稅字(2006)103号文(关于股权分置試点改革有关稅收政策问題的通 知》的规定。股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入。暂免征 收流通股股东政策的的个人所得稅。 7.47关联方关系 5.金管理人股东、基金代销机构

金额单位:人民币元

7.4.6.3.差错更正的说明
本基金本报告明无差错更正。
7.4.6.税项
1.自10年稅
根据财政部。国家税务总局财税字(2007)84号文《关于调整证券(股票)交易印花税率的通知》的规
定,自2007年5月30日起、调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的1%调整分3%。;
根据财政部。国家税务总局财税字(2005)103号文《关于股权分置试点改革有关税收取策问题的通知)的规定,根据财政部。国家税务总局财税字(2005)103号文《关于股权分置法点改革有关税收取策问题的通问的规定,股权分置改革过程中因非活通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让、售免征收印花税;
经国务院批准、根据财政部、国家税务总局、关于调整证券(股票)交易印花税率的通知》的规定,自
2008年4月24日起、调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的3%调整为13%。
经国务院批准、财政部、国家税务总局市好决定。自2008年9月19日起、证券(股票)交易印花税调整为约率12位税。由出让方按证券股票)交易印花税税率,由原先的3%调整为13%。
经国务院批准、财政部、国家税务总局市好决定,自2008年919日已。 证券(股票)交易印花税调整为均。
经国务院批准、财政部、国家税务总局市好决定,自2008年919日已。 证券(股票)交易印花税调整为价值税,由出让方按证券股票)交易印花税减率缴纳印花税,受让方不再证收、税率不变;
2.营业税、企业所得税
根期财政部。国家税务总局市财税字(2004月78号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知),自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金)管理人运用基金实实股票、债券的分单位、继承股股部、国家税务总局财税等(2005)107号文《关于股权分置试点改革有关税收问题的通知,为基金取得的股票的股息。红利收入,债券的利息收入及储蓄利息收入,由上市公司、债券投行企业。
3.个人所得税。

本期 2013年1月30日至2013年12月31日 上年度可日 2012年1月1日至20 成交金额 | 「州班券有限責任公司 24,6 7-4.8.1.2权证交易 本基金本报告期未通过关联方进行权证交易。 7-4.8.1.3债券交易

本期 2013年1月30日至2013年12月31日 上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日

	成交金額	自当期简券成交 总额的比例	成交金额	成交总额的 比例	
广州证券有限责任公司	270,613,715.62	15.10%	-	-	
基金于2013年1月30日成立 4.8.1.4债券回购交易	,截至报告期末本基	金合同生效未	,,	可比期间数据 额单位:人E	
兰能古名称	本期 2013年1月30日至201	3年12月31日	上年度可比期 2012年1月1日至2012年	[11]	

金额单位:人民币元

23.70%

上述佣金按市场佣金率计算,以扣除中国证券登记结算公司收取的证管费、经手费和适用期间内由承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。 该类佣金协议的服务范围发起括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。 本基金于2013年1月30日成立,截至报告期末本基金合同生效未满一年,无上年度可比期间数据。 单位:人民币元

项目	本期 2013年1月30日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日	
当期发生的基金应支付的管理费	8,223,154.72	_	
其中:支付销售机构的客户维护费	4,898,771.11	-	
	金资产净值的1.2%的年费率计	是,计算方法如下:	-
=E×1.2%/当年天数			
为每日应支付的基金管理费			

H万時日於文行功維金管理數 定为前一日的基金资产净值 2、基金管理费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付;由基金托管人于次月前两个工作日内从 基金资产中一次性支付给基金管理人。 748.22基金托管费

本期 2013年1月30日至2013年12月31日 上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日 注:1、基金托管费按前一日的基金资产净值的0.2%的年费率计提。计算方法如下:H=E×0.2%/当年

H为每日应支付的基金托管费 E为前一日的基金资产净值 」即一口口至至双门"任"但 基金托管费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付;由基金托管人于次月前两个工作日内从

2、基金托管费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付;由基金托管人于次月前两个工资产中一次性支限。 7.4.8.2.3销售服务费。 7.4.8.2.3销售服务费。 7.4.8.3与关联方进行银行间间业市场的债券(含回购)交易 本基金本报台期分与关联方进行银行间间业市场的债券(含回购)交易。 7.4.8.4与关联方进行银行间间业市场的债券(含回购)交易。 7.4.8.4年关联方投资未基金的情况 7.4.8.4年发现为投资未基金的情况。 7.4.8.4年发现为投资未基金的情况。 本基金未报告期内及上年度可比期间内均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。 7.4.8.4股告期内及上年度可比期间内均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。 7.4.8.4股告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。 4.2股告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。 4.2股告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

本期 2013年1月30日至2013年12月31日

主:本基金干2013年1月30日成立,截至报告期末本基金合同生效未满一年,无上年度可比期间数 本基金清算备付金2013年度期末余额43,617,521.25元,清算备付金利息收入430,687.57元。

47,463,445.7 8.2期末按行业分类的股票投资组合 金额单位:人民币元 金额单位:人民币元 基金资产净值比例(%)

3 002535 結析量形 100,000 710,000.00 0.10 ::- : 本基金本报告期末仅持有二只股票。 ::投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于基金管理人网站的年度报告

股票代码 股票名称 300128 300273 齐峰新材 12 002535 林州重机 70 8.4.2累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

	序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	例(%)
	1	002353	杰瑞股份	13,880,199.15	2.04
	2	601333	广深铁路	8,317,917.03	1.22
	3	002241	歌尔声学	5,204,605.12	0.77
	4	002317	众生药业	5,077,245.43	0.75
	5	300273	和佳股份	4,977,148.51	0.73
	6	002011	盾安环境	3,597,971.10	0.53
	7	600765	中航重机	2,340,914.19	0.34
	8	300198	纳川股份	2,102,369.00	0.31
	9	600521	华海药业	1,049,356.00	0.15
_			总额及卖出股票的。	女 入总额	单位:人民
3	5人股票	票的成本(成交)总	. WE		52,559,809.75

77/13/100	券品种分类的债券投资组合		金额单位:人
字号	债券品种	公允价值	占基金资产净值 比例(%)
1	国家债券	34,990,000.00	5.15
2	央行票据	_	-
3	金融债券	4,992,000.00	0.73
	其中;政策性金融债	4,992,000.00	0.73
4	企业债券	1,194,054,985.20	175.6
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	_	-
9	合计	1,234,036,985.20	181.49

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	98,650,000.00	14.51
2	122065	11上港01	759,780	75,544,925.40	11.11
3	122984	09六城投	600,000	60,600,000.00	8.91
4	122229	12国控01	590,010	57,230,970.00	8.42
5	124289	13丽城投	600,000	56,406,000.00	8.30
.7期末接	公允价值占基	金资产净值	七例大小排名的前	十名资产支持证券投资明	細

3. 那不以公儿即用上基正设产伊恒比例大小非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。 8.8期末按公允价值占基金资产净值比例大小非名的前五名权证投资明细 本基金报告期末未持有权证。 8.9投资组合租告附注 8.91次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。 8.92。本基金投资前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。 8.93、期末其他各项资产构成

序号	名称	金額
1	存出保证金	117,254.80
2	应收证券清算款	_
3	应收股利	-
4	应收利息	31,103,456.14
5	应收申购款	2,135.12
6	其他应收款	_
7	待摊费用	
8	其他	-
9	合计	31,222,846.06
本基金报 8.9.5期末 本基金报	持有的处于转股期的可转换债券明细 告期末未持有处于转股期的可转换债券。 前十名股票中存在流通受限情况的说明 告期末前十名股票中不存在流通受限情况。	

8.9.6投资组合报告附注的其他文字描述部分 由于四舍五人的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。 9.8基金份额持有人信息 9.1期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份 持有份额 100.00% .2期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情

或宣理公司所有从业人员持有本并放入基金 0.0000% 92.84 92.84 0.0000% 3.22 0.00000% 3.22 0.0000% 3.22 0.0000% 3.22 0.0000% 3.22 0.0000% 3.22 0.00000% 3.22 0.000000% 3.22 0.00000% 3.22 0.0000% 3.2 注:1. 數至中因內別小,件部地區上級 量的數量区间为0。 2. 截至本报告期末,本基金基金经理持有本基金份額总量的數量区间为0。 **§ 10开放式基金份额变动**

11.7基金租用证券公司交易单元的有关情况 11.7.1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

方正证券

60,925,356.06 61.47% 台计 8 99,107,535.28 100.00% 86,407.18 100.00% − E: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

注:本基金管理人依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) 具有基金作所需的高效。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、全面地向公司捷程高质量的支于发现。行业及市场走向、个极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,推供专门所实报告,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建设的服务和支持。
本基金专用交易单位的选择程序对下。
(1) 本基金管型人根据上基东准考察后确定选用交易单位的证券经营机构。
(2) 基金管理人根据上基东准考察后确定选用交易单位的证券经营机构。
(2) 基金管理人根据上基东准考察后确定选用交易单位和用协议。
117.2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 成交会額 成交金額 成交会額

38,878,658 § 12影响投资者决策的其他重要信息

公开披露。 金鷹基金管理有限公司 二〇一四年三月二十六日

真实、准确机完整。 **8 6审计报告** 中审亚太会计师事务所对金藏基金管理有限公司金藏二丰保本混合型证券投资基金证券投资基金 2013年12月31日的资产负债表,2013年度的利润表,所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注出 具了标准无保留意见的审计报告(中审亚太审学(2014)010225—15号)。投资者可通过本基金年度报告

上市后,上市流通的债券和权业分别按上还②、(3)中相天原则进行计算。(5)回脚协议 基金持有的回脚协议 (封闭式回胸)以成本列示,按实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率,在实际持有期间内逐日计提利息。 7.445金融资产和金融负债的估值原则 本基金目前金融资产和金融负债的估值原则 本基金目前金融资产和金融负债的估值原则和方法如下: 1.股票估值原则和方法 (1)上市流通股票的估值 上申充通股票的估值 1.其所在证券交易所的收盘价估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境决发生重大变化,以最近交易日的收盘价估值,如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价处重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格。 (2)未上市股票的估值 法股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票,按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值,估值目元交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,以最近交易日的收盘价估值,如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素、调整最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交

1,456,211,685 4,692,200,00

1.根据中国证监会(证监许可(2013)864号)之。詹醒是全管理有限公司获准设立全资子公司,子公司必称为"深圳前海金融资产管理有限公司"、公司注册资本为人民币2000万元,从事特定客户资产管理业务以及中国证监会中可的其他业务、该事项已于2013年8月6日进行了公开投票。
2.因公司业务及展需要、经本基金管理人第四届董事会第三十一次会议决议通过,则请中申亚亚太会计师事务所担任公司及据,至基金的审计工作。第负责公司及基金审计业务的立信会计师事务所不再负责,我公司审计业务。该事项已与托管行场商一致,并于2013年12月21日进行了公开投票。