

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:二〇一四年八月二十五日

## 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责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字确认。

基金管理人中工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年8月20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。

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

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2014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
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07月17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	196,365,206,165份
基金合同的期限	不定期

## 2.2 基金产品说明

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、保证基金安全的基础上，力争在保持本金不变的前提下，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)，本基金将通过运作过程中的核心策略，投资股票、债券等资产，根据宏观经济与基金资产规模的变化，定期对资产配置进行调整，灵活地选择适当的风格与时机，以期对宏观经济与资产类别之间的配置能进行优化调节，力争在确保基金本金的前提下，获取稳定收益。
业绩比较基准	3年银行定期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为积极配置型的保本混合型基金，属于证券投资基金中的低风险品种，与同期银行定期存款收益率水平相当；相较于货币基金，该基金的风险收益特征更优。

## 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
姓名	支文峰	赵会群
联系电话	020-8382627	010-66105799
电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	custod@icbc.com.cn
客户服务电话	4006158802/02-83961380	95588
传真	020-8328266	010-66105798

## 2.4 信息披露方式

披露基金年度报告摘要的管理人互联网网址	http://www.gefund.com.cn
基金半年度报告备查地点	广州市天河区体育西路189号建银大厦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号建银大厦22-23层
基金保证人	广州越秀金融控股集团有限公司	广州市天河区体育西路189号建银金融中心主楼写字楼裙楼101-18单元
会计师事务所	中审亚太会计师事务所	北京市海淀区复兴路47号天地商务大厦22-23层

注:本基金第一个保本期已于2014年5月19日中止，并自2014年6月21日起转入第二个保本期运作，保本期3年，第二个保本期自2014年6月21日起至2017年6月20日止，由广州越秀金融控股集团有限公司提供不可撤销的连带责任保证。该项目已于2014年5月6日进行了公告，详情请查看相关公告。

## 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

报告期内数据和指标		报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)	
本期已实现收益	-	-826,071.93	
本期利润	-	9,295,712.04	
加权平均基金份额本期利润	-	0.0320	
本期基金份额净值增长率	-	2.6%	

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.基金经理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。

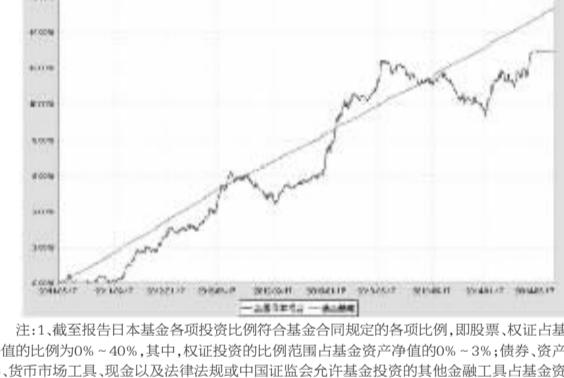
## 3.2 基金净值表现

## 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	0.00%	0.00%	0.37%	0.00%	-0.37%	-0.01%
过去二个月	1.80%	0.10%	1.08%	0.01%	0.72%	0.09%
过去三个月	2.63%	0.12%	2.16%	0.01%	0.47%	0.11%
过去一年	0.89%	0.12%	4.40%	0.01%	-3.51%	0.11%
过去三年	12.77%	0.12%	14.66%	0.01%	-1.89%	0.11%
自基金合同生 效起至今	13.00%	0.12%	15.34%	0.01%	-2.34%	0.11%

注:本基金的业绩比较基准为3年定期存款利率(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



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货币基金不低于基金资产净值的5%;2.本基金的业绩比较基准为3年定期存款利率(税后)。

3.2.3 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

注:本基金的业绩比较基准为3年定期存款利率(税后)。

3.2.4 基金管理人对本基金运作的说明

3.2.4.1 基金管理人及基金管理情况

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,是自律机制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2亿元人民币,股东包括广州证券有限责任公司和广州白云山医药有限公司,美的集团股份有限公司和东亚联丰投资管理有限公司,分别持有4.20%、20.20%和11.1%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存在的风险,并提出风险措施。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,确定基金资产的估值原则、方法、程序及其他相关的估值事宜。

公司目前下设三个部门,分别是:基金管理部、研究发展部、集中交易部,金融工程部、产品研发中心、固定收益投资部、市场拓展部、机构客户部、专户投资部、电子商务部、监察稽核部、综合管理部。基金经理部负责根据投资决策组的投决意见执行基金投资;研究发展部根据基金经理的指令,负责宏观、行业、上市公司的研究和投资策略研究;集中交易部负责完成基金经理指令和基金投资组合的构建;金融工程部负责基金的运行监控、数据分析工作;产品研发中心负责基金产品的设计和开发工作;固定收益投资部负责制定投资券种、货币基金、债券、资产支持证券、货币市场基金、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的配置;市场拓展部负责渠道维护、客户服务、机构客户部、专户投资部、电子商务部、运营保障部、监察稽核部、综合管理部;基金经理部负责根据投资决策组的投决意见执行基金投资;研究发展部根据基金经理的指令,负责宏观、行业、上市公司的研究和投资策略研究;集中交易部负责完成基金经理指令和基金投资组合的构建;金融工程部负责基金的运行监控、数据分析工作;产品研发中心负责基金产品的设计和开发工作;固定收益投资部负责制定投资券种、货币基金、债券、资产支持证券、货币市场基金、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的配置;市场拓展部负责渠道维护、客户服务、机构客户部、专户投资部、电子商务部、运营保障部、监察稽核部、综合管理部;基金经理部负责根据投资决策组的投决意见执行基金投资;研究发展部根据基金经理的指令,负责宏观、行业、上市公司的研究和投资策略研究;集中交易部负责完成基金经理指令和基金投资组合的构建;金融工程部负责基金的运行监控、数据分析工作;产品研发中心负责基金产品的设计和开发工作;固定收益投资部负责制定投资券种、货币基金、债券、资产支持证券、货币市场基金、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的配置;市场拓展部负责渠道维护、客户服务、机构客户部、专户投资部、电子商务部、运营保障部、监察稽核部、综合管理部;基金经理部负责根据投资决策组的投决意见执行基金投资;研究发展部根据基金经理的指令,负责宏观、行业、上市公司的研究和投资策略研究;集中交易部负责完成基金经理指令和基金投资组合的构建;金融工程部负责基金的运行监控、数据分析工作;产品研发中心负责基金产品的设计和开发工作;固定收益投资部负责制定投资券种、货币基金、债券、资产支持证券、货币市场基金、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的配置;市场拓展部负责渠道维护、客户服务、机构客户部、专户投资部、电子商务部、运营保障部、监察稽核部、综合管理部;基金经理部负责根据投资决策组的投决意见执行基金投资;研究发展部根据基金经理的指令,负责宏观、行业、上市公司的研究和投资策略研究;集中交易部负责完成基金经理指令和基金投资组合的构建;金融工程部负责基金的运行监控、数据分析工作;产品研发中心负责基金产品的设计和开发工作;固定收益投资部负责制定投资券种、货币基金、债券、资产支持证券、货币市场基金、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的配置;市场拓展部负责渠道维护、客户服务、机构客户部、专户投资部、电子商务部、运营保障部、监察稽核部、综合管理部;基金经理部负责根据投资决策组的投决意见执行基金投资;研究发展部根据基金经理的指令,负责宏观、行业、上市公司的研究和投资策略研究;集中交易部负责完成基金经理指令和基金投资组合的构建;金融工程部负责基金的运行监控、数据分析工作;产品研发中心负责基金产品的设计和开发工作;固定收益投资部负责制定投资券种、货币基金、债券、资产支持证券、货币市场基金、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的配置;市场拓展部负责渠道维护、客户服务、机构客户部、专户投资部、电子商务部、运营保障部、监察稽核部、综合管理部;基金经理部负责根据投资决策组的投决意见执行基金投资;研究发展部根据基金经理的指令,负责宏观、行业、上市公司的研究和投资策略研究;集中交易部负责完成基金经理指令和基金投资组合的构建;金融工程部负责基金的运行监控、数据分析工作;产品研发中心负责基金产品的设计和开发工作;固定收益投资部负责制定投资券种、货币基金、债券、资产支持证券、货币市场基金、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的配置;市场拓展部负责渠道维护、客户服务、机构客户部、专户投资部、电子商务部、运营保障部、监察稽核部、综合管理部;基金经理部负责根据投资决策组的投决意见执行基金投资;研究发展部根据基金经理的指令,负责宏观、行业、上市公司的研究和投资策略研究;集中交易部负责完成基金经理指令和基金投资组合的构建;金融工程部负责基金的运行监控、数据分析工作;产品研发中心负责基金产品的设计和开发工作;固定收益投资部负责制定投资券种、货币基金、债券、资产支持证券、货币市场基金、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的配置;市场拓展部负责渠道维护、客户服务、机构客户部、专户投资部、电子商务部、运营保障部、监察稽核部、综合管理部;基金经理部负责根据投资决策组的投决意见执行基金投资;研究发展部根据基金经理的指令,负责宏观、行业、上市公司的研究和投资策略研究;集中交易部负责完成基金经理指令和基金投资组合的构建;金融工程部负责基金的运行监控、数据分析工作;产品研发中心负责基金产品的设计和开发工作;固定收益投资部负责制定投资券种、货币基金、债券、资产支持证券、货币市场基金、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的配置;市场拓展部负责渠道维护、客户服务、机构客户部、专户投资部、电子商务部、运营保障部、监察稽核部、综合管理部;基金经理部负责根据投资决策组的投决意见执行基金投资;研究发展部根据基金经理的指令,负责宏观、行业、上市公司的研究和投资策略研究;集中交易部负责完成基金经理指令和基金投资组合的构建;金融工程部负责基金的运行监控、数据分析工作;产品研发中心负责基金产品的设计和开发工作;固定收益投资部负责制定投资券种、货币基金、债券、资产支持证券、货币市场基金、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的配置;市场拓展部负责渠道维护、客户服务、机构客户部、专户投资部、电子商务部、运营保障部、监察稽核部、综合管理部;基金经理部负责根据投资决策组的投决意见执行基金投资;研究发展部根据基金经理的指令,负责宏观、行业、上市公司的研究和投资策略研究;集中交易部负责完成基金经理指令和基金投资组合的构建;金融工程部负责基金的运行监控、数据分析工作;产品研发中心负责基金产品的设计和开发工作;固定收益投资部负责制定投资券种、货币基金、债券、资产支持证券、货币市场基金、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的配置;市场拓展部负责渠道维护、客户服务、机构客户部、专户投资部、电子商务部、运营保障部、监察稽核部、综合管理部;基金经理部负责根据投资决策组的投决意见执行基金投资;研究发展部根据基金经理的指令,负责宏观、行业、上市公司的研究和投资策略研究;集中交易部负责完成基金经理指令和基金投资组合的构建;金融工程部负责基金的运行监控、数据分析工作;产品研发中心负责基金产品的设计和开发工作;固定收益投资部负责制定投资券种、货币基金、债券、资产支持证券、货币市场基金、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的配置;市场拓展部负责渠道维护、客户服务、机构客户部、专户投资部、电子商务部、运营保障部、监察稽核部、综合管理部;基金经理部负责根据投资决策组的投决意见执行基金投资;研究发展部根据基金经理的指令,负责宏观、行业、上市公司的研究和投资策略研究;集中交易部负责完成基金经理指令和基金投资组合的构建;金融工程部负责基金的运行监控、数据分析工作;产品研发中心负责基金产品的设计和开发工作;固定收益投资部负责制定投资券种、货币基金、债券、资产支持证券、货币市场基金、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的配置;市场拓展部负责渠道维护、客户服务、机构客户部、专户投资部、电子商务部、运营保障部、监察稽核部、综合管理部;基金经理部负责根据投资决策组的投决意见执行基金投资;研究发展部根据基金经理的指令,负责宏观、行业、上市公司的研究和投资策略研究;集中交易部负责完成基金经理指令和基金投资组合的构建;金融工程部负责基金的运行监控、数据分析工作;产品研发中心负责基金产品的设计和开发工作;固定收益投资部负责制定投资券种、货币基金、债券、资产支持证券、货币市场基金、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的配置;市场拓展部负责渠道维护、客户服务、机构客户部、专户投资部、电子商务部、运营保障部、监察稽核部、综合管理部;基金经理部负责根据投资决策组的投决意见执行基金投资;研究发展部根据基金经理的指令,负责宏观、