金鹰元丰保本混合型证券投资基金更新的招募说明书摘要

2013年第2号

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

【重要提示】

金鹰元丰保本混合型证券投资基金(以下简称"本基金")根据2012年11月19日中国证券监督管理委员会《关于核准金鹰元丰保本混合型证券投资基金募集的批复》(证监许可【2012】1537号)和2012年12月17日《关于金鹰元丰保本混合型证券投资基金募集时间安排的确认函》(基金部函[2012]1131号)进行募集。本基金的基金合同经中国证监会基金监管部于2013年1月30日备案确认(基金部函[2013]58号)后正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等等。

本基金为保本混合型基金，保本周期为十八个月，投资者认购并持有到期的基金份额存在着仅能收回本金(即实际净认购金额)的可能性；未持有到期的基金份额，投资者赎回或转换出时不能获得保本担保，将承担市场波动的风险。此外，投资者投资于保本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，如果发生《基金合同》约定的不适用保本条款的情形，投资者认购并持有到期的基金份额亦存在着无法收回本金的可能性。保本周期到期后，本基金可能到期终止或转入下一保本周期或根据《基金合同》的约定转为其他类型基金，到期具体操作以届时公告为准。

此外，依照基金合同的约定，本基金若变更为"金鹰元丰债券型证券投资基金"后，将可投资于中小企业私募债券，受其低流动性和较高信用风险的影响，相对于普通的债券型基金，届时本基金面临相对较高的流动性风险和信用风险。

投资人购买本基金时应认真阅读本基金的基金合同、保证合同、招募说明书。基金管理人建议投资人根据自身的风险收益偏好，选择适合自己的基金产品，并且中长期持有。投资者购买本基金份额的行为视为同意保证合同的约定。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本招募说明书已经本基金托管人复核。除非另有说明，本招募说明书所载内容截止日为2013年7月30日，有关财务数据截止日为2013年6月30日，净值表现截止日为2013年6月30日，本报告中财务数据未经审计。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称：金鹰基金管理有限公司
注册地址：广东省珠海市吉大九洲大道东段商业银行大厦7楼16单元
办公地址：广东省广州市天河区体育西路189号22-23层
设立日期：2002年12月25日
法定代表人：刘东
联系电话：020-83282855
联系人：祝红
注册资本：人民币2.5亿元
股权结构：

股东名称	出资额(万元)	出资比例
广州证券有限责任公司	12250	49%
广州药业股份有限公司	5000	20%
广东美的电器股份有限公司	5000	20%
东亚联丰投资管理有限公司	2750	11%
总计	25000	100%

(二)主要人员情况

1、公司董事和监事

刘东先生，董事长，经济学硕士，高级经济师。曾在中国现代国际关系研究所、中国信达信托投资公司驻武汉证券交易中心任职，历任中国信达信托投资公司北京营业部总经理、证券业务总部副总经理，新疆宏源信托投资股份有限公司总经理助理兼证券业务总部总经理，宏源证券股份有限公司党委委员、副总经理，宏源期货有限公司董事长，现任广州证券有限责任公司总经理。经公司第三届董事会第十六次会议选举通过，并报经中国证监会核准，2010年4月起担任公司董事长。

郑德珵先生，董事，留美经济学博士，教授，高级经济师。历任广州中山大学管理学院讲师、副教授，美国乔治华盛顿大学助教，美国华盛顿投资咨询公司副研究员，美国世界银行政策研究局转型经济处经济顾问。现任广州证券有限责任公司副总经理、首席经济学家，兼任广州风险投资促进会会长，广州市政协委员，上市公司独立董事等。

王静女士，董事，企业管理硕士。历任美的集团有限公司资本运营项目助理，资产重组经理，现任美的集团股份有限公司资产重组高级专员。

温婉容女士，董事，商科毕业。历任德盛安联资产管理香港有限公司市场及传媒经理、景顺投资管理亚洲有限公司副总裁、德意志资产管理(香港)有限公司区域销售总监、Societe Generale Asset Management Asia Ltd.高级副总裁、德盛安联资产管理香港有限公司行政总裁、香港财务策划师学会行政总裁等职。2011年7月加入东亚联丰投资管理有限公司，现任东亚联丰投资管理有限公司行政总裁。

陈炳华先生，董事，硕士，会计师。曾任广州药业股份有限公司财务部部长，现任广州药业股份有限公司财务总监。

吴晓球先生，独立董事，国民经济管理学博士。历任江西省余江县商业局秘书、中国人民大学经济研究所主任、中国人民大学财政金融学院副院长、中国人民大学研究生院副院长，现任中国人民大学校长助理、财政金融学院常务副院长、金融与证券研究所所长、教授、博导。

杜金岷先生，独立董事，博士、教授、博士生导师。历任高校讲师、副教授，现任暨南大学教授、社会科学研究处处长，广东中青年经济工作者学会副秘书长，广东经济学会常务理事，中华外国经济学说研究会理事、广东金融学会理事、广州留学归国人员协会理事等。

黄元生先生，独立董事，经济学硕士、副教授、高级会计师。历任中山大学会计教研室主任及会计系副主任，广州市康乐会计师事务所副所长及所长，现任广州万隆康正会计师事务所主任会计师。

颜俊先生，独立董事，法学硕士、法学博士生，资深合伙人、律师。曾为广东华邦世纪律师事务所的创始合伙人、北京市金杜律师事务所资深合伙人。曾多次在国内法学和人文社会科学杂志发表论文。现任安徽国祯环保节能科技股份有限公司独立董事，北京市君泽君律师事务所资深合伙人。

刘晓东先生，监事，工商管理硕士。曾任深圳市审计局主任科员，招商银行总行稽核部高级审计师，鹏华基金管理有限公司监察稽核部副总监，现任金鹰基金管理有限公司监察稽核部总监。

曾巧女士，监事，管理学学士。历任佛山会计师事务所审计助理、美的集团审计部审计经理、美的集团审计监察部副部长，现任美的集团审计监察部总监。

姚万义先生，监事，大学本科。历任中共北京市纪律检查委员会北京市监察局办公厅主任、副局长、常委等职，中国证监会北京证管办副主任、巡视员等职，现任北京证券业协会顾问。

2、公司高级管理人员

殷克胜先生，总经理，经济学博士。曾在综合开发研究院(中国深圳)、深圳市体改办任职，历任深圳证监局法规处副处长、上市公司处处长，鹏华基金管理有限公司董事、常务副总经理，方正证券有限责任公司基金公司筹备组组长等职。经公司第三届董事会第十六次会议选举通过，并报经中国证监会核准，2010年4月起担任公司总经理。

刘葆先生，副总经理，经济学博士，副教授。历任深圳国资经营公司(商贸控股)资产经营部总经理助理，上海复旦大学博士后流动站(金融研究方向)博士后研究员，深圳华强集团资本经营部副部长，广州越秀集团资本经营部副经理，广州证券有限责任公司总经理助理兼资产管理总部总经理，金鹰基金管理有限公司总经理助理等职。经公司第二届董事会第二十一次会议审议通过，并报经中国证监会核准，2008年12月起担任公司副总经理。

郭容辰女士，副总经理，法律硕士。历任交通银行深圳分行公司业务部科长、交通银行深圳华富支行行长助理、交通银行深圳福田支行行长、交通银行深圳分行个人金融部总经理、零售信贷管理部总经理、华夏银行深圳分行个人业务部总经理等职。经公司第三届董事会第十九次会议审议通过，并报经中国证监会核准，2010年10月起担任公司副总经理。

苏文锋先生，督察长，经济学硕士。历任广州市经济管理干部学院外贸经济系党支部书记，南方证券广州分公司研究发展部经理，南方证券广州分公司大德路营业部总经理，南方证券广州分公司办公室主任，南方证券广州分公司投资银行部总经理，华鼎担保投资有限公司副总经理等职，金鹰基金管理有限公司市场拓展部副总监等职。经公司第二届董事会第二十一次会议审议通过，并报经中国证监会核准，2008年9月起担任公司督察长。

3、本基金基金经理

邱新红先生，卡内基梅隆大学计算金融专业硕士，南京大学物理系应用物理专业学士，证券从业经历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限公司，先后担任债券研究员，现任固定收益部总监，兼任本基金、金鹰保本混合型证券投资基金、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基金经理。

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以及金鹰保本混合型证券投资基金基金经理。

4、投资决策委员会成员

本基金采取集体投资决策制度，投资决策委员会成员有：
殷克胜先生，投资决策委员会主席，总经理；
杨绍基先生，投资决策委员会委员，首席投资官，基金经理；
杨刚先生，投资决策委员会委员，研究发展部总监；
陈晓先生，投资决策委员会委员，基金管理部总监，基金经理；
徐海焱女士，投资决策委员会委员，集中交易部总监。

5、本基金固定收益投资决策委员会成员有：
殷克胜先生，固定收益投资决策委员会主席，总经理；
杨绍基先生，固定收益投资决策委员会委员，首席投资官，基金经理；
杨刚先生，固定收益投资决策委员会委员，研究发展部总监；
邱新红先生，固定收益投资决策委员会委员，固定收益部总监，基金经理；
汪仪先生，固定收益投资决策委员会委员，固定收益部副总监，基金经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

本基金之基金托管人为中国工商银行股份有限公司，基本情况如下：
名称：中国工商银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号
成立时间：1984年1月1日
法定代表人：姜建清
注册资本：人民币349,018,545,827元
联系电话：010-66105799
联系人：赵会军

三、基金担保人

名称：广州国际集团有限公司
住所：广州市越秀区东风中路509号建银大厦25楼，邮政编码：510045
注册地址：广州市越秀区东风中路509号建银大厦25楼
法定代表人：关易波
成立日期：2001年12月6日
注册资本：20亿元人民币
联系人：常文彦
联系电话：(020)83606813/15/52/52-2015
组织形式：有限责任公司(国有独资)
经营范围：对授权范围内的国有资产的经营管理

四、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、直销机构

名称：金鹰基金管理有限公司
注册地址：广东省珠海市吉大九洲大道东段商业银行大厦7楼16单元
办公地址：广东省广州市天河区体育西路189号城建大厦22-23层
法定代表人：刘东
总经理：殷克胜
成立时间：2002年12月25日
批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字【2002】97号
组织形式：有限责任公司
注册资本：2.5亿元人民币
存续期间：持续经营
联系人：潘晓毅
联系电话：020-83282950
传真电话：020-83283445
客户服务及投诉电话：4006-135-888
电子邮箱：csmail
gefund.com.cn
网址：www.gefund.com.cn

2、代销机构(排名不分先后)

(1)名称：中国工商银行股份有限公司
注册(办公)地址：北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人：姜建清
联系人：查樱
电话：010-66105662
客服电话：95588(全国)
网址：www.icbc.com.cn

(2)名称：中国建设银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街 25 号
办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院1号楼
法定代表人：王洪章
联系人：张静
电话：010-67596219
客服电话：95533(全国)
网址：www.ccb.com

(3)名称：交通银行股份有限公司
注册(办公)地址：上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人：牛锡明
联系人：韩璞
电话：021-58781234
客户服务电话：95559
网址：www.bankcomm.com

(4)名称：中国邮政储蓄银行股份有限公司
注册(办公)地址：北京市西城区金融大街3号
法定代表人：李国华
联系人：文彦娜
电话：010-68858101
客服电话：95580(全国)
网址：www. psbc.com

(5)名称：中信银行股份有限公司
注册(办公)地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
联系人：赵树林
电话：010-65556960
客服电话：95558(全国)
网址：bank.ecitic.com

(6)名称：上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区浦东南路500号
办公地址：上海市中山东一路12号
法定代表人：吉晓辉
联系人：于慧
电话：021-61616196
客服电话：95528(全国)
网址：www.spdb.com.cn

(7)名称：东莞农村商业银行股份有限公司
注册(办公)地址：东莞市南城路2号
法定代表人：何沛良
联系人：黄飞燕
电话：0769-23394102
客服电话：0769-961122
网址：www.dgrcc.com

(8)名称：广东顺德农村商业银行股份有限公司
注册(办公)地址：佛山市顺德区大良德和居委会拥翠路2号
法定代表人：吴海恒
联系人：何浩华
联系电话：0757-22388928
客服电话：0757-22223388
网址：www.sdebank.com

(9)名称：成都农村商业银行股份有限公司
注册(办公)地址：四川省成都市武侯区科华中路88号
法定代表人：陈萍
联系人：张海涛
电话：028-85190961
客服电话：4006-028-666
网址：www.cdrcb.com

(10)名称：广州证券有限责任公司
注册(办公)地址：广东省广州市珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心19-20楼
法定代表人：刘东
联系人：林洁茹
联系电话：020-88836999
客服电话：020-961303
网址：www.gzs.com.cn

(11)名称：海通证券股份有限公司
注册(办公)地址：上海市淮海中路 98 号
法定代表人：王开国
联系人：李笑鸣
电话：021-23219000
客服电话：95533(全国)、4008888001
网址：www.htsec.com

(12)名称：申银万国证券股份有限公司
注册(办公)地址：上海市常熟路171号
法定代表人：丁国荣
联系人：曹晔
电话：021-54047892
客服电话：021-962505
网址：www.sywg.com

(13)名称：东吴证券股份有限公司
注册(办公)地址：苏州工业园区翠园路181号商旅大厦
法定代表人：吴永敏
联系人：方晓丹
电话：0512-65581136
客服电话：0512-96288
网址：www.dwzq.com.cn

(14)名称：光大证券股份有限公司
注册地址：上海市静安区新闸路1508号
办公地址：上海市浦东新区浦东南路528号上海证券大厦南塔16楼
法定代表人：袁长清
联系人：李芳芳
电话：021-22169089
客服电话：95525(全国)、4008888788
网址：www.ebscn.com

(15)名称：东海证券有限责任公司
注册(办公)地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19号楼
法定代表人：朱科敏
联系人：霍晓飞
电话：0519-88157761
客服电话：400-888-8588、0519-88166222(常州地区)、021-52574550(上海地区)、0379-64902266(洛阳地区)
网址：www.longone.com.cn

(16)名称：财通证券有限责任公司
注册(办公)地址：浙江省杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心
法定代表人：沈继宁
联系人：乔骏
电话：0571-87925129
客服电话：0571-96336(上海地区 962336)
网址：www.ctsec.com

(17)名称：中国中投证券有限责任公司
注册(办公)地址：深圳福田区益田路6003号荣超商务中心A座18-21层
法定代表人：龙增来
联系人：范雪玲
电话：0755-82023431
客服电话：4006008008
网址：www.cjis.cn

(18)名称：国信证券股份有限公司
注册(办公)地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人：何如
联系人：周洋
电话：0755-82133066
客服电话：95536(全国)
网址：www.guosen.com.cn

(19)名称：长城证券有限责任公司
注册(办公)地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层
法定代表人：黄耀华
联系人：匡婷
电话：0755-83516289
客服电话：400-6666-888
网址：www.cgws.com

(20)名称：平安证券有限责任公司
注册(办公)地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
法定代表人：杨宇翔
联系人：袁月
电话：0755-22627802
客服电话：4008816168
网址：www.stock.pingan.com

(21)名称：中国银河证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦2-6层
办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人：顾伟国
联系人：田薇
电话：010-66568430
客服电话：4008888888
网址：www.chinastock.com.cn

(22)名称：山西证券股份有限公司
注册(办公)地址：山西省太原市府西街69号国际贸易中心
法定代表人：侯巍
联系人：孟婉娉
电话：0351-8686602
客服电话：400-666-1618
网址：www.i618.com.cn

(23)名称：国盛证券有限责任公司
注册(办公)地址：江西省南昌市永叔路15号信达大厦10-13楼
法定代表人：管荣升
联系人：徐美云
电话：0791-6285337
客服电话：0791-6272572
网址：www.gsstock.com

(24)名称：信达证券股份有限公司
注册(办公)地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表：张志刚
联系人：唐静
电话：010-63080985
客服电话：400-800-8899
网址：www.cindasc.com

(25)名称：江海证券有限公司
注册(办公)地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人：孙名扬
联系人：高悦铭
电话：0451-82337802
客服电话：400-666-2288
网址：www.jhzq.com.cn

(26)名称：中国国际金融有限公司
注册(办公)地址：北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
法定代表人：朱云来
联系人：黄峻敏
电话：0755-83196491
客服电话：010-65051166
网址：www.cicc.com.cn

(27)名称：爱建证券有限责任公司
注册(办公)地址：上海市南京西路758号23楼
法定代表人：郭林
联系人：陈敏
电话：021-32229888
客服电话：021-63340678
网址：www.ajzq.com

(28)名称：长江证券股份有限公司
注册(办公)地址：湖北省武汉市江汉区新华路特8号
法定代表人：胡运钊
联系人：李良
电话：027-65799999
客服电话：95579或4008-888-999
网址：www.cjsc.com.cn

(29)名称：中航证券有限公司
注册(办公)地址：江西省南昌市抚河北路291号
法定代表人：杜航
联系人：余雅娜
电话：0791-6768763
客服电话：400-8866-567
网址：www.avicsec.com

(30)名称：天风证券股份有限公司
注册(办公)地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼
法定代表人：余磊
联系人：陈璐
电话：027-87618882
客服电话：027-87618882
网址：www.tfzq.com

(31)名称：方正证券股份有限公司
注册(办公)地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
法定代表人：雷杰
联系人：邵艳霞
电话：0731-85832507
客服电话：95571(全国)
网址：www.foundersc.com

(32)名称：华福证券有限责任公司
注册(办公)地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层
法定代表人：黄金琳
联系人：张腾
电话：0591-87383623
客服电话：0591-96326
网址：www.gfhfzq.com.cn

(33)名称：世纪证券有限责任公司
注册(办公)地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦40-42层
法定代表人：卢长才
联系人：王佳佳
电话：0755-83199599转8172
客服电话：0755-83199599
网址：www.csco.com.cn

(34)名称：东莞证券有限责任公司
注册(办公)地址：广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼
法定代表人：张运勇
联系人：苏卓仁
电话：0769-22112062
客服电话：0769-961130
网址：www.dgzq.com.cn

(35)名称：国都证券有限责任公司
注册(办公)地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
法定代表人：常喆
联系人：黄静
电话：010-84183389
客服电话：400-818-8118
网址：www.guodu.com

(36)名称：天相投资顾问有限公司
注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座4层
法定代表人：林义相
联系人：莫晓丽
电话：010-66045529
客服电话：010-66045678
网址：www.txsec.com

(37)名称：宏源证券股份有限公司
注册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号宏源大厦
办公地址：新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号宏源大厦
北京市西城区太平桥大街 19 号
法定代表人：冯戎
联系人：李巍
电话：010-88085338
客服电话：4008000562
网址：www.hysec.com

(38)名称：中信建投证券股份有限公司
注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址：北京市朝阳门内大街188号
法定代表人：张佑君
联系人：权唐
电话：010-85130577
客服电话：4008888108
网址：www.csc108.com

(39)名称：五矿证券有限公司
注册地址：深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公楼47层01单元
办公地址：深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心49层
法定代表人：高竹
联系人：高克南
联系电话：0755-82545707
客服电话：40018-40028
网址：www.wkzq.com.cn

(40)名称：安信证券股份有限公司
注册(办公)地址：深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元
法定代表人：牛冠兴
联系人：陈剑虹
电话：0755-82558305
客服电话：4008-001-001
网址：www.essence.com.cn

(41)名称：中信证券股份有限公司
注册地址：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层
办公地址：北京市朝阳区新源南路6号京城大厦3层
法定代表人：王东明
联系人：陈忠
电话：010-84683893
客服电话：0755-83478806
网址：www.cs.ecitic.com

(42)名称：中信证券(浙江)有限责任公司
注册(办公)地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19-20层
法定代表人：沈强
联系人：丁思聪
电话：0571-87112510
客服电话：96598
网址：www.bigsun.com.cn

(43)名称：西南证券股份有限公司
注册(办公)地址：重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦A幢
法定代表人：余维佳
联系人：米兵
电话：023-63786922
客服电话：4008096096
网址：www.swsc.com.cn

(44)名称：招商证券股份有限公司
注册(办公)地址：深圳福田区益田路江苏大厦 38-45 层
法定代表人：宫少林
联系人：林生迎
电话：0755-82960223
客服电话：95565(全国)、4008888111
网址：www.newone.com.cn

(45)名称：国泰君安证券股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区商城路618号
办公地址：上海市银河中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人：万建华
联系人：芮敏祺
电话：021-38676161
客服电话：95521(全国)
网址：www.gtja.com

(46)名称：广发证券股份有限公司
注册(办公)地址：广州市天河区天河北路183-187号大都会广场43楼
法定代表人：孙树明
联系人：黄兰
电话：020-87555888-333
客服电话：95575(全国)
网址：www.gf.com.cn

(47)名称：齐鲁证券有限公司
注册(办公)地址：济南市市中区经七路86号
法定代表人：李玮
电话：0531-82024184
联系人：傅咏梅
电话：0531-87107718
客服电话：95538(全国)
网址：www.qlzq.com.cn

(48)名称：国联证券股份有限公司
注册(办公)地址：无锡市县前东街168号
法定代表人：雷建辉
联系人：徐欣
电话：0510-82831662
客服电话：400-888-5288、0510-82588168
网址：www.glsc.com.cn

(49)名称：华安证券有限责任公司
注册地址：合肥市长江中路357号
办公地址：合肥市阜南路166号
法定代表人：李工
联系人：甘霖
电话：0551-5161821
客服电话：96518、4008-096-518
网址：www.hazq.com

(50)名称：国海证券股份有限公司
注册(办公)地址：广西南宁市滨湖路46号
法定代表人：张雅锋
联系人：牛孟宇
电话：0755-83709350
客服电话：95563
网址：www.ghzq.com.cn

(51)名称：新时代证券有限责任公司
注册(办公)地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
法定代表人：刘汝军
联系人：孙恺
电话：010-83561149
客服电话：4006-989898
网址：www.xsdzq.cn

(52)名称：金元证券股份有限公司
注册地址：海口市南宝路36号证券大厦4楼
办公地址：深圳市深南大道4001号时代金融中心大厦17楼
法定代表人：陆涛
联系人：马贤清
电话：0755-83025022
客服电话：4008-888-228
网址：www.jyzq.cn

(53)名称：深圳众禄基金销售有限公司
办公地址：深圳市深南东路5047号发展银行大厦25层I、J单元
法定代表人：薛峰
联系人：张玉静
电话：0755-33227953
客服电话：4006-788-887
网址：众禄基金网(www.zlfund.cn)、基金买卖网(www.jjmmw.com)

(54)名称：上海好买基金销售有限公司
办公地址：上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906室
法定代表人：杨文斌
联系人：蒋章
电话：021-58870011-6618
客服电话：400-700-9665
网址：好买基金网(www.ehowbuy.com)

(55)名称：杭州数米基金销售有限公司
办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号12层
法定代表人：陈柏青
联系人：周嬿旻
电话：0751-28829790
客服电话：4000-766-123、0571-28829123
网址：数米基金网(www.fund123.cn)

(56)名称：上海长量基金销售投资顾问有限公司
办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人：张跃伟
联系人：沈雯斌
电话：021-58788678-8201
客服电话：400-089-1289
网址：长量基金销售网(www.erichfund.com)

(57)名称：浙江同花顺基金销售有限公司
办公地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903
法定代表人：李晓涛
联系人：杨翼
电话：0571-88911818
客服电话：0571-88920897
网址：同花顺基金销售网(www.ijijin.cn)

(58)名称：北京展恒基金销售有限公司
注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
办公地址：北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦6层
法定代表人：闫振杰
联系人：李二钢
电话：010-85188234
客服电话：400-888-6661
网址：展恒基金理财平台(www.myfund.com)

(59)名称：上海天天基金销售有限公司
注册地址：浦东新区峨山路613号6幢551室
办公地址：上海市徐汇区龙田路195 号3C 座9 楼
法定代表人：其实
联系人：潘世友
电话：021-54509998
客服电话：400-1818-188
网址：天天基金网(www.1234567.com.cn)

(60)名称：中期时代基金销售(北京)有限公司
办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路16号1幢11层
法定代表人：路瑶
联系人：徐亮
电话：010-59539955
客服电话：95162或4008888160
网址：中期金融超市(www.cifcofund.com)

(61)名称：和讯信息科技有限公司
办公地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦1002室
法定代表人：王莉
联系人：李延鹏
电话：0755-82721122-8625
客服电话：400-920-0022
网址：和讯理财客(http://licaike.hexun.com)

基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

(二)注册登记机构

名称：金鹰基金管理有限公司
注册地址：广东省珠海市吉大九洲大道东段商业银行大厦7楼16单元
办公地址：广东省广州市天河区体育西路189号城建大厦22-23层
法定代表人：刘东
电话：020-83284983
传真：020-83282856
联系人：傅军

(三)律师事务所和经办律师

名称：广东岭南律师事务所
办公地址：广州市新港西路135号中山大学西门科技园601-605室
法定代表人：黄添顺
电话：020-84035397
传真：020-84113152
经办律师：江亚芳、陈进学、王欢

(四)会计师事务所和经办注册会计师

名称：立信会计师事务所(特殊普通合伙)
住所：上海市黄浦区南京东路61号四楼
法定代表人：朱建弟
电话：021-63391166
邮编：200002
经办注册会计师：张宁、刘国棣

五、基金的名称

本基金名称：金鹰元丰保本混合型证券投资基金
本基金简称：金鹰元丰保本混合
本基金代码：210014

六、基金的类型

本基金类型：契约型开放式

七、基金的保本

(一)保本周期

18个月。

本基金的第一个保本周期自《基金合同》生效之日起至18个月后对应日止。如果该对应日为非工作日，保本周期到期日顺延至下一个工作日。

第一个保本周期届满时，在符合保本基金存续条件下(符合法律法规有关担保人或保本义务人资质要求，并经基金管理人认可的其他机构，为本基金下一保本周期提供保本保障，与基金管理人就本基金下一保本周期签订保证合同或风险买断合同，同时本基金满足法律法规和《基金合同》规定的基金存续要求)，本基金继续存续并进入下一保本周期，该保本周期仍为18个月，具体起讫日期以本基金管理人届时公告为准。如保本到期后，本基金未能符合上述保本基金存续条件，则本基金将按《基金合同》的约定，变更为"金鹰元丰债券型证券投资基金"。

(二)适用保本条款的情形

1、对于本基金第一个保本周期而言，基金份额持有人认购并持有到期的基金份额；

2、对于认购并持有到期的基金份额、或过渡期申购并持有到期、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的份额，基金份额持有人无论选择赎回、转换为基金管理人管理的其他基金、本基金转入下一保本周期或是转型为"金鹰元丰债券型证券投资基金"，均适用保本条款。

八、基金保本的担保

为确保履行保本条款，保障基金份额持有人利益，本基金由中海信达担保有限公司作为担保人。

九、基金的投资

(一)投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证，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(但须符合中国证监会相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金按照固定比例组合保险策略将投资对象主要分为安全资产和风险资产，其中安全资产为国内依法公开发行的各类债券(包括国债、央行票据、公司债、企业债、短期融资券、资产支持证券、可转换债券、分离交易可转债和债券回购等)、银行存款等固定收益类金融工具。本基金投资的风险资产为股票、权证等权益类金融工具。

本基金按照固定比例组合保险策略对各类金融工具的投资比例进行动态调整。其中，股票、权证等风险资产占基金资产的比例不超过30%；债券、货币市场工具等安全资产占基金资产的比例不低于70%，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%。

(二)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。

1、保本策略

本基金的保本策略采用固定比例组合保险策略。该策略的基本原理是将基金资产按一定比例划分为安全资产和风险资产，其中安全资产遵循保本要求将投资于各类债券及银行存款，以保证投资本金的安全性，进而起到到期保本的效果；而除安全资产外的风险资产主要投资于股票、权证等权益类资产，以提升基金投资者的收益。

2、资产配置策略

(1)大类资产的配置策略

本基金采用固定比例组合保险策略进行投资，其中风险乘数对于确定风险资产和安全资产的配置额具有相当重要的作用。风险资产主要以权益类资产为代表，安全资产主要以固定收益类资产为代表。故本基金以风险乘数的设定作为大类资产配置的关键变量。

(2)债券类资产的配置策略

为实现保本期结束时的本金保障目标，本基金的部分债券类资产将采取买入并持有的策略；对于此类配置，我们着重考虑债券的信用风险、到期收益率以及剩余期限是否与剩余保本期匹配等因素。同时为保证基金的流动性及更高的收益率，本基金小部分债券类资产将采取主动灵活的配置策略，积极布局各类债券资产，以追求更高的收益率。

① 债券类资产的期限配置

本基金根据宏观经济走势、CPI与利率变化、央行货币政策、剩余保本期等因素，通过审慎分析与测算，确定投资组合的加权平均久期。当预期利率下降时，适当提升久期，以分享债券的上涨收益；当预期利率上升时，适当降低久期，以规避债券的下跌风险。

在确定了债券类、货币类资产的配置比例与大致的期限结构之后，根据债券类资产的加权平均久期之目标区间，确定久期为1年以下、1~3年、3~5年、5年以上的债券品种之市值占本基金债券总市值的相对比例。

② 债券类资产的类属配置

本基金通过分析宏观经济走势、利率的变动趋势、各类债券的收益率水平与流动性、基金申购与赎回的情况以及股票市场的运行状况，确定国债、央票、金融债、信用债等大类债券市值占基金债券类资产总市值的相对比例。

③ 债券品种选择

为保障本基金本金安全、防范信用风险，本基金将在严格的内部评级基础上选择债券品种。通过严格的内部评级，挑选金融债、企业债、公司债、资产支持证券、短期融资券等券种。

(3)货币市场类资产的配置策略

根据宏观经济走势、名义利率的运行趋势，债券市场、股票市场的运行情况，本基金申购赎回的情况，各类货币市场工具的流动性、收益率的变化，确定本基金配置在现金、活期存款及1年期以下存款(含1年期)，1年期以上存款上的资金量占货币类资产总量的相对比例，制定审慎的配置方案，并随着前述决策变量的变化，实时动态地调整配置比例，严格控制货币市场类资产的加权平均剩余期限。

(4)股票资产的配置策略

①股票一级市场申购策略

本基金可参与一级市场新股申购或增发。本基金将结合定性与定量分析，对新股的基本面做出分析研判。并采用适当的估值模型对新股的投资价值进行评估，结合二级市场的平均估值水平、并参考类似新股上市之后的平均溢价率，给出合理的询价；根据二级市场的运行情况、新股发行的频度、近期参与一级市场新股申购的平均资金规模、拟参与申购的新股之实际发行规模，估计中签率，测算该次新股申购的预期收益率，做出是否参与该次新股申购的决定。

②股票二级市场投资策略

基金管理人将把握股票市场出现的趋势性或结构性投资机会，在《基金合同》约定范围内直接投资股票市场，努力获取超额收益。在股票投资方面，将遵循稳健和灵活兼顾的投资思路。

③风格追踪

本基金将密切追踪大盘股与中小盘股、成长股与价值股、低价股与高价股、低PB与高PB等不同市场风格股票的切换，关注地理区域板块、投资类与消费类板块的轮动。随着市场行情风格的转换与板块的轮动，适时、适度地调整投资组合的行业配置、板块构成与风格特征。

④个股选择

本基金将审慎甄别公司的核心价值，从公司治理、公司战略、行业地位等方面审视公司核心竞争力，以基本面分析为核心，力求挖掘出具有核心竞争力的稳健经营、价值低估型公司。

(5)权证投资策略

本基金将因为上市公司进行增发、配售以及投资分离交易的可转换公司债券等原因被动获得权证，或者在进行套利交易、避险交易以及权证价值严重低估等情形下投资权证。

3、业绩比较基准

2年期银行定期存款利率(税后)

在基金合同生效日，业绩比较基准为中国人民银行公布的、该日适用的2年期银行定期存款利率(税后)；并随着2年期银行定期存款利率的调整而动态调整。

本基金选择2年期银行定期存款利率(税后)作为业绩比较基准，主要理由：(1)与本基金的保本周期期限相近。本基金的保本期为18个月，对于认购本基金的投资者而言，将持有到保本期结束时的收益率与另一个可替代的投资方向——2年期银行定期存款利率(税后)相比较，可以反映出二者之间的优劣；(2)定期存款利率(税后)为投资者投资于定期存款实际可获得的收益率，将其作为本基金的业绩比较基准，有助于本基金份额的持有人理性地判断本基金的风险收益特性，准确地理解本基金本金保证的有效性。

如果今后法律法规发生变化，推出更具权威性的业绩比较基准或者市场出现更加适用于本基金的业绩比较基准时，本基金将与托管人协商一致后，报中国证监会备案变更业绩比较基准并及时公告。

4、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。

(三)变更后的"金鹰元丰债券型证券投资基金"的投资

1、投资目标

通过对宏观经济、资本市场运行趋势的前瞻性研判，预测未来利率水平及其变化趋势，力求准确把握固定收益类、权益类资产的投资机会，在严格控制投资风险的前提下，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。

2、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，主要投资于国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债(含分离交易可转债)、资产支持证券、短期融资券、回购、中小企业私募债券、货币市场工具等固定收益类证券品种、国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证，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(但须符合中国证监会的相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金对固定收益类证券品种的投资比例不低于基金资产的80%；对股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)等权益类资产的投资比例不超过基金资产的20%，其中，权证投资的比例范围占基金资产净值的0~3%。为维持投资组合的流动性，本基金持有现金和到期日不超过一年的政府债券不低于基金资产净值的5%。

3、投资策略

(1)大类资产配置策略

本基金变更为"金鹰元丰债券型证券投资基金"后，在大类资产配置比例上将不再遵守保本周期内适用的固定比例组合保险策略投资策略。

本基金将综合考虑国内外政治经济环境、政策形势、宏观经济与资本市场运行状况、固定收益类与权益类资产风险收益特征，定性分析与定量分析并用，灵活确定大类资产配置比例，并将在实际运作中根据证券市场走势以及本基金业绩表现不断对大类资产配置比例进行调整，以期优化大类资产配置，力争获取超额投资收益。

(2)债券类资产配置策略

1)债券类资产的期限配置

本基金根据宏观经济走势、CPI与利率变化、央行货币政策、剩余保本期等因素，通过审慎分析与测算，确定投资组合的加权平均久期。当预期利率下降时，适当提升久期，以分享债券的上涨收益；当预期利率上升时，适当降低久期，以规避债券的下跌风险。

在确定了债券类、货币类资产的配置比例与大致的期限结构之后，根据债券类资产的加权平均久期之目标区间，确定久期为1年以下、1~3年、3~5年、5年以上的债券品种之市值占本基金债券总市值的相对比例。

2)债券类资产的类属配置

本基金通过分析宏观经济走势、利率的变动趋势、各类债券的收益率水平与流动性、基金申购与赎回的情况以及股票市场的运行状况，确定国债、央票、金融债、信用债等大类债券市值占基金债券类资产总市值的相对比例。

3)债券品种选择

本基金将在严格的内部评级基础上选择债券品种。通过严格的内部评级，挑选政府债券、央票、金融债、信用债券、可转换债券等券种。

4)债券交易策略

在债券配置策略外，本基金亦将根据宏观经济运行状况、证券市场走势、CPI与未来利率的变化趋势，灵活选择恰当的交易策略，在严格控制风险、保持投资组合流动性的前提下，以争取更大的投资回报。

(3)股票资产的配置策略

基金管理人将把握股票市场出现的趋势性或结构性投资机会，在《基金合同》约定范围内直接投资股票市场，努力获取超额收益。在股票投资方面，将遵循稳健和灵活兼顾的投资思路。

4、业绩比较基准

本基金业绩比较基准：

中国债券综合指数(全价)×90%+沪深300指数×10%。

本基金选择中国债券综合指数(全价)作为业绩比较基准，主要理由是：(1)样本债券涵盖的范围广。中国债券综合指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的中国全市场债券指数，除了美元债、资产支持证券和部分在交易所发行上市的债券以外，其他所有债券均纳入样本债券范围，且待偿期在一年以内的债券亦进入指数样本券，能够较好地反映债券市场整体状况。中国债券综合指数样本债券涵盖的范围与本基金可投资的债券类属基本一致。(2)时间序列完整。其全价指数序列、净价指数序列、平均市值法到期收益率等一系列指标的起始时间点均为2002年1月4日，较长的时间序列有利于本基金更加深入地研究和分析债券市场。

沪深300指数由中证指数公司编制并发布，指数样本覆盖了沪深两地大部分流通市值，成分股均为A股市场中代表性强且流动性高的主流投资股票，能够反映中国证券市场股票价格变动的概貌和运行状况，适合作为本基金权益类资产投资的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的债券指数时，本基金将与托管人协商一致后，报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

5、风险收益特征

本基金为债券型基金，属于证券投资基金当中风险较低的品种，其长期平均风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金，但高于货币市场基金。

(四)投资禁止行为与限制

1、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：
(1)承销证券；
(2)向他人贷款或提供担保；
(3)从事承担无限责任的投资；
(4)买卖其他基金份额，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；
(5)向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或债券；
(6)买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
(7)从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
(8)当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

2、基金投资组合比例限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：
(1)在保本周期内，本基金股票、权证占基金资产的比例不超过30%，债券等固定收益类品种占基金资产的比例不低于70%；若本基金变更为"金鹰元丰债券型证券投资基金"后，本基金对固定收益类证券品种的投资比例不低于基金资产的80%；对股票、权证、货币等其它金融工具的投资比例不超过基金资产的20%；
(2)本基金保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；
(3)本基金持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的10%；
(4)本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%；
(5)本基金进入全国银行间同业市场进行债券正回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%；
(6)本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；
(7)本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的0.5%；本基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定；
(8)本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。本基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内全部卖出；
(9)本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；
(10)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；
(11) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；
(12)本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
(13)本基金不得违反《基金合同》关于投资范围和投资比例的约定；
(14)本基金若变更为"金鹰元丰债券型证券投资基金"后，持有单只中小企业私募债券的市值不超过本基金资产净值的10%；
(15)法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定，履行适当程序后，本基金不受上述规定的限制。

(五)投资组合比例调整

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合《基金合同》的有关约定。由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在10个交易日内进行调整，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

(六)基金管理人代表基金行使股东权利处理原则和方法

1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
2、有利于基金财产的安全与增值；
3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；
4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

十、基金投资组合报告(未经审计)

本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。

本基金的托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于2013年8月27日复核了本报告中的内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告有关数据截止日为2013年6月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

(一)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	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

(二)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	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

(三)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	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

注：本基金本报告期末仅持有三只股票。

(四)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	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

(五)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

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	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萧国资债	500,000	52,590,000.00	6.96

(六)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。

(七)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。

(八)报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

(九)投资组合报告附注

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。

2、本基金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。

3、其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
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

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、报告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。

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。

十一、基金的业绩

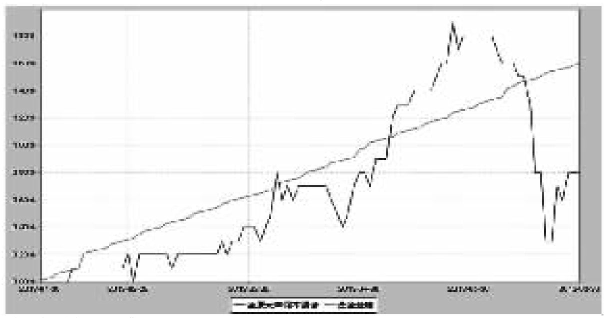
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效日为2013年1月30日，基金合同生效以来(截至2013年6月30日)的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示：

金鹰元丰保本混合型证券投资基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

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(%)
2013.1.30-2013.6.30	0.80	0.13	1.60	0.01	-0.80	0.12

金鹰元丰保本混合型基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图(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、截至报告日本基金各项投资比例符合基金合同规定。本基金按照固定比例组合保险策略对各类金融工具的投资比例进行动态调整。其中，股票、权证等风险资产占基金资产的比例不超过30%；债券、货币市场工具等安全资产占基金资产的比例不低于70%，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%。

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)。

十二、基金的费用和税收

(一)与基金运作相关的费用

1、与基金运作相关的费用种类
(1)基金管理人的管理费；
(2)基金托管人的托管费；
(3)因基金的证券交易或结算而产生的费用(包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等)；
(4)基金合同生效以后的信息披露费用；
(5)基金份额持有人大会费用；
(6)基金合同生效以后的会计师费和律师费；
(7)基金资产的资金汇划费用；
(8)按照国家有关法律法规和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

2、与基金运作相关的费用之计提方法、计提标准和支付方式

(1)、基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金财产净值的1.2%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金财产净值的1.2%年费率计提。计算方法如下：

$H=E\times1.2\%\div$当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金财产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

(2)、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金财产净值的0.2%年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金财产净值的0.2%年费率计提。计算方法如下：

$H=E\times0.2\%\div$当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金财产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

若保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，基金份额持有人将所持有本基金份额转为变更后的"金鹰元丰债券型证券投资基金"的基金份额，管理费按前一日基金资产净值的0.75%的年费率计提，托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。计算方法同上。

(3)本条第(一)款第3 至第8项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

3、不列入基金费用的项目

本条第(一)款约定以外的其他费用，以及基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失等不列入基金费用。

4、基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

(二)与基金销售有关的费用

1、申购赎回费率

(1)申购费率：

投资人申购本基金需缴纳申购费，投资人在同一天多次申购的，根据单次申购金额确定每次申购所适用的费率。申购费用用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。

申购费率如下：

申购金额(万元)	申购费率
A <100	1.0%
100 ≤ A <300	0.8%
300 ≤A <500	0.6%
A ≥500	每笔1000元

注：上表中，A为投资者申购金额。

(2)赎回费率

赎回费率随基金份额持有人持有本基金的时间的增加而递减，具体赎回费率如下表所示：

持有期(计为T)	赎回费率
T <1年	2%
1年 ≤ T <18个月	1.6%
T ≥18个月	0%

本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，不低于赎回费总额25%的部分归基金财产所有，其余部分用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率和赎回费率。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施2日前在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登公告。

基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，在基金促销活动期间，基金管理人可以对促销活动范围内的基金投资者调低基金申购费率、赎回费率。

2、转换费率

本基金与基金管理人所管理的其他基金之间的转换费率由基金管理人根据有关法律法规和基金合同的原则另行制定并公告。

3、基金管理人可以在基金合同规定的范围内调整上述费率。上述费率如发生变更，基金管理人应按照《信息披露办法》或其他相关规定于新的费率实施前在至少一种指定媒体公告。调整后的上述费率还应在最新的招募说明书中列示。

基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人在与托管人协商一致后可以对促销活动范围内的投资者调低基金申购、赎回费率，并报中国证监会备案。

(三)税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

十三、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对2012年12月19日刊登的《金鹰元丰保本混合型证券投资基金招募说明书》进行了更新，主要更新的内容如下：

(一)在"二、释义"部分，更新了法规颁布实施的日期；
(二)在"三、基金管理人"部分，更新了独立董事简介、基金经理以及投资决策委员会委员任职情况；
(三)在"四、基金托管人"部分，更新了有关基金托管人的资料信息；
(四)在"五、基金担保人"部分，更新了有关基金担保人的资料信息；
(五)在"六、相关服务机构"部分，对机构与人员的信息按照最新变动情况进行了更新：
1、更新了代销机构、律师事务所等相关服务机构的基本信息和联络方式；
2、增加了广发证券股份有限公司、国海证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、新时代证券有限责任公司、华安证券有限责任公司以及国联证券股份有限公司为代销机构，该变动事项于2012年12月27日公告；
3、新增了中期时代基金销售(北京)有限公司为代销机构，该变动事项于2013年3月11日公告；
4、新增了成都农村商业银行股份有限公司销售为代销机构，该变动事项于2013年3月27日公告；
5、新增了和讯信息科技有限公司证券为代销机构，该变动事项于2013年4月19日公告；
6、增加了金元证券股份有限公司为代销机构，该变动事项于2013年4月24日公告。
(六)在"七、基金的募集"部分，更新了本基金募集期间；
(七)在"十、基金的转换"部分，补充了本基金与本基金管理人管理的其他部分基金之间开通转换业务的说明；
(八)在"十三、定期定额投资计划" 部分，补充了本基金开通定期定额投资业务的说明；
(九)在"十六、基金的投资"部分，补充了本基金最近一期投资组合报告的内容；
(十)在"十七、基金的业绩"，补充了本基金基金合同生效以来投资业绩；
(十一) 在"三十、其他应披露事项"部分，补充了本基金在本报告期内公开披露的信息内容。

金鹰基金管理有限公司

2013年8月31日

金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金调整长期停牌股票估值方法的公告

根据中国证券监督管理委员会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》(证监会公告[2008]38号)，为使持有长期停牌股票的基金估值更加公平、合理，更好的维护持有人利益，经与托管人协商一致，本公司已自2013年8月30日起对旗下金鹰主题优势股票型证券投资基金(基金代码：210005)、金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金(基金代码：210002)、金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金(基金代码：210007)以及金鹰策略配置股票型证券投资基金(基金代码：210008)持有的停牌股票东华软件(股票代码：002065)采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》中的"指数收益法"估值。本基金管理人将在上述股票复牌且其交易体现活跃市场交易特征后，按市场价格进行估值，届时不再另行公告。敬请投资者予以关注。

投资者可登录本基金管理人网站(www.gefund.com.cn)或拨打本基金管理人客户服务电话(400-6135-888)了解相关情况。

特此公告。

金鹰基金管理有限公司
2013年8月31日