# 中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金

## 2014 第二季度 报告

2014年6月30日

**基金管理人:汇添富基金管理股份有限公司**
**基金托管人:中国工商银行股份有限公司**
**报告送出日期:2014年7月19日**

### §1 重要提示

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。

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7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 汇添富中证主要消费ETF (场内简称:消费ETF) |
| 交易代码 | 159928 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2013年8月23日 |
| 报告期末基金份额总额 | 196,657,260.00份 |
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 |
| 投资策略 | 主要采取完全复制法,在正常市场情况下,日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.1%,年化跟踪误差不超过2%。 |
| 业绩比较基准 | 中证主要消费指数 |
| 风险收益特征 | 属股票型基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本系列基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。 |
| 基金管理人 | 汇添富基金管理股份有限公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2014年4月1日 - 2014年6月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -1,879,063.06 |
| 2.本期利润 | 744,918.26 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0037 |
| 4.期末基金资产净值 | 180,600,107.03 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.9183 |

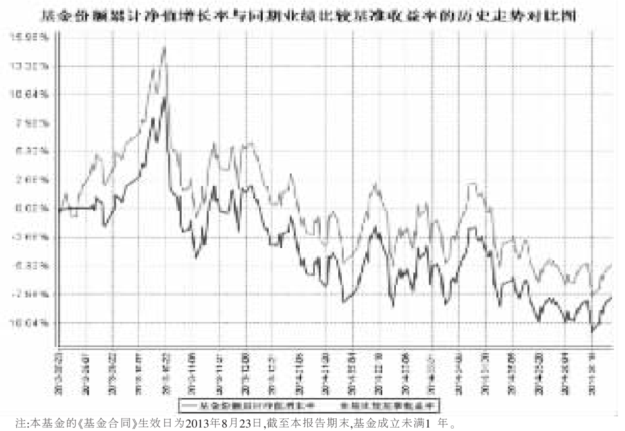
注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 | 净值增长率① | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.23% | 0.98% | -0.60% | 0.99% | 0.83% | -0.01% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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《基金合同》生效日为2013年8月23日,截至本报告期末,基金成立未满1 年。

本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2013 年8 月23日)起3个月,建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

### §4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 吴振翔 | 汇添富上证综合指数、汇添富中证主要消费ETF、汇添富中证医药卫生ETF、汇添富中证能源ETF、汇添富中证金融地产ETF、汇添富沪深300安中指数基金的基金经理,金融工程部总监助理。 | 2013年8月23日 | - | 8年 | 国籍:中国。学历:中国科学技术大学管理学博士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008年3月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任产品开发高级经理、数量投资高级分析师,现任金融工程部总监助理。2010年1月8日至2010年2月4日任汇添富上证综合指数基金的基金经理助理,2010年2月5日至今任汇添富上证综合指数基金的基金经理,2011年9月16日至2013年11月7日任汇添富深证300ETF基金的基金经理,2011年9月28日至2013年11月7日任汇添富深证300ETF基金联接基金的基金经理,2013年8月23日至今任中证主要消费ETF基金、中证医药卫生ETF基金、中证能源ETF基金、中证金融地产ETF基金的基金经理,2013年11月6日至今任汇添富沪深300安中指数基金的基金经理。 |
| 汪洋 | 汇添富中证主要消费ETF、汇添富中证医药卫生ETF、汇添富中证能源ETF、汇添富中证金融地产ETF、汇添富深证300ETF基金、汇添富深证300ETF基金联接基金的基金经理。 | 2013年9月13日 | - | 5年 | 国籍:中国。学历:金融工程及计算机科学双硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:曾任华泰联合证券有限责任公司金融工程高级研究员,华泰柏瑞基金管理有限公司基金经理助理。2013年5月6日加入汇添富基金管理股份有限公司,从事指数及ETF产品的投资、研究工作,2013年9月13日至今任汇添富中证主要消费ETF、汇添富中证医药卫生ETF、汇添富中证能源ETF、汇添富中证金融地产ETF基金的基金经理,2013年11月7日至今任汇添富深证300ETF基金、汇添富深证300ETF基金联接基金的基金经理。 |

注:1、基金的首任基金经理,其"任职日期"为基金合同生效日,其"离职日期"为根据公司决议确定的解聘日期;

2、非首任基金经理,其"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期;

3、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

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定,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,无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为,本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护,根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规,借鉴国际经验,建立了健全、有效的公平交易制度体系,形成涵盖各开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合全部投资组合,交易所市场、银行间市场等各投资市场,债券、股票、回购等各投资标的,并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。

本报告期内,基金管理人对公平交易制度和公平交易机制实现了流程优化和进一步系统化,确保全程嵌入式风险控制体系的有效运行,包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节执行情况良好。

本报告期内,通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查,本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司制定了同日反向交易控制的规则,同时加强对基金、专户、社保间同日反向交易的监控和隔日反向交易的检查。公司利用公平交易分析系统,对各组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控,并定期对组合间的同向交易分析。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的交易次数为3次,其中2次是由于对冲专户采取指数化策略投资导致,1次是由于投资流动性的需求导致。经检查和分析未发现异常情况。

4.4 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

本基金在报告期内遵循了ETF基金的被动投资原则,保持了指数基金的本质属性,股票投资仓位在考察期内始终保持在98%~100%之间,基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

本基金日常管理中非常重视风险管理,对股票和现金头寸严格管理、实时监控,基本实现了ETF平稳运作管理的目的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内中证消费指数下跌-0.60%,本基金在报告期内累计收益率为0.23%,收益率超越业绩比较基准0.83%。收益率的差异因素主要来源于期间成份股分红、日常申购赎回等因素。本基金日均跟踪误差为0.0221%,这一跟踪误差水平远低于合同约定上限,在报告期达到了投资目标。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014年二季度消费行业整体振荡下行,子行业中的白酒和乳制品表现较为平淡,农林牧渔行业在近期表现强势,但由于指数中所占权重较低,未能带动消费行业整体上行。

从行业基本面角度来看,白酒行业基本面底部已经出现,在回归大众消费品以及产业改革升级之后将会迎来新的成长机遇,近期多个白酒企业纷纷开拓互联网平台已经展现了强烈的发展意愿。农林牧渔行业方面,猪肉鸡肉价格的上涨将继续利好相关上市公司,而厄尔尼诺事件的预期将推高部分农产品的价格,相关的上市公司或因此受益。总体来看,消费行业作为关系到国计民生的重要行业,其景气度的企稳回升是大概率事件,投资消费行业将对资产组合起到稳定作用。

作为被动投资的交易所上市指数型基金,汇添富中证消费ETF将严格遵守基金合同,继续坚持既定的指数化投资策略,积极采取有效方法去严格控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差。

### §5 投资组合报告

5.1 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 | 179,166,170.81 | 98.98 |
| | 其中:股票 | 179,166,170.81 | 98.98 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 1,827,198.84 | 1.01 |
| 7 | 其他资产 | 11,486.80 | 0.01 |
| 8 | 合计 | 181,004,856.45 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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 | 14,886,311.12 | 8.24 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 132,605,546.02 | 73.42 |
| 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 | 27,391,999.79 | 15.17 |
| 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 | 4,282,313.88 | 2.37 |
| 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 | 179,166,170.81 | 99.21 |

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未进行积极投资。

5.3 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

5.3.1 报告期末指数投资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 | 600887 | 伊利股份 | 548,777 | 18,175,494.24 | 10.06 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 126,049 | 17,896,437.02 | 9.91 |
| 3 | 000858 | 五 粮 液 | 645,271 | 11,569,709.03 | 6.41 |
| 4 | 000895 | 双汇发展 | 224,491 | 8,034,532.89 | 4.45 |
| 5 | 600518 | 康美药业 | 523,361 | 7,824,246.95 | 4.33 |
| 6 | 600315 | 上海家化 | 160,017 | 5,864,623.05 | 3.25 |
| 7 | 002304 | 洋河股份 | 110,092 | 5,587,169.00 | 3.09 |
| 8 | 600600 | 青岛啤酒 | 118,294 | 4,738,857.64 | 2.62 |
| 9 | 000061 | 农 产 品 | 463,956 | 4,282,313.88 | 2.37 |
| 10 | 601607 | 上海医药 | 326,937 | 4,063,826.91 | 2.25 |

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

注:本基金本报告期末未进行积极投资。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券投资。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券投资。

5.6 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资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:报告期末本基金无股指期货持仓。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

报告期末本基金无国债期货持仓。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。

5.11.2

本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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 11,218.90 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 267.90 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 11,486.80 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未进行积极投资,不存在流通受限情况。

### §6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 200,657,260.00 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 19,563,761.25 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 23,563,761.25 |
| 报告期期末基金份额总额 | 196,657,260.00 |

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注:本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本公司管理的基金。

### §8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金募集的文件;

2、《中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;

3、《中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;

4、基金管理人业务资格批件、营业执照;

5、报告期内中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告;

6、中国证监会要求的其他文件。

8.2 存放地点

上海市富城路99号震旦国际大楼21楼 汇添富基金管理股份有限公司

8.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅,或登录基金管理人网站www.99fund.com查阅,还可拨打基金管理人客户服务中心电话:400-888-9918查询相关信息。

**汇添富基金管理股份有限公司**
**2014年7月19日**

---

# 金鹰策略配置股票型证券投资基金

## 2014 第二季度 报告

2014年6月30日

**基金管理人:金鹰基金管理有限公司**
**基金托管人:中信银行股份有限公司**
**报告送出日期:二〇一四年七月十九日**

### §1 重要提示

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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 金鹰策略配置股票 |
| 基金主代码 | 210008 |
| 交易代码 | 210008 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2011年9月1日 |
| 报告期末基金份额总额 | 103,340,939.35份 |
| 投资目标 | 在对基本面进行深入分析的基础上,制定适当的投资策略,以策略指导投资运作,在充分控制风险的前提下,分享中国经济快速发展的成果以及企业经营绩效提升所带来的股权溢价,力争实现基金资产的长期可持续稳健增值。 |
| 投资策略 | "防御"与"进取"的权衡与取舍是本基金进行大类资产配置、行业配置过程中的重要决策依据。通过对宏观经济所处投资时钟象限的判断、对股票市场与资金市场之间套利空间的测度,综合考察国内外宏观经济、财政政策与货币政策新动向、资本市场运行状况,对"防御"与"进取"目标适时、适度地有所侧重,将是本基金在投资策略上的现实选择。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数增长率×75%+中信标普国债指数增长率×25% |
| 风险收益特征 | 本基金为主动操作的股票型证券投资基金,属于证券投资基金中的预期收益与风险较高的品种。一般情形下,其风险和预期收益均高于货币型基金、债券型基金和混合型基金。 |
| 基金管理人 | 金鹰基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中信银行股份有限公司 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2014年4月1日-2014年6月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -1,236,254.16 |
| 2.本期利润 | 2,311,855.14 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0221 |
| 4.期末基金资产净值 | 100,686,399.78 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.9743 |

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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。2、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。

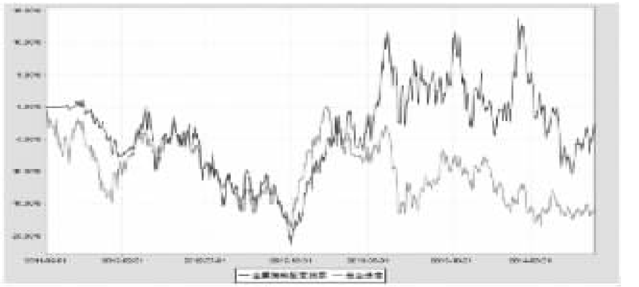
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 | 净值增长率① | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 2.32% | 1.08% | 1.00% | 0.66% | 1.32% | 0.42% |

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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

金鹰策略配置股票型证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2011年9月1日至2014年6月30日)



注:1、本基金合同于2011年9月1日正式生效;2、截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同规定的各项比例。本基金投资范围:股票资产占基金资产净值的比例为60%~95%;债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券等其他金融工具占基金资产净值的5%~40%;3、本基金业绩比较基准为:沪深300指数增长率×75%+中信标普国债指数增长率×25%。

### §4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 陈晓 | 基金经理 | 2012-11-3 | - | 13 | 陈晓先生,硕士,13年证券业从业经历,曾任香港顺达电子集团公司、上海元创投资有限公司董事长助理,广州证券有限责任公司资产管理部投资总监,华泰联合证券有限公司资产管理部总经理,摩根士丹利华鑫基金管理有限公司总经理助理及投资总监等职,2012年2月加入金鹰基金管理有限公司,现任公司基金管理部总监,本基金以及金鹰核心资源股票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颁布的《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、《金鹰策略配置股票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,无损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

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,必要时启用投资交易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 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

2014年2季度,中国经济逐步回稳,汇丰PMI创出近几个月的新高,外盘美国股市纳斯达克和道琼斯指数持续走高,国内央行定向降准释放流动性。在这样的背景下,市场比较活跃,特别是小市值的股票全面繁荣,主板继续窄幅波动,上半年的波动率为十多年中罕见。但近期热点频出,快速切换,表现为创业板综比创业板指强,深证综指比深证成指强,这本质是存量资金有限的情况下,通过提高周转率获益的盈利模式。对已公布中报业绩预警的974 家上市公司统计显示,业绩向好、持平与转差的占比分别为52.13 %、14.29%和33.59%,向好类占比相较一季报(49.16%)及去年中报(49.11%)均有回升,表明微刺激作用下,二季度上市公司的盈利增速有望小幅回升。从板块看,经济起不来已是市场共识,局部热点会反复围绕小市值、高估值的概念股开展,比如智能机器人、智能穿戴、新能源汽车、TMT、环保、医疗服务等,本基金延续了一季度的操作风格,主要布局在优质的成长股和一些行业增长较快的个股上面,大类资产配置策略主要采用至下而上的方式对看好的个股进行投资,总体来讲,效果达到了预期。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止2014年6月30日,基金份额净值为0.9743元,本报告期份额净值增长率为2.32%,同期业绩比较基准增长率为1.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年我们认为中国经济处于转型期,无风险利率需要一个下行的过程,股票市场很难有大的系统性行情,市场的主要机会来之于结构化的机会,而这些结构性的机会主要来自于主动缩容、创新转型。下半年影响股价的因素无非是估值和盈利两个因素,但股价的涨跌并非取决于估值与盈利本身,而是取决于这两个因素的变化趋势。我们预计中国经济增长进入缺乏弹性区间,宏观经济增速企稳的概率较大,制造业有 好转迹象,加上保底思维,经济增速难以进一步降低,无需担心营业收入增速进一步下降 。毛利率从去年起呈提高趋势,随着PPI 的降幅收窄乃至转正, 毛利率有望继续提高。财务费用上升是拖累净利润率的最关键因素,今年难以出现钱荒,但资金价格高企向实体经济转移是新的挑战。我们认为上市公司业绩增长的预期已经过了最坏阶段,但由于业绩对于政策的滞后性,短期内也难以明显好转。因此,我们预计2014 年下半年的行情,A 股波动率仍在一个狭小的空间运行,传统行业下跌空间不大,新兴行业整体消化高估值,短暂的主题投资难以把握好节奏,更难以把握风险收益比,然而小市值股票特别是存在外延扩张的预期的股票会表现较好。

因此下半年,对成长股研究和配置仍将是该基金的主流方向。配置上我们将重点关注医药、替代能源和新兴成长行业,包括TMT、安防和传媒等未来市场空间大的行业。

### §5 投资组合报告

5.1 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 | 76,465,202.46 | 74.24 |
| | 其中:股票 | 76,465,202.46 | 74.24 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | 18,000,000.00 | 17.48 |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 5,927,569.17 | 5.76 |
| 7 | 其他资产 | 2,604,592.04 | 2.53 |
| 8 | 合计 | 102,997,363.67 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 序号 | 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 | 45,429,087.05 | 45.12 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 1,699,194.00 | 1.69 |
| 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 | 19,784,562.35 | 19.65 |
| J | 金融业 | 3,948,506.80 | 3.92 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,396,720.00 | 1.39 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 1,056,502.90 | 1.05 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 591,429.36 | 0.59 |
| 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 | 2,559,200.00 | 2.54 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 76,465,202.46 | 75.94 |

5.3 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 | 002223 | 鱼跃医疗 | 231,100 | 5,604,175.00 | 5.57 |
| 2 | 600330 | 天通股份 | 421,700 | 5,085,702.00 | 5.05 |
| 3 | 002023 | 海特高新 | 178,092 | 3,401,557.20 | 3.38 |
| 4 | 600637 | 百视通 | 101,914 | 3,264,305.42 | 3.24 |
| 5 | 603000 | 人民网 | 82,486 | 3,232,626.34 | 3.21 |
| 6 | 002396 | 星网锐捷 | 112,800 | 3,157,272.00 | 3.14 |
| 7 | 300245 | 天玑科技 | 146,746 | 3,140,364.40 | 3.12 |
| 8 | 002104 | 恒宝股份 | 159,240 | 3,121,104.00 | 3.10 |
| 9 | 000988 | 华工科技 | 318,057 | 2,986,555.23 | 2.97 |
| 10 | 002174 | 游族网络 | 54,026 | 2,973,050.78 | 2.95 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末本基金未持有债券。

5.5 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

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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。

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

报告期本基金未投资贵金属。

5.8 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投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货持仓。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本基金投资国债期货的投资政策

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货持仓。

5.10.3 本基金投资国债期货的投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他各项资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 95,220.99 |
| 2 | 应收证券清算款 | 2,504,311.74 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,691.87 |
| 5 | 应收申购款 | 2,367.44 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,604,592.04 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600637 | 百视通 | 3,264,305.42 | 3.24 | 筹划重大事项 |
| 2 | - | - | - | - | - |
| 3 | - | - | - | - | - |
| 4 | - | - | - | - | - |
| 5 | - | - | - | - | - |
| 6 | - | - | - | - | - |
| 7 | - | - | - | - | - |
| 8 | - | - | - | - | - |
| 9 | - | - | - | - | - |
| 10 | - | - | - | - | - |

5.11.6 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。

### §6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 106,006,230.04 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,186,767.73 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 3,852,058.42 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 103,340,939.35 |

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

### §8 影响投资者决策的其他重要信息

经公司第四届董事会第三十七次会议决议通过,公司原总经理殷克胜先生已于2014年6月5日离职,由公司董事长刘东先生代行总经理职务。该事项已于2014年6月9日公告,详情请查看2014年6月9日的《证券时报》和公司网站公告内容。

### §9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准金鹰策略配置股票型证券投资基金发行及募集的文件。

2、《金鹰策略配置股票型证券投资基金基金合同》。

3、《金鹰策略配置股票型证券投资基金托管协议》。

4、金鹰基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程。。

5、基金托管人业务资格批件和营业执照。

6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、季度报告、半年度报告、更新的招募说明书及其他临时公告。

9.2 存放地点

广州市天河区体育西路189号城建大厦22-23层

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅或按工本费购买复印件, 也可登录本基金管理人网站查阅, 本基金管理人网址:http://www.gefund.com.cn。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人客户服务中心,客户服务中心电话:4006-135-888或020-83936180。

**金鹰基金管理有限公司**
**二〇一四年七月十九日**

---

# 金鹰保本混合型证券投资基金

## 2014 第二季度 报告

2014年6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**
**报告送出日期:二〇一四年七月十九日**

### §1 重要提示

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。

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7月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 金鹰保本混合 |
| 基金主代码 | 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5月17日 |
| 报告期末基金份额总额 | 196,365,286.15份 |
| 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、保证本金安全的基础上,力争在保本期结束时,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),是本基金投资运作过程中的核心策略;投资策略采用"自上而下"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风险收益特性、基金净资产、价值底线,定性分析与定量分析并用,灵活动态地选取适当的风险乘数,以期对固定收益类与权益类资产之间的配置额进行优化调节,力争在确保本金安全的前提下,获取投资收益。 |
| 业绩比较基准 | 3年期银行定期存款利率(税后) |
| 风险收益特征 | 本基金为积极配置的保本混合型基金,属于证券投资基金当中的低风险品种,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。 |
| 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 |
| 基金保证人 | 广州国际集团有限公司 |

注:本基金第二个保本期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。

### §3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2014年4月1日-2014年6月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -3,900,789.60 |
| 2.本期利润 | 6,173,881.50 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0245 |
| 4.期末基金资产净值 | 196,414,664.88 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.000 |

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。

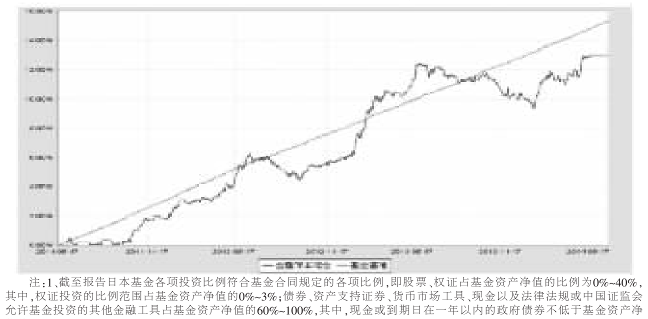
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 | 净值增长率① | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 1.80% | 0.10% | 1.08% | 0.01% | 0.72% | 0.09% |

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2011年5月17日至2014年6月30日)



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政府债券不低于基金资产净值的5%;

2、本基金的业绩比较基准为:3年期银行定期存款利率(税后)。

### §4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 邱新红 | 基金经理 | 2011-5-17 | - | 11 | 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11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、金鹰元丰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 | 2013-4-12 | - | 5 | 洪利平女士,西南财经大学硕士,证券从业年限5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元丰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 公平交易专项说明

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,必要时启用投资交易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 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

2014年2季度, 短端债券收益率的下行开始传导到长端债券, 长期债券收益率显著下降,10年国债收益率下降了45BP左右。由于金鹰保本基金在二季度第一个保本期结束,所有在二季度的投资中逐步降低了基金中的债券比例,所投资债券主要为中短期限中高等级信用债。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年6月30日,基金份额净值为1.00元,本报告期份额净值增长率为1.8%,同期业绩比较基准增长率为1.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为影响三季度债券市场走势的主要因素为流动性以及宏观经济状况。持续相对宽松的资金面将使上半年的债券牛市得以持续;另一个关注因素为宏观经济,需关注政府微刺激的政策效果,假如经济明显好转制约债券市场的表现。从目前中短期信用债收益率与融资成本的利差来看,我们认为部分债券品种仍有配置价值,尤其是中短期信用债,所以我们仍然相对看好三季度部分债券品种的表现。但是我们对低评级债券持规避态度,由于低评级债券流动性较弱,考虑回撤成本的情况下目前持有价值不高。

### §5 投资组合报告

5.1 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 | - | - |
| | 其中:股票 | - | - |
| 2 | 固定收益投资 | 10,348,016.44 | 3.88 |
| | 其中:债券 | 10,348,016.44 | 3.88 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | 175,000,000.00 | 65.53 |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 81,452,952.68 | 30.50 |
| 7 | 其他资产 | 238,631.78 | 0.09 |
| 8 | 合计 | 267,039,600.90 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资组合。

5.3 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

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.4 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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中:政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 10,348,016.44 | 5.27 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | - | - |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 10,348,016.44 | 5.27 |

5.5 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 | 124588 | 14济宁债 | 100,000 | 10,348,016.44 | 5.27 |
| 2 | - | - | - | - | - |
| 3 | - | - | - | - | - |
| 4 | - | - | - | - | - |
| 5 | - | - | - | - | - |

5.6 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。

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 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投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本基金投资国债期货的投资政策

无

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本基金投资国债期货的投资评价

无

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他各项资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 57,399.54 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 181,232.24 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 238,631.78 |

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 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。

### §6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 320,573,973.95 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,887,709.10 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 148,693,510.23 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | 22,597,113.33 |
| 报告期期末基金份额总额 | 196,365,286.15 |

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

### §8 影响投资者决策的其他重要信息

1、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21 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。该事项已于2014年5月6日进行了公告,详情请查看相关公告。

2、经公司第四届董事会第三十七次会议决议通过,公司原总经理殷克胜先生已于2014年6月5日离职,由公司董事长刘东先生代行总经理职务。该事项已于2014年6月9日公告,详情请查看2014年6月9日的《证券时报》和公司网站公告内容。

### §9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准金鹰保本混合型证券投资基金发行及募集的文件。

2、《金鹰保本混合型证券投资基金基金合同》。

3、《金鹰保本混合型证券投资基金托管协议》。

4、金鹰基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程。

5、基金托管人业务资格批件和营业执照。

6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、季度报告、更新的招股说明书及其他临时公告。

9.2 存放地点

广州市天河区体育西路189号城建大厦22-23层

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅或按工本费购买复印件, 也可登录本基金管理人网站查阅, 本基金管理人网址:http://www.gefund.com.cn。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人客户服务中心,客户服务中心电话:4006-135-888或020-83936180。

**金鹰基金管理有限公司**
**二〇一四年七月十九日**