

金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金
2012 年半年度报告
2012 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：交通银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一二年八月二十六日

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 8 月 24 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标、基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况	32
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	32
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	34
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	38
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	39
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	39
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	39
7.9 投资组合报告附注	39
8 基金份额持有人信息	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	40
8.2	错误！未定义书签。
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	40
9 开放式基金份额变动	40

10 重大事件揭示	41
10.1 基金份额持有人大会决议.....	41
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.....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	41
10.4 基金投资策略的改变	41
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	41
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的情况.....	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	41
10.8 其他重大事件.....	43
11 影响投资者决策的其他重要信息	44
12 备查文件目录	45
12.1 备查文件目录.....	45
12.2 存放地点	45
12.3 查阅方式	45

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	金鹰红利价值混合
基金主代码	210002
交易代码	210002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年12月4日
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	130,418,585.24份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对分红能力良好且长期投资价值突出的优质股票投资，为基金资产获取稳定的当期收益和长期增值。
投资策略	本基金采取积极主动式投资管理，通过积极的资产配置策略，深入研究、调研基础上的主动性证券选择和市场时机选择，在合理控制投资风险的前提下，最大限度地获取投资收益。本基金主要投资于分红能力良好且长期价值突出的优质企业，股票资产占基金资产净值比例为30%—80%；现金、债券资产、其他资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产净值的比例为20%—70%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；权证投资占基金资产净值的比例不超过3%。
业绩比较基准	富时中国A股红利150指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。
风险收益特征	本基金风险收益特征从长期来看，其风险与预期收益高于债券型基金，低于股票型基金。

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	交通银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	苏文锋	张咏东
	联系电话	020-83282627	021-32169999
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	zhangyd@bankcomm.com
客户服务电话		4006135888,020-83936180	95559
传真		020-83282856	021-62701216
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	上海市浦东新区银城中路 188 号
办公地址		广州市天河区体育西路 189 号城建大厦 22-23 楼	上海市浦东新区银城中路 188 号
邮政编码		510620	200120
法定代表人		刘东	胡怀邦

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》
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
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（2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-10,882,785.85
本期利润	357,686.32
加权平均基金份额本期利润	0.0027
本期加权平均净值利润率	0.31%

本期基金份额净值增长率	0.19%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-18,982,843.93
期末可供分配基金份额利润	-0.1456
期末基金资产净值	111,435,741.31
期末基金份额净值	0.8544
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	15.41%

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。

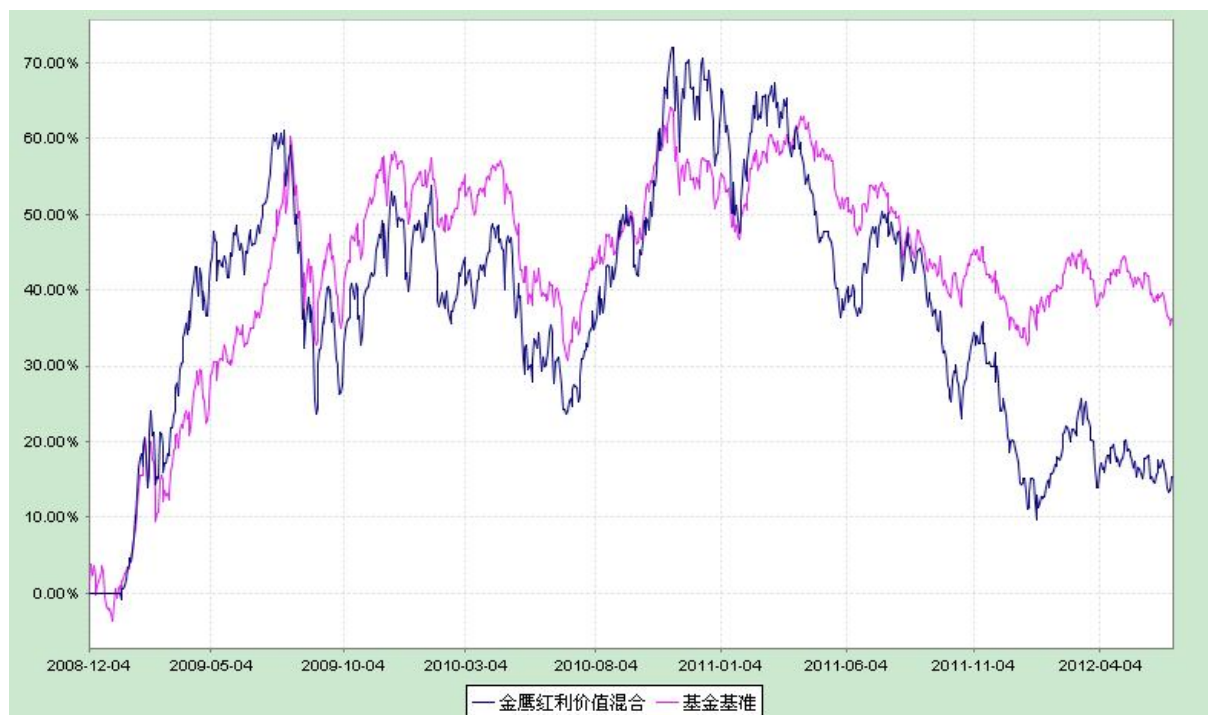
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	-2.10%	0.94%	-3.99%	0.56%	1.89%	0.38%
过去三个月	1.30%	0.87%	-1.31%	0.56%	2.61%	0.31%
过去六个月	0.19%	1.02%	0.94%	0.69%	-0.75%	0.33%
过去一年	-19.81%	1.06%	-10.12%	0.72%	-9.69%	0.34%
过去三年	-21.82%	1.35%	-0.22%	0.95%	-21.60%	0.40%
自基金合同生效起至今	15.41%	1.37%	36.15%	1.02%	-20.74%	0.35%

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

金鹰红利价值灵活配置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
 （2008 年 12 月 4 日至 2012 年 6 月 30 日）



注：1、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,股票资产占基金资产比例为30%—80%；现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为20%-70%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；权证投资占基金资产净值的比例不超过3%。2、本基金的业绩比较基准为：富时中国A股红利150指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。

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。

公司目前下设十二个部门，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、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；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；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、基金会计核算、估值、开放式基金注册、登记和清算等业务；专户投资部负责特定客户资产的投资和管理；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 2012 年 6 月 30 日，公司共管理金鹰成份股优选证券投资基金、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以及金鹰中证 500 指数分级证券投资基金 12 只基金。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
朱丹	基金经理	2011-06-11	-	6	朱丹女士，金融学硕士，曾任职于深圳晨星咨询公司，2007 年 5 月加入金鹰基金管理有限公司，先后担任行业研究员、研究组长、基金经理助理等职，现任金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金、金鹰中小盘精选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合规守信情况的说明

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、《金鹰红利价值灵活配置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，必要时启用投资交易系统内的公平交易模块；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

2012 年上半年，市场先涨后跌维持弱市震荡走势，上证综指上涨 1.18%，深证成指上涨 6.52%，中小盘指数上涨 4.23%。由于估值偏高同时大量新股发行的影响，创业板指数下跌-0.39%。上半年市场走势出现明显两级分化，地产券商白酒等板块强者恒强持续上涨，其余板块的走势都较弱，通信，电力设备和国防军工等板块跌幅靠后。一季度市场流动性好转，预期改善，出现一波较好的短期机会；但二季度国内发电量持续低迷，煤炭库存到达历史高位，而市场期盼的政府大规模投资也没有得到快速有效的实施，经济尚未出现触底迹象，市场又开始向下回调。整个上半年市场的成交量都没有出现有效放大，我们认为市场仍然以存量资金为主，目前较弱经济基本面无法使市场稳步向上，难以吸引增量资金入场。

本基金上半年一直保持中性仓位，配置以自下而上的个股为主，一季度主要配置了

铁路水利和装饰园林板块，半年报增加了医药股配置，主题板块仍然保留了铁路板块和装饰园林板块。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值为 0.8544 元，本报告期份额净值增长率为 0.19%，同期业绩比较基准增长率为 0.94%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从市场的过往历史来看，上涨一般分为两波：第一波是市场到达底部后，预期改善带动上涨的第一波。然后市场开始横盘整理，等待基本面的好转。如果基本面确实好转后，市场会出现基于基本面好转后的第二波上涨。如果基本面没有明显好转，则市场就会横盘整理然后向下。我们认为：市场一季度的上涨属于预期改善流动性好转带来的上涨，而目前市场处于横盘震荡等待基本面改善的阶段。二季度基本面改善并不明显，而目前观察三季度中国经济触底的确定性也并不是非常大，我们对于三季度仍然持相对谨慎的态度。

如果经济一旦出现见底信号，我们愿意将仓位提高到上限，但是基于目前基本面好转信号并不明显，三季度本基金仍然会保持中性仓位，愿意较多配置医药和保险板块。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则》、2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《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》（证监会计字[2007]15 号）与《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 号等相关规定和基金合同的约定，日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

为确保公司估值程序的正常进行，本公司成立了资产估值委员会。资产估值委员会由公司总经理、分管副总经理或总经理助理、研究发展部总监、运作保障部总监、投资管理部总监、基金经理、基金会计和相关人员组成。基金经理可以发表相关意见和建议，如估值委员会表决时，其仅有一票表决权，遵从少数服从多数的原则。

报告期内，本公司对长期停牌的股票依据相关规定采用行业内通用的公允价值估值方法进行估值。

本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金未签约与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2012 年上半年度,基金托管人在金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2012 年上半年度,金鹰基金管理有限公司在金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2012 年上半年度,由金鹰基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	129,879.94	25,426,765.24
结算备付金		7,836,192.54	14,300,991.56
存出保证金		298,590.97	-
交易性金融资产	6.4.7.2	97,291,307.13	90,385,633.59
其中：股票投资		86,726,855.01	80,385,633.59

基金投资		-	-
债券投资		10,564,452.12	10,000,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		7,589,674.26	1,937,947.01
应收利息	6.4.7.5	251,451.39	64,856.82
应收股利		-	-
应收申购款		39,043.29	42,957.18
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		113,436,139.52	132,159,151.40
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 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		-	-
应付证券清算款		554,780.46	15,213,934.75
应付赎回款		64,263.09	427,089.55
应付管理人报酬		137,654.65	155,346.01
应付托管费		22,942.42	25,890.99
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.6	267,817.63	146,540.31
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	952,939.96	977,281.47
负债合计		2,000,398.21	16,946,083.08
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.8	130,418,585.24	135,106,747.60
未分配利润	6.4.7.9	-18,982,843.93	-19,893,679.28
所有者权益合计		111,435,741.31	115,213,068.32
负债和所有者权益总计		113,436,139.52	132,159,151.40

注：报告截止日2012年6月30日，基金份额净值0.8544元，基金份额总额130,418,585.24份。

6.2 利润表

会计主体：金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2012年1月1日至2012年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012年1月1日至 2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年6月30日
一、收入		2,644,016.85	-13,443,357.56
1.利息收入		619,569.53	404,483.59
其中：存款利息收入	6.4.7.1 0	201,752.34	197,418.95
债券利息收入		319,008.33	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		98,808.86	207,064.64
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-9,227,731.58	-10,230,753.88
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-9,797,424.55	-10,542,552.80
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.1 2	208,708.83	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.1 3	-	-
股利收益	6.4.7.1 4	360,984.14	311,798.92
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 5	11,240,472.17	-3,671,197.96
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 6	11,706.73	54,110.69
减：二、费用		2,286,330.53	3,386,601.71
1. 管理人报酬		863,693.63	1,113,920.74
2. 托管费		143,948.85	185,653.50

3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.1 7	1,091,359.37	1,900,101.01
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.1 8	187,328.68	186,926.46
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		357,686.32	-16,829,959.27
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		357,686.32	-16,829,959.27

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 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）	135,106,747.60	-19,893,679.28	115,213,068.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	357,686.32	357,686.32
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）	-4,688,162.36	553,149.03	-4,135,013.33
其中：1. 基金申购款	6,050,339.27	-822,780.47	5,227,558.80
2. 基金赎回款	-10,738,501.63	1,375,929.50	-9,362,572.13
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）	130,418,585.24	-18,982,843.93	111,435,741.31

项目	上年度可比期间		
	2011 年 1 月 1 日至 2011 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)	128,960,277.40	25,669,928.04	154,630,205.44
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	-16,829,959.27	-16,829,959.27
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)	-130,151.10	-400,555.48	-530,706.58
其中：1.基金申购款	36,420,234.03	6,334,281.46	42,754,515.49
2.基金赎回款	-36,550,385.13	-6,734,836.94	-43,285,222.07
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)	128,830,126.30	8,439,413.29	137,269,539.59

报表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：

基金管理公司负责人：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

金鹰红利价值灵活配置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")证监许可[2008]521号文《关于金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》、基金部函字[2008]509号文《关于金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金备案确认的函》批准，于2008年12月4日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为367,018,547.39份基金份额。本基金募集期间自2008年10月8日起至2008年11月29日止，认购金额为366,942,740.65元，认购资金在认购期间的银行利息75,806.74元折算成基金资产。上述资金已于2008年12月4日全额划入本基金在基金托管人交通银行开立的本基金托管专户。验资机构为立信羊城会计师事务所。本基金的基金管理人为金鹰基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

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

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日止会计期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无差错更正。

6.4.6 税项

1、印花税

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）交易印花税率，由原先的 1‰调整为 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政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税；

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）交易印花税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，证券（股票）交易印花税调整为单边征税，由出让方按证券（股票）交易印花税率缴纳印花税，受

让方不再征收, 税率不变。

2、营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

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政策问题的通知》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应缴纳的企业所得税；

3、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，对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、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，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红利所得，按照财税[2005]102 号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按 50% 计算应纳税所得额；

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政策问题的通知》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应缴纳的个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
活期存款	129,879.94
定期存款	-
其他存款	-
合计	129,879.94

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2012年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		86,937,133.78	86,726,855.01	-210,278.77
债券	交易所市场	10,123,100.00	10,564,452.12	441,352.12
	银行间市场	-	-	-
	合计	10,123,100.00	10,564,452.12	441,352.12
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		97,060,233.78	97,291,307.13	231,073.35

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应收活期存款利息	28.07
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	8,172.06
应收债券利息	243,250.48
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.78
其他	-
合计	251,451.39

6.4.7.6 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	267,817.63
银行间市场应付交易费用	-
合计	267,817.63

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	242.18
预提审计费	83,847.82
预提信息披露费	368,849.96
合计	952,939.96

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	135,106,747.60	135,106,747.60
本期申购	6,050,339.27	6,050,339.27
本期赎回（以“-”号填列）	-10,738,501.63	-10,738,501.63
本期末	130,418,585.24	130,418,585.24

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,917,775.42	-23,811,454.70	-19,893,679.28
本期利润	-10,882,785.85	11,240,472.17	357,686.32
本期基金份额交易产生	115,742.24	437,406.79	553,149.03

的变动数			
其中：基金申购款	-149,524.23	-673,256.24	-822,780.47
基金赎回款	265,266.47	1,110,663.03	1,375,929.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-6,849,268.19	-12,133,575.74	-18,982,843.93

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2012年1月1日至2012年6月30日
活期存款利息收入	16,505.80
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	185,245.76
其他	0.78
合计	201,752.34

6.4.7.11 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2012年1月1日至2012年6月30日
卖出股票成交总额	360,336,626.33
减：卖出股票成本总额	370,134,050.88
买卖股票差价收入	-9,797,424.55

6.4.7.12 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2012年1月1日至2012年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	10,207,942.02
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	9,876,900.00
减：应收利息总额	122,333.19
债券投资收益	208,708.83

6.4.7.13 衍生工具收益**6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期末未进行权证投资。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2012年1月1日至2012年6月30日
股票投资产生的股利收益	360,984.14
基金投资产生的股利收益	-
合计	360,984.14

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期
	2012年1月1日至2012年6月30日
1.交易性金融资产	11,240,472.17
——股票投资	10,799,120.05
——债券投资	441,352.12
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	11,240,472.17

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2012年1月1日至2012年6月30日
基金赎回费收入	11,141.17
其他	-
转出费	565.56
合计	11,706.73

6.4.7.17 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
交易所市场交易费用	1,091,359.37
银行间市场交易费用	-
合计	1,091,359.37

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
审计费用	27,847.82
信息披露费	149,178.12
银行间市场账户维护费	9,000.00
银行汇划费用	1,302.74
合计	187,328.68

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至资产负债表日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期内关联方无发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
金鹰基金管理有限公司	基金发起人、管理人
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付给关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年 6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	863,693.63	1,113,920.74
其中：支付销售机构的客户维护费	217,096.96	292,736.25

注：1、基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金管理费

E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；由基金管理人向基金托管人发送基金管理人报酬划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2012年1月1日至2012年 6月30日	2011年1月1日至2011年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	143,948.85	185,653.50

注：1、基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

2、基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内，从基金资产中一次性支付，若遇节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付给关联方的销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付给关联方的销售服务费。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2012年1月1日至2012年6 月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6 月30日
期初持有的基金份额	8,988,673.14	0.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	8,988,673.14	0.00
期末持有的基金份额占基金 总份额比例	6.89%	0%

注：公司运用固有资金，通过代销机构购入本基金1000万元，于2011年7月14日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了公告。本报告期与上年同期无可比数据。本报告期无申购、赎回。

6.4.10.4.2 报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

报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2012年1月1日至2012年6月30日		2011年1月1日至2011年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份 有限公司	129,879.94	16,505.80	4,980,996.40	19,647.48
合计	129,879.94	16,505.80	4,980,996.40	19,647.48

注：本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息，在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示。该科目2012年6月30日余额为7,836,192.54元,2011年6月30日余额为11,045,767.74元。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金报告期及上年度可比期间内均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金报告期及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2012年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金报告期末未持有因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险等。基金成立以来，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，致力于内控机制的建立和完善，公司内部管理制度及业务规范流程的制定和完善，加强内部风险的控制与有效防范，以保证各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

为保证公司规范化运作，有效地防范和化解经营风险，确保基金和公司财务和其他信息真实、准确、完整、及时，从而最大程度地保护基金持有人的合法权益，本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了科学合理、控制严密、运行高效的各项管理制度：

(1) 风险管理控制制度

风险控制制度由总则、风险控制的目标和原则、风险控制的机构设置、风险控制的程序、风险类型的界定、风险控制的主要措施、风险控制的具体制度、风险控制制度的监督与评价等部分组成。

风险控制的具体制度主要包括投资风险管理制度、交易风险控制制度、财务风险控制制度、公司资产管理制度等业务风险控制制度，以及岗位分离制度、业务空间隔离制度、作业规则、岗位职责、反馈制度、资料保全制度、保密制度、员工行为守则等程序性风险管理制度。

(2) 投资管理制度

投资管理制度包括研究业务管理制度、投资决策管理制度、基金交易管理制度等。

制订研究业务管理制度的目的是保持研究工作的独立、客观。研究业务管理制度包括：建立严密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法；根据基金合同要求，在充分研究的基础上建立和维护投资对象备选库；建立研究与投资的业务交流制度，保持通畅的交流渠道；建立研究报告质量评价体系。

制订投资决策业务管理制度的目的是严格遵守法律法规的有关规定，确保基金的投资符合基金合同所规定的投资目标、投资范围、投资策略、投资组合和投资限制等要求。投资决策业务管理制度包括投资决策授权制度；投资决策支持制度，重要投资要有详细的研究报告和风险分析支持；投资风险评估与管理制度，在设定的风险权限额度内进行投资决策；投资管理业绩评价制度等。

制订基金交易管理制度的目的是保证基金投资交易的安全、有效、公平。基金交易管理制度包括基金交易的集中交易制度；交易监测、预警、反馈机制；投资指令审核制度；投资指令公平分配制度；交易记录保管制度；交易绩效评价制度等。

(3) 监察稽核制度

公司设立督察长，负责监察稽核工作，督察长由总经理提名，经董事会聘任，对董事会负责，报中国证监会核准。

除应当回避的情况外，督察长可以列席公司相关会议，调阅公司相关档案，就内部控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能。

督察长应当定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况，董事会应当对督察长的报告进行审议。

公司设立监察稽核部门，具体执行监察稽核工作。公司明确规定了监察稽核部门及内部各岗位的具体职责，严格审查监察稽核人员的专业任职条件，配备了充足的合格的监察稽核人员，明确规定了监察稽核的操作程序和组织纪律。

监察稽核制度包括检查公司业务部门和工作人员是否遵守法律、法规、规章的有关规定；检查公司业务部门和工作人员对公司内部控制制度、各项管理制度、业务规章的执行情况；对公司各部门作业流程的遵守合规性和有效性的检查、监督、评价及建议等。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本基金所持有的金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和

外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。

6.4.13.4.1 利率风险

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012年6月30 日	1个月以内	6个月以内	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	129,879.94	-	-	-	-	-	129,879.94
结算备付金	7,836,192.54	-	-	-	-	-	7,836,192.54
存出保证金	-	-	-	-	-	298,590.97	298,590.97
交易性金融资产	-	-	-	10,564,452.12	-	86,726,855.01	97,291,307.13
应收证券清算款	-	-	-	-	-	7,589,674.26	7,589,674.26
应收利息	-	-	-	-	-	251,451.39	251,451.39
应收申购款	-	-	-	-	-	39,043.29	39,043.29
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	7,966,072.48	-	-	10,564,452.12	-	94,905,614.92	113,436,139.52
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	554,780.46	554,780.46
应付赎回款	-	-	-	-	-	64,263.09	64,263.09
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	137,654.65	137,654.65
应付托管费	-	-	-	-	-	22,942.42	22,942.42
应付交易费用	-	-	-	-	-	267,817.63	267,817.63
其他负债	-	-	-	-	-	952,939.96	952,939.96
负债总计	-	-	-	-	-	2,000,398.21	2,000,398.21
利率敏感度缺口	7,966,072.48	-	-	10,564,452.12	-	92,905,216.71	111,435,741.31
上年度末2011	1个月以内	6个月以内	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

年12月31日							
资产							
银行存款	25,426,765.24	-	-	-	-	-	25,426,765.24
结算备付金	14,300,991.56	-	-	-	-	-	14,300,991.56
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	10,000,000.00	-	80,385,633.59	90,385,633.59
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,937,947.01	1,937,947.01
应收利息	-	-	-	-	-	64,856.82	64,856.82
应收申购款	-	-	-	-	-	42,957.18	42,957.18
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	39,727,756.80	-	-	10,000,000.00	-	82,431,394.60	132,159,151.40
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	15,213,934.75	15,213,934.75
应付赎回款	-	-	-	-	-	427,089.55	427,089.55
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	155,346.01	155,346.01
应付托管费	-	-	-	-	-	25,890.99	25,890.99
应付交易费用	-	-	-	-	-	146,540.31	146,540.31
其他负债	-	-	-	-	-	977,281.47	977,281.47
负债总计	-	-	-	-	-	16,946,083.08	16,946,083.08
利率敏感度缺口	39,727,756.80	-	-	10,000,000.00	-	65,485,311.52	115,213,068.32

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 其他变量不变, 只有利率变动通过债券公允价值变动对基金资产净值产生影响。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币)	
		本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日

1.利率上升25个基点	-97,307.17	-95,742.49
2.利率下降25个基点	97,307.17	95,742.49

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日		上年度末 2011年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	86,726,855.01	77.83	80,385,633.59	69.77
交易性金融资产-债券投资	10,564,452.12	9.48	10,000,000.00	8.68
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	97,291,307.13	87.31	90,385,633.59	78.45

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	市场其他变量保持不变，只有业绩比较基准所对应的市场组合价格发生合理、可能的变动；		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币）	
		本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
	业绩比较基准变动+5%	7,328,082.11	7,673,278.43

业绩比较基准变动-5%	-7,328,082.11	-7,673,278.43
-------------	---------------	---------------

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本报告期无其他有助于理解和分析会计报表需要说明的事项。

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	86,726,855.01	76.45
	其中：股票	86,726,855.01	76.45
2	固定收益投资	10,564,452.12	9.31
	其中：债券	10,564,452.12	9.31
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	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	7,966,072.48	7.02
6	其他各项资产	8,178,759.91	7.21
7	合计	113,436,139.52	100.00

注：其他资产包括：交易保证金、应收利息、应收证券清算款、其他应收款、应收申购款。

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	采掘业	9,017,302.83	8.09
C	制造业	33,489,414.14	30.05
C0	食品、饮料	1,711,195.20	1.54

C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	5,885,774.15	5.28
C5	电子	4,281,697.10	3.84
C6	金属、非金属	225,140.89	0.20
C7	机械、设备、仪表	8,775,989.81	7.88
C8	医药、生物制品	12,609,616.99	11.32
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	2,370,161.00	2.13
E	建筑业	9,330,985.87	8.37
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	11,857,561.00	10.64
H	批发和零售贸易	5,386,304.10	4.83
I	金融、保险业	10,288,694.00	9.23
J	房地产业	1,037,195.00	0.93
K	社会服务业	3,949,237.07	3.54
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	86,726,855.01	77.83

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600085	同仁堂	394,659	6,886,799.55	6.18
2	600028	中国石化	1,059,300	6,673,590.00	5.99
3	600050	中国联通	1,788,800	6,654,336.00	5.97
4	601669	中国水电	1,175,951	5,138,905.87	4.61
5	601601	中国太保	211,700	4,695,506.00	4.21
6	002129	中环股份	333,206	4,281,697.10	3.84
7	002480	新筑股份	398,074	4,088,219.98	3.67
8	000861	海印股份	228,199	3,628,364.10	3.26
9	300086	康芝药业	274,603	3,427,045.44	3.08
10	601318	中国平安	73,400	3,357,316.00	3.01

11	300054	鼎龙股份	124,915	2,804,341.75	2.52
12	000690	宝新能源	539,900	2,370,161.00	2.13
13	002509	天广消防	214,229	2,264,400.53	2.03
14	601336	新华保险	65,300	2,235,872.00	2.01
15	300275	梅安森	74,592	2,051,280.00	1.84
16	000888	峨眉山 A	87,789	1,876,928.82	1.68
17	002640	百圆裤业	70,600	1,757,940.00	1.58
18	000848	承德露露	97,504	1,711,195.20	1.54
19	002310	东方园林	26,357	1,547,419.47	1.39
20	002325	洪涛股份	104,084	1,542,524.88	1.38
21	600378	天科股份	161,256	1,394,864.40	1.25
22	300156	天立环保	91,685	1,263,419.30	1.13
23	002683	宏大爆破	76,300	1,240,638.00	1.11
24	000661	长春高新	25,000	1,181,500.00	1.06
25	300171	东富龙	40,700	1,159,950.00	1.04
26	002306	湘鄂情	104,587	1,124,310.25	1.01
27	600062	华润双鹤	58,400	1,114,272.00	1.00
28	600259	广晟有色	16,731	1,103,074.83	0.99
29	002431	棕榈园林	42,735	1,102,135.65	0.99
30	600736	苏州高新	183,250	1,037,195.00	0.93
31	300198	纳川股份	58,900	1,031,339.00	0.93
32	002253	川大智胜	69,857	968,218.02	0.87
33	000931	中关村	164,920	931,798.00	0.84
34	002296	辉煌科技	41,970	841,498.50	0.76
35	002474	榕基软件	27,700	581,423.00	0.52
36	600570	恒生电子	39,359	540,005.48	0.48
37	600596	新安股份	58,400	361,496.00	0.32
38	600389	江山股份	34,155	293,733.00	0.26
39	300075	数字政通	9,600	220,800.00	0.20
40	002271	东方雨虹	16,000	217,600.00	0.20
41	002573	国电清新	900	16,200.00	0.01
42	002445	中南重工	723	7,540.89	0.01

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初基金资产净值 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	占期初基金 资产净值比 例 (%)
1	600028	中国石化	14,331,782.00	12.44
2	601669	中国水电	12,702,629.00	11.03
3	600050	中国联通	12,618,870.00	10.95
4	002480	新筑股份	10,752,131.02	9.33
5	600085	同仁堂	7,708,861.96	6.69
6	002325	洪涛股份	6,559,630.08	5.69
7	002024	苏宁电器	6,019,480.51	5.22
8	300086	康芝药业	5,763,462.47	5.00
9	002431	棕榈园林	5,591,426.53	4.85
10	600739	辽宁成大	5,166,115.00	4.48
11	002413	常发股份	5,024,343.41	4.36
12	600153	建发股份	4,675,440.71	4.06
13	002296	辉煌科技	4,625,125.29	4.01
14	002129	中环股份	4,574,494.99	3.97
15	002310	东方园林	4,542,958.20	3.94
16	601601	中国太保	4,536,592.72	3.94
17	600995	文山电力	4,535,587.22	3.94
18	000861	海印股份	4,523,240.05	3.93
19	002509	天广消防	4,325,578.26	3.75
20	002445	中南重工	4,317,500.51	3.75
21	300241	瑞丰光电	4,139,615.90	3.59
22	601766	中国南车	3,985,889.35	3.46
23	002387	黑牛食品	3,985,556.29	3.46
24	300275	梅安森	3,754,138.80	3.26
25	300107	建新股份	3,735,284.10	3.24
26	600880	博瑞传播	3,690,937.89	3.20
27	002253	川大智胜	3,649,400.53	3.17
28	000850	华茂股份	3,624,061.52	3.15
29	002205	国统股份	3,620,487.90	3.14
30	002457	青龙管业	3,601,198.97	3.13
31	600468	百利电气	3,480,966.26	3.02
32	600125	铁龙物流	3,440,518.04	2.99
33	600048	保利地产	3,436,207.68	2.98

34	600316	洪都航空	3,433,549.80	2.98
35	600389	江山股份	3,370,251.28	2.93
36	600837	海通证券	3,322,526.00	2.88
37	601318	中国平安	3,305,744.64	2.87
38	002091	江苏国泰	3,018,307.88	2.62
39	002379	鲁丰股份	3,008,274.00	2.61
40	300156	天立环保	3,008,086.15	2.61
41	601002	晋亿实业	2,975,498.00	2.58
42	002306	湘鄂情	2,961,134.75	2.57
43	300032	金龙机电	2,928,753.94	2.54
44	601299	中国北车	2,876,037.00	2.50
45	600694	大商股份	2,863,115.57	2.49
46	002620	瑞和股份	2,842,188.40	2.47
47	002405	四维图新	2,827,216.78	2.45
48	601106	中国一重	2,808,460.72	2.44
49	002414	高德红外	2,789,809.42	2.42
50	600259	广晟有色	2,673,805.42	2.32
51	000519	江南红箭	2,632,398.68	2.28
52	300054	鼎龙股份	2,610,361.45	2.27
53	600596	新安股份	2,608,735.00	2.26
54	002640	百圆裤业	2,440,868.00	2.12
55	600268	国电南自	2,408,641.63	2.09
56	002673	西部证券	2,346,579.40	2.04
57	002221	东华能源	2,312,717.23	2.01

注：该表的累计买入金额按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,未考虑相关交易费用。

7.4.2 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

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	占期初基金资产净值比例(%)
1	600028	中国石化	14,896,009.48	12.93
2	600050	中国联通	12,604,107.91	10.94
3	002480	新筑股份	12,570,597.81	10.91
4	002325	洪涛股份	9,742,911.39	8.46

5	002445	中南重工	9,531,974.38	8.27
6	601669	中国水电	7,272,587.03	6.31
7	000861	海印股份	7,196,815.43	6.25
8	600085	同仁堂	5,779,660.89	5.02
9	002024	苏宁电器	5,603,430.78	4.86
10	600739	辽宁成大	5,500,095.80	4.77
11	600048	保利地产	5,223,361.00	4.53
12	600378	天科股份	5,205,558.42	4.52
13	002253	川大智胜	5,074,356.70	4.40
14	600153	建发股份	5,020,234.48	4.36
15	002413	常发股份	4,789,325.94	4.16
16	600995	文山电力	4,652,336.02	4.04
17	600831	广电网络	4,650,241.64	4.04
18	002431	棕榈园林	4,567,207.89	3.96
19	601333	广深铁路	4,561,919.02	3.96
20	002129	中环股份	4,446,964.41	3.86
21	300241	瑞丰光电	4,257,651.36	3.70
22	002296	辉煌科技	4,220,360.24	3.66
23	002387	黑牛食品	4,179,036.96	3.63
24	300086	康芝药业	4,075,664.54	3.54
25	601766	中国南车	4,051,427.62	3.52
26	600316	洪都航空	3,696,476.72	3.21
27	600088	中视传媒	3,684,942.50	3.20
28	300107	建新股份	3,645,722.53	3.16
29	600880	博瑞传播	3,633,050.00	3.15
30	002310	东方园林	3,616,452.79	3.14
31	000850	华茂股份	3,487,460.40	3.03
32	600837	海通证券	3,480,978.00	3.02
33	600125	铁龙物流	3,385,539.95	2.94
34	002457	青龙管业	3,335,470.74	2.90
35	000519	江南红箭	3,228,395.78	2.80
36	000961	中南建设	3,210,065.64	2.79
37	000888	峨眉山 A	3,185,689.75	2.77
38	300032	金龙机电	3,153,217.70	2.74
39	002620	瑞和股份	3,139,779.91	2.73
40	600468	百利电气	3,113,876.30	2.70

41	002091	江苏国泰	3,031,630.05	2.63
42	601002	晋亿实业	2,956,577.60	2.57
43	002379	鲁丰股份	2,950,546.03	2.56
44	002205	国统股份	2,876,485.12	2.50
45	601299	中国北车	2,864,075.46	2.49
46	002405	四维图新	2,842,568.94	2.47
47	601106	中国一重	2,834,482.29	2.46
48	002671	龙泉股份	2,678,161.92	2.32
49	600694	大商股份	2,677,689.47	2.32
50	600389	江山股份	2,628,841.25	2.28
51	002414	高德红外	2,560,979.95	2.22
52	300004	南风股份	2,486,179.70	2.16
53	002448	中原内配	2,421,782.11	2.10
54	002221	东华能源	2,409,991.74	2.09
55	600963	岳阳林纸	2,371,880.78	2.06

注：该表的累计卖出金额按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,未考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	365,676,152.25
卖出股票的收入（成交）总额	360,336,626.33

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	10,564,452.12	9.48
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-

9	合计	10,564,452.12	9.48
---	----	---------------	------

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	112068	11 棕榈债	65,851	6,881,429.50	6.18
2	112053	11 新筑债	35,380	3,683,022.62	3.31

注：本基金期末持有2只债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金报告期末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

本基金报告期末未持有权证。

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末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	298,590.97
2	应收证券清算款	7,589,674.26
3	应收股利	-
4	应收利息	251,451.39
5	应收申购款	39,043.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,178,759.91

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期期末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
9,473	13,767.40	10,444,675.76	8.01%	119,973,909.48	91.99%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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基金	679.11	0.0005%

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（2008年12月4日）基金份额总额	367,018,547.39
本报告期期初基金份额总额	135,106,747.60
本报告期基金总申购份额	6,050,339.27
减：本报告期基金总赎回份额	10,738,501.63
本报告期基金拆分变动份额	-

本报告期末基金份额总额

130,418,585.24

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本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

基金托管人交通银行于 2012 年 5 月 28 日刊公布了《交通银行股份有限公司关于资产托管部总经理变更的公告》，交通银行资产托管部原总经理谷娜莎同志不再担任资产托管部总经理职务。资产托管部总理由刘树军担任。具体内容请参阅在 2012 年 5 月 30 日《上海证券报》上发布的《交通银行股份有限公司关于资产托管部总经理变更的公告》。

本基金管理人报告期内未发生重大人事变动。

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

因负责本公司基金审计事务的立信羊城会计师事务所有限公司已整体加入立信会计师事务所（特殊普通合伙），并已经完成相关变更登记手续，经公司第四届董事会第三次会议决议通过，并经基金托管银行同意，本报告期公司将负责公司基金审计事务的会计师事务所变更为立信会计师事务所（特殊普通合伙）。上述事项已向监管机关备案并于 2012 年 1 月 20 日进行了公告。

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的情况

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	
中投证券	1	123,802,811.77	17.05%	101,627.40	17.26%	-
银河证券	2	115,509,763.76	15.91%	93,316.54	15.85%	-
国联证券	2	93,375,695.09	12.86%	76,287.80	12.96%	-
国都证券	1	53,475,105.28	7.37%	40,775.45	6.92%	-

中信建投证券	1	48,329,938.34	6.66%	39,268.62	6.67%	-
海通证券	1	47,399,410.40	6.53%	40,289.18	6.84%	-
安信证券	1	44,386,331.34	6.11%	36,064.19	6.12%	-
中银国际证券	1	42,231,809.72	5.82%	33,295.03	5.65%	-
财达证券	1	39,661,537.24	5.46%	33,712.02	5.73%	-
中信证券	2	34,267,544.48	4.72%	27,842.67	4.73%	-
信达证券	1	28,036,008.84	3.86%	21,895.23	3.72%	-
国信证券	1	25,714,083.00	3.54%	20,150.60	3.42%	-
国泰君安	1	23,741,952.44	3.27%	19,290.61	3.28%	-
华创证券	2	6,080,786.88	0.84%	5,006.22	0.85%	-
江南证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
山西证券(天相投资)	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
兴安证券	1	-	-	-	-	-

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；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。

2、本基金与本基金管理人旗下托管在交通银行股份有限公司其他基金共用交易席位。

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
中投证券	4,254,038.86	42.18%	-	-	-	-
银河证券	2,342,634.94	23.23%	78,600,000.00	15.15%	-	-
国联证券	-	-	94,500,000.00	18.22%	-	-
国都证券	-	-	154,500,000.00	29.78%	-	-
中信建投证 券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	40,300,000.00	7.77%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证 券	-	-	30,500,000.00	5.88%	-	-
财达证券	-	-	97,100,000.00	18.72%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	23,300,000.00	4.49%	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	3,488,935.03	34.59%	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
江南证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
山西证券(天 相投资)	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
兴安证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	金鹰基金管理有限公司关于旗下开放式基金净值的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报	2012-01-04

2	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华夏银行基金网上银行和定投申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-01-04
3	金鹰基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新已过期身份证件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-01-06
4	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金新增国海证券为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-01-11
5	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金变更会计师事务所的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-01-20
6	金鹰基金关于增加中信证券（浙江）为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-02-16
7	金鹰基金管理有限公司关于运用公司自有资金认购旗下开放式基金的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-02-29
8	关于网上直销增加通联支付第三方支付业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-03-01
9	关于网上直销增加通联支付第三方支付业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-03-01
10	关于继续参加工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-04-06
11	关于提醒投资者及时更新已过期身份证件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-04-20
12	金鹰基金管理有限公司关于网站、网上直销、客服电话暂停服务的通知	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-04-28
13	关于网上直销中国农业银行支付渠道升级维护暂停服务的通知	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-05-18
14	关于旗下部分基金增加众禄基金为代销机构并开通定投、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-06-06
15	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华龙证券为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-06-13
16	金鹰基金管理有限公司关于旗下开放式基金资产净值等的公告	证券时报	2012-06-30

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。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金发行及募集的文件。
- 2、《金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、《金鹰红利价值灵活配置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、半年度报告、更新的招募说明书及其他临时公告。

12.2 存放地点

广州市天河区体育西路 189 号城建大厦 22-23 层

12.3 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
二〇一二年八月二十八日