

---

金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金  
2012 年年度报告  
2012 年 12 月 31 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：二〇一三年三月二十八日

## § 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 2013 年 3 月 27 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。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§ 1	重要提示及目录 .....	1
1.1	重要提示 .....	1
§ 2	基金简介 .....	4
2.1	基金基本情况 .....	4
2.2	基金产品说明 .....	4
2.3	基金管理人和基金托管人 .....	4
2.4	信息披露方式 .....	5
2.5	其他相关资料 .....	5
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 .....	5
3.1	主要会计数据和财务指标 .....	5
3.2	基金净值表现 .....	6
3.3	过去三年基金的利润分配情况 .....	8
§ 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 .....	9
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	9
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	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	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	11
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	12
4.8	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运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	13
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	13
§ 6	审计报告 .....	13
6.1	管理层对财务报表的责任 .....	13
6.2	注册会计师的责任 .....	13
6.3	审计意见 .....	14
§ 7	年度财务报表 .....	14
7.1	资产负债表 .....	14
7.2	利润表 .....	16
7.3	所有者权益（基金净值）变动表 .....	17
7.4	报表附注 .....	18
§ 8	投资组合报告 .....	41
8.1	期末基金资产组合情况 .....	41
8.2	期末按行业分类的股票投资组合 .....	41
8.3	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 .....	42
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动 .....	43
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	47
8.6	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 .....	48
8.7	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 .....	48
8.8	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 .....	48

---

8.9	投资组合报告附注 .....	48
§ 9	基金份额持有人信息 .....	49
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
§ 10	开放式基金份额变动 .....	50
§ 11	重大事件揭示 .....	50
11.1	基金份额持有人大会决议.....	50
11.2	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.....	50
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
11.4	基金投资策略的改变 .....	50
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	51
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
11.8	其他重大事件 .....	53
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息.....	55
§ 13	备查文件目录 .....	55
13.1	备查文件目录 .....	55
13.2	存放地点 .....	56
13.3	查阅方式 .....	56

## § 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	127,699,557.04 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	裴学敏
	联系电话	020-83282627	021-32169999
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	zh_jjb@bankcomm.com
客户服务电话		4006135888,020-83936180	95559

传真	020-83282856	021-62701262
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	上海市仙霞路18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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.gefund.com.cn">http://www.gefund.com.cn</a>
基金年度报告备置地点	广州市天河区体育西路189号城建大厦22-23楼

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	立信会计师事务所公司（特殊普通合伙）	上海市黄浦区南京东路61号四楼
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

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2012 年	2011 年	2010 年
本期已实现收益	-18,719,075.59	-29,786,235.93	25,705,430.38
本期利润	-2,724,248.03	-46,131,343.19	14,267,699.79
加权平均基金份额本期利润	-0.0207	-0.3458	0.0922
本期加权平均净值利润率	-2.45%	-32.44%	8.10%
本期基金份额净值增长率	-2.56%	-28.88%	8.93%
3.1.2 期末数据和指标	2012 年末	2011 年末	2010 年末
期末可供分配利润	-21,582,229.90	-19,893,679.28	25,669,928.04
期末可供分配基金份额利润	-0.1690	-0.1472	0.1991
期末基金资产净值	106,117,327.14	115,213,068.32	154,630,205.44
期末基金份额净值	0.8310	0.8528	1.1991

3.1.3 累计期末指标	2012 年末	2011 年末	2010 年末
基金份额累计净值增长率	12.25%	15.19%	61.97%

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、期末可供分配利润，指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

## 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
过去三个月	2.03%	0.75%	3.91%	0.61%	-1.88%	0.14%
过去六个月	-2.74%	0.80%	-0.61%	0.62%	-2.13%	0.18%
过去一年	-2.56%	0.91%	0.32%	0.65%	-2.88%	0.26%
过去三年	-24.51%	1.18%	-12.61%	0.78%	-11.90%	0.40%
自基金合同生效起至今	12.25%	1.31%	35.32%	0.98%	-23.07%	0.33%

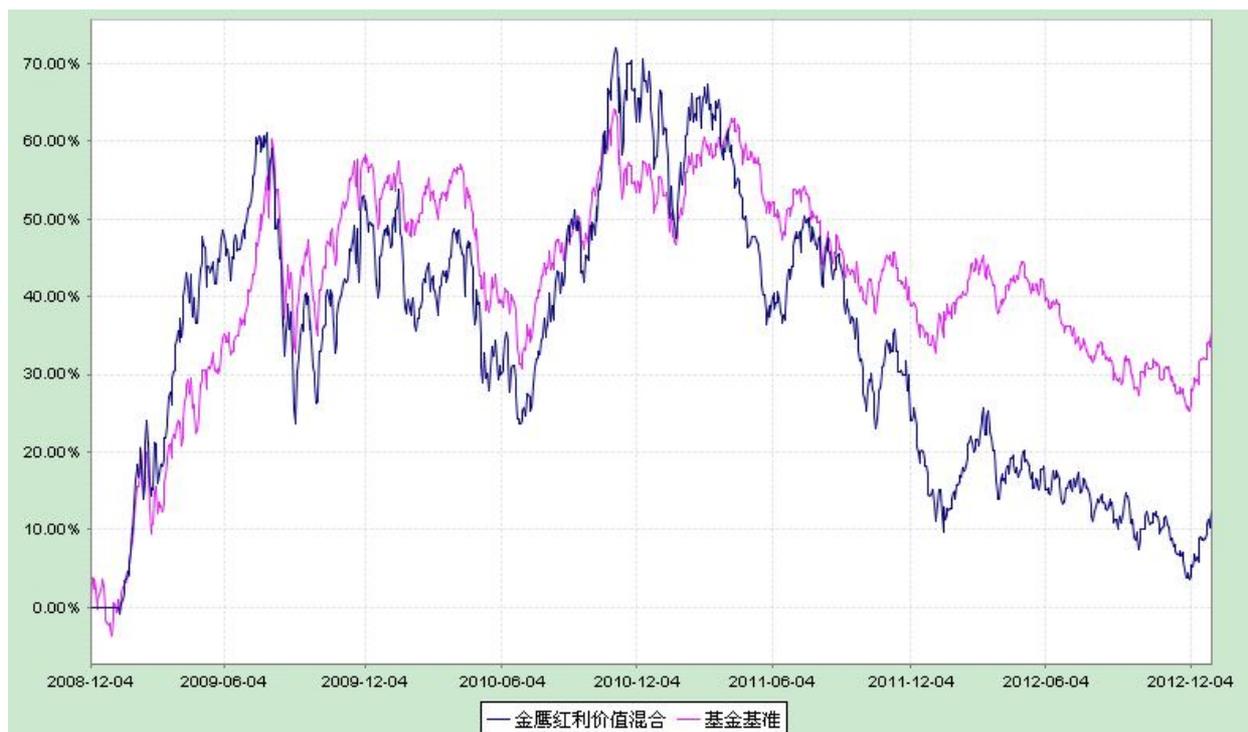
注：本基金的业绩比较基准为富时中国 A 股红利 150 指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。

### 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

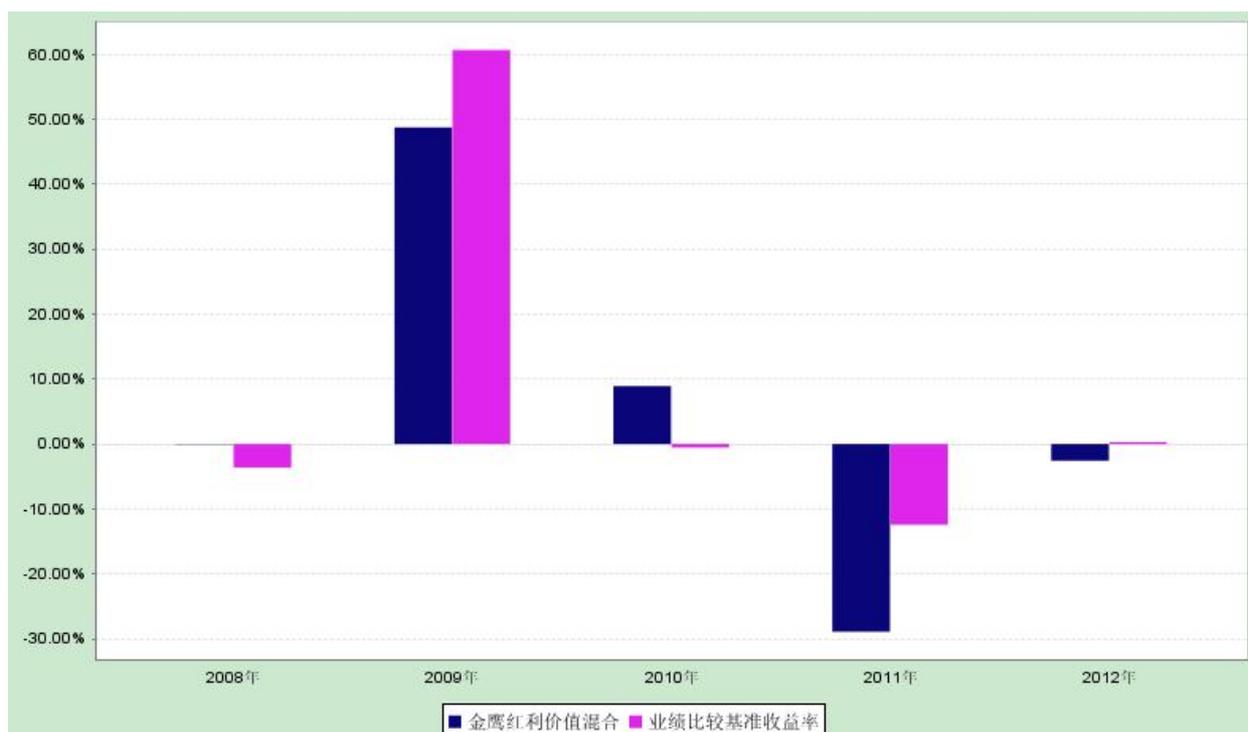
（2008 年 12 月 4 日至 2012 年 12 月 31 日）



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%。

### 3.2.3 合同生效日以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金  
合同生效日以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

金额单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2010	1.000	8,959,560.71	5,951,225.30	14,910,786.01	-
合计	1.000	8,959,560.71	5,951,225.30	14,910,786.01	-

注：上年度及本报告期本基金未实施利润分配。

## § 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 12 月 31 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、金鹰中证 500 指数分级证券投资基金、金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金和金鹰货币市场证券投资基金十四只开放式基金。

#### 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（助理）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 年	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，现任本基金基金经理以及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《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 公平交易制度和控制方法

为了保证本基金管理人的各类投资者和委托人享受到平等的资产管理服务,保证本基金管理人管理

的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益，本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，以及公司内控大纲的要求，制定了《金鹰基金管理有限公司公平交易制度》并严格执行。

同时，本基金管理人自主开发了公平交易数量分析系统，该系统能够实现对公司旗下任意两个资产管理账户在一定期间内买卖相同证券的差价率与差价金额进行统计分析，设置了包括：正向交易占比、差价率 t 检验值等监控指标，并设置预警阈值，通过定期或不定期对公司旗下各资产管理账户的公平交易执行情况进行预警、分析和提示。

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 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的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2012 年市场峰回路转，上证综指涨 3.17%，深证成指涨 2.22%，中小板指数和创业板指数分别下跌 -1.38% 和 -2.14%。全年分季度看：一季度在 2011 年股市下跌较多的背景下，在流动性放松和经济见底的预期下，市场迎来一波上涨；二季度市场等待经济好转，上下波动；三季度由于没有看到经济明显好转迹象同时对政府换届预期不清晰，市场一路向下；四季度国内经济出现了企稳迹象，工业增加值缓慢回升，投资从 9 月开始明显加速，同时政府换届后预期明确，市场最后一个月大幅上涨，全年指数翻红。

本基金全年维持中等仓位，主要的仓位配置以自下而上的个股为主，主题方面主要配置了铁路板

块。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2012 年 12 月 31 日, 基金份额净值为 0.8310 元, 本报告期份额净值增长率为-2.56%, 同期业绩比较基准增长率为 0.32%

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从过往历史看, 市场上涨一般分为两波: 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, 二季度市场处于横盘震荡等待基本面改善的阶段; 三季度基本面仍未出现明显的改善, 市场选择向下。而国内经济终于从 9 月份开始有了企稳迹象, 工业增加值缓慢回升, 投资从 9 月开始明显加速, 房地产销量年底出现价量齐涨, 这一切基本面的共振终于带来了市场在 12 月份急速的报复性上涨。

我们认为从 12 月开始的上涨, 属于基本面好转后的第二波上涨, 具备可持续性。现在市场的分歧在于: 2013 年经济到底是弱复苏还是强复苏? 如果是弱复苏, 估计 2013 年 2 季度后看到的经济好转信号就会非常有限, 市场空间就比较有限。但是如果 2013 年的经济是一个强复苏的格局, 2013 年市场就可能有比较大上涨空间。目前我们更偏好认为 2013 年会是一个强复苏格局, 基金仓位会维持在较高的仓位。但是一旦我们确认经济是一个弱复苏, 或者通胀开始明显抬头, 我们会修正我们的观点。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内, 监察稽核工作根据独立、客观、公正的原则, 按照规定的权限和程序独立开展本基金运作的合规性监察, 认真履行职责, 通过材料审阅、监督监控、覆盖检查、重点抽查等多种方法开展工作, 督促各项业务的合规运作, 发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告, 定期向公司董事会和监管部门出具监察稽核报告。

本报告期有关本基金的监察稽核内容包括投资、交易、研究、市场营销、信息披露等各项业务的每个环节以及信息技术、运营保障、行政管理等后台支持工作, 重点对基金投资、研究、营销宣传的合规性进行检查。监察结果显示, 本报告期内公司对本基金的管理始终都能按照法律法规、基金合同、基金招募说明书的要求和公司制度的规定进行。本基金的投资决策、投资交易程序、投资权限等各方面均符合规定的要求; 交易行为合法合规, 未出现异常交易、操纵市场的现象; 未发现内幕交易的情

况；基金持有的证券符合规定的比例要求；基金专用交易席位年度交易量比例符合证监会的有关规定；相关的信息披露真实、完整、准确、及时；销售工作合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 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，本公司还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、基金管理部总监、固定收益部总监、专户投资部总监、基金经理、投资经理、基金会计和相关人员组成。在特殊情况下，公司召集估值委员会会议，讨论和决策特殊估值事项，估值委员会问题决策，需到会的三分之二估值委员会成员表决通过。

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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内本基金无利润分配。

### § 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运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2012 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 审计报告

信会师报字【2013】第 430008 号

金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金全体份额持有人：

我们审计了后附的金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“金鹰红利价值混合基金”）2012 年 12 月 31 日的资产负债表和 2012 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

### 6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是金鹰红利价值混合基金的基金管理人的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

### 6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 6.3 审计意见

我们认为，金鹰红利价值混合基金财务报表已经按照企业会计准则的规定编制，在所有重大方面公允反映了金鹰红利价值混合基金 2012 年 12 月 31 日的财务状况和 2012 年度的经营成果和净值变动情况。

立信会计师事务所公司（特殊普通合伙） 注册会计师 张宁 刘国棣  
上海市黄浦区南京东路 61 号四楼  
2013-03-26

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
<b>资 产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	257,995.97	25,426,765.24
结算备付金		950,968.36	14,300,991.56
存出保证金		119,716.11	-
交易性金融资产	7.4.7. 2	114,633,675.67	90,385,633.59
其中：股票投资		65,856,160.99	80,385,633.59
基金投资		-	-
债券投资		48,777,514.68	10,000,000.00
资产支持证券投资		-	-

衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产	7.4.7.3	-	-
应收证券清算款		1,356,435.33	1,937,947.01
应收利息	7.4.7.4	1,170,259.89	64,856.82
应收股利		-	-
应收申购款		32,425.02	42,957.18
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		118,521,476.35	132,159,151.40
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2012年12月31日</b>	<b>上年度末 2011年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
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		9,400,000.00	-
应付证券清算款		1,591,645.76	15,213,934.75
应付赎回款		120,259.57	427,089.55
应付管理人报酬		129,871.37	155,346.01
应付托管费		21,645.21	25,890.99
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.5	184,274.12	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	7.4.7.6	956,453.18	977,281.47
负债合计		12,404,149.21	16,946,083.08
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.7	127,699,557.04	135,106,747.60
未分配利润	7.4.7.8	-21,582,229.90	-19,893,679.28
所有者权益合计		106,117,327.14	115,213,068.32
负债和所有者权益总计		118,521,476.35	132,159,151.40

注：报告截止日 2012 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.8310 元，基金份额总额 127,699,557.04 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2012年1月1日至2012年12 月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12 月31日
<b>一、收入</b>		<b>1,304,442.18</b>	<b>-40,562,159.04</b>
1. 利息收入		1,373,353.39	816,368.60
其中：存款利息收入	7.4.7.9	305,286.85	560,272.15
债券利息收入		867,469.22	46,575.34
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		200,597.32	209,521.11
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-16,083,750.45	-25,104,126.18
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-17,249,421.38	-25,489,490.30
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	608,811.87	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	7.4.7.12	556,859.06	385,364.12
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.13	15,994,827.56	-16,345,107.26
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	20,011.68	70,705.80
<b>减：二、费用</b>		<b>4,028,690.21</b>	<b>5,569,184.15</b>
1. 管理人报酬		1,665,867.84	2,136,341.48
2. 托管费		277,644.53	356,056.99
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.15	1,719,588.65	2,700,129.45
5. 利息支出		8,155.79	-
其中：卖出回购金融资产支出		8,155.79	-
6. 其他费用	7.4.7.16	357,433.40	376,656.23
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-2,724,248.03</b>	<b>-46,131,343.19</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-2,724,248.03</b>	<b>-46,131,343.19</b>

## 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31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）	-	-2,724,248.03	-2,724,248.03
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）	-7,407,190.56	1,035,697.41	-6,371,493.15
其中：1. 基金申购款	11,384,145.32	-1,756,383.45	9,627,761.87
2. 基金赎回款	-18,791,335.88	2,792,080.86	-15,999,255.02
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）	127,699,557.04	-21,582,229.90	106,117,327.14
项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31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）	-	-46,131,343.19	-46,131,343.19
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）	6,146,470.20	567,735.87	6,714,206.07
其中：1. 基金申购款	55,787,131.39	7,486,521.02	63,273,652.41
2. 基金赎回款	-49,640,661.19	-6,918,785.15	-56,559,446.34
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）	135,106,747.60	-19,893,679.28	115,213,068.32

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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。

### 7.4.2 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。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本年度报告中财务报表的编制遵守了企业会计准则及其他有关规定,真实、完整地反映了本基金于2012年12月31日的财务状况以及2012年度的经营成果和净值变动情况。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期(2011年)年度报告一致。

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年1月1日至12月31日。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

### (1) 金融资产分类

金融资产应当在初始确认时划分为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项，以及可供出售金融资产。金融资产分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。

本基金将持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）于初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金将持有的其他金融资产划分为贷款和应收款项，包括银行存款和各类应收款项等。

### (2) 金融负债分类

金融负债应当在初始确认时划分为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债两类。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

基金初始确认金融资产或金融负债，应当按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票投资、债券投资等，以及不作为有效套期工具的衍生金融工具，相关的交易费用在发生时计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，相关交易费用在发生时计入初始确认金额。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量。

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，其中包括同时结转的公允价值变动收益。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）。本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了

金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账。

因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价，于股权分置改革方案实施后的股票复牌日，冲减股票投资成本。

卖出股票于成交日确认股票投资收益，出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

#### (2) 债券投资

买入证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本。

买入未上市债券和银行间同业市场交易的债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交总额扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本。

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限计算应收利息，按上述会计处理方法核算。

卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券投资收益。

卖出未上市债券和银行间同业市场交易的债券于成交日确认债券投资收益。

卖出债券的成本按移动加权平均法结转。

#### (3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账。

配股权证及由股权分置改革而被动获得的权证，在确认日记录所获分配的权证数量，该类权证初始成本为零。

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，出售权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

#### (4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本。

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算。

#### (5)回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购）以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金目前金融资产和金融负债的估值原则和方法如下：

##### 1、股票估值原则和方法

###### (1) 上市流通股票的估值

上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

###### (2) 未上市股票的估值

送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

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

###### (3) 长期停牌股票的估值

已停牌股票且潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，则相应股票采用指数收益法确定其公允价值。指数收益法是指对于需要进行估值的股票，在估值日以公开发布的相应交易市场和相应行业指数的日收益率作为该股票的收益率，然后根据此收益率计算该股票当日的公允价值。

###### (4) 有明确锁定期股票的估值

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的收盘价估值；非公开发行且处于明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

##### 2、固定收益证券的估值原则和方法

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘净价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重

大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息(自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息)得到的净价进行估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去所含的最近交易日债券应收利息后的净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(3) 未上市债券采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。

(4) 在银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

(5) 交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量。

(6) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

### 3、权证估值原则和方法

(1) 配股权证的估值：

因持有股票而享有的配股权，类同权证处理方式的，采用估值技术进行估值。

(2) 认沽/认购权证的估值：

从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的认沽/认购权证按估值日的最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。未上市交易的认沽/认购权证采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值；停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

### 4、其他资产的估值原则和方法

其他资产按照国家有关规定或行业约定进行估值。

5、在任何情况下，基金管理人采用上述 1-4 项规定的方法对基金财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人有着充足的理由认为按上述方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素的基础上与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

6、国家有最新规定的，按其规定进行估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵

销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现平准金与已实现平准金均在"损益平准金"科目中核算，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

1、存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

2、债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

3、资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，在证券实际持有期内逐日计提；

4、买入返售金融资产收入,按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

5、股票投资收益于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额入账；

6、债券投资收益于卖出债券成交日确认，并按卖出债券成交金额与其成本、应收利息的差额入账；

7、衍生工具投资收益于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交总额与其成本的差额入账；

8、股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

9、公允价值变动收益系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

10、其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

- 1、基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5%的年费率逐日计提；
- 2、基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率逐日计提；
- 3、卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；
- 4、其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第五位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

- 1、基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式（指将现金红利按分红权益再投资日经过除权后的基金份额净值为计算基准自动转为基金份额进行再投资），基金份额持有人可选择现金方式或红利再投资方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；
- 2、每一基金份额享有同等分配权；
- 3、基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；
- 4、基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值；
- 5、如果基金当期出现亏损，则不进行收益分配；
- 6、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多 4 次；
- 7、每次基金收益分配比例不得低于可分配收益的 50%。基金合同生效不满 3 个月，收益可不分配；
- 8、分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红，分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红；
- 9、法律、法规或监管机构另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 外币交易

本基金本年度无外币交易。

#### 7.4.4.13 分部报告

本基金本年度无分部报告。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本年度无其他重要的会计政策和会计估计。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本年度无会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本年度无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本年度无差错更正。

### 7.4.6 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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
活期存款	257,995.97	25,426,765.24
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	257,995.97	25,426,765.24

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	61,147,359.98	65,856,160.99	4,708,801.01
债券	交易所市场	48,500,886.95	48,777,514.68
	银行间市场	-	-
	合计	48,500,886.95	48,777,514.68
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	109,648,246.93	114,633,675.67	4,985,428.74
项目	上年度末 2011 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	91,395,032.41	80,385,633.59	-11,009,398.82
债券	交易所市场	10,000,000.00	10,000,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	10,000,000.00	10,000,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	101,395,032.41	90,385,633.59	-11,009,398.82

**7.4.7.3 买入返售金融资产****7.4.7.3.1 各项买入返售金融资产期末余额**

报告期末及上年度末本基金未持有买入返售金融资产。

**7.4.7.4 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
应收活期存款利息	96.60	5,091.88
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	3,618.08	10,257.57
应收债券利息	1,166,543.73	46,575.34
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	1.48	2,932.03
其他	-	-
合计	1,170,259.89	64,856.82

**7.4.7.5 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
交易所市场应付交易费用	184,274.12	146,540.31
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	184,274.12	146,540.31

**7.4.7.6 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
应付券商交易单元保证金	500,000.00	500,000.00
应付赎回费	453.18	1,609.63
预提审计费	56,000.00	56,000.00
预提信息披露费	400,000.00	419,671.84
合计	956,453.18	977,281.47

**7.4.7.7 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12月31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	11,384,145.32	11,384,145.32
本期赎回（以“-”号填列）	-18,791,335.88	-18,791,335.88
本期末	127,699,557.04	127,699,557.04

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.8 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	-18,719,075.59	15,994,827.56	-2,724,248.03
本期基金份额交易产生的变动数	348,301.96	687,395.45	1,035,697.41
其中：基金申购款	-562,983.42	-1,193,400.03	-1,756,383.45
基金赎回款	911,285.38	1,880,795.48	2,792,080.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-14,452,998.21	-7,129,231.69	-21,582,229.90

#### 7.4.7.9 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12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
活期存款利息收入	24,476.43	56,324.49
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	280,808.94	503,931.53
其他	1.48	16.13
合计	305,286.85	560,272.15

注：其他存款利息收入为申购款利息收入。

#### 7.4.7.10 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12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
卖出股票成交总额	576,281,105.71	891,370,011.70
减：卖出股票成本总额	593,530,527.09	916,859,502.00
买卖股票差价收入	-17,249,421.38	-25,489,490.30

#### 7.4.7.11 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12月	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
----	--------------------------	----------------------------------

	31日	日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	20,623,980.13	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	19,746,439.02	-
减：应收利息总额	268,729.24	-
债券投资收益	608,811.87	-

**7.4.7.12 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
股票投资产生的股利收益	556,859.06	385,364.12
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	556,859.06	385,364.12

**7.4.7.13 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
1. 交易性金融资产	15,994,827.56	-16,345,107.26
——股票投资	15,718,199.83	-16,345,107.26
——债券投资	276,627.73	-
——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	15,994,827.56	-16,345,107.26

**7.4.7.14 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
基金赎回费收入	19,359.62	62,116.21
基金转出费收入	652.06	8,589.59
合计	20,011.68	70,705.80

**7.4.7.15 交易费用**

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12月31日	2011年1月1日至2011年12月31日
交易所市场交易费用	1,718,801.61	2,700,129.45
银行间市场交易费用	787.04	-
合计	1,719,588.65	2,700,129.45

**7.4.7.16 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
审计费用	56,000.00	56,000.00
信息披露费	280,328.16	299,946.00
银行间市场账户维护费	18,000.00	18,000.00
银行汇划费用	2,605.24	2,710.23
其他	500.00	-
合计	357,433.40	376,656.23

**7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****7.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

**7.4.8.2 资产负债表日后事项**

截止本财务报告批准报出日，本基金没有重大须作披露的资产负债表日后事项。

**7.4.9 关联方关系**

关联方名称	与本基金的关系
广州证券有限责任公司	基金管理人股东、基金代销机构
广州药业股份有限公司	基金管理人股东
广东美的电器股份有限公司	基金管理人股东
东亚联丰投资管理有限公司	基金管理人股东
金鹰基金管理有限公司	基金发起人、管理人、销售机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

**7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****7.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
-------	-----------------------------	----------------------------------

	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广州证券	215,446,659.29	18.91%	144,693,887.10	8.12%

#### 7.4.10.1.2 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。

#### 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广州证券	41,727,907.25	71.42%	-	-

#### 7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
广州证券	48,200,000.00	3.26%	-	-

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广州证券	186,824.29	19.77%	117,457.96	63.74%
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广州证券	-	-	-	-
	117,565.03	7.99%	41,763.06	28.50%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除中国证券登记结算公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务

等。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31 日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,665,867.84	2,136,341.48
其中：支付销售机构的客户维护费	415,818.76	552,275.50

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。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31 日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	277,644.53	356,056.99

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。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间均无应付给关联方的销售服务费。

#### 7.4.10.3 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与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 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	上年度可比期间
	2012年1月1日至2012年12月31日	2011年1月1日至2011年12月31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	0.00	8,988,673.14
期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
期末持有的基金份额	8,988,673.14	8,988,673.14
期末持有的基金份额占基金总份额比例	7.04%	6.65%

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。本报告期无申购、赎回。

##### 7.4.10.4.2 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

报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 7.4.10.5 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12月31日		2011年1月1日至2011年12月31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	257,995.97	24,476.43	25,426,765.24	56,324.49

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，在资产负债表中“结算备付金”科目中单独列示，按银行同业利率计息。结算备付金 2012 年末余额 950,968.36 元，当期结算备付金利息收入 280,808.94 元；结算备付金 2011 年末余额为 14,300,991.56 元，当期结算备付金利息收入为 503,931.53 元。

**7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内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。

**7.4.11 利润分配情况**

本基金报告期内无利润分配情况。

**7.4.12 期末（2012 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券****7.4.12.1 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。

**7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600728	佳都新太	2012-12-07	公司筹划重大事项	8.62	2013-03-21	9.48	174,233	1,708,962.67	1,501,888.46	-

**7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金报告期末无银行间市场债券正回购。

**7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金报告期末无交易所市场债券正回购。

**7.4.13 金融工具风险及管理**

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。

**7.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

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各业务部门和工作人员是否遵守法律、法规、规章的有关规定；检查公司各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。

#### 7.4.13.2 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。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估控制证券发行人的信用风险，建立了内部评级体系，通过内部评级与外部评级相结合的方法充分评估证券以及交易对手的信用风险。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年末 2011 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：本统计数据未包含国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债。

##### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年末 2011 年 12 月 31 日
AAA	7,584,000.00	0.00

AAA 以下	14,906,498.18	10,000,000.00
未评级	0.00	0.00
合计	22,490,498.18	10,000,000.00

注：本统计数据未包含国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债。

#### 7.4.13.3 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同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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012年12 月31日	1个月以 内	1-3 个月	6个月 以内	3个月 -1年	6个月-1 年	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产										
银行存款	257,995.9 7	-	-	-	-	-	-	-	-	257,995.9 7
结算备付 金	950,968.3 6	-	-	-	-	-	-	-	-	950,968.3 6
存出保证	-	-	-	-	-	-	-	-	119,716.1	119,716.1

金									1	1
交易性金融资产	-	-	-	-	-	9,977,000.00	22,490,498.18	16,310,016.50	65,856,160.99	114,633,675.67
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	1,356,435.33	1,356,435.33
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	1,170,259.89	1,170,259.89
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	32,425.02	32,425.02
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,208,964.33	-	-	-	-	9,977,000.00	22,490,498.18	16,310,016.50	68,534,997.34	118,521,476.35
负债										
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-	-	9,400,000.00	9,400,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	1,591,645.76	1,591,645.76
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	120,259.57	120,259.57
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	129,871.37	129,871.37
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	21,645.21	21,645.21
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	184,274.12	184,274.12
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	956,453.18	956,453.18
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	12,404,149.21	12,404,149.21
利率敏感	1,208,964	-	-	-	-	9,977,000	22,490,49	16,310,01	56,130,84	106,117,3

度缺口	.33					.00	8.18	6.50	8.13	27.14
上年度末 2011年12 月31日	1个月以 内	1-3个月	6个月以 内	3个月-1 年	6个月-1 年	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产										
银行存款	25,426,76 5.24	-	-	-	-	-	-	-	-	25,426,76 5.24
结算备付 金	14,300,99 1.56	-	-	-	-	-	-	-	-	14,300,99 1.56
存出保证 金	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
交易性金 融资产	-	-	-	-	-	-	10,000,00 0.00	-	80,385,63 3.59	90,385,63 3.59
买入返售 金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
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	39,727,75 6.80	-	-	-	-	-	10,000,00 0.00	-	82,431,39 4.60	132,159,1 51.40
负债										
卖出回购 金融资产 款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付证券 清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	15,213,93 4.75	15,213,93 4.75
应付赎回 款	-	-	-	-	-	-	-	-	427,089.5 5	427,089.5 5
应付管理 人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	155,346.0 1	155,346.0 1

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

#### 7.4.13.4.1.2 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：人民币元）	
		本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
	1. 利率上升 25 个基点	-383,828.71	-95,742.49
	2. 利率下降 25 个基点	383,828.71	95,742.49

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他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。本基金所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31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	65,856,160.99	62.06	80,385,633.59	69.77
交易性金融资产-债券投资	48,777,514.68	45.97	10,000,000.00	8.68
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

合计	114,633,675.67	108.03	90,385,633.59	78.45
----	----------------	--------	---------------	-------

## 7.4.13.4.3.2 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：人民币元）	
		本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
	业绩比较基准变动+5%	5,823,120.98	7,673,278.43
	业绩比较基准变动-5%	-5,823,120.98	-7,673,278.43

## § 8 投资组合报告

## 8.1 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	65,856,160.99	55.56
	其中：股票	65,856,160.99	55.56
2	固定收益投资	48,777,514.68	41.16
	其中：债券	48,777,514.68	41.16
	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	1,208,964.33	1.02
6	其他各项资产	2,678,836.35	2.26
7	合计	118,521,476.35	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。

## 8.2 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	-	-
C	制造业	15,800,052.10	14.89
C0	食品、饮料	1,522,462.40	1.43

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	1,006,018.40	0.95
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	5,900,866.66	5.56
C8	医药、生物制品	7,370,704.64	6.95
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	12,050,098.58	11.36
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	15,751,795.56	14.84
H	批发和零售贸易	7,994,511.90	7.53
I	金融、保险业	7,837,964.00	7.39
J	房地产业	3,198,426.55	3.01
K	社会服务业	3,223,312.30	3.04
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	65,856,160.99	62.06

### 8.3 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	000861	海印股份	401,871	5,666,381.10	5.34
2	600085	同仁堂	287,492	5,123,107.44	4.83
3	601669	中国水电	1,162,569	4,441,013.58	4.19
4	601166	兴业银行	239,600	3,998,924.00	3.77
5	002480	新筑股份	310,961	3,887,012.50	3.66
6	601169	北京银行	412,800	3,839,040.00	3.62
7	601668	中国建筑	879,600	3,430,440.00	3.23
8	300275	梅安森	124,851	3,308,551.50	3.12
9	000888	峨眉山 A	167,011	3,223,312.30	3.04
10	600256	广汇能源	195,145	3,198,426.55	3.01
11	601800	中国交建	603,100	3,196,430.00	3.01
12	300288	朗玛信息	45,650	3,000,118.00	2.83
13	300005	探路者	136,148	2,328,130.80	2.19
14	300267	尔康制药	117,368	2,247,597.20	2.12

15	300171	东富龙	55,264	1,654,604.16	1.56
16	600498	烽火通信	72,060	1,640,085.60	1.55
17	000063	中兴通讯	166,600	1,624,350.00	1.53
18	000716	南方食品	155,990	1,522,462.40	1.43
19	600728	佳都新太	174,233	1,501,888.46	1.42
20	300075	数字政通	49,200	1,466,160.00	1.38
21	300050	世纪鼎利	112,500	1,109,250.00	1.05
22	002115	三维通信	147,100	1,076,772.00	1.01
23	300054	鼎龙股份	37,538	1,006,018.40	0.95
24	002431	棕榈园林	42,705	982,215.00	0.93
25	300299	富春通信	36,800	528,448.00	0.50
26	002396	星网锐捷	32,600	496,172.00	0.47
27	300124	汇川技术	15,000	359,250.00	0.34

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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	20,662,374.00	17.93
2	601669	中国水电	18,288,294.70	15.87
3	002480	新筑股份	15,978,841.04	13.87
4	600085	同仁堂	14,692,723.15	12.75
5	600050	中国联通	12,618,870.00	10.95
6	000861	海印股份	11,334,435.86	9.84
7	002024	苏宁电器	10,094,246.51	8.76
8	300275	梅安森	9,851,257.13	8.55
9	002129	中环股份	8,348,625.88	7.25
10	002431	棕榈园林	7,627,037.80	6.62
11	600378	天科股份	7,170,451.39	6.22
12	002325	洪涛股份	6,559,630.08	5.69
13	002296	辉煌科技	6,528,959.91	5.67
14	600141	兴发集团	6,315,136.08	5.48
15	300086	康芝药业	6,293,620.47	5.46
16	600259	广晟有色	5,922,618.14	5.14
17	000888	峨眉山 A	5,654,042.88	4.91
18	002509	天广消防	5,633,880.77	4.89
19	002414	高德红外	5,626,482.87	4.88
20	002253	川大智胜	5,289,655.76	4.59

21	300054	鼎龙股份	5,200,263.51	4.51
22	600739	辽宁成大	5,166,115.00	4.48
23	600256	广汇能源	5,155,814.09	4.48
24	600389	江山股份	5,037,223.28	4.37
25	002413	常发股份	5,024,343.41	4.36
26	002306	湘鄂情	4,929,875.65	4.28
27	002445	中南重工	4,879,990.51	4.24
28	600153	建发股份	4,675,440.71	4.06
29	002310	东方园林	4,542,958.20	3.94
30	601601	中国太保	4,536,592.72	3.94
31	600995	文山电力	4,535,587.22	3.94
32	002448	中原内配	4,469,295.38	3.88
33	300241	瑞丰光电	4,139,615.90	3.59
34	300267	尔康制药	4,129,648.59	3.58
35	600499	科达机电	4,120,500.95	3.58
36	300171	东富龙	4,050,357.40	3.52
37	601766	中国南车	3,985,889.35	3.46
38	002387	黑牛食品	3,985,556.29	3.46
39	300098	高新兴	3,947,524.28	3.43
40	002671	龙泉股份	3,831,415.42	3.33
41	300107	建新股份	3,735,284.10	3.24
42	600880	博瑞传播	3,690,937.89	3.20
43	000850	华茂股份	3,624,061.52	3.15
44	002205	国统股份	3,620,487.90	3.14
45	002457	青龙管业	3,601,198.97	3.13
46	600109	国金证券	3,578,109.00	3.11
47	300148	天舟文化	3,569,932.50	3.10
48	300198	纳川股份	3,486,378.58	3.03
49	600468	百利电气	3,480,966.26	3.02
50	601166	兴业银行	3,457,638.00	3.00
51	601169	北京银行	3,456,755.00	3.00
52	600125	铁龙物流	3,440,518.04	2.99
53	600048	保利地产	3,436,207.68	2.98
54	300156	天立环保	3,435,796.15	2.98
55	600316	洪都航空	3,433,549.80	2.98
56	002673	西部证券	3,361,230.40	2.92
57	600837	海通证券	3,322,526.00	2.88
58	601318	中国平安	3,305,744.64	2.87
59	600596	新安股份	3,168,302.00	2.75
60	002091	江苏国泰	3,018,307.88	2.62
61	002379	鲁丰股份	3,008,274.00	2.61

62	000716	南方食品	2,995,937.13	2.60
63	601002	晋亿实业	2,975,498.00	2.58
64	000338	潍柴动力	2,939,669.98	2.55
65	300032	金龙机电	2,928,753.94	2.54
66	600495	晋西车轴	2,919,912.01	2.53
67	601800	中国交建	2,905,123.00	2.52
68	601668	中国建筑	2,884,496.00	2.50
69	601299	中国北车	2,876,037.00	2.50
70	600694	大商股份	2,863,115.57	2.49
71	300288	朗玛信息	2,853,378.70	2.48
72	002620	瑞和股份	2,842,188.40	2.47
73	002405	四维图新	2,827,216.78	2.45
74	601106	中国一重	2,808,460.72	2.44
75	002474	榕基软件	2,779,115.52	2.41
76	600184	光电股份	2,762,924.01	2.40
77	000697	炼石有色	2,722,450.67	2.36
78	300101	国腾电子	2,704,412.50	2.35
79	000519	江南红箭	2,632,398.68	2.28
80	300005	探路者	2,551,424.00	2.21
81	002640	百圆裤业	2,440,868.00	2.12
82	600268	国电南自	2,408,641.63	2.09
83	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。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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	27,933,012.68	24.24
2	600050	中国联通	19,258,443.91	16.72
3	002480	新筑股份	18,660,239.82	16.20
4	600085	同仁堂	14,708,912.34	12.77
5	601669	中国水电	14,283,300.93	12.40
6	002129	中环股份	11,597,181.95	10.07
7	600378	天科股份	11,593,334.46	10.06
8	000861	海印股份	11,390,673.20	9.89
9	002325	洪涛股份	11,305,405.81	9.81
10	002445	中南重工	10,005,273.61	8.68
11	002024	苏宁电器	9,311,039.31	8.08
12	300086	康芝药业	7,678,669.27	6.66
13	002253	川大智胜	7,315,805.84	6.35

14	300275	梅安森	6,889,250.67	5.98
15	600141	兴发集团	6,799,303.65	5.90
16	002296	辉煌科技	6,547,341.74	5.68
17	002431	棕榈园林	6,505,217.05	5.65
18	002509	天广消防	5,863,138.74	5.09
19	000888	峨眉山 A	5,638,789.21	4.89
20	600739	辽宁成大	5,500,095.80	4.77
21	002414	高德红外	5,327,975.31	4.62
22	600048	保利地产	5,223,361.00	4.53
23	600389	江山股份	5,203,496.14	4.52
24	600259	广晟有色	5,141,692.07	4.46
25	002310	东方园林	5,127,064.05	4.45
26	600153	建发股份	5,020,234.48	4.36
27	002413	常发股份	4,789,325.94	4.16
28	002306	湘鄂情	4,745,548.73	4.12
29	600995	文山电力	4,652,336.02	4.04
30	600831	广电网络	4,650,241.64	4.04
31	601333	广深铁路	4,561,919.02	3.96
32	601601	中国太保	4,555,782.10	3.95
33	002448	中原内配	4,542,506.85	3.94
34	300054	鼎龙股份	4,468,474.03	3.88
35	002671	龙泉股份	4,385,561.92	3.81
36	300241	瑞丰光电	4,257,651.36	3.70
37	002387	黑牛食品	4,179,036.96	3.63
38	601766	中国南车	4,051,427.62	3.52
39	300098	高新兴	4,010,705.16	3.48
40	300004	南风股份	3,913,458.60	3.40
41	002474	榕基软件	3,754,803.10	3.26
42	600499	科达机电	3,705,468.72	3.22
43	600316	洪都航空	3,696,476.72	3.21
44	600088	中视传媒	3,684,942.50	3.20
45	300107	建新股份	3,645,722.53	3.16
46	600880	博瑞传播	3,633,050.00	3.15
47	000850	华茂股份	3,487,460.40	3.03
48	600837	海通证券	3,480,978.00	3.02
49	300156	天立环保	3,414,997.62	2.96
50	600125	铁龙物流	3,385,539.95	2.94
51	600109	国金证券	3,376,550.00	2.93
52	002457	青龙管业	3,335,470.74	2.90
53	000338	潍柴动力	3,262,809.21	2.83
54	002673	西部证券	3,229,461.92	2.80

55	000519	江南红箭	3,228,395.78	2.80
56	601318	中国平安	3,210,836.79	2.79
57	000961	中南建设	3,210,065.64	2.79
58	300198	纳川股份	3,169,834.65	2.75
59	600596	新安股份	3,157,167.41	2.74
60	300032	金龙机电	3,153,217.70	2.74
61	300148	天舟文化	3,141,403.58	2.73
62	002620	瑞和股份	3,139,779.91	2.73
63	600468	百利电气	3,113,876.30	2.70
64	002091	江苏国泰	3,031,630.05	2.63
65	600495	晋西车轴	2,979,728.50	2.59
66	601002	晋亿实业	2,956,577.60	2.57
67	002379	鲁丰股份	2,950,546.03	2.56
68	002205	国统股份	2,876,485.12	2.50
69	601299	中国北车	2,864,075.46	2.49
70	002405	四维图新	2,842,568.94	2.47
71	601106	中国一重	2,834,482.29	2.46
72	600694	大商股份	2,677,689.47	2.32
73	600256	广汇能源	2,658,934.13	2.31
74	600184	光电股份	2,591,003.93	2.25
75	002369	卓翼科技	2,533,477.00	2.20
76	000697	炼石有色	2,528,070.88	2.19
77	300171	东富龙	2,457,471.42	2.13
78	002221	东华能源	2,409,991.74	2.09
79	600963	岳阳林纸	2,371,880.78	2.06
80	300101	国腾电子	2,310,099.50	2.01

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。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	563,282,854.66
卖出股票的收入（成交）总额	576,281,105.71

#### 8.5 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	26,287,016.50	24.77
2	央行票据	-	-

3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	22,490,498.18	21.19
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	48,777,514.68	45.97

#### 8.6 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	019006	10 国债 06	100,000	9,977,000.00	9.40
2	010303	03 国债(3)	89,060	8,683,350.00	8.18
3	010107	21 国债(7)	72,850	7,626,666.50	7.19
4	112068	11 棕榈债	73,971	7,622,711.55	7.18
5	126011	08 石化债	79,000	7,584,000.00	7.15

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 投资组合报告附注

**8.9.1** 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。

**8.9.2** 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。

#### 8.9.3 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	119,716.11

2	应收证券清算款	1,356,435.33
3	应收股利	-
4	应收利息	1,170,259.89
5	应收申购款	32,425.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,678,836.35

#### 8.9.4 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。

#### 8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末前十名股票中无流通受限情况。

#### 8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### § 9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (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
9,898	12,901.55	10444675.76	8.18%	117254881.28	91.82%

#### 9.2 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	1,883.97	0.0015%

注：1、截至本报告期末，本基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本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本基金份额总量的数量区间为 0。

## § 10 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	11,384,145.32
减：本报告期基金总赎回份额	18,791,335.88
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	127,699,557.04

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 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。资产托管部总经理职务由刘树军同志担任。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。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金审计的会计师事务所为立信会计师事务所（特殊普通合伙）。

本报告期内应支付会计师事务所的审计费为 56000 元。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

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	
安信证券	1	44,386,331.34	3.90%	36,064.19	3.82%	-
财达证券	1	39,661,537.24	3.48%	33,712.02	3.57%	-
广州证券	2	215,446,659.29	18.91%	186,824.29	19.78%	-
国都证券	1	65,584,195.34	5.76%	51,202.55	5.42%	-
国联证券	2	147,449,784.21	12.94%	120,883.13	12.80%	-
国泰君安	1	25,635,861.04	2.25%	20,895.70	2.21%	-
国信证券	1	48,978,366.39	4.30%	40,552.70	4.29%	-
海通证券	1	47,399,410.40	4.16%	40,289.18	4.27%	-
华创证券	2	15,911,003.38	1.40%	13,532.67	1.43%	-
信达证券	1	53,463,481.48	4.69%	44,233.03	4.68%	-
银河证券	1	137,585,953.90	12.07%	112,115.39	11.87%	-
中投证券	1	137,979,756.28	12.11%	113,642.47	12.03%	-
中信建投证券	1	50,707,891.17	4.45%	41,372.87	4.38%	-
中信证券	1	34,267,544.48	3.01%	27,842.67	2.95%	-
中银国际证券	1	75,106,184.43	6.59%	61,413.55	6.50%	-
合计	18	1,139,563,960.37	100.00%	944,576.41	100.00%	-

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、个股分析报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，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。

### 11.7.2 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		股指期货交易	
	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	成交金额	占当期成交总额的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	97,100,000.00	6.57%	-	-	-	-
广州证券	41,727,907.25	71.42%	48,200,000.00	3.26%	-	-	-	-
国都证券	-	-	184,500,000.00	12.48%	-	-	-	-
国联证券	-	-	234,900,000.00	15.89%	-	-	-	-
国泰君安	3,488,935.03	5.97%	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	174,100,000.00	11.78%	-	-	-	-
海通证券	-	-	40,300,000.00	2.73%	-	-	-	-
华创证券	2,892,381.20	4.95%	12,300,000.00	0.83%	-	-	-	-
信达证券	-	-	90,800,000.00	6.14%	-	-	-	-
银河证券	2,342,634.93	4.01%	78,600,000.00	5.32%	-	-	-	-
中投证券	7,973,757.42	13.65%	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国	-	-	517,100,000.00	34.99%	-	-	-	-

际证券								
合计	58,425,615.83	100.00%	1,477,900,000.00	100.00%	-	-	-	-

### 11.8 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
3	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
4	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
5	金鹰基金关于增加中信证券（浙江）为代销机构以及开通基金定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-02-16
6	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
7	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
8	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	2012-04-20
9	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
10	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
11	金鹰基金管理有限公司关于新增顺德农商行为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012-07-17
12	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金增加天天基金为代销机构并开通定投、转换业务以及参加相关费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012-07-19
13	关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012-07-20
14	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金在银河证券开通定投业务以及参加相关费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012-07-31
15	金鹰基金管理有限公司关于网上直销通联支付新增支持银行卡并开展费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012-08-06
16	金鹰基金管理有限公司关于新增江海证券为旗下部分基金代销机构并开通定投业务、参与网上交易费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012-08-06
17	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金	中国证券报、证券时	2012-08-23

	新增长量基金销售为代销机构并开通定投、转换业务以及参加相关费率优惠活动的公告	报、上海证券报	
18	金鹰基金管理有限公司关于因系统升级暂停网上直销服务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012-08-25
19	金鹰基金管理有限公司关于网上直销开通广东南粤银行网上下单汇款支付开户业务及开展费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012-08-25
20	金鹰基金管理有限公司关于参加光大证券网上申购费率优惠活动、开通旗下部分基金在光大证券的定投业务以及参与定投费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012-09-04
21	金鹰基金管理有限公司关于网上直销增加银联第三方支付业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012-09-05
22	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国都证券网上申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012-09-18
23	金鹰基金管理有限公司关于新增同花顺基金销售为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012-09-20
24	金鹰基金管理有限公司关于网上直销通联支付新增支持交通银行卡并开展费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012-09-25
25	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增展恒基金销售为代销机构并开通定投、转换业务以及参加相关费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012-10-09
26	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、证券时报、上海证券报	2012-10-13
27	金鹰基金管理有限公司关于网上直销开通手机委托业务同时继续开展相关费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012-10-18
28	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增同花顺基金销售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、证券时报、上海证券报	2012-10-18
29	金鹰基金管理有限公司关于网上直销增加易购通第三方支付业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012-10-22
30	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增诺亚正行基金销售为代销机构并开通定投、转换业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012-10-26
31	金鹰基金管理有限公司关于新增新时代证券为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012-11-19
32	金鹰基金管理有限公司关于网上直销易宝	中国证券报、证券时	2012-11-20

	支付新增支持银行卡并继续开展费率优惠的公告	报、上海证券报	
33	金鹰基金管理有限公司关于网上直销易宝支付新增支持银行卡并继续开展费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012-11-22
34	金鹰基金管理有限公司关于网上直销增加支付宝第三方支付业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012-11-28
35	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国银行定投费率优惠的公告	证券时报	2012-12-03
36	金鹰基金管理有限公司关于网上直销系统升级维护暂停服务的通知	证券时报	2012-12-03
37	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠的公告	证券时报	2012-12-04
38	金鹰基金管理有限公司关于网上直销开通赎回转认/申购业务的公告	证券时报	2012-12-05
39	金鹰基金管理有限公司关于第一代居民身份证停止使用的提示公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012-12-27
40	金鹰基金管理有限公司关于网上直销开通电话委托业务同时继续开展相关费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012-12-27

注：相关信息披露文件请登录本基金管理人网站查询。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 1、公司成立深圳分公司

经公司董事会决议通过，并经中国证券监督管理委员会深圳监管局《关于核准金鹰基金管理有限公司设立深圳分公司的批复》（深证局发〔2012〕117号）批复同意，我公司向深圳市市场监管局申请登记设立深圳分公司，分公司负责人为郭容辰，营业场所位于深圳市福田区中国凤凰大厦2栋17G，经营范围是基金销售及公司授权的其他业务。目前相关工商登记注册手续已办理完毕。公司已于2012年7月11日对此事项进行了公开披露。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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。

### 13.2 存放地点

广州市天河区体育西路 189 号城建大厦 22-23 层

### 13.3 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  
二〇一三年三月二十八日