

金鹰中证 500 指数分级证券投资基金
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 6 月 5 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	5
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	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
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	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的说明	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
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	13
§ 5	托管人报告	13
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	14
§ 6	审计报告	14
6.1	管理层对财务报表的责任	14
6.2	注册会计师的责任	14
6.3	审计意见	15
§ 7	年度财务报表	15
7.1	资产负债表	15
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	42
8.1	期末基金资产组合情况	42
8.2	期末按行业分类的股票投资组合	43
8.2.1	指数投资期末按行业分类的股票投资组合	43
8.2.2	积极投资期末按行业分类的股票投资组合	43
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	43
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	56
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	57
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	57

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	57
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	57
8.9	投资组合报告附注	58
§ 9	基金份额持有人信息	58
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
9.2	期末上市基金前十名持有人	59
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	59
§ 10	开放式基金份额变动	60
§ 11	重大事件揭示	60
11.1	基金份额持有人大会决议	60
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	60
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
11.4	基金投资策略的改变	61
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	61
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	61
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
11.8	其他重大事件	63
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息	66
§ 13	备查文件目录	67
13.1	备查文件目录	67
13.2	存放地点	67
13.3	查阅方式	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	金鹰中证 500 指数分级证券投资基金		
基金简称	金鹰中证 500 指数分级		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012 年 6 月 5 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	117,213,594.40 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2012 年 7 月 3 日		
下属分级基金的基金简称	金鹰 500A	金鹰 500B	金鹰 500
下属分级基金的交易代码	150088	150089	162107
报告期末下属分级基金的份额总额	5,732,733.00	5,732,733.00	105,748,128.40

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数基金，以跟踪指数为目标，力求将基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在 0.35% 以下、年跟踪误差控制在 4% 以下。
投资策略	<p>本基金以中证 500 指数成分股在其指数中的基准权重为基础，在综合考察指数成分股的行业构成与市值占比、各行业成分股权重的构成与分散程度、成分股流动性与贝塔值等因素的基础上，采用重点抽样与分层抽样相结合的策略以构建指数化投资组合；若抽样组合内的股票停牌或出现流动性不足等情形时，本基金将根据变化了的新情况，对于抽样组合进行再调整。</p> <p>本基金投资于股票的资产占基金资产净值的比例为 90%~95%，其中，中证 500 指数成分股和备选成分股占基金资产净值的比例不低于 90%；债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券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 5%~10%，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%，权证投资的比例范围占基金资产净值的 0%~3%。</p>
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为中证 500 指数收益率×95%+活期存款利率（税后）

	×5%
风险收益特征	本基金为被动跟踪指数的指数型证券投资基金，属于证券投资基金当中收益、风险较高的品种。一般情形下，其风险和预期收益高于混合型、债券型、货币市场基金。从本基金拆分的两级基金来看，金鹰 500A 具有低风险、预期收益相对稳定的特征，金鹰 500B 具有高风险、高预期收益的特征。

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	http://www.gefund.com.cn
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层

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(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	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区金融大街27号投资广场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 6 月 5 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-11,928,013.57
本期利润	-8,349,489.60
加权平均基金份额本期利润	-0.0474
本期加权平均净值利润率	-4.96%
本期基金份额净值增长率	-3.93%
3.1.2 期末数据和指标	2012 年末
期末可供分配利润	-9,543,533.60
期末可供分配基金份额利润	-0.0814
期末基金资产净值	112,607,219.90
期末基金份额净值	0.9607
3.1.3 累计期末指标	2012 年末
基金份额累计净值增长率	-3.93%

注：1、本基金于 2012 年 6 月 5 日成立，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2、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；

3、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；

4、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	3.49%	1.18%	2.29%	1.37%	1.20%	-0.19%
过去六个月	-4.03%	0.96%	-5.28%	1.39%	1.25%	-0.43%

自基金合同生效起至今	-3.93%	0.89%	-9.02%	1.35%	5.09%	-0.46%
------------	--------	-------	--------	-------	-------	--------

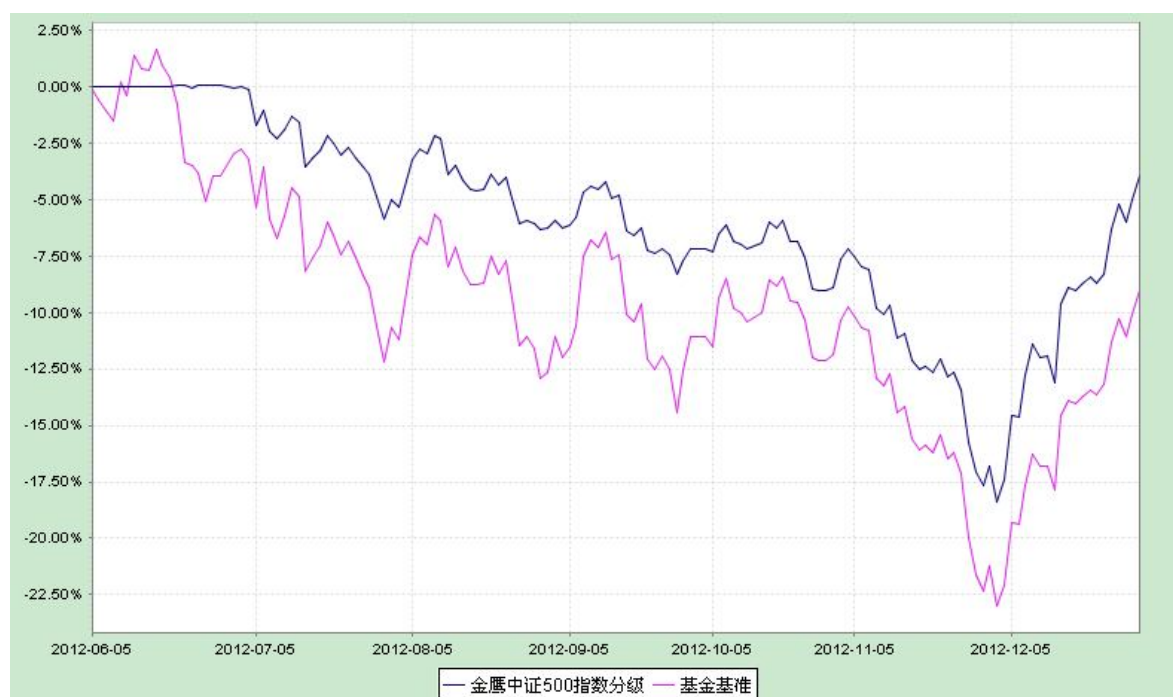
注：本基金业绩比较基准为中证 500 指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%

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

金鹰中证 500 指数分级证券投资基金

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

（2012 年 6 月 5 日至 2012 年 12 月 31 日）

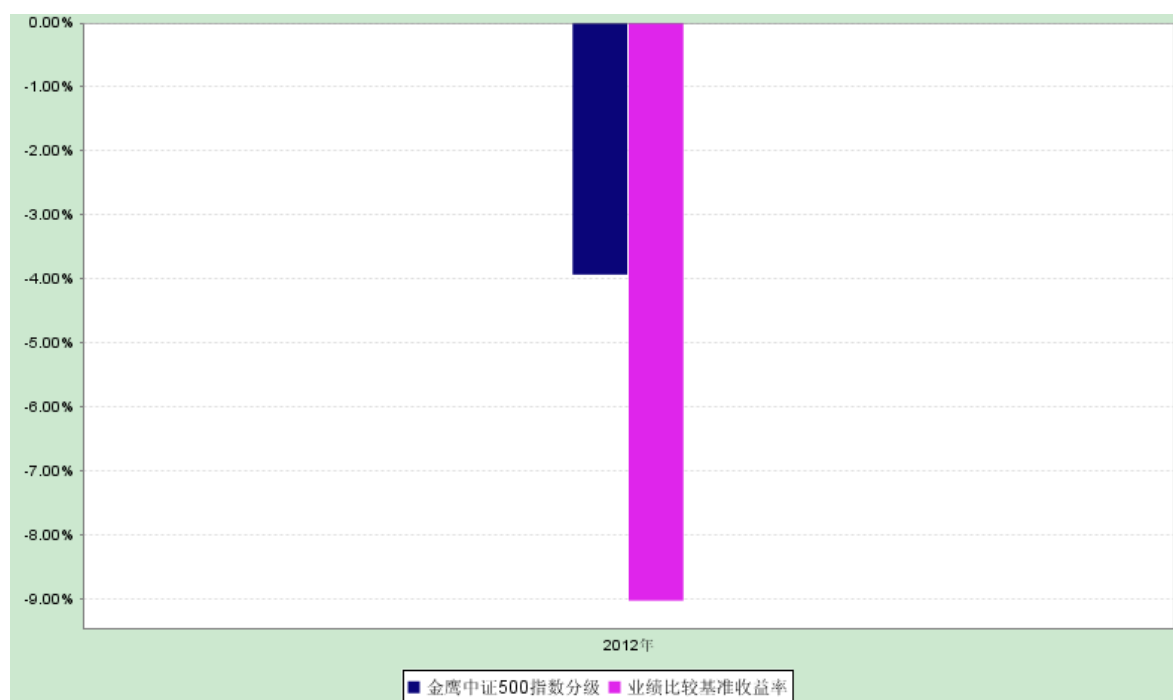


注：1、本基金于 2012 年 6 月 5 日成立。2、按基金合同规定，本基金建仓期为六个月。建仓期满后，本基金的各项投资比例应符合股票资产占基金资产净值的比例为 90%~95%，其中，中证 500 指数成分股和备选成分股占基金资产净值的比例不低于 90%；债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产净值的 5%~10%，其中，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证投资的比例范围占基金资产净值的 0%~3%；3、本基金业绩比较基准为中证 500 指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%

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

金鹰中证 500 指数分级证券投资基金

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

根据本基金基金合同约定，存续期内，本基金（包括金鹰中证 500 份额、金鹰中证 500A 份额、金鹰中证 500B 份额）不进行收益分配。

§ 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		
张永东	金融工程部总监，基金经理	2012-06-07	-	9	张永东先生，工学博士，FRM（金融风险管理师），证券从业经历 9 年，中山大学数学与计算科学学院兼职研究生导师，曾任广发证券和中山大学联合博士后工作站研究人员、广发证券发展研究中心金融工程组负责人、华南理工大学副教授、硕士生导师以及广发基金、天治基金、益民基金金融工程负责人等职。2010 年 7 月加入金鹰基金管理有限公司，现任金融工程部总监、本基金以及金鹰中证技术领先指数

					增强型证券投资基金基金经理。
林华显	基金经 理	2012-06-0 5	-	10	林华显先生 2002 年 10 月进入金鹰基金管理有限公司, 2004 年后开始从事投资研究等工作, 先后任交易员、交易主管、基金经理助理等职。2009 年 10 月 12 日开始担任金鹰成份股优选证券投资基金基金经理助理, 协助基金经理管理金鹰成份股优选证券投资基金, 现任本基金以及金鹰成份股优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。

3、本报告期，本基金增聘张永东先生为基金经理。本基金现由林华显先生和张永东先生共同管理。本基金调整基金经理的公告已于 2012 年 6 月 7 日在指定媒体刊登。

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、《金鹰稳健成长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。

4.3.3 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

本基金于 2012 年 6 月 5 日成立，自成立之日以来，A 股市场整体维持弱势格局，上证指数于第四季度盘中跌至 1949 点，创出三年新低，年底大盘在大盘蓝筹板块的带动下强劲反弹。自成立之日起至报告期末，上证综指下跌 1.71%，中证 500 指数下跌 9.55%，其中，在行业表现上，金融服务、房地产、医药生物、公用事业、建筑建材等行业表现较好，涨幅均为正数；机械设备、商业贸易、纺织服装、食品饮料、采掘、有色金属、信息设备、黑色金属等行业表现较差，跌幅均超过 10% 以上；在风格特征上，低估值组合、大盘股组合（如上证 50、上证 180 成分股组合）显著跑赢其它风格组合。

在报告期内，由于本基金建仓期实施择时优化建仓策略，以及封闭运作期后的大额赎回所引起的股票仓位与基准之间的偏离，致使年化跟踪误差 10.43% 超出了投资目标的限定范围。收益表现上，择时建仓取得了一定的效果，自成立之日起至报告期末的超额收益为 5.09%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金于 2012 年 6 月份完成发行，截至 2012 年 12 月 31 日，本基金基金份额净值为 0.9607

元；自基金合同生效起至本报告期末，份额净值增长率为-3.93%，同期业绩比较基准增长率为-9.02%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济总体处于温和复苏的态势，在新政治经济周期的启动和经济转型的背景下，经济将继续企稳向上，政策变革与经济转型的改革红利以及由此带来的新的行业性机会值得期待，因此，我们总体上判断 2013 年 A 股有望继续延续结构性行情。

本基金建仓期结束后，将继续坚持采用量化策略进行指数复制和风险管理，适时对投资组合进行再平衡调整，力求将跟踪误差控制在投资目标限定范围内。

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

根据本基金基金合同约定，存续期内，本基金（包括金鹰中证 500 份额、金鹰中证 500A 份额、金鹰中证 500B 份额）不进行收益分配。

§ 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，基金托管人在金鹰中证 500 指数分级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遵规守信、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中证 500 指数分级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，符合基金合同的规定。

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中证 500 指数分级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 430012 号

金鹰中证 500 指数分级证券投资基金全体份额持有人：

我们审计了后附的金鹰中证 500 指数分级证券投资基金(简称“金鹰中证 500 指数分级基金”)2012 年 12 月 31 日的资产负债表和 2012 年 6 月 5 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日的利润表、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中证 500 指数分级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，金鹰中证 500 指数分级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中证 500 指数分级基金 2012 年 12 月 31 日的财务状况和 2012 年 6 月 5 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日的经营成果及净值变动情况。

立信会计师事务所（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：金鹰中证 500 指数分级证券投资基金

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
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	2,500,363.15
结算备付金		4,874,680.39
存出保证金		162,890.80
交易性金融资产	7.4.7.2	106,856,777.86
其中：股票投资		106,856,777.86
基金投资		-
债券投资		-
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		-
应收利息	7.4.7.4	2,434.61
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-

其他资产		-
资产总计		114,397,146.81
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012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		-
应付赎回款		1,343,152.85
应付管理人报酬		90,634.37
应付托管费		19,939.55
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.5	101,138.04
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	235,062.10
负债合计		1,789,926.91
所有者权益:		
实收基金	7.4.7.7	117,213,594.40
未分配利润	7.4.7.8	-4,606,374.50
所有者权益合计		112,607,219.90
负债和所有者权益总计		114,397,146.81

注：本基金于 2012 年 6 月 5 日成立，截至报告期末本基金合同生效未满一年。报告截止日 2012 年 12 月 31 日，金鹰 500 份额净值 0.9607 元，基金份额总额 105,748,128.40 份；金鹰 500A 份额净值 1.0402 元，基金份额总额 5,732,733.00 份；金鹰 500B 份额净值 0.8812 元，基金份额总额 5,732,733.00 份。

7.2 利润表

会计主体：金鹰中证 500 指数分级证券投资基金

本报告期：2012 年 6 月 5 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2012年6月5日（基金合同生效日）至2012年12月31日
一、收入		-6,065,723.86

1. 利息收入		1,515,860.19
其中：存款利息收入	7.4.7.9	293,956.66
债券利息收入		36,742.04
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,185,161.49
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-11,501,123.02
其中：股票投资收益	7.4.7.1 0	-11,713,119.08
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.1 1	9,185.58
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益	7.4.7.1 2	202,810.48
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.1 3	3,578,523.97
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.1 4	341,015.00
减：二、费用		2,283,765.74
1. 管理人报酬		949,414.36
2. 托管费		208,871.14
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.1 5	772,212.52
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.1 6	353,267.72
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-8,349,489.60
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-8,349,489.60

注：本基金于 2012 年 6 月 5 日成立，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金鹰中证 500 指数分级证券投资基金

本报告期：2012 年 6 月 5 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2012年6月5日（基金合同生效日）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）	393,471,186.50	-	393,471,186.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-8,349,489.60	-8,349,489.60
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）	-276,257,592.10	3,743,115.10	-272,514,477.00
其中：1. 基金申购款	313,423.51	-16,863.38	296,560.13
2. 基金赎回款	-276,571,015.61	3,759,978.48	-272,811,037.13
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）	117,213,594.40	-4,606,374.50	112,607,219.90

注：本基金于 2012 年 6 月 5 日成立，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

报告附注为财务报表的组成部分

本报告页码从 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

金鹰中证 500 指数分级证券投资基金(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[2012]247 号文《关于核准金鹰中证 500 指数分级证券投资基金募集的批复》、基金部函[2012]458 号文《关于金鹰中证 500 指数分级证券投资基金备案确认的函》批准，于 2012 年 6 月 5 日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定。

本基金募集期间自 2012 年 4 月 23 日起至 2012 年 5 月 29 日止，认购金额及认购期银行利息合计 393,471,186.50 元，于 2012 年 6 月 5 日划至托管银行账户。首次设立募集规模为 393,471,186.50 份，根据《基金合同》约定，其中场外募集资金及其利息确认金鹰 500 份额 341,051,468.50 份，场内募集资金及其利息按 1:1 的比例确认金鹰 500A 份额 26,209,859.00 份和金鹰 500B 份额 26,209,859.00 份。验资机构为立信会计师事务所。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（简称"交通银行"）。

根据《基金合同》约定，每 2 份金鹰中证 500 指数基金场内份额（初始面值为 1 元）按照 1:1 的比例，分拆成预期收益与风险特性不同的两种份额，即：优先获得收益分配权的优先级（称为金鹰 500A，初始面值为 1 元），获得剩余收益分配权的进取级（称为金鹰 500B，初始面值为 1 元）金鹰 500、金鹰 500A、金鹰 500B 三类基金份额的基金资产合并运作。

根据基金合同的约定，每 2 份金鹰 500 场内份额分拆为 1 份金鹰 500A 份额与 1 份金鹰 500B 份额，每 1 份金鹰 500A 份额与 1 份金鹰 500B 份额进行配对，可申请转换成 2 份金鹰 500 份额的场内份额。金鹰 500A 份额与金鹰 500B 份额在深交所上市交易，不可单独申赎。

本基金份额的折算包括定期折算与不定期折算。定期折算为金鹰中证 500 指数分级基金存续期内每个会计年度第一个工作日。不定期折算，当金鹰 500B 份额的基金份额参考净值小于 0.2500（不含 0.2500）元，或金鹰 500 份额净值大于 2.0000（不含 2.0000）时，基金管理人即可确定基金份额折算日。

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

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。

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，2007 年 7 月 1 日前，按协议金额及约定利率，在回购期内采用直线法逐日计提；2007 年 7 月 1 日后，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基金资产净值的 1.0% 的年费率逐日计提；

2、基金托管费按前一日基金资产净值的 0.22% 的年费率逐日计提；

3、基金指数使用费按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率逐日计提，收取下限为每季度 5 万元整，不足 5 万元按 5 万元收取；

4、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；

5、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

根据本基金合同约定，存续期内，本基金（包括金鹰中证 500 份额、金鹰中证 500A 份额、金鹰中证 500B 份额）不进行收益分配。

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

本基金报告期会计政策无变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在报告期间不存在重大会计差错。

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
活期存款	2,500,363.15
定期存款	-
其他存款	-
合计	2,500,363.15

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	103,278,253.89	106,856,777.86	3,578,523.97
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	103,278,253.89	106,856,777.86	3,578,523.97

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

本基金本报告期末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
应收活期存款利息	509.25
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	1,925.36
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	2,434.61

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
交易所市场应付交易费用	101,138.04
银行间市场应付交易费用	-
合计	101,138.04

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
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	5,062.10
预提指数使用费	50,000.00
预提审计费	30,000.00
预提信息披露费	150,000.00
合计	235,062.10

7.4.7.7 实收基金

项目	本期 2012年6月5日（基金合同生效日）至2012年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	393,471,186.50	393,471,186.50
本期申购	313,423.51	313,423.51
本期赎回（以“-”号填列）	-276,571,015.61	-276,571,015.61
本期末	117,213,594.40	117,213,594.40

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-11,928,013.57	3,578,523.97	-8,349,489.60
本期基金份额交易产生的变动数	2,384,479.97	1,358,635.13	3,743,115.10
其中：基金申购款	-23,842.20	6,978.82	-16,863.38
基金赎回款	2,408,322.17	1,351,656.31	3,759,978.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-9,543,533.60	4,937,159.10	-4,606,374.50

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年6月5日（基金合同生效日）至2012年12月31日
活期存款利息收入	78,032.97
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	215,923.69
其他	-
合计	293,956.66

7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年6月5日（基金合同生效日）至2012年12月31日
卖出股票成交总额	216,637,293.79
减：卖出股票成本总额	228,350,412.87
买卖股票差价收入	-11,713,119.08

7.4.7.11 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年6月5日（基金合同生效日）至2012年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	45,719,568.06
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	45,197,940.88
减：应收利息总额	512,441.60
债券投资收益	9,185.58

7.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年6月5日（基金合同生效日）至2012年12月31日
股票投资产生的股利收益	202,810.48
基金投资产生的股利收益	-
合计	202,810.48

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6月5日（基金合同生效日）至2012年12月31日
1. 交易性金融资产	3,578,523.97
——股票投资	3,578,523.97
——债券投资	-
——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	3,578,523.97

7.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年6月5日（基金合同生效日）至2012年12月31日
基金赎回费收入	341,015.00
合计	341,015.00

7.4.7.15 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年6月5日（基金合同生效日）至2012年12月31日
交易所市场交易费用	772,212.52
银行间市场交易费用	-
合计	772,212.52

7.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年6月5日（基金合同生效日）至2012年12月31日
审计费用	30,000.00
信息披露费	150,000.00
银行间市场账户维护费	4,500.00
银行费用	3,175.55

指数使用费	105,592.17
上市费	60,000.00
合计	353,267.72

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

根据本基金的基金合同、招募说明书及深圳证券交易所（以下简称“深交所”）和中国证券登记结算有限责任公司的规定，本基金以 2013 年 1 月 4 日为份额折算基准日，对金鹰 500 场外、场内份额以及金鹰 500A 份额实施定期份额折算，金鹰 500B 份额不进行折算。份额折算结果如下：

基金份额名称	折算前份额数量 (份)	折算前单位 净值(元)	新增金鹰500份额 (份)	折算后数量 (份)	折算后单位 净值(元)
金鹰500	105,554,202.25	0.9561	2,264,639.00	108,063,756.25	0.9360
-场内	3,671,738.00	0.9561	78,776.00	3,995,429.00	0.9360
-场外	101,882,464.25	0.9561	2,185,863.00	104,068,327.25	0.9360
金鹰500A	5,707,733.00	1.0409	2,44,915.00	5,707,733.00	1.0007
金鹰500B	5,707,733.00	0.8713	0.00	5,707,733.00	0.8713

注 1、金鹰 500 场外份额经份额折算后产生新增的金鹰 500 场外份额；金鹰 500 场内份额经份额折算后产生新增的金鹰 500 场内份额；金鹰 500A 份额经份额折算后产生新增的金鹰 500 场内份额。

2、自 2013 年 1 月 8 日起，本基金恢复申购、赎回、转托管（包括场外转托管和跨系统转托管）和配对转换业务，金鹰 500A 在深交所复牌。根据深交所《关于分级基金份额折算后复牌首日收盘价调整的通知》，2013 年 1 月 8 日金鹰 500A 复牌首日即时行情显示的前收盘价为 2013 年 1 月 7 日的金鹰 500A 的份额净值（四舍五入至 0.001），即人民币 1.0012 元。

除以上情况外，无其他需要说明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、基金销售机构
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6月5日（基金合同生效日）至2012年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广州证券	145,127,063.25	26.47%

注：本基金于 2012 年 6 月 5 日成立，截至报告期末本基金合同生效未满一年，无上年度可比期间数据。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本年度及上年度可比期间未通过关联方进行权证交易。

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6月5日（基金合同生效日）至2012年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广州证券	20,096,971.45	15.98%

注：本基金于 2012 年 6 月 5 日成立，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本年度及上年度可比期间未通过关联方进行债券回购交易。

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6月5日（基金合同生效日）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	126,358.17	26.97%	47,658.59	47.12%

注：本基金于 2012 年 6 月 5 日成立，截至报告期末本基金合同生效未满一年，无上年度可比期间数据。

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6月5日（基金合同生效日）至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	949,414.36
其中：支付销售机构的客户维护费	276,826.80

注：1、基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.0%的年费率计提，计算方法如下：

$$H=E \times 1.0\% / \text{当年天数}$$

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。

3、本基金于 2012 年 6 月 5 日成立，截至报告期末本基金合同生效未满一年，无上年度可比期间数据。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年6月5日（基金合同生效日）至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	208,871.14

注：1、基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.22%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.22\% / \text{当年天数}$$

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。

3、本基金于 2012 年 6 月 5 日成立，截至报告期末本基金合同生效未满一年，无上年度可比期间数据。

7.4.10.2.3 销售服务费

本基金报告期及上年度可比期间内没有应支付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

本基金本年度及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（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**

报告期及上年度可比期间内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

本报告期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

关联方名称	本期 2012 年 6 月 5 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行	2,500,363.15	78,032.97
合计	2,500,363.15	78,032.97

注：1、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。2012 年年末结算备付金余额 4,874,680.39 元,当期结算备付金存款利息收入 215,923.69 元。

2、本基金于 2012 年 6 月 5 日成立，截至报告期末本基金合同生效未满一年，无上年度可比期间数据。

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

根据本基金基金合同约定，存续期内，本基金（包括金鹰中证 500 份额、金鹰中证 500A 份额、金鹰中证 500B 份额）不进行收益分配。

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
600110	中科英华	2012-11-19	筹划收购资产有关重大事项	3.61	2013-03-11	3.97	71,843	262,155.21	259,353.23	-
600127	金健米业	2012-12-24	股东拟转让股份	4.69	2013-02-08	5.16	40,700	191,541.14	190,883.00	-
600236	桂冠电力	2012-12-21	重大资产重组事项	3.98	2013-02-05	4.36	68,102	229,830.48	271,045.96	-
600580	卧龙电气	2012-11-20	重大资产重组事项	3.94	2013-01-09	4.33	34,226	158,059.62	134,850.44	-
000042	深长城	2012-12-18	筹划重大事项	20.10	2013-02-05	22.11	7,174	130,137.91	144,197.40	-
000428	华天酒店	2012-12-31	筹划关联交易事项	4.20	2013-01-08	4.38	31,584	135,760.59	132,652.80	-
000698	沈阳化工	2012-12-24	筹划重大事项	4.22	2013-01-31	4.64	34,434	156,016.52	145,311.48	-
000712	锦龙股份	2012-12-10	筹划重大资产重组事项	11.10	2013-03-18	12.21	16,718	189,277.04	185,569.80	-
000793	华闻传媒	2012-11-23	筹划非公开发行股份购买资	6.63	2013-02-28	7.29	55,734	351,766.17	369,516.42	-

			产的重大重组事项							
000903	云内动力	2012-12-31	云南内燃机厂要约收购公司股份	4.65	2013-01-04	4.72	34,819	150,065.60	161,908.35	-
000973	佛塑科技	2012-12-28	筹划非公开发行股份购买资产重大事项	4.15	2013-01-18	4.57	53,986	227,633.20	224,041.90	-
002190	成飞集成	2012-10-16	筹划重大资产重组	11.45	2013-01-14	12.60	4,138	52,235.62	47,380.10	-
002506	ST 超日	2012-12-20	披露公司经营有关的重大事项	5.11	2013-02-01	4.85	37,682	204,263.49	192,555.02	-

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，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。

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
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	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
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	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。

7.4.13.3 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	2,500,363 .15	-	-	-	-	-	-	-	-	2,500,363 .15
结算备 付金	4,874,680 .39	-	-	-	-	-	-	-	-	4,874,680 .39
存出保 证金	-	-	-	-	-	-	-	-	162,890.8 0	162,890.8 0
交易性 金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	106,856.7 77.86	106,856.7 77.86
衍生金 融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
买入返 售金融资 产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收证 券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收利 息	-	-	-	-	-	-	-	-	2,434.61	2,434.61
应收股 利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申 购款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他资 产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	7,375,043 .54	-	-	-	-	-	-	-	107,022.1 03.27	114,397.1 46.81
负债										
应付证	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

券清算款										
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	1,343,152.85	1,343,152.85
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	90,634.37	90,634.37
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	19,939.55	19,939.55
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	101,138.04	101,138.04
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	235,062.10	235,062.10
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	1,789,926.91	1,789,926.91
利率敏感度缺口	7,375,043.54	-	-	-	-	-	-	-	105,232,176.36	112,607,219.90

注：本基金于 2012 年 6 月 5 日成立，截至报告期末本基金合同生效未满一年，无上年度可比期间数据。

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
	1. 利率上升 25 个基点	-
2. 利率下降 25 个基点	-	

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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	106,856,777.86	94.89
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	106,856,777.86	94.89

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
	业绩比较基准变动+5%	3,599,204.25
	业绩比较基准变动-5%	-3,599,204.25

§ 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	106,856,777.86	93.41
	其中：股票	106,856,777.86	93.41
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	7,375,043.54	6.45
6	其他各项资产	165,325.41	0.14
7	合计	114,397,146.81	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

8.2.1 指数投资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	2,093,726.58	1.86
B	采掘业	1,904,222.71	1.69
C	制造业	59,217,828.31	52.59
C0	食品、饮料	5,855,203.02	5.20
C1	纺织、服装、皮毛	2,787,875.57	2.48
C2	木材、家具	426,133.26	0.38
C3	造纸、印刷	1,717,937.45	1.53
C4	石油、化学、塑胶、塑料	10,287,299.07	9.14
C5	电子	6,169,975.59	5.48
C6	金属、非金属	6,603,416.48	5.86
C7	机械、设备、仪表	15,663,781.37	13.91
C8	医药、生物制品	8,286,374.82	7.36
C99	其他制造业	1,419,831.68	1.26
D	电力、煤气及水的生产和供应业	4,281,428.56	3.80
E	建筑业	2,544,655.90	2.26
F	交通运输、仓储业	4,247,751.47	3.77
G	信息技术业	5,462,021.83	4.85
H	批发和零售贸易	5,440,361.33	4.83
I	金融、保险业	1,448,130.38	1.29
J	房地产业	10,020,132.87	8.90
K	社会服务业	3,406,094.98	3.02
L	传播与文化产业	3,208,234.27	2.85
M	综合类	3,582,188.67	3.18
	合计	106,856,777.86	94.89

8.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

注：本报告期末本基金未持有积极投资股票。

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

8.3.1 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	600340	华夏幸福	25,861	730,056.03	0.65
2	600079	人福医药	29,009	678,520.51	0.60
3	002230	科大讯飞	21,872	662,721.60	0.59
4	600637	百视通	40,568	643,814.16	0.57
5	600436	片仔癀	5,117	557,343.64	0.49
6	002450	康得新	22,665	550,759.50	0.49
7	600199	金种子酒	28,581	549,041.01	0.49
8	000963	华东医药	15,899	540,566.00	0.48
9	000917	电广传媒	52,027	518,709.19	0.46
10	002250	联化科技	26,393	514,663.50	0.46
11	600702	沱牌舍得	17,371	500,458.51	0.44
12	000503	海虹控股	52,429	497,026.92	0.44
13	000998	隆平高科	24,201	495,636.48	0.44
14	600805	悦达投资	41,462	493,397.80	0.44
15	002051	中工国际	16,771	493,067.40	0.44
16	600157	永泰能源	51,492	484,539.72	0.43
17	600138	中青旅	30,352	483,203.84	0.43
18	000750	国海证券	39,193	469,924.07	0.42
19	000799	酒鬼酒	14,312	469,433.60	0.42
20	600643	爱建股份	56,659	449,305.87	0.40
21	600557	康缘药业	21,222	441,417.60	0.39
22	002008	大族激光	53,582	438,300.76	0.39
23	000400	许继电气	17,725	436,921.25	0.39
24	000877	天山股份	45,023	424,116.66	0.38
25	600300	维维股份	61,239	421,936.71	0.37
26	600675	中华企业	79,698	421,602.42	0.37
27	600366	宁波韵升	26,421	419,301.27	0.37
28	600478	科力远	18,358	412,320.68	0.37
29	600325	华发股份	47,745	405,832.50	0.36
30	600311	荣华实业	48,799	400,151.80	0.36
31	600635	大众公用	96,111	397,899.54	0.35
32	000690	宝新能源	88,392	395,996.16	0.35
33	000926	福星股份	41,806	395,066.70	0.35
34	002152	广电运通	27,499	390,210.81	0.35
35	600141	兴发集团	21,435	386,687.40	0.34
36	000540	中天城投	55,547	385,496.18	0.34
37	600426	华鲁恒升	49,034	380,013.50	0.34
38	600601	方正科技	159,808	378,744.96	0.34
39	600867	通化东宝	39,755	377,672.50	0.34
40	600517	置信电气	27,163	374,849.40	0.33

41	000735	罗牛山	64,197	374,268.51	0.33
42	600594	益佰制药	18,511	370,405.11	0.33
43	600717	天津港	61,234	369,853.36	0.33
44	000539	粤电力 A	62,463	369,780.96	0.33
45	000793	华闻传媒	55,734	369,516.42	0.33
46	000786	北新建材	21,110	369,213.90	0.33
47	000939	凯迪电力	55,168	368,522.24	0.33
48	002294	信立泰	9,581	366,952.30	0.33
49	002477	雏鹰农牧	19,441	363,546.70	0.32
50	000028	国药一致	10,291	363,272.30	0.32
51	600239	云南城投	41,847	361,976.55	0.32
52	000616	亿城股份	87,218	357,593.80	0.32
53	600747	大连控股	77,867	357,409.53	0.32
54	601588	北辰实业	116,461	355,206.05	0.32
55	002065	东华软件	24,907	350,192.42	0.31
56	600008	首创股份	80,084	349,967.08	0.31
57	002029	七匹狼	18,532	349,884.16	0.31
58	600312	平高电气	47,922	348,392.94	0.31
59	600458	时代新材	26,521	346,099.05	0.31
60	000816	江淮动力	63,601	345,989.44	0.31
61	600570	恒生电子	30,821	345,503.41	0.31
62	600820	隧道股份	37,959	345,426.90	0.31
63	600067	冠城大通	51,628	338,679.68	0.30
64	002129	中环股份	26,368	336,192.00	0.30
65	600086	东方金钰	15,261	333,605.46	0.30
66	002063	远光软件	22,725	333,148.50	0.30
67	600978	宜华木业	67,398	331,598.16	0.29
68	600200	江苏吴中	45,434	327,124.80	0.29
69	000006	深振业 A	65,858	325,997.10	0.29
70	600522	中天科技	41,250	325,462.50	0.29
71	600653	申华控股	127,652	324,236.08	0.29
72	600064	南京高科	26,417	321,494.89	0.29
73	000975	科学城	31,795	320,493.60	0.28
74	600059	古越龙山	27,930	318,960.60	0.28
75	600720	祁连山	29,892	316,855.20	0.28
76	600880	博瑞传播	32,164	310,060.96	0.28
77	600879	航天电子	47,536	309,934.72	0.28
78	002005	德豪润达	43,601	309,567.10	0.27
79	002482	广田股份	14,943	308,572.95	0.27
80	002237	恒邦股份	13,315	308,508.55	0.27
81	600816	安信信托	23,376	308,329.44	0.27

82	600511	国药股份	21,115	307,645.55	0.27
83	000762	西藏矿业	24,475	302,755.75	0.27
84	002022	科华生物	28,752	301,896.00	0.27
85	600755	厦门国贸	67,963	301,076.09	0.27
86	600240	华业地产	62,540	300,817.40	0.27
87	000830	鲁西化工	75,132	300,528.00	0.27
88	600572	康恩贝	30,821	300,504.75	0.27
89	600596	新安股份	39,632	297,240.00	0.26
90	000667	名流置业	131,864	296,694.00	0.26
91	600210	紫江企业	84,050	295,015.50	0.26
92	600704	物产中大	40,351	294,562.30	0.26
93	600220	江苏阳光	104,397	293,355.57	0.26
94	600269	赣粤高速	85,542	292,553.64	0.26
95	600499	科达机电	33,338	292,040.88	0.26
96	000518	四环生物	75,386	291,743.82	0.26
97	600072	中船股份	20,898	290,482.20	0.26
98	000031	中粮地产	66,198	288,623.28	0.26
99	002140	东华科技	13,095	287,828.10	0.26
100	600844	丹化科技	25,827	285,904.89	0.25
101	600787	中储股份	36,871	285,012.83	0.25
102	600158	中体产业	49,263	284,247.51	0.25
103	002311	海大集团	16,598	283,825.80	0.25
104	000513	丽珠集团	8,079	281,149.20	0.25
105	601002	晋亿实业	27,064	278,488.56	0.25
106	600112	长征电气	26,048	277,150.72	0.25
107	600388	龙净环保	12,643	276,881.70	0.25
108	002408	齐翔腾达	16,500	276,540.00	0.25
109	000550	江铃汽车	15,223	273,709.54	0.24
110	000897	津滨发展	94,416	271,918.08	0.24
111	600748	上实发展	31,740	271,377.00	0.24
112	600750	江中药业	13,760	271,347.20	0.24
113	000488	晨鸣纸业	65,011	271,095.87	0.24
114	600236	桂冠电力	68,102	271,045.96	0.24
115	600872	中炬高新	58,896	270,921.60	0.24
116	000655	金岭矿业	21,815	270,506.00	0.24
117	000683	远兴能源	55,997	270,465.51	0.24
118	000930	中粮生化	56,382	270,069.78	0.24
119	600801	华新水泥	17,792	269,904.64	0.24
120	000900	现代投资	30,758	269,440.08	0.24
121	002028	思源电气	19,282	268,983.90	0.24
122	000652	泰达股份	75,391	268,391.96	0.24

123	002429	兆驰股份	20,756	267,959.96	0.24
124	000612	焦作万方	24,578	266,179.74	0.24
125	600122	宏图高科	66,191	264,764.00	0.24
126	600597	光明乳业	26,919	264,613.77	0.23
127	600584	长电科技	62,208	263,761.92	0.23
128	000571	新大洲 A	53,674	263,539.34	0.23
129	600176	中国玻纤	25,611	259,951.65	0.23
130	600765	中航重机	34,136	259,774.96	0.23
131	600017	日照港	89,789	259,490.21	0.23
132	600110	中科英华	71,843	259,353.23	0.23
133	000860	顺鑫农业	19,349	258,309.15	0.23
134	600636	三爱富	19,455	257,389.65	0.23
135	000510	金路集团	44,606	256,930.56	0.23
136	600284	浦东建设	29,239	256,426.03	0.23
137	000541	佛山照明	38,538	255,506.94	0.23
138	000511	银基发展	67,143	255,143.40	0.23
139	600651	飞乐音响	54,122	254,373.40	0.23
140	600575	芜湖港	35,580	252,973.80	0.22
141	001696	宗申动力	43,376	251,580.80	0.22
142	600425	青松建化	25,392	251,126.88	0.22
143	000685	中山公用	22,781	250,818.81	0.22
144	000598	兴蓉投资	33,868	250,284.52	0.22
145	600586	金晶科技	73,135	250,121.70	0.22
146	600322	天房发展	64,508	249,645.96	0.22
147	600858	银座股份	26,606	249,298.22	0.22
148	600078	澄星股份	29,148	246,883.56	0.22
149	000650	仁和药业	44,072	245,921.76	0.22
150	600545	新疆城建	39,582	245,804.22	0.22
151	600740	山西焦化	28,917	245,794.50	0.22
152	000656	金科股份	16,949	245,760.50	0.22
153	600326	西藏天路	28,130	245,574.90	0.22
154	000415	渤海租赁	37,192	244,351.44	0.22
155	600197	伊力特	16,107	244,021.05	0.22
156	000848	承德露露	17,776	243,708.96	0.22
157	000636	风华高科	39,325	243,028.50	0.22
158	000962	东方钨业	19,375	242,962.50	0.22
159	600428	中远航运	61,756	242,701.08	0.22
160	002041	登海种业	10,277	242,537.20	0.22
161	000601	韶能股份	67,929	242,506.53	0.22
162	002223	鱼跃医疗	15,623	242,156.50	0.22
163	000426	兴业矿业	19,291	241,330.41	0.21

164	600525	长园集团	38,026	240,324.32	0.21
165	600496	精工钢构	29,912	240,193.36	0.21
166	000959	首钢股份	87,253	239,945.75	0.21
167	600004	白云机场	33,648	238,564.32	0.21
168	000417	合肥百货	34,129	238,561.71	0.21
169	600491	龙元建设	41,964	238,355.52	0.21
170	600835	上海机电	29,452	237,383.12	0.21
171	600761	安徽合力	26,298	235,104.12	0.21
172	600759	正和股份	44,588	234,532.88	0.21
173	600161	天坛生物	18,841	234,382.04	0.21
174	600503	华丽家族	50,391	234,318.15	0.21
175	600724	宁波富达	31,749	233,355.15	0.21
176	600038	哈飞股份	12,377	232,935.14	0.21
177	600139	西部资源	24,191	232,475.51	0.21
178	600851	海欣股份	43,070	232,147.30	0.21
179	600509	天富热电	28,719	232,049.52	0.21
180	000088	盐田港	56,763	229,890.15	0.20
181	600654	飞乐股份	55,210	229,121.50	0.20
182	600521	华海药业	19,963	227,578.20	0.20
183	002048	宁波华翔	31,021	226,143.09	0.20
184	600435	北方导航	27,163	224,638.01	0.20
185	002428	云南锗业	9,574	224,606.04	0.20
186	002123	荣信股份	25,925	224,510.50	0.20
187	000973	佛塑科技	53,986	224,041.90	0.20
188	002011	盾安环境	24,496	223,893.44	0.20
189	600033	福建高速	99,929	222,841.67	0.20
190	000078	海王生物	38,261	222,679.02	0.20
191	002277	友阿股份	24,617	222,537.68	0.20
192	000627	天茂集团	79,102	222,276.62	0.20
193	000759	中百集团	33,767	222,186.86	0.20
194	002475	立讯精密	8,023	222,076.64	0.20
195	002470	金正大	15,345	222,042.15	0.20
196	600531	豫光金铅	12,938	221,627.94	0.20
197	600198	大唐电信	27,217	221,274.21	0.20
198	600611	大众交通	45,694	220,702.02	0.20
199	000563	陕国投 A	16,967	220,571.00	0.20
200	002233	塔牌集团	26,161	219,752.40	0.20
201	000682	东方电子	71,576	219,738.32	0.20
202	600069	银鸽投资	42,053	219,516.66	0.19
203	600736	苏州高新	46,365	218,842.80	0.19
204	600021	上海电力	46,977	217,973.28	0.19

205	000726	鲁 泰 A	33,013	217,555.67	0.19
206	002154	报 喜 鸟	21,753	217,094.94	0.19
207	000988	华工科技	39,116	216,702.64	0.19
208	600351	亚宝药业	40,420	215,842.80	0.19
209	600884	杉杉股份	21,016	215,834.32	0.19
210	600790	轻纺城	35,316	215,780.76	0.19
211	600251	冠农股份	13,157	215,248.52	0.19
212	000823	超声电子	22,504	214,238.08	0.19
213	000501	鄂武商 A	18,594	213,831.00	0.19
214	600106	重庆路桥	53,212	212,848.00	0.19
215	000572	海马汽车	72,119	212,751.05	0.19
216	600797	浙大网新	49,210	212,587.20	0.19
217	600439	瑞贝卡	48,294	211,527.72	0.19
218	600533	栖霞建设	46,097	211,124.26	0.19
219	000997	新 大 陆	26,025	210,802.50	0.19
220	000850	华茂股份	41,374	210,593.66	0.19
221	002056	横店东磁	14,980	210,319.20	0.19
222	600628	新世界	31,143	210,215.25	0.19
223	000886	海南高速	57,862	210,039.06	0.19
224	600410	华胜天成	33,028	209,727.80	0.19
225	601880	大连港	73,913	209,173.79	0.19
226	600622	嘉宝集团	30,125	209,067.50	0.19
227	600815	厦工股份	29,846	208,623.54	0.19
228	000659	珠海中富	75,283	207,781.08	0.18
229	600308	华泰股份	59,696	207,145.12	0.18
230	600963	岳阳林纸	50,445	206,320.05	0.18
231	600409	三友化工	54,195	205,941.00	0.18
232	002097	山河智能	30,098	205,870.32	0.18
233	600993	马应龙	14,602	204,720.04	0.18
234	600380	健康元	45,383	204,223.50	0.18
235	000861	海印股份	14,475	204,097.50	0.18
236	600408	安泰集团	51,159	203,612.82	0.18
237	600227	赤天化	55,675	203,213.75	0.18
238	600063	皖维高新	76,593	202,971.45	0.18
239	000887	中鼎股份	21,847	202,084.75	0.18
240	000932	华菱钢铁	88,175	201,920.75	0.18
241	002168	深圳惠程	27,673	201,736.17	0.18
242	600616	金枫酒业	22,749	201,328.65	0.18
243	600612	老凤祥	9,325	200,953.75	0.18
244	002340	格林美	17,011	199,879.25	0.18
245	600685	广船国际	16,030	198,772.00	0.18

246	002161	远望谷	32,366	198,727.24	0.18
247	002309	中利科技	17,485	196,706.25	0.17
248	600298	安琪酵母	12,042	196,645.86	0.17
249	000717	*ST 韶钢	85,411	196,445.30	0.17
250	600151	航天机电	36,573	196,397.01	0.17
251	000090	深天健	25,808	195,882.72	0.17
252	600961	株冶集团	19,237	195,063.18	0.17
253	600289	亿阳信通	33,600	194,880.00	0.17
254	600467	好当家	26,613	194,807.16	0.17
255	600387	海越股份	22,554	194,415.48	0.17
256	600773	西藏城投	16,864	193,598.72	0.17
257	000931	中关村	34,567	193,229.53	0.17
258	600737	中粮屯河	36,765	192,648.60	0.17
259	000608	阳光股份	33,044	192,646.52	0.17
260	002506	ST 超日	37,682	192,555.02	0.17
261	600449	宁夏建材	20,951	191,701.65	0.17
262	000301	东方市场	62,015	191,626.35	0.17
263	600127	金健米业	40,700	190,883.00	0.17
264	600831	广电网络	28,936	190,109.52	0.17
265	600292	九龙电力	15,050	189,329.00	0.17
266	600270	外运发展	26,511	187,962.99	0.17
267	600479	千金药业	15,642	187,704.00	0.17
268	600487	亨通光电	9,118	187,374.90	0.17
269	002308	威创股份	18,743	187,242.57	0.17
270	600171	上海贝岭	39,267	186,518.25	0.17
271	000712	锦龙股份	16,718	185,569.80	0.16
272	600888	新疆众和	19,568	184,526.24	0.16
273	600056	中国医药	9,119	184,112.61	0.16
274	600510	黑牡丹	23,459	183,918.56	0.16
275	600482	风帆股份	23,901	183,081.66	0.16
276	600330	天通股份	34,656	182,983.68	0.16
277	600662	强生控股	46,165	182,813.40	0.16
278	002254	泰和新材	20,067	182,609.70	0.16
279	600195	中牧股份	14,374	181,399.88	0.16
280	601886	江河幕墙	8,284	180,591.20	0.16
281	600723	首商股份	24,073	179,343.85	0.16
282	600103	青山纸业	62,045	179,310.05	0.16
283	600373	中文传媒	12,451	177,551.26	0.16
284	600707	彩虹股份	32,188	177,034.00	0.16
285	000506	中润资源	22,604	176,989.32	0.16
286	002393	力生制药	5,443	176,353.20	0.16

287	000979	中弘股份	22,095	174,550.50	0.16
288	000927	一汽夏利	35,008	174,339.84	0.15
289	000525	红太阳	14,824	174,182.00	0.15
290	002181	粤传媒	20,260	174,033.40	0.15
291	600639	浦东金桥	19,260	173,340.00	0.15
292	000543	皖能电力	22,636	173,165.40	0.15
293	000099	中信海直	22,530	173,030.40	0.15
294	600121	郑州煤电	22,521	172,736.07	0.15
295	600429	三元股份	25,942	171,476.62	0.15
296	002191	劲嘉股份	18,830	171,353.00	0.15
297	600578	京能热电	22,888	171,202.24	0.15
298	000777	中核科技	9,375	170,906.25	0.15
299	002292	奥飞动漫	9,039	170,746.71	0.15
300	600589	广东榕泰	30,724	169,596.48	0.15
301	600246	万通地产	44,392	169,577.44	0.15
302	002006	精功科技	19,970	167,748.00	0.15
303	600223	鲁商置业	29,441	166,930.47	0.15
304	600824	益民集团	37,497	166,861.65	0.15
305	600329	中新药业	15,688	166,292.80	0.15
306	000852	江钻股份	11,772	166,220.64	0.15
307	000631	顺发恒业	22,949	166,150.76	0.15
308	600581	八一钢铁	27,975	165,891.75	0.15
309	000050	深天马 A	20,879	165,152.89	0.15
310	002083	孚日股份	41,051	165,025.02	0.15
311	000713	丰乐种业	15,271	164,621.38	0.15
312	600261	阳光照明	18,984	164,401.44	0.15
313	002025	航天电器	14,490	164,316.60	0.15
314	002424	贵州百灵	10,293	162,835.26	0.14
315	000829	天音控股	41,315	162,367.95	0.14
316	000066	长城电脑	48,517	162,046.78	0.14
317	000903	云内动力	34,819	161,908.35	0.14
318	601616	广电电气	41,048	160,908.16	0.14
319	600117	西宁特钢	32,544	160,441.92	0.14
320	600416	湘电股份	31,350	159,885.00	0.14
321	002179	中航光电	11,755	159,868.00	0.14
322	600295	鄂尔多斯	17,942	159,504.38	0.14
323	000159	国际实业	24,646	158,473.78	0.14
324	601107	四川成渝	47,422	158,389.48	0.14
325	000951	中国重汽	12,296	157,757.68	0.14
326	600337	美克股份	27,808	157,393.28	0.14
327	000822	山东海化	38,995	157,149.85	0.14

328	600830	香溢融通	23,406	156,820.20	0.14
329	600107	美尔雅	21,011	156,742.06	0.14
330	002479	富春环保	12,532	156,650.00	0.14
331	600995	文山电力	28,141	156,463.96	0.14
332	601100	恒立油缸	13,846	155,767.50	0.14
333	600569	安阳钢铁	70,085	155,588.70	0.14
334	002242	九阳股份	22,134	154,495.32	0.14
335	000987	广州友谊	13,177	153,907.36	0.14
336	002480	新筑股份	12,302	153,775.00	0.14
337	002646	青青稞酒	6,541	153,517.27	0.14
338	601010	文峰股份	10,784	153,024.96	0.14
339	002410	广联达	8,928	152,936.64	0.14
340	002078	太阳纸业	29,319	151,872.42	0.13
341	600644	乐山电力	16,670	151,697.00	0.13
342	600866	星湖科技	32,355	150,127.20	0.13
343	600360	华微电子	39,687	149,223.12	0.13
344	600825	新华传媒	30,622	149,129.14	0.13
345	600874	创业环保	31,789	149,090.41	0.13
346	601000	唐山港	44,541	148,321.53	0.13
347	600507	方大特钢	38,034	147,952.26	0.13
348	000410	沈阳机床	23,853	147,650.07	0.13
349	002332	仙琚制药	15,003	147,629.52	0.13
350	002648	卫星石化	8,855	147,612.85	0.13
351	002252	上海莱士	10,799	147,082.38	0.13
352	002249	大洋电机	21,037	145,786.41	0.13
353	002342	巨力索具	21,172	145,663.36	0.13
354	000698	沈阳化工	34,434	145,311.48	0.13
355	600288	大恒科技	22,436	145,160.92	0.13
356	002306	湘鄂情	14,616	144,990.72	0.13
357	600469	风神股份	16,513	144,488.75	0.13
358	601678	滨化股份	14,486	144,425.42	0.13
359	000042	深 长 城	7,174	144,197.40	0.13
360	600333	长春燃气	16,848	141,691.68	0.13
361	600657	信达地产	33,457	141,523.11	0.13
362	600468	百利电气	13,321	141,202.60	0.13
363	600163	福建南纸	36,897	140,577.57	0.12
364	600551	时代出版	14,776	140,224.24	0.12
365	600073	上海梅林	21,808	140,007.36	0.12
366	600231	凌钢股份	29,439	139,835.25	0.12
367	600683	京投银泰	27,291	139,184.10	0.12
368	000554	泰山石油	28,161	138,833.73	0.12

369	601801	皖新传媒	13,371	138,790.98	0.12
370	600162	香江控股	28,142	137,895.80	0.12
371	600501	航天晨光	17,193	137,887.86	0.12
372	600743	华远地产	34,779	137,724.84	0.12
373	600290	华仪电气	26,977	137,312.93	0.12
374	600673	东阳光铝	18,154	137,244.24	0.12
375	002440	闰土股份	11,030	136,772.00	0.12
376	600339	天利高新	29,221	136,462.07	0.12
377	600268	国电南自	23,237	135,936.45	0.12
378	600864	哈投股份	23,896	135,729.28	0.12
379	601519	大智慧	30,491	135,075.13	0.12
380	600580	卧龙电气	34,226	134,850.44	0.12
381	600602	仪电电子	38,626	134,804.74	0.12
382	600618	氯碱化工	16,504	134,342.56	0.12
383	002285	世联地产	9,597	134,262.03	0.12
384	600277	亿利能源	22,492	133,602.48	0.12
385	601777	力帆股份	20,882	133,435.98	0.12
386	000428	华天酒店	31,584	132,652.80	0.12
387	000936	华西股份	32,864	132,441.92	0.12
388	002293	罗莱家纺	3,048	131,826.00	0.12
389	600676	交运股份	31,397	129,983.58	0.12
390	002283	天润曲轴	20,460	129,716.40	0.12
391	600590	泰豪科技	21,985	129,491.65	0.11
392	600481	双良节能	18,640	129,361.60	0.11
393	600075	新疆天业	19,218	128,760.60	0.11
394	002064	华峰氨纶	26,976	127,596.48	0.11
395	000919	金陵药业	18,480	127,142.40	0.11
396	600633	浙报传媒	9,417	127,129.50	0.11
397	601126	四方股份	8,958	127,114.02	0.11
398	600488	天药股份	23,821	126,489.51	0.11
399	600782	新钢股份	30,618	126,146.16	0.11
400	600641	万业企业	29,483	125,597.58	0.11
401	002121	科陆电子	17,461	125,544.59	0.11
402	600226	升华拜克	20,909	125,454.00	0.11
403	000755	山西三维	24,126	125,213.94	0.11
404	002437	誉衡药业	6,183	125,143.92	0.11
405	600293	三峡新材	17,655	124,114.65	0.11
406	601011	宝泰隆	11,359	124,040.28	0.11
407	000533	万家乐	30,435	123,261.75	0.11
408	000620	新华联	23,302	122,801.54	0.11
409	600563	法拉电子	8,232	122,409.84	0.11

410	002204	大连重工	9,501	121,612.80	0.11
411	600776	东方通信	27,996	121,502.64	0.11
412	000708	大冶特钢	16,433	121,439.87	0.11
413	002267	陕天然气	14,753	121,269.66	0.11
414	600480	凌云股份	18,523	121,140.42	0.11
415	002612	朗姿股份	4,346	119,515.00	0.11
416	002109	兴化股份	15,808	119,192.32	0.11
417	000738	中航动控	13,844	118,919.96	0.11
418	600460	士兰微	31,699	118,554.26	0.11
419	600789	鲁抗医药	30,001	118,503.95	0.11
420	600983	合肥三洋	15,561	118,419.21	0.11
421	000517	荣安地产	15,559	118,403.99	0.11
422	600710	常林股份	28,145	118,209.00	0.10
423	000732	泰禾集团	14,835	117,938.25	0.10
424	600054	黄山旅游	9,211	115,874.38	0.10
425	600829	三精制药	12,712	114,535.12	0.10
426	600869	三普药业	14,551	114,516.37	0.10
427	600088	中视传媒	12,203	114,220.08	0.10
428	002183	怡亚通	24,372	114,060.96	0.10
429	600475	华光股份	11,308	113,758.48	0.10
430	002463	沪电股份	25,473	112,590.66	0.10
431	600537	亿晶光电	14,110	112,456.70	0.10
432	000514	渝开发	22,510	112,099.80	0.10
433	002091	江苏国泰	13,122	111,143.34	0.10
434	000837	秦川发展	20,351	111,116.46	0.10
435	002444	巨星科技	11,103	109,586.61	0.10
436	601311	骆驼股份	12,347	108,036.25	0.10
437	002414	高德红外	6,701	107,819.09	0.10
438	000918	嘉凯城	26,379	107,362.53	0.10
439	000158	常山股份	31,643	107,269.77	0.10
440	000912	泸天化	21,142	107,189.94	0.10
441	600328	兰太实业	15,903	105,436.89	0.09
442	002276	万马电缆	20,450	105,317.50	0.09
443	002449	国星光电	15,761	104,022.60	0.09
444	002345	潮宏基	5,356	103,906.40	0.09
445	601636	旗滨集团	15,302	103,747.56	0.09
446	000911	南宁糖业	12,685	103,382.75	0.09
447	002384	东山精密	11,260	103,366.80	0.09
448	600386	北巴传媒	14,788	102,185.08	0.09
449	600523	贵航股份	10,529	101,710.14	0.09
450	000949	新乡化纤	36,432	101,645.28	0.09

451	000935	四川双马	13,962	101,224.50	0.09
452	601999	出版传媒	16,164	101,025.00	0.09
453	002238	天威视讯	9,409	100,864.48	0.09
454	002194	武汉凡谷	16,351	99,250.57	0.09
455	000925	众合机电	10,999	97,561.13	0.09
456	002601	佰利联	4,235	97,489.70	0.09
457	600061	中纺投资	22,150	96,574.00	0.09
458	600287	江苏舜天	16,015	94,808.80	0.08
459	002489	浙江永强	10,610	94,535.10	0.08
460	000893	东凌粮油	8,142	94,447.20	0.08
461	002498	汉缆股份	10,445	94,422.80	0.08
462	600725	云维股份	22,561	93,853.76	0.08
463	002232	启明信息	14,825	92,804.50	0.08
464	002386	天原集团	13,995	91,807.20	0.08
465	002281	光迅科技	4,727	91,751.07	0.08
466	600178	东安动力	16,921	91,204.19	0.08
467	002320	海峡股份	9,401	90,249.60	0.08
468	600184	光电股份	4,647	90,244.74	0.08
469	002585	双星新材	9,124	89,141.48	0.08
470	002392	北京利尔	11,865	88,750.20	0.08
471	600810	神马股份	16,104	87,927.84	0.08
472	601208	东材科技	13,544	86,952.48	0.08
473	002075	沙钢股份	23,104	86,871.04	0.08
474	002218	拓日新能	14,429	84,121.07	0.07
475	002326	永太科技	7,088	82,291.68	0.07
476	002534	杭锅股份	5,931	81,373.32	0.07
477	002574	明牌珠宝	5,278	81,333.98	0.07
478	000029	深深房 A	19,557	80,379.27	0.07
479	002461	珠江啤酒	9,080	79,268.40	0.07
480	002225	濮耐股份	10,632	77,719.92	0.07
481	002315	焦点科技	2,605	77,446.65	0.07
482	600258	首旅股份	6,787	77,032.45	0.07
483	000597	东北制药	12,272	76,822.72	0.07
484	601908	京运通	12,631	76,417.55	0.07
485	002362	汉王科技	7,892	73,079.92	0.06
486	002383	合众思壮	4,148	72,838.88	0.06
487	000617	石油济柴	8,489	69,949.36	0.06
488	002653	海思科	2,438	67,045.00	0.06
489	002110	三钢闽光	11,712	58,677.12	0.05
490	002190	成飞集成	4,138	47,380.10	0.04
491	600819	耀皮玻璃	8,036	45,483.76	0.04

492	600623	双钱股份	4,556	38,133.72	0.03
493	002651	利君股份	2,399	33,010.24	0.03

8.3.2 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所有股票投资明细

本基金报告期末未持有积极投资股票。

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002008	大族激光	2,595,930.50	2.31
2	000917	电广传媒	2,116,831.40	1.88
3	600522	中天科技	1,817,705.26	1.61
4	000400	许继电气	1,713,195.70	1.52
5	000799	酒鬼酒	1,646,231.16	1.46
6	600220	江苏阳光	1,637,789.40	1.45
7	600653	申华控股	1,619,502.90	1.44
8	600110	中科英华	1,608,097.55	1.43
9	600157	永泰能源	1,592,882.00	1.41
10	600312	平高电气	1,583,392.93	1.41
11	000939	凯迪电力	1,561,079.74	1.39
12	600635	大众公用	1,549,712.90	1.38
13	600584	长电科技	1,543,761.87	1.37
14	600704	物产中大	1,484,234.41	1.32
15	600141	兴发集团	1,470,547.59	1.31
16	600720	祁连山	1,467,635.02	1.30
17	000667	名流置业	1,460,425.99	1.30
18	600079	人福医药	1,454,620.66	1.29
19	600199	金种子酒	1,440,282.50	1.28
20	000612	焦作万方	1,438,485.68	1.28

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002008	大族激光	2,148,384.41	1.91
2	000917	电广传媒	1,582,737.96	1.41
3	600522	中天科技	1,412,510.01	1.25
4	600220	江苏阳光	1,283,947.43	1.14
5	600110	中科英华	1,263,824.95	1.12

6	600653	申华控股	1,259,754.99	1.12
7	000400	许继电气	1,254,213.03	1.11
8	600312	平高电气	1,219,551.77	1.08
9	600584	长电科技	1,204,104.57	1.07
10	000667	名流置业	1,165,264.42	1.03
11	000826	桑德环境	1,138,564.68	1.01
12	000612	焦作万方	1,133,483.34	1.01
13	002123	荣信股份	1,121,068.93	1.00
14	000636	风华高科	1,119,865.49	0.99
15	600635	大众公用	1,109,394.49	0.99
16	600704	物产中大	1,086,681.99	0.97
17	600720	祁连山	1,086,480.37	0.96
18	600651	飞乐音响	1,085,553.18	0.96
19	600525	长园集团	1,083,016.54	0.96
20	600765	中航重机	1,082,641.82	0.96

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	331,628,666.76
卖出股票的收入（成交）总额	216,637,293.79

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金报告期末未持有债券投资。

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

本基金报告期末未持有债券投资。

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

序号	名称	金额
1	存出保证金	162,890.80
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,434.61
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	165,325.41

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。

8.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期期末未持有积极投资股票。

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

份额级别	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
金鹰	324	17,693.62	100	0%	5,732,633.00	100%

500A						
金鹰 500B	170	33,721.96	171,654.00	2.99%	5,561,079.00	97.01%
金鹰 500	586	180,457.56	11,049,247.20	10.45%	94,698,881.20	89.55%
合计	1080	108,531.11	11,221,001.20	9.57%	105,992,593.20	90.43%

9.2 期末上市基金前十名持有人

金鹰500A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	曾菊	2,499,725.00	43.60%
2	朱秀珍	500,035.00	8.72%
3	胡爱东	250,017.00	4.36%
4	赵良举	186,200.00	3.25%
5	郭建华	155,513.00	2.71%
6	单顺桃	144,014.00	2.51%
7	王日平	100,038.00	1.75%
8	邝少茹	100,008.00	1.74%
9	张吉水	82,028.00	1.43%
10	韦秀吟	80,027.00	1.40%

金鹰500B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	曾菊	2,014,325.00	35.14%
2	朱秀珍	500,034.00	8.72%
3	胡爱东	250,017.00	4.36%
4	谢胜红	250,000.00	4.36%
5	江西省出版集团公司企业年金计划— 中信银行	171,653.00	3.00%
6	丁碧霞	151,900.00	2.65%
7	单顺桃	144,014.00	2.51%
8	王日平	100,039.00	1.75%
9	邝少茹	100,008.00	1.74%
10	葛红光	85,918.00	1.50%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	份额级别	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开放式基金	金鹰 500A	100.00	0.0017%
	金鹰 500B	-	-
	金鹰 500	50,571.66	0.0478%
	合计	50,671.66	0.0432%

注：1、截至本报告期末，本基金管理人高级管理人员、基金投资部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0；研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0 至 10 万份。

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

项目	金鹰 500A	金鹰 500B	金鹰 500
基金合同生效日(2012年6月5日)基金份额总额	26,209,859.00	26,209,859.00	341,051,468.50
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-	313,423.51
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-	276,571,015.61
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-20,477,126.00	-20,477,126.00	40,954,252.00
本报告期期末基金份额总额	5,732,733.00	5,732,733.00	105,748,128.40

§ 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 32000 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

本基金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	
财通证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	145,127,063.25	26.47%	126,358.17	26.97%	-
国联证券	1	122,076,395.96	22.27%	103,650.52	22.12%	-
国信证券	1	69,398,587.17	12.66%	56,511.04	12.06%	-
海通证券	1	90,782,219.36	16.56%	79,977.28	17.07%	-
华创证券	1	94,177,702.90	17.18%	79,816.20	17.04%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	7,183,634.50	1.31%	6,271.52	1.34%	-
中银国际	1	19,477,175.93	3.55%	15,942.49	3.40%	-

合计	9	548,222,779.07	100.00%	468,527.22	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
财通证券	-	-	369,700,000.00	5.96%	-	-	-	-
广州证券	20,096,971.45	15.98%	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	2,077,300,000.00	33.51%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	2,730,700,000.00	44.05%	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	105,702,397.26	84.02%	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	145,000,000.00	2.34%	-	-	-	-
中银国际	-	-	876,900,000.00	14.14%	-	-	-	-
合计	125,799,368.71	100.00%	6,199,600,000.00	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部分基金停牌股票估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-01-07
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
7	关于旗下部分基金因停牌股票复牌后估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2012-02-16
8	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
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	2012-04-20
11	关于新增上海好买基金销售有限公司为开放式基金代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012-04-24
12	关于新增上海天天基金销售有限公司为开放式基金代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012-04-25
13	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、证券时报、上海证券报	2012-04-28
14	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、证券时报、上海证券报	2012-05-18
15	关于新增深圳众禄基金销售有限公司为开放式基金代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012-05-18
16	关于新增杭州数米基金销售有限公司为开放式基金代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012-05-19
17	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、证券时报、上海证券报	2012-06-06
18	金鹰基金管理有限公司关于在直销平台开通金鹰核心资源股票型证券投资基金定投、转换业务并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	2012-06-20
19	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

20	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	2012-07-02
21	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中信银行电子银行基金申购费率优惠的公告	证券时报	2012-07-03
22	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参与交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	证券时报	2012-07-03
23	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	证券时报	2012-07-05
24	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金增加众禄基金为代销机构并开通定投以及参加相关费率优惠活动的公告	证券时报	2012-07-10
25	金鹰基金管理有限公司关于设立深圳分公司的公告	证券时报	2012-07-11
26	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金增加数米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	证券时报	2012-07-14
27	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金增加好买基金为代销机构并开通转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	证券时报	2012-07-14
28	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金停牌股票估值方法调整的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012-07-17
29	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
30	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
31	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
32	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金增加数米基金为代销机构并开通定投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	2012-07-24
33	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金增加好买基金为代销机构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	2012-07-25
34	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
35	金鹰基金管理有限公司关于调整金鹰稳健成长股票型证券投资基金基金经理的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012-08-01
36	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

	告		
37	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金增加天天基金销售为代销机构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	2012-08-23
38	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金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	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012-08-23
39	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
40	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金在天天基金销售开通定投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	2012-08-25
41	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
42	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
43	金鹰基金管理有限公司关于网上直销增加银联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	2012-09-05
44	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
45	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
46	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
47	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
48	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
49	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
50	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

51	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
52	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
53	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	2012-11-20
54	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
55	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	证券时报	2012-11-28
56	金鹰基金管理有限公司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	2012-11-30
57	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
58	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
59	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
60	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
61	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
62	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，公司向深圳市市场监督管理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。

2、增聘基金经理事项

本报告期，本基金增聘张永东先生为基金经理。本基金现由林华显先生和张永东先生共同管理。本基金调整基金经理的公告已于 2012 年 6 月 7 日在指定媒体刊登。

3、本基金托管行的资产托管部变更总经理

本基金托管行于 2012 年 5 月 30 日刊登关于资产托管部总经理变更的公告。公告如下：本公司资产托管部总经理谷娜莎因工作安排离职，现新聘刘树军为交通银行资产托管部总经理，任职日期自 2012 年 5 月 25 日起。

§ 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中证 500 指数分级证券投资基金发行及募集的文件。
- 2、《金鹰中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》。
- 3、《金鹰中证 500 指数分级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