

金鹰中证 500 指数分级证券投资基金
2013 年半年度报告
2013 年 6 月 30 日

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：二〇一三年八月二十六日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	6
2.4	信息披露方式.....	7
2.5	其他相关资料.....	7
3	主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1	主要会计数据和财务指标.....	7
3.2	基金净值表现.....	8
4	管理人报告.....	9
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	12
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	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7	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投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
6	半年度财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1	资产负债表.....	14
6.2	利润表.....	15
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4	报表附注.....	18
7	投资组合报告.....	37
7.1	期末基金资产组合情况.....	37
7.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	37
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	38
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	52
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	52
7.8	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	52
7.9	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	52
7.10	投资组合报告附注.....	52
8	基金份额持有人信息.....	53

8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	53
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
9	开放式基金份额变动.....	54
10	重大事件揭示.....	55
10.1	基金份额持有人大会决议.....	55
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	55
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4	基金投资策略的改变.....	55
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况.....	55
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况.....	56
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8	其他重大事件.....	58
11	影响投资者决策的其他重要信息.....	59
12	备查文件目录.....	59
12.1	备查文件目录.....	59
12.2	存放地点.....	59
12.3	查阅方式.....	59

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		
基金主代码	162107		
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	39,467,692.89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		
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	1601776.00	1601776.00	36264140.89

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	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

	<p>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	<p>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%</p>		
风险收益特征	<p>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。</p>		
下属三级基金的风险收益特征	<p>本级基金具有低风险、预期收益相对稳定的特征。</p>	<p>本级基金具有高风险、高预期收益的特征</p>	<p>本级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。</p>

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	95559
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	peixm@bankcomm.com
客户服务电话		4006135888, 020-83936180	95559
传真		020-83282856	021-62701216
注册地址		广东省珠海市吉大九洲大道东段商业银行大厦7楼	上海市浦东新区银城中路188号
办公地址		广州市天河区体育西路189号城建大厦22-23楼	上海市浦东新区银城中路188号
邮政编码		510620	200120

法定代表人	刘东	牛锡明
-------	----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gefund.com.cn
基金半年度报告备置地点	广州市天河区体育西路 189 号城建大厦 22-23 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
会计师事务所	立信会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区南京东路 61 号四楼

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2013年1月1日至2013年6月30日)
本期已实现收益	8,686,539.22
本期利润	5,349,883.00
加权平均基金份额本期利润	0.0730
本期加权平均净值利润率	7.35%
本期基金份额净值增长率	-1.82%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配利润	-2,195,908.40
期末可供分配基金份额利润	-0.0556
期末基金资产净值	36,442,611.64
期末基金份额净值	0.9234
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2013年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-5.68%

注：1、本基金于 2012 年 6 月 5 日成立。

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
过去一个月	-14.46%	1.78%	-15.01%	1.86%	0.55%	-0.08%
过去三个月	-5.50%	1.41%	-5.80%	1.46%	0.30%	-0.05%
过去六个月	-1.82%	1.40%	-1.09%	1.42%	-0.73%	-0.02%
过去一年	-5.77%	1.18%	-6.31%	1.40%	0.54%	-0.22%
自基金合同生效起至今	-5.68%	1.14%	-10.01%	1.38%	4.33%	-0.24%

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 2013 年 6 月 30 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 \times 95%+活期存款利率(税后) \times 5%

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。

公司目前下设十三个部门, 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、品牌电子商务部、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工作; 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; 专户投资部负责特定客户资产的投资和管理; 品牌电子商务部负责公司品牌宣传、媒介关系及广告管理、电子商务的营销策划及业务推广等; 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; 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 2013 年 6 月 30 日，公司共管理金鹰成份股优选证券投资基金、金鹰中小盘精选证券投资基金、金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金、金鹰行业优势股票型证券投资基金、金鹰稳健成长股票型证券投资基金、金鹰主题优势股票型证券投资基金、金鹰保本混合型证券投资基金、金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金、金鹰策略配置股票型证券投资基金、金鹰持久回报分级债券型证券投资基金、金鹰核心资源股票型证券投资基金、金鹰中证 500 指数分级证券投资基金、金鹰元泰精选信用债证券投资基金、金鹰货币市场证券投资基金、金鹰元丰保本混合型证券投资基金、金鹰元盛分级债券型发起式证券投资基金以及金鹰元安保本混合型证券投资基金 17 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	2012-06-07	-	10	张永东,工学博士,FRM（金融风险管理师）,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	2012-06-05	-	11	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，现任本基金基金经理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。

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》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无出现重大违法违规或违反基金合同的行为，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期，本基金管理人按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，根据本公司《公平交易制度》的规定，通过规范化的投资、研究和交易流程，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。

本基金管理人事前规定了严格的股票备选库管理制度、投资权限管理制度、债券库管理制度和集中交易制度等；事中重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，必要时启用投资交易系统内的公平交易模块；事后加强对不同投资组合的交易价差、收益率的分析，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合发生的同日反向交易，未发生过成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2013 年上半年，在经济复苏乐观预期、流动性相对宽松、IPO 暂停等积极因素推动下，年初 A 股市场延续了去年 12 月伊始的“建国底”反弹行情，但由于经济复苏内在动力低于市场预期，反弹未满一个季度便宣告夭折，市场总体呈现了先扬后抑的修正调整行情，上证综指下跌 12.78%，中证 500 指数下跌 1.22%，但市场风格与行业分化相当明显，其中，在行业表现上，信息服务、电子元器件、医药生物、信息设备等行业表现较好，涨幅均超过 15%；采掘、有色金属、黑色金属等行业表现较差，跌幅均超过 20%；在风格特征上，创业板、中小板等小盘股组合、高估值组合显著跑赢其它风格组合。

本报告期的年化跟踪误差 0.79% 控制在投资目标限定范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值为 0.9234 元，本报告期份额净值增长率-1.82%，同期业绩比较基准增长率为-1.09%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2013 年下半年，经济转型之路依然漫长，政府对经济短期回落的容忍度提高，更加注重长期改革，下半年国内经济增速可能不会显著改善，并且美联储 QE 的逐步退出、IPO 重启与流动性回归中性等因素，可能对市场有所冲击，但下半年三中全会召开有望带动改革预期、提升市场对中长期经济转型升级的信心，因此，下半年市场可能呈现区间震荡的结构性行情。

本基金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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则》、2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》（证监会计字[2007]15 号）与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》（证监会公告[2008]38 号等相关规定和基金合同的约定，日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

为确保公司估值程序的正常进行，本公司成立了资产估值委员会。资产估值委员会由公司总经理、分管副总经理或总经理助理、研究发展部总监、运作保障部总监、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。

4.7 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

2013 年上半年度，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投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2013 年上半年度，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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2013 年上半年度，由金鹰基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关金鹰中证 500 指数分级证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：金鹰中证 500 指数分级证券投资基金

报告截止日：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,906,748.94	2,500,363.15
结算备付金		927,426.40	4,874,680.39
存出保证金		28,493.67	162,890.80
交易性金融资产	6.4.7.2	33,020,970.25	106,856,777.86
其中：股票投资		33,020,970.25	106,856,777.86
1 基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	865.09	2,434.61

应收股利		3,276.74	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		36,887,781.09	114,397,146.81
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 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		3.72	1,343,152.85
应付管理人报酬		33,258.37	90,634.37
应付托管费		7,316.85	19,939.55
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.6	30,203.74	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	6.4.7.7	374,386.77	235,062.10
负债合计		445,169.45	1,789,926.91
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.8	38,638,520.04	117,213,594.40
未分配利润	6.4.7.9	-2,195,908.40	-4,606,374.50
所有者权益合计		36,442,611.64	112,607,219.90
负债和所有者权益总计		36,887,781.09	114,397,146.81

注：报告截止日 2013 年 6 月 30 日，金鹰 500 份额净值 0.9234 元，基金份额总额 36,264,140.89 份；金鹰 500A 份额净值 1.0322 元，基金份额总额 1,601,776.00 份；金鹰 500B 份额净值 0.8146 元，基金份额总额 1,601,776.00 份

6.2 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：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013	上年度可比期间 2012 年 6 月 5 日(基金合
-----	-----	----------------------------	-------------------------------

		年 6 月 30 日	同生效日) 至 2012 年 6 月 30 日
一、收入		6,304,263.27	802,918.91
1.利息收入		40,683.47	814,329.87
其中：存款利息收入	6.4.7.10	40,007.46	80,293.64
债券利息收入		-	8,438.35
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		676.01	725,597.88
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		9,495,710.86	-
其中：股票投资收益	6.4.7.11	9,209,089.18	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	286,621.68	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-3,336,656.22	-11,410.96
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	104,525.16	-
减：二、费用		954,380.27	402,216.07
1. 管理人报酬		363,018.56	268,848.67
2. 托管费		79,864.15	59,146.71
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.17	206,995.84	363.37
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.18	304,501.72	73,857.32
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,349,883.00	400,702.84
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,349,883.00	400,702.84

6.3 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：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	117,213,594.40	-4,606,374.50	112,607,219.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,349,883.00	5,349,883.00
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）	-78,575,074.36	-2,939,416.90	-81,514,491.26
其中：1. 基金申购款	3,691,043.20	-31,291.53	3,659,751.67
2. 基金赎回款	-82,266,117.56	-2,908,125.37	-85,174,242.93
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）	38,638,520.04	-2,195,908.40	36,442,611.64
项目	上年度可比期间 2012 年 6 月 5 日（基金合同生效日）至 2012 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	400,702.84	400,702.84
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	393,471,186.50	400,702.84	393,871,889.34

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：殷克胜，主管会计工作负责人：殷克胜，会计机构负责人：傅军

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

金鹰中证 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。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则-基本准则》

和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释（统称“企业会计准则”），中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、关于发布《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉（试行）》等问题的通知及其他中国证监会颁布的相关规定而编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本半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 2013 年 6 月 30 日的财务状况以及 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日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。

6.4.4 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（2012 年）年度报告一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在报告期间不存在重大会计差错。

6.4.6 税项

1、印花税

根据财政部、国家税务总局财税字[2007]84 号文《关于调整证券（股票）交易印花税率的通知》的规定，自 2007 年 5 月 30 日起，调整证券（股票）交易印花税率，由原先的 1‰调整为 3‰；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税；

经国务院批准，根据财政部、国家税务总局《关于调整证券（股票）交易印花税率的通知》的规定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

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

2、营业税、企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

3、个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自 2005 年 6 月 13 日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102 号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按 50% 计算应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
活期存款	2,906,748.94
定期存款	-
其他存款	-
合计	2,906,748.94

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
----	-------------------

		成本	公允价值	公允价值变动
股票		32,779,102.50	33,020,970.25	241,867.75
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		32,779,102.50	33,020,970.25	241,867.75

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
应收活期存款利息	475.38
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	368.25
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	9.94
其他	11.52
合计	865.09

注：“其他”指存出保证金利息。

6.4.7.6 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
交易所市场应付交易费用	30,203.74
银行间市场应付交易费用	-
合计	30,203.74

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.01
预提指数使用费	50,000.00
预提审计费	45,868.27
预提上市年费	29,752.78
预提信息披露费	248,765.71
合计	374,386.77

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	117,213,594.40	117,213,594.40
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-243,926.15	-243,926.15
2013年1月4日基金拆分/ 份额折算前	116,969,668.25	116,969,668.25
基金拆分/份额折算调整	2,509,554.00	-
本期申购	3,770,215.65	3,691,043.20
本期赎回（以“-”号填列）	-83,781,745.01	-82,022,191.41
本期末	39,467,692.89	38,638,520.04

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-9,543,533.60	4,937,159.10	-4,606,374.50
本期利润	8,686,539.22	-3,336,656.22	5,349,883.00
本期基金份额交易产生的 变动数	3,003,374.34	-5,942,791.24	-2,939,416.90
其中：基金申购款	-70,131.52	38,839.99	-31,291.53
基金赎回款	3,073,505.86	-5,981,631.23	-2,908,125.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,146,379.96	-4,342,288.36	-2,195,908.40

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	6,733.68
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	33,263.84
其他	9.94
合计	40,007.46

注：其他存款利息收入项目是指申购款利息收入

6.4.7.11 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	95,130,885.89
减：卖出股票成本总额	85,921,796.71
买卖股票差价收入	9,209,089.18

6.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2013年1月1日至2013年6月30日
股票投资产生的股利收益	286,621.68
基金投资产生的股利收益	-
合计	286,621.68

6.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期
	2013年1月1日至2013年6月30日
1. 交易性金融资产	-3,336,656.22
——股票投资	-3,336,656.22
——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	-3,336,656.22

6.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2013年1月1日至2013年6月30日
基金赎回费收入	104,525.16
配股手续费	-
新股手续费返还	-
印花税返还	-
新股申购返还利息收入	-
分销国债手续费返还	-
转换费收入	-
其他	-
合计	104,525.16

6.4.7.15 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
交易所市场交易费用	206,995.84
银行间市场交易费用	-
合计	206,995.84

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
审计费用	15,868.27
信息披露费	148,765.71
银行汇划费用	1,114.96
上市费	29,752.78
银行间市场账户维护费	9,000.00
指数使用费	100,000.00
合计	304,501.72

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内关联方无发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
广州证券有限责任公司	基金管理人股东、基金代销机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
金鹰基金管理有限公司	基金发起人、管理人、基金销售机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年6月5日（基金合同生效日） 至2012年6月30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	52,812,664.97	47.82%	-	-

注：上年度可比期间未通过关联方进行股票交易，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30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	46,734.10	47.56%	14,621.56	48.41%
关联方名称	上年度可比期间 2012年6月5日（基金合同生效日）至2012年6月30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	-	-	-	-

注：1、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。

2、上年度可比期间无应支付关联方的佣金，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月 30日	上年度可比期间 2012年6月5日（基金合同生效日） 至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	363,018.56	268,848.67
其中：支付销售机构的客户 维护费	113,288.55	-

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月 30日	上年度可比期间 2012年6月5日（基金合同生效日） 至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	79,864.15	59,146.71

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。

6.4.10.2.3 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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金报告期及上年度可比期间内基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金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。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年6月5日（基金合同生效日）至 2012年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	2,906,748.94	6,733.68	19,787,451.45	54,811.58

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。2013年6月30日结算备付金余额927,426.40元，2012年6月30日结算备付金余额234,454.4元

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金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。

6.4.11 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。

6.4.12 期末（2013年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金报告期末未持有因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
600284	浦东建设	2013-06-24	筹划重大事项	9.50	-	-	9,101	67,476.19	86,459.50	-
600292	中电远达	2013-06-05	刊登重	19.37	2013-07-01	17.50	5,254	62,114.78	101,769.98	-

			大 事 项							
600725	云维股份	2013-06-24	刊登重大 事项	3.77	2013-07-01	3.42	6,758	27,914.93	25,477.66	-
600088	中视传媒	2013-05-30	刊登重大 资产重 组事 项	14.29	-	-	4,563	47,267.80	65,205.27	-
600983	合肥三洋	2013-05-14	刊登重大 事项	9.96	-	-	7,734	52,687.84	77,030.64	-
000683	远兴能源	2013-04-08	公司预 计有重 大事 项发 生	4.80	2013-07-18	5.09	31,420	156,755.89	150,816.00	-

000719	大地传媒	2013-05-17	刊登重大事项停牌公告	9.61	-	-	3,161	29,715.26	30,377.21	-
600436	片仔癀	2013-06-21	刊登配股提示公告	136.82	2013-07-01	118.73	1,545	154,882.43	211,386.90	-
600654	飞乐股份	2013-04-08	刊登重大事项停牌公告	4.63	2013-07-16	5.09	30,889	125,432.51	143,016.07	-
601886	江河创建	2013-06-20	刊登重大事项	13.22	2013-07-16	13.78	7,354	71,141.16	97,219.88	-
600328	兰太实业	2013-05-08	刊登	7.30	2013-07-31	6.57	7,767	55,902.59	56,699.10	-

			重 大 事 项							
00099 7	新 大 陆	2013-06- 03	刊 登 筹 划 重 大 事 项	15.11	-	-	8,957	78,792.92	135,340.2 7	-
00099 8	隆 平 高 科	2013-05- 03	筹 划 重 大 事 项	20.73	2013-0 7-08	20.5 0	12,115	236,042.5 3	251,143.9 5	-
00225 2	上 海 莱 士	2013-03- 26	筹 划 重 大 事 项	21.00	2013-0 7-02	22.8 0	6,338	81,014.70	133,098.0 0	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金报告期末无银行间市场债券正回购。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 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。

6.4.13.1 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

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；对公司各部门业务流程的遵守合规性和有效性的检查、监督、评价及建议等。

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.2.1 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 2013 年 6 月 30 日	上年末 2012 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债和央票。

6.4.13.2.2 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 2013 年 6 月 30 日	上年末 2012 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本基金所持有的金融负债的合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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2013年6 月30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	2,906,74 8.94	-	-	-	-	-	-	-	-	2,906,74 8.94
结算备 付金	927,426. 40	-	-	-	-	-	-	-	-	927,426. 40
存出保 证金	28,493.6 7	-	-	-	-	-	-	-	-	28,493.6 7
交易性 金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	33,020,9 70.25	33,020,9 70.25
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	-	-	-	-	-	-	-	-	865.09	865.09
应收股 利	-	-	-	-	-	-	-	-	3,276.74	3,276.74
应收申 购款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他资 产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	3,862,66 9.01	-	-	-	-	-	-	-	33,025,1 12.08	36,887,7 81.09
负债										
应付证	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

券清算款											
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	3.72	3.72	
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	33,258.37	33,258.37	
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	7,316.85	7,316.85	
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	30,203.74	30,203.74	
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	374,386.77	374,386.77	
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	445,169.45	445,169.45	
利率敏感度缺口	3,862,669.01	-	-	-	-	-	-	-	32,579,942.63	36,442,611.64	
上年度末 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	-	-	-	-	-	-	-	-	162,890.80	162,890.80	
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	106,856,777.86	106,856,777.86	
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	7,375,04 3.54	-	-	-	-	-	-	-	107,022, 103.27	114,397, 146.81
负债										
应付证 券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付赎 回款	-	-	-	-	-	-	-	-	1,343,15 2.85	1,343,15 2.85
应付管 理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	90,634.3 7	90,634.3 7
应付托 管费	-	-	-	-	-	-	-	-	19,939.5 5	19,939.5 5
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	-	-	-	-	-	-	-	-	1,789,92 6.91	1,789,92 6.91
利率敏感 度缺口	7,375,04 3.54	-	-	-	-	-	-	-	105,232, 176.36	112,607, 219.90

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
1. 利率上升25个基点	-	-
2. 利率下降25个基点	-	-

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日		上年度末 2012 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	33,020,970.25	90.61	106,856,777.86	94.89
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	33,020,970.25	90.61	106,856,777.86	94.89

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	市场其他变量保持不变，只有业绩比较基准所对应的市场组合价格发生合理、可能的变动；		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币）	
		本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
	业绩比较基准变动+5%	1,769,352.10	3,599,204.25
	业绩比较基准变动-5%	-1,769,352.10	-3,599,204.25

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	33,020,970.25	89.52
	其中：股票	33,020,970.25	89.52
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	3,834,175.34	10.39
6	其他各项资产	32,635.50	0.09
7	合计	36,887,781.09	100.00

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

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	584,628.28	1.60
B	采矿业	606,344.56	1.66
C	制造业	19,769,008.58	54.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,596,180.78	4.38
E	建筑业	916,015.09	2.51
F	批发和零售业	1,724,238.07	4.73
G	交通运输、仓储和邮政业	928,209.39	2.55
H	住宿和餐饮业	27,597.10	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,869,498.70	5.13
J	金融业	269,963.49	0.74

K	房地产业	2,786,359.43	7.65
L	租赁和商务服务业	428,695.66	1.18
M	科学研究和技术服务业	143,280.72	0.39
N	水利、环境和公共设施管理业	416,466.83	1.14
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	818,301.85	2.25
S	综合	136,181.72	0.37
	合计	33,020,970.25	90.61

7.2.2 积极期末按行业分类的股票投资组合

本报告期末本基金未持有积极投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 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	002230	科大讯飞	7,105	328,251.00	0.90
2	002450	康得新	10,252	286,850.96	0.79
3	000826	桑德环境	8,401	271,100.27	0.74
4	000998	隆平高科	12,115	251,143.95	0.69
5	000400	许继电气	8,664	234,621.12	0.64
6	600079	人福医药	8,678	226,322.24	0.62
7	000661	长春高新	2,293	224,507.63	0.62
8	000503	海虹控股	15,905	223,942.40	0.61
9	600867	通化东宝	14,312	213,105.68	0.58
10	000793	华闻传媒	21,134	211,762.68	0.58
11	600200	江苏吴中	13,520	211,452.80	0.58
12	600436	片仔癀	1,545	211,386.90	0.58
13	600198	大唐电信	15,688	203,316.48	0.56
14	002456	欧菲光	3,964	188,924.24	0.52
15	000598	兴蓉投资	39,044	187,801.64	0.52
16	000917	电广传媒	15,573	183,294.21	0.50
17	002008	大族激光	16,126	180,449.94	0.50
18	002065	东华软件	9,005	178,299.00	0.49
19	600880	博瑞传播	9,762	172,104.06	0.47
20	600557	康缘药业	6,405	170,052.75	0.47

21	600388	龙净环保	7,458	169,072.86	0.46
22	600594	益佰制药	5,426	167,717.66	0.46
23	002250	联化科技	8,106	162,038.94	0.44
24	600521	华海药业	10,229	155,992.25	0.43
25	600008	首创股份	23,927	152,654.26	0.42
26	000683	远兴能源	31,420	150,816.00	0.41
27	600645	中源协和	5,688	143,280.72	0.39
28	600654	飞乐股份	30,889	143,016.07	0.39
29	002129	中环股份	7,604	140,217.76	0.38
30	600418	江淮汽车	19,787	139,102.61	0.38
31	600765	中航重机	10,177	136,778.88	0.38
32	600805	悦达投资	14,867	136,181.72	0.37
33	000997	新大陆	8,957	135,340.27	0.37
34	600570	恒生电子	10,712	133,900.00	0.37
35	002252	上海莱士	6,338	133,098.00	0.37
36	600312	平高电气	14,169	130,638.18	0.36
37	600422	昆明制药	4,853	128,604.50	0.35
38	002022	科华生物	8,623	127,706.63	0.35
39	600517	置信电气	9,046	127,548.60	0.35
40	600596	新安股份	11,948	126,051.40	0.35
41	600879	航天电子	18,672	125,289.12	0.34
42	600366	宁波韵升	7,933	125,262.07	0.34
43	600110	中科英华	25,043	124,463.71	0.34
44	600067	冠城大通	15,569	124,396.31	0.34
45	002294	信立泰	4,260	123,284.40	0.34
46	000690	宝新能源	26,237	122,526.79	0.34
47	600499	科达机电	10,179	121,028.31	0.33
48	000540	中天城投	17,187	120,480.87	0.33
49	600872	中炬高新	17,122	120,367.66	0.33
50	000848	承德露露	5,239	118,977.69	0.33
51	002005	德豪润达	12,749	118,565.70	0.33
52	600138	中青旅	9,043	118,192.01	0.32
53	600199	金种子酒	8,552	115,537.52	0.32
54	600458	时代新材	12,375	112,488.75	0.31
55	600675	中华企业	23,739	110,623.74	0.30
56	600601	方正科技	48,013	110,429.90	0.30
57	600635	大众公用	28,627	109,355.14	0.30
58	000786	北新建材	6,203	109,296.86	0.30
59	600584	长电科技	18,508	107,716.56	0.30
60	002152	广电运通	9,755	107,109.90	0.29
61	600597	光明乳业	7,908	106,678.92	0.29

62	600643	爱建股份	16,758	106,078.14	0.29
63	002004	华邦颖泰	7,432	104,716.88	0.29
64	600522	中天科技	12,260	103,474.40	0.28
65	002063	远光软件	7,145	103,245.25	0.28
66	600292	九龙电力	5,254	101,769.98	0.28
67	600478	科力远	5,492	101,052.80	0.28
68	000735	罗牛山	19,287	100,678.14	0.28
69	600435	北方导航	8,401	99,467.84	0.27
70	002653	海思科	3,476	99,066.00	0.27
71	600387	海越股份	6,758	98,937.12	0.27
72	600572	康恩贝	8,860	98,257.40	0.27
73	601886	江河创建	7,354	97,219.88	0.27
74	002140	东华科技	3,900	96,759.00	0.27
75	600835	上海机电	8,792	96,624.08	0.27
76	600851	海欣股份	12,987	94,415.49	0.26
77	000762	西藏矿业	8,201	94,393.51	0.26
78	600059	古越龙山	8,350	93,687.00	0.26
79	002482	广田股份	4,448	93,408.00	0.26
80	600086	东方金钰	4,542	92,066.34	0.25
81	600717	天津港	18,219	91,459.38	0.25
82	002028	思源电气	5,761	90,620.53	0.25
83	600511	国药股份	6,302	90,370.68	0.25
84	000926	福星股份	12,502	90,139.42	0.25
85	002477	雏鹰农牧	5,702	90,034.58	0.25
86	002219	独一味	4,670	89,430.50	0.25
87	600978	宜华木业	20,323	89,217.97	0.24
88	000616	亿城股份	31,291	89,179.35	0.24
89	000513	丽珠集团	2,379	88,736.70	0.24
90	600720	祁连山	10,374	88,593.96	0.24
91	002223	鱼跃医疗	4,698	88,557.30	0.24
92	002292	奥飞动漫	3,945	88,328.55	0.24
93	000511	银基发展	20,198	88,265.26	0.24
94	000006	深振业 A	20,563	87,598.38	0.24
95	000566	海南海药	8,595	87,067.35	0.24
96	000712	锦龙股份	4,918	86,507.62	0.24
97	600325	华发股份	14,223	86,475.84	0.24
98	600284	浦东建设	9,101	86,459.50	0.24
99	002161	远望谷	11,256	85,770.72	0.24
100	600651	飞乐音响	16,365	85,752.60	0.24
101	600816	安信信托	6,855	85,481.85	0.23
102	000028	国药一致	3,030	84,597.60	0.23

103	600820	隧道股份	11,350	84,557.50	0.23
104	600747	大连控股	23,028	83,361.36	0.23
105	600183	生益科技	18,500	83,250.00	0.23
106	000726	鲁 泰 A	9,775	82,501.00	0.23
107	000830	鲁西化工	22,367	81,639.55	0.22
108	600038	哈飞股份	3,625	81,272.50	0.22
109	000939	凯迪电力	16,521	80,787.69	0.22
110	600240	华业地产	18,750	80,062.50	0.22
111	600161	天坛生物	5,644	79,636.84	0.22
112	600426	华鲁恒升	14,558	79,632.26	0.22
113	002428	云南锗业	7,008	79,330.56	0.22
114	600151	航天机电	10,823	78,899.67	0.22
115	600685	广船国际	7,985	78,572.40	0.22
116	000563	陕国投 A	4,978	78,403.50	0.22
117	603000	人民网	1,782	78,247.62	0.21
118	600797	浙大网新	14,612	77,881.96	0.21
119	000988	华工科技	13,564	77,857.36	0.21
120	600298	安琪酵母	4,477	77,810.26	0.21
121	000877	天山股份	13,372	77,423.88	0.21
122	600064	南京高科	7,914	77,319.78	0.21
123	600300	维维股份	18,186	77,290.50	0.21
124	600983	合肥三洋	7,734	77,030.64	0.21
125	002048	宁波华翔	9,177	76,719.72	0.21
126	000975	银泰资源	9,417	76,466.04	0.21
127	600017	日照港	33,485	76,345.80	0.21
128	002573	国电清新	4,652	75,734.56	0.21
129	600702	沱牌舍得	5,151	75,668.19	0.21
130	002475	立讯精密	3,597	75,537.00	0.21
131	600269	赣粤高速	25,554	75,128.76	0.21
132	002050	三花股份	6,152	75,054.40	0.21
133	600755	厦门国贸	20,153	74,969.16	0.21
134	002011	盾安环境	7,393	74,965.02	0.21
135	600500	中化国际	15,644	74,778.32	0.21
136	600141	兴发集团	6,663	74,625.60	0.20
137	002168	深圳惠程	10,067	74,596.47	0.20
138	002244	滨江集团	8,834	74,205.60	0.20
139	600158	中体产业	14,946	73,833.24	0.20
140	000887	中鼎股份	11,686	73,621.80	0.20
141	000652	泰达股份	22,509	73,604.43	0.20
142	600351	亚宝药业	11,977	73,538.78	0.20
143	000050	深天马 A	6,262	73,453.26	0.20

144	600373	中文传媒	4,294	73,212.70	0.20
145	000572	海马汽车	21,915	72,757.80	0.20
146	600874	创业环保	9,494	72,439.22	0.20
147	600261	阳光照明	5,684	72,073.12	0.20
148	600611	大众交通	14,104	72,071.44	0.20
149	600750	江中药业	4,035	71,944.05	0.20
150	002325	洪涛股份	6,040	71,876.00	0.20
151	000031	中粮地产	19,680	71,832.00	0.20
152	600311	荣华实业	14,420	71,811.60	0.20
153	000518	四环生物	22,505	71,790.95	0.20
154	600586	金晶科技	21,573	71,622.36	0.20
155	000541	佛山照明	11,490	71,123.10	0.20
156	600289	亿阳信通	10,024	70,769.44	0.19
157	600503	华丽家族	14,811	70,648.47	0.19
158	600210	紫江企业	25,197	70,551.60	0.19
159	000667	名流置业	39,466	70,249.48	0.19
160	600112	长征电气	7,769	70,231.76	0.19
161	000900	现代投资	9,140	70,103.80	0.19
162	000510	金路集团	13,226	69,965.54	0.19
163	600578	京能热电	10,095	69,958.35	0.19
164	600525	长园集团	11,325	69,762.00	0.19
165	000488	晨鸣纸业	19,479	69,540.03	0.19
166	000550	江铃汽车	4,527	69,308.37	0.19
167	002429	兆驰股份	9,230	69,132.70	0.19
168	600614	鼎立股份	4,837	69,120.73	0.19
169	002440	闰土股份	3,339	69,017.13	0.19
170	000078	海王生物	11,130	69,006.00	0.19
171	600410	华胜天成	11,328	68,874.24	0.19
172	000816	江淮动力	19,049	68,766.89	0.19
173	600993	马应龙	4,330	68,414.00	0.19
174	000415	渤海租赁	11,050	68,399.50	0.19
175	600220	江苏阳光	31,170	68,262.30	0.19
176	000930	中粮生化	17,205	67,787.70	0.19
177	600509	天富热电	7,901	67,474.54	0.19
178	002410	广联达	3,555	67,402.80	0.18
179	002237	恒邦股份	4,934	67,299.76	0.18
180	600884	杉杉股份	6,211	67,016.69	0.18
181	002308	威创股份	7,268	66,865.60	0.18
182	600787	中储股份	10,480	66,862.40	0.18
183	000525	红太阳	4,436	66,495.64	0.18
184	600239	云南城投	12,600	66,024.00	0.18

185	000680	山推股份	19,756	65,985.04	0.18
186	600844	丹化科技	8,888	65,504.56	0.18
187	600088	中视传媒	4,563	65,205.27	0.18
188	600122	宏图高科	19,689	64,973.70	0.18
189	000829	天音控股	11,679	64,935.24	0.18
190	600580	卧龙电气	12,013	64,870.20	0.18
191	000759	中百集团	11,859	64,631.55	0.18
192	600704	物产中大	12,114	64,567.62	0.18
193	002041	登海种业	3,028	64,284.44	0.18
194	601002	晋亿实业	8,034	64,030.98	0.18
195	002470	金正大	4,532	63,810.56	0.18
196	000685	中山公用	6,777	63,161.64	0.17
197	600072	中船股份	6,286	63,111.44	0.17
198	600790	轻纺城	10,447	63,099.88	0.17
199	600496	精工钢构	9,242	63,030.44	0.17
200	600260	凯乐科技	9,264	62,995.20	0.17
201	000021	长城开发	14,146	62,949.70	0.17
202	002437	誉衡药业	2,459	62,876.63	0.17
203	600858	银座股份	7,998	62,784.30	0.17
204	600004	白云机场	9,974	62,736.46	0.17
205	000650	仁和药业	12,858	62,618.46	0.17
206	600864	哈投股份	7,128	62,583.84	0.17
207	600729	重庆百货	3,227	62,506.99	0.17
208	002393	力生制药	1,994	62,372.32	0.17
209	600236	桂冠电力	19,302	62,345.46	0.17
210	000636	风华高科	11,669	62,312.46	0.17
211	000860	顺鑫农业	5,725	62,288.00	0.17
212	000417	合肥百货	11,932	61,807.76	0.17
213	000501	鄂武商 A	5,514	61,756.80	0.17
214	000601	韶能股份	18,756	61,707.24	0.17
215	600329	中新药业	4,754	61,421.68	0.17
216	001696	宗申动力	12,990	61,053.00	0.17
217	600761	安徽合力	7,809	60,597.84	0.17
218	000897	津滨发展	28,134	60,488.10	0.17
219	002340	格林美	6,512	60,105.76	0.16
220	000612	焦作万方	7,083	59,993.01	0.16
221	002309	中利科技	5,254	59,790.52	0.16
222	601608	中信重工	18,028	59,312.12	0.16
223	600409	三友化工	16,118	58,991.88	0.16
224	002029	七匹狼	8,233	58,865.95	0.16
225	000090	深天健	8,423	58,624.08	0.16

226	000627	天茂集团	23,603	58,535.44	0.16
227	000962	东方钽业	5,759	58,165.90	0.16
228	600322	天房发展	19,299	58,089.99	0.16
229	600636	三爱富	5,814	57,907.44	0.16
230	600176	中国玻纤	7,573	57,781.99	0.16
231	600831	广电网络	8,610	57,428.70	0.16
232	600021	上海电力	13,887	57,214.44	0.16
233	002648	卫星石化	2,602	57,165.94	0.16
234	600545	新疆城建	11,794	56,847.08	0.16
235	600780	通宝能源	10,000	56,800.00	0.16
236	600328	兰太实业	7,767	56,699.10	0.16
237	002480	新筑股份	3,654	56,637.00	0.16
238	000426	兴业矿业	6,781	56,621.35	0.16
239	600380	健康元	13,588	56,526.08	0.16
240	002056	横店东磁	4,493	56,521.94	0.16
241	000088	盐田港	16,912	56,316.96	0.15
242	002183	怡亚通	8,492	56,217.04	0.15
243	002064	华峰氨纶	8,048	55,853.12	0.15
244	600801	华新水泥	5,274	55,798.92	0.15
245	002408	齐翔腾达	4,832	55,326.40	0.15
246	600428	中远航运	18,289	55,232.78	0.15
247	002663	普邦园林	3,650	55,005.50	0.15
248	000973	佛塑科技	15,857	54,865.22	0.15
249	000823	超声电子	6,715	54,861.55	0.15
250	600251	冠农股份	3,954	54,644.28	0.15
251	002277	友阿股份	7,324	54,490.56	0.15
252	600633	浙报传媒	2,526	54,485.82	0.15
253	000931	中关村	11,787	54,455.94	0.15
254	600748	上实发展	9,374	54,369.20	0.15
255	000886	海南高速	17,012	54,098.16	0.15
256	600069	银鸽投资	12,731	53,979.44	0.15
257	000682	东方电子	21,298	53,883.94	0.15
258	000042	深长城	2,074	53,654.38	0.15
259	601311	骆驼股份	5,556	53,393.16	0.15
260	600470	六国化工	9,090	53,176.50	0.15
261	000850	华茂股份	12,196	53,052.60	0.15
262	002123	荣信股份	7,652	53,028.36	0.15
263	600270	外运发展	7,908	52,983.60	0.15
264	002305	南国置业	6,385	52,676.25	0.14
265	600773	西藏城投	4,874	52,590.46	0.14
266	600757	长江传媒	8,997	52,542.48	0.14

267	000533	万家乐	14,337	52,473.42	0.14
268	600759	正和股份	13,318	52,206.56	0.14
269	002181	粤传媒	5,986	52,078.20	0.14
270	600460	士兰微	9,305	52,014.95	0.14
271	600487	亨通光电	2,738	51,994.62	0.14
272	600106	重庆路桥	15,702	51,816.60	0.14
273	002216	三全食品	3,574	51,787.26	0.14
274	002083	孚日股份	14,208	51,717.12	0.14
275	600171	上海贝岭	11,788	51,395.68	0.14
276	002332	仙琚制药	4,406	51,373.96	0.14
277	600628	新世界	9,305	51,177.50	0.14
278	000959	首钢股份	25,840	50,904.80	0.14
279	600826	兰生股份	4,590	50,811.30	0.14
280	600078	澄星股份	8,613	50,730.57	0.14
281	002091	江苏国泰	3,923	50,724.39	0.14
282	600326	西藏天路	8,356	50,720.92	0.14
283	000301	东方市场	18,624	50,657.28	0.14
284	600482	风帆股份	6,857	50,604.66	0.14
285	002097	山河智能	8,905	50,313.25	0.14
286	000608	阳光股份	9,902	50,203.14	0.14
287	600824	益民集团	11,221	49,821.24	0.14
288	600622	嘉宝集团	8,944	49,728.64	0.14
289	600481	双良节能	6,980	49,697.60	0.14
290	600740	山西焦化	8,467	49,616.62	0.14
291	600330	天通股份	10,427	49,215.44	0.14
292	601880	大连港	21,927	49,116.48	0.13
293	002254	泰和新材	7,734	49,033.56	0.13
294	600736	苏州高新	13,808	49,018.40	0.13
295	002191	劲嘉股份	5,637	48,760.05	0.13
296	002006	精工科技	6,956	48,413.76	0.13
297	600815	厦工股份	12,476	48,406.88	0.13
298	002179	中航光电	4,033	48,396.00	0.13
299	600479	千金药业	4,716	48,339.00	0.13
300	000655	金岭矿业	6,469	47,870.60	0.13
301	600308	华泰股份	17,842	47,816.56	0.13
302	002154	报喜鸟	7,864	47,577.20	0.13
303	600197	伊力特	4,839	47,518.98	0.13
304	600333	长春燃气	5,856	47,433.60	0.13
305	600533	栖霞建设	13,747	47,427.15	0.13
306	600616	金枫酒业	6,657	47,131.56	0.13
307	600589	广东榕泰	9,106	47,078.02	0.13

308	600491	龙元建设	12,547	47,051.25	0.13
309	600162	香江控股	8,366	47,016.92	0.13
310	600195	中牧股份	4,214	46,943.96	0.13
311	002479	富春环保	6,398	46,577.44	0.13
312	600056	中国医药	2,838	46,514.82	0.13
313	002190	成飞集成	3,767	46,409.44	0.13
314	002249	大洋电机	6,141	46,118.91	0.13
315	600830	香溢融通	6,884	45,985.12	0.13
316	600227	赤天化	16,527	45,945.06	0.13
317	600337	美克股份	8,530	45,891.40	0.13
318	002267	陕天然气	4,466	45,865.82	0.13
319	600551	时代出版	4,394	45,785.48	0.13
320	600888	新疆众和	8,442	45,586.80	0.13
321	600468	百利电气	4,013	45,547.55	0.12
322	600662	强生控股	13,727	45,436.37	0.12
323	600825	新华传媒	9,108	45,357.84	0.12
324	002233	塔牌集团	7,786	45,314.52	0.12
325	600723	首商股份	7,205	45,247.40	0.12
326	002424	贵州百灵	3,145	45,193.65	0.12
327	600063	皖维高新	23,041	45,160.36	0.12
328	600425	青松建化	11,870	45,106.00	0.12
329	600121	郑州煤电	8,249	44,957.05	0.12
330	000852	江钻股份	3,457	44,941.00	0.12
331	600073	上海梅林	7,210	44,918.30	0.12
332	000979	中弘股份	6,625	44,851.25	0.12
333	600612	老凤祥	2,734	44,755.58	0.12
334	600439	瑞贝卡	14,340	44,597.40	0.12
335	002025	航天电器	4,315	44,573.95	0.12
336	600737	中粮屯河	8,869	44,522.38	0.12
337	002384	东山精密	3,265	44,110.15	0.12
338	600416	湘电股份	9,201	44,072.79	0.12
339	000066	长城电脑	14,587	44,052.74	0.12
340	000903	云内动力	10,371	43,558.20	0.12
341	002396	星网锐捷	3,058	43,545.92	0.12
342	600408	安泰集团	15,415	43,316.15	0.12
343	600139	西部资源	7,206	43,308.06	0.12
344	600963	岳阳林纸	15,913	43,283.36	0.12
345	601519	大智慧	11,810	43,224.60	0.12
346	000659	珠海中富	22,395	43,222.35	0.12
347	600163	福建南纸	11,050	43,095.00	0.12
348	000410	沈阳机床	8,380	43,073.20	0.12

349	600866	星湖科技	12,028	42,939.96	0.12
350	600995	文山电力	8,352	42,929.28	0.12
351	002414	高德红外	1,955	42,423.50	0.12
352	600449	宁夏建材	6,255	42,346.35	0.12
353	600563	法拉电子	2,394	42,278.04	0.12
354	000932	华菱钢铁	26,084	42,256.08	0.12
355	000099	中信海直	6,736	41,965.28	0.12
356	000777	中核科技	2,781	41,826.24	0.11
357	600488	天药股份	10,324	41,812.20	0.11
358	601616	广电电气	12,187	41,679.54	0.11
359	002444	巨星科技	3,214	41,557.02	0.11
360	600268	国电南自	6,912	41,472.00	0.11
361	600467	好当家	7,890	41,422.50	0.11
362	601801	皖新传媒	3,967	41,296.47	0.11
363	600246	万通地产	13,232	41,151.52	0.11
364	600639	浦东金桥	5,769	41,132.97	0.11
365	002672	东江环保	1,152	40,734.72	0.11
366	002281	光迅科技	1,619	40,669.28	0.11
367	600537	亿晶光电	4,268	40,460.64	0.11
368	600103	青山纸业	18,559	40,458.62	0.11
369	002646	青青稞酒	1,998	40,439.52	0.11
370	000738	中航动控	4,076	40,270.88	0.11
371	000543	皖能电力	6,930	40,194.00	0.11
372	601100	恒立油缸	4,121	40,138.54	0.11
373	603366	日出东方	2,633	39,810.96	0.11
374	000159	国际实业	7,653	39,795.60	0.11
375	600429	三元股份	7,754	39,622.94	0.11
376	000861	海印股份	4,309	39,599.71	0.11
377	000698	沈阳化工	10,034	38,931.92	0.11
378	600683	京投银泰	8,140	38,827.80	0.11
379	002118	紫鑫药业	5,503	38,796.15	0.11
380	601126	四方股份	2,684	38,783.80	0.11
381	600438	通威股份	7,483	38,387.79	0.11
382	002242	九阳股份	6,652	38,382.04	0.11
383	000732	泰禾集团	4,247	38,350.41	0.11
384	000927	一汽夏利	10,461	37,659.60	0.10
385	002430	杭氧股份	5,358	37,506.00	0.10
386	000828	东莞控股	9,094	37,467.28	0.10
387	002093	国脉科技	7,500	37,275.00	0.10
388	002285	世联地产	3,732	37,096.08	0.10
389	603001	奥康国际	2,636	37,088.52	0.10

390	000713	丰乐种业	4,559	37,064.67	0.10
391	600776	东方通信	8,268	36,709.92	0.10
392	000919	金陵药业	5,506	36,504.78	0.10
393	600590	泰豪科技	6,624	36,498.24	0.10
394	600531	豫光金铅	3,854	36,381.76	0.10
395	600469	风神股份	4,847	36,352.50	0.10
396	002449	国星光电	4,738	36,150.94	0.10
397	600117	西宁特钢	9,716	36,046.36	0.10
398	600673	东阳光铝	5,396	35,937.36	0.10
399	600501	航天晨光	5,190	35,811.00	0.10
400	000822	山东海化	11,602	35,734.16	0.10
401	002203	海亮股份	5,104	35,728.00	0.10
402	600644	乐山电力	4,980	35,656.80	0.10
403	002342	巨力索具	6,258	35,608.02	0.10
404	600480	凌云股份	5,540	35,511.40	0.10
405	600581	八一钢铁	8,389	35,401.58	0.10
406	600295	鄂尔多斯	5,292	35,350.56	0.10
407	002283	天润曲轴	7,269	34,963.89	0.10
408	000506	中润资源	8,106	34,936.86	0.10
409	002121	科陆电子	5,140	34,746.40	0.10
410	002345	潮宏基	3,154	34,599.38	0.09
411	600075	新疆天业	5,595	34,353.30	0.09
412	600223	鲁商置业	8,687	34,139.91	0.09
413	002638	勤上光电	2,464	34,027.84	0.09
414	000936	华西股份	9,930	33,464.10	0.09
415	600961	*ST 株冶	5,712	33,415.20	0.09
416	002386	天原集团	5,173	33,365.85	0.09
417	000987	广州友谊	3,887	33,311.59	0.09
418	002078	太阳纸业	7,551	33,299.91	0.09
419	000620	新华联	6,969	32,963.37	0.09
420	000697	炼石有色	3,140	32,907.20	0.09
421	600510	黑牡丹	6,917	32,717.41	0.09
422	600290	华仪电气	8,051	32,042.98	0.09
423	601777	力帆股份	6,080	32,041.60	0.09
424	002194	武汉凡谷	4,795	32,030.60	0.09
425	600184	光电股份	1,406	31,719.36	0.09
426	603077	和邦股份	2,974	31,673.10	0.09
427	002601	佰利联	2,068	31,474.96	0.09
428	600743	华远地产	11,909	31,320.67	0.09
429	600475	华光股份	3,414	31,272.24	0.09
430	000809	铁岭新城	3,668	31,214.68	0.09

431	601678	滨化股份	4,322	30,772.64	0.08
432	600657	信达地产	9,893	30,767.23	0.08
433	000951	中国重汽	3,649	30,761.07	0.08
434	600710	常林股份	9,807	30,499.77	0.08
435	000554	泰山石油	8,377	30,492.28	0.08
436	000631	顺发恒业	6,832	30,402.40	0.08
437	000719	大地传媒	3,161	30,377.21	0.08
438	601208	东材科技	5,398	30,336.76	0.08
439	002293	罗莱家纺	1,794	30,031.56	0.08
440	601010	文峰股份	4,822	29,510.64	0.08
441	600618	氯碱化工	4,946	29,428.70	0.08
442	601515	东风股份	2,466	29,345.40	0.08
443	002463	沪电股份	9,150	29,280.00	0.08
444	600339	天利高新	8,859	29,234.70	0.08
445	600094	大名城	5,687	29,174.31	0.08
446	000893	东凌粮油	2,313	29,143.80	0.08
447	002238	天威视讯	2,721	29,114.70	0.08
448	600397	安源煤业	6,448	29,016.00	0.08
449	600054	黄山旅游	2,822	28,897.28	0.08
450	600523	贵航股份	3,180	28,874.40	0.08
451	002204	大连重工	2,800	28,756.00	0.08
452	600226	升华拜克	6,211	28,446.38	0.08
453	000603	盛达矿业	2,207	28,205.46	0.08
454	600641	万业企业	8,830	27,814.50	0.08
455	600287	江苏舜天	4,780	27,771.80	0.08
456	002306	湘鄂情	4,346	27,597.10	0.08
457	600231	凌钢股份	8,683	27,438.28	0.08
458	000925	众合机电	3,414	27,107.16	0.07
459	002678	珠江钢琴	2,029	26,863.96	0.07
460	600869	三普药业	4,280	26,792.80	0.07
461	002315	焦点科技	769	26,761.20	0.07
462	002612	朗姿股份	1,314	26,753.04	0.07
463	002489	浙江永强	3,055	26,700.70	0.07
464	600258	首旅股份	2,032	26,598.88	0.07
465	000708	大冶特钢	4,967	26,523.78	0.07
466	002225	濮耐股份	4,795	26,372.50	0.07
467	002232	启明信息	4,441	26,246.31	0.07
468	002276	万马电缆	6,071	26,226.72	0.07
469	601999	出版传媒	4,811	26,171.84	0.07
470	002218	拓日新能	4,271	26,138.52	0.07
471	000912	泸天化	6,409	26,084.63	0.07

472	600386	北巴传媒	4,412	25,942.56	0.07
473	000935	四川双马	4,529	25,770.01	0.07
474	600725	云维股份	6,758	25,477.66	0.07
475	002574	明牌珠宝	2,105	24,817.95	0.07
476	000755	山西三维	7,151	24,813.97	0.07
477	601636	旗滨集团	4,496	24,728.00	0.07
478	601011	宝泰隆	3,361	24,703.35	0.07
479	600829	三精制药	3,739	24,677.40	0.07
480	002498	汉缆股份	4,637	24,483.36	0.07
481	601339	百隆东方	3,224	24,341.20	0.07
482	002662	京威股份	3,911	23,896.21	0.07
483	600810	神马股份	4,862	23,386.22	0.06
484	002320	海峡股份	2,808	23,166.00	0.06
485	002461	珠江啤酒	2,957	23,094.17	0.06
486	002534	杭锅股份	1,820	22,877.40	0.06
487	601388	怡球资源	2,623	22,741.41	0.06
488	601908	京运通	3,767	22,375.98	0.06
489	000517	荣安地产	4,638	22,030.50	0.06
490	000911	南宁糖业	3,720	21,836.40	0.06
491	000918	嘉凯城	7,885	21,604.90	0.06
492	002651	利君股份	1,689	20,943.60	0.06
493	002392	北京利尔	3,554	20,861.98	0.06
494	002585	双星新材	2,748	20,829.84	0.06
495	002226	江南化工	1,691	19,818.52	0.05
496	002326	永太科技	2,120	18,380.40	0.05
497	601677	明泰铝业	1,791	12,716.10	0.03

7.3.2 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。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000826	桑德环境	632,313.00	0.56
2	000661	长春高新	479,168.14	0.43
3	600418	江淮汽车	464,520.39	0.41
4	002456	欧菲光	439,941.13	0.39

5	600645	中源协和	363,252.95	0.32
6	002004	华邦颖泰	361,867.00	0.32
7	000680	山推股份	320,958.00	0.29
8	002244	滨江集团	318,021.00	0.28
9	600729	重庆百货	299,301.65	0.27
10	600500	中化国际	297,324.00	0.26
11	600422	昆明制药	291,502.00	0.26
12	600260	凯乐科技	285,138.00	0.25
13	000566	海南海药	282,045.00	0.25
14	600470	六国化工	274,833.00	0.24
15	600183	生益科技	265,356.25	0.24
16	601608	中信重工	240,123.00	0.21
17	002219	独一味	230,948.65	0.21
18	603000	人民网	224,304.96	0.20
19	002325	洪涛股份	216,873.00	0.19
20	000021	长城开发	215,682.22	0.19

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600340	华夏幸福	728,926.39	0.65
2	600637	百视通	647,909.24	0.58
3	000826	桑德环境	568,607.49	0.50
4	600079	人福医药	549,684.13	0.49
5	000963	华东医药	535,369.15	0.48
6	002230	科大讯飞	533,780.81	0.47
7	002456	欧菲光	531,777.25	0.47
8	002450	康得新	508,324.30	0.45
9	600157	永泰能源	506,038.36	0.45
10	000503	海虹控股	493,692.01	0.44
11	000799	酒鬼酒	493,618.08	0.44
12	000750	国海证券	487,484.13	0.43
13	002008	大族激光	486,217.04	0.43
14	000661	长春高新	473,730.10	0.42
15	000400	许继电气	462,601.31	0.41
16	002051	中工国际	458,650.12	0.41
17	000917	电广传媒	453,241.26	0.40
18	000598	兴蓉投资	425,730.47	0.38
19	600867	通化东宝	412,635.28	0.37
20	600436	片仔癀	412,488.68	0.37

7.4.3 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	15,422,645.32
卖出股票的收入（成交）总额	95,130,885.89

7.5 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。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金报告期末未持有资产支持证券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金报告期末未持有权证。

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金报告期末投资股指期货。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1 本报告期本基金投资的前十名证券海虹控股的发行主体海虹企业（控股）股份有限公司，曾于 2013 年 1 月 30 日因信息披露问题，被交易所计入上市公司诚信档案。

7.10.2 报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.10.3 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	28,493.67
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	3,276.74
4	应收利息	865.09
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	32,635.50

7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.10.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000998	隆平高科	251,143.95	0.69	筹划重大资产重组事项

7.10.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末未持有积极投资股票。

7.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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500A	355	4,512.05	0.00	0.00%	1,601,776.00	100.00%
金鹰500B	301	5,321.51	1.00	0.00%	1,601,775.00	100.00%
金鹰500	529	68,552.25	0.00	0.00%	36,264,140.89	100.00%
合计	1,185	33,306.07	1.00	0.00%	39,467,691.89	100.00%

8.2 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	314,825.00	19.65%

2	梁妙红	149,000.00	9.30%
3	武菁	107,729.00	6.73%
4	王日平	100,038.00	6.25%
5	梁妙青	83,800.00	5.23%
6	龚雪松	81,128.00	5.06%
7	屈敏茹	50,003.00	3.12%
8	赖雄飞	49,504.00	3.09%
9	朱鹏	44,399.00	2.77%
10	洪婉惠	39,503.00	2.47%

金鹰500B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	吴大烈	290,700.00	18.15%
2	胡爱东	167,606.00	10.46%
3	王日平	100,039.00	6.25%
4	张国壮	62,900.00	3.93%
5	蔡晨珮	50,009.00	3.12%
6	屈敏茹	50,003.00	3.12%
7	钟金好	50,003.00	3.12%
8	吴振久	49,907.00	3.12%
9	赖雄飞	49,504.00	3.09%
10	黄炳钊	40,000.00	2.50%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	金鹰 500A	100.00	0.01%
	金鹰 500B	300.00	0.02%
	金鹰 500	-	-
	合计	400.00	0.00%

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。

9 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	26,209,859	341,051,468.50

本报告期期初基金份额总额	5,732,733	5,732,733	105,748,128.40
本报告期基金总申购份额	-	-	3,770,215.65
减：本报告期基金总赎回份额	-	-	84,025,671.16
本报告期基金拆分变动份额	-4,130,957	-4,130,957	10,771,468
本报告期期末基金份额总额	1,601,776	1,601,776	36,264,140.89

注：1、本期因本基金三级份额之间转换拆分产生的份额变化：金鹰 500A 和金鹰 500B 分别减少份额 4,130,957.00 份，金鹰 500 增加份额 8,261,914.00 份。

2、2013 年 1 月 4 日本基金实施定期折算，金鹰 500 场内、场外份额与金鹰 500A 份额折算后共计增加金鹰 500 份额 2,509,554.00 份。

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

- 1、本报告期基金管理人的无重大人事变动；
- 2、本报告期基金托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金报告期内没有改变基金投资策略。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本基金报告期内没有改聘会计师事务所的情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况

本基金报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
财通证券	1	3,462,446.97	3.14%	3,152.21	3.21%	-
日信证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	1	7,613,016.20	6.89%	6,646.83	6.76%	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	16,369,865.35	14.82%	14,259.26	14.51%	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	30,185,072.74	27.33%	27,481.37	27.96%	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
广州证券	2	52,812,664.97	47.82%	46,734.10	47.56%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
合计	22	110,443,066.23	100.00%	98,273.77	100.00%	-

注：1、本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的专用交易单位。本基金专用交易单位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和

行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务；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。

2、金鹰基金管理公司托管于交通银行的所有理财产品共用交易席位。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		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	-	-	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	1,800,000.00	33.33%	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	3,600,000.00	66.67%	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	5,400,000.00	100.00%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	金鹰基金管理有限公司关于旗下开放式基金资产净值等的公告	证券时报	2013-01-04
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	证券时报	2013-01-05
3	关于金鹰中证500指数分级证券投资基金之金鹰中证500A份额2013年度约定年收益率的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2013-01-07
4	关于金鹰中证500指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间金鹰中证500A份额停复牌的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2013-01-07
5	关于金鹰中证500A定期份额折算后复牌首日前收盘价调整的风险提示公告	证券时报	2013-01-08
6	关于金鹰中证500指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告	证券时报	2013-01-08
7	金鹰基金管理有限公司关于网上直销平台开通理财宝业务的公告	证券时报	2013-01-16
8	金鹰中证500指数分级证券投资基金2012年第4季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2013-01-21
9	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	2013-01-26
10	金鹰基金管理有限公司关于网上直销增加财付通第三方支付业务的公告	证券时报	2013-01-29
11	金鹰基金管理有限公司关于全面开展网上直销转换业务费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2013-02-26
12	金鹰中证500指数分级证券投资基金2012年年度报告（摘要）	证券时报	2013-03-28
13	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	2013-04-03
14	金鹰中证500指数分级证券投资基金2013年第1季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2013-04-19
15	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增和讯信息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	2013-04-19
16	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金增加金元证券为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2013-04-24
17	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	2013-05-04
18	金鹰基金管理有限公司关于网上直销支付宝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	2013-06-04
19	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金在	证券时报	2013-06-20

	平安银行开通定投及转换业务的公告		
20	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金在好买基金销售开通定投以及参加相关费率优惠活动的公告	证券时报	2013-06-24
21	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金2013年6月28日基金资产净值和基金份额净值的公告	证券时报	2013-06-29

11 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准金鹰中证 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、季度报告及其他临时公告。

12.2 存放地点

广州市天河区体育西路 189 号城建大厦 22-23 层

12.3 查阅方式

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

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

金鹰基金管理有限公司
二〇一三年八月二十六日