

金鹰中证 500 指数分级证券投资基金
2014 年半年度报告
2014 年 6 月 30 日

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一四年八月二十五日

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 2014 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 2014 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.....	12
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.....	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.....	17
6.4	报表附注.....	18
7	投资组合报告.....	35
7.1	期末基金资产组合情况.....	35
7.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	37
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.....	51
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.....	51
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	51
7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	51
7.9	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
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	52

7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12	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
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	54
9	开放式基金份额变动	55
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	56
10.4	基金投资策略的改变	56
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	56
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	57
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		
场内简称	金鹰500		
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	15,886,665.26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	591895.00	591895.00	14702875.26

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

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

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	王涛
	联系电话	020-83282627	95559
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	t_wang@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

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（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	1,002,799.46
本期利润	285,149.40
加权平均基金份额本期利润	0.0161
本期加权平均净值利润率	1.57%
本期基金份额净值增长率	0.39%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2014 年 6 月 30 日）
期末可供分配利润	1,157,528.93
期末可供分配基金份额利润	0.0729
期末基金资产净值	16,230,820.67
期末基金份额净值	1.0217
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2014 年 6 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	7.68%

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	1.97%	0.90%	2.38%	0.93%	-0.41%	-0.03%
过去三个月	1.05%	0.98%	2.11%	1.01%	-1.06%	-0.03%
过去六个月	0.39%	1.16%	2.43%	1.19%	-2.04%	-0.03%
过去一年	14.16%	1.23%	20.27%	1.26%	-6.11%	-0.03%
自基金合同生效起至今	7.68%	1.18%	8.23%	1.32%	-0.55%	-0.14%

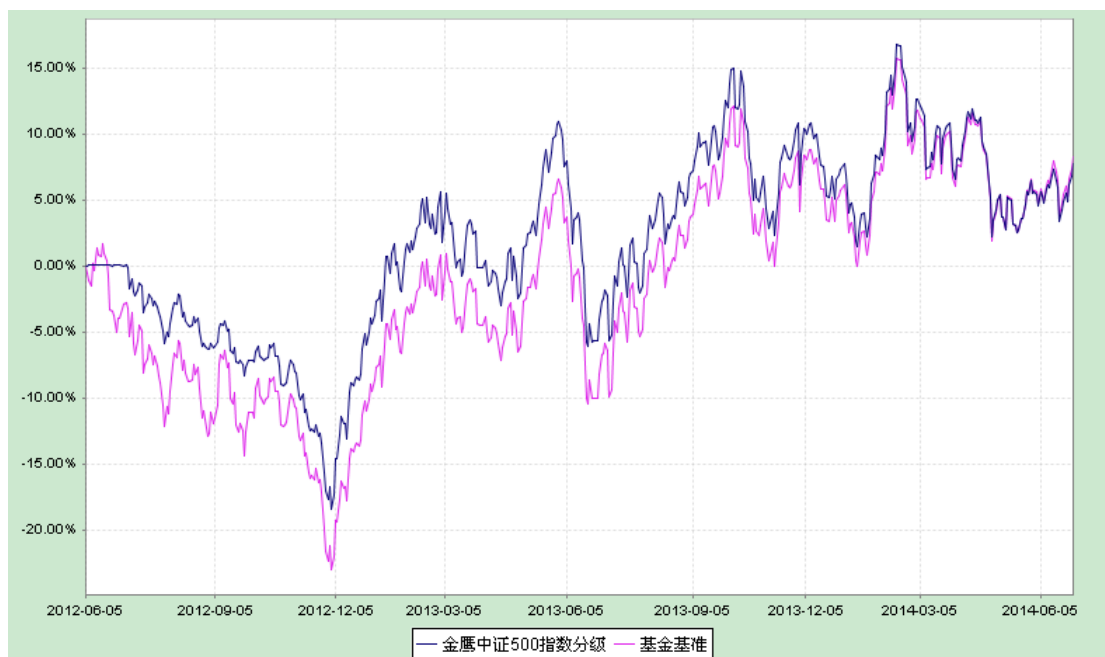
注：本基金业绩比较基准为中证 500 指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%

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 2014 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×95%+活期存款利率（税后）×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、广州白云山医药集团股份有限公司、美的集团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；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 2014 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	-	11	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	-	12	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中的公平交易模块；事后加强对不同投资组合的交易价差、收益率的分析，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合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

在报告期内，本基金的跟踪标的中证 500 指数微涨 2.50%，基金规模大幅变动等因素对指数跟踪效果造成了较大的冲击，本基金日均跟踪偏离度 0.03316%、年化跟踪误差 0.81% 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 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值为 1.0217 元，本报告期份额净值增长率 0.39%，同期业绩比较基准增长率为 2.43%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金为股票型指数基金，以跟踪指数为目标，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, 获取与跟踪标的指数相近的收益率。

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。

4.7 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

2014 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

2014 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

2014 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：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	78,489.25	356,151.87
结算备付金		1,345,197.33	1,607,454.51
存出保证金		2,461.54	13,357.69
交易性金融资产	6.4.7.2	15,304,179.35	19,780,319.16
其中：股票投资		15,304,179.35	19,780,319.16
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
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		43,957.32	-
应收利息	6.4.7.5	517.41	864.58
应收股利		-	-
应收申购款		198.81	2,982.11
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		16,775,001.01	21,761,129.92
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 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		45,979.56	52,736.87
应付管理人报酬		13,975.72	18,655.75
应付托管费		3,074.67	4,104.25
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.6	8,882.99	13,340.40
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	472,267.40	382,119.01
负债合计		544,180.34	470,956.28
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.8	15,073,291.74	19,847,283.12
未分配利润	6.4.7.9	1,157,528.93	1,442,890.52
所有者权益合计		16,230,820.67	21,290,173.64
负债和所有者权益总计		16,775,001.01	21,761,129.92

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，金鹰 500 份额净值 1.0217 元，基金份额总额 15,886,665.26 份；金鹰 500A 份额净值 1.0322 元，基金份额总额 591,895.00 份；金鹰 500B 份额净值 1.0112 元，基金份额总额 591,895.00 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：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
一、收入		717,235.93	6,304,263.27
1.利息收入		10,697.78	40,683.47
其中：存款利息收入	6.4.7.10	10,697.78	40,007.46
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	676.01
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,416,463.63	9,495,710.86
其中：股票投资收益	6.4.7.11	1,309,465.76	9,209,089.18
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收 益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.12	106,997.87	286,621.68
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	-717,650.06	-3,336,656.22
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	7,724.58	104,525.16
减：二、费用		432,086.53	954,380.27
1. 管理人报酬		90,217.75	363,018.56
2. 托管费		19,847.93	79,864.15
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.15	25,540.47	206,995.84
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.16	296,480.38	304,501.72
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		285,149.40	5,349,883.00
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		285,149.40	5,349,883.00

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：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	19,847,283.12	1,442,890.52	21,290,173.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	285,149.40	285,149.40
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-4,773,991.38	-570,510.99	-5,344,502.37
其中：1. 基金申购款	2,420,541.65	124,322.89	2,544,864.54
2. 基金赎回款	-7,194,533.03	-694,833.88	-7,889,366.91
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）	15,073,291.74	1,157,528.93	16,230,820.67
项目	上年度可比期间 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
-----------------	---------------	---------------	---------------

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：刘东，主管会计工作负责人：刘东，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 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 年 1 月 1 日至 2014 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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期（2013 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 2014 年 6 月 30 日
活期存款	78,489.25
定期存款	-
其他存款	-

合计	78,489.25
----	-----------

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	13,931,331.62	15,304,179.35	1,372,847.73
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
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	13,931,331.62	15,304,179.35	1,372,847.73

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 2014年6月30日
应收活期存款利息	136.23
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	368.78
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	11.41
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.99
合计	517.41

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 2014年6月30日
交易所市场应付交易费用	8,882.99
银行间市场应付交易费用	-
合计	8,882.99

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	173.27
预提指数使用费	49,178.95
预提审计费	44,396.69
预提上市年费	29,752.78
预提信息披露费	348,765.71
合计	472,267.40

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	20,273,542.36	19,847,283.12
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-354,307.31	-346,842.76
基金拆分/份额折算前	19,919,235.05	19,500,440.36
基金拆分/份额折算调整	633,382.41	-
本期申购	2,551,129.46	2,420,541.65
本期赎回（以“-”号填列）	-7,217,081.66	-6,847,690.27
本期末	15,886,665.26	15,073,291.74

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	4,073,915.08	-2,631,024.56	1,442,890.52
本期利润	1,002,799.46	-717,650.06	285,149.40
本期基金份额交易产生的变动数	-1,077,557.51	507,046.52	-570,510.99
其中：基金申购款	558,184.82	-433,861.93	124,322.89

基金赎回款	-1,635,742.33	940,908.45	-694,833.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,999,157.03	-2,841,628.10	1,157,528.93

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
活期存款利息收入	3,188.74
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	0.06
结算备付金利息收入	7,508.98
其他	-
合计	10,697.78

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 2014年1月1日至2014年6月30日
卖出股票成交总额	10,207,642.00
减：卖出股票成本总额	8,898,176.24
买卖股票差价收入	1,309,465.76

6.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
股票投资产生的股利收益	106,997.87
基金投资产生的股利收益	-
合计	106,997.87

6.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
1. 交易性金融资产	-717,650.06
——股票投资	-717,650.06
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-

2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-717,650.06

6.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
基金赎回费收入	7,724.58
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	7,724.58

6.4.7.15 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
交易所市场交易费用	25,540.47
银行间市场交易费用	-
合计	25,540.47

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
审计费用	12,396.69
信息披露费	148,765.71
银行汇划费用	386.25
上市费	29,752.78
银行间市场账户维护费	6,000.00
指数使用费	99,178.95
合计	296,480.38

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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	6,992,012.61	45.61%	52,812,664.97	47.82%

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 2014年1月1日至2014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	6,187.27	45.98%	3,957.57	44.56%
关联方名称	上年度可比期间 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%

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。

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 2014年1月1日至2014年6月 30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	90,217.75	363,018.56
其中：支付销售机构的客户维护费	29,391.63	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 2014年1月1日至2014年6月 30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	19,847.93	79,864.15

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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	78,489.25	3,188.74	2,906,748.94	6,733.68

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。2014年6月30日结算备付金余额1,345,197.33元，2013年6月30日结算备付金余额927,426.40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（2014 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
600507	方大特钢	2014-06-30	澄清公告	3.16	2014-07-02	3.03	4,232	15,165.87	13,373.12	-
002340	格林	2014-06-26	重	11.19	-	-	4,488	45,025.54	50,220.72	-

	美		大 事 项							
002638	勤上 光电	2014-06-10	重 大 事 项	14.15	2014- 07-15	14.75	2,332	29,612.38	32,997.80	-
600260	凯乐 科技	2014-06-09	重 大 事 项	6.59	-	-	3,758	33,036.99	24,765.22	-
600418	江淮 汽车	2014-04-14	重 大 事 项	10.20	2014- 07-11	11.22	8,050	59,214.20	82,110.00	-
600582	天地 科技	2014-06-26	重 大 事 项	7.97	-	-	3,900	35,295.00	31,083.00	-
600685	广船 国际	2014-04-08	重 大 事 项	17.13	-	-	1,875	22,808.15	32,118.75	-
600850	华东 电脑	2014-04-04	重 大 事 项	19.56	2014- 07-11	21.52	853	18,939.54	16,684.68	-
600864	哈投 股份	2014-04-11	重 大 事 项	8.68	2014- 07-15	8.30	2,772	19,844.52	24,060.96	-
000612	焦作 万方	2014-04-03	重 大 事 项	6.08	-	-	5,036	27,871.15	30,618.88	-

002167	东方锆业	2014-01-02	重大 事项	11.39	2014- 07-01	11.10	3,637	36,986.29	41,425.43	-
002252	上海莱士	2014-06-13	重大 事项	63.30	-	-	1,265	20,701.22	80,074.50	-
600755	厦门国贸	2014-06-27	重大 事项	4.85	2014- 07-07	4.74	7,589	33,526.93	36,806.65	-
000762	西藏矿业	2014-04-29	重大 资产 重组	10.54	-	-	3,916	50,525.93	41,274.64	-
600490	鹏欣资源	2014-04-01	重大 事项	6.11	2014- 07-15	6.11	6,343	37,990.81	38,755.73	-
600757	长江传媒	2014-06-17	重大 事项	8.85	-	-	3,117	22,312.85	27,585.45	-
601012	隆基股份	2014-06-19	重大 事项	15.50	2014- 07-01	15.60	2,800	38,444.00	43,400.00	-
601777	力帆股份	2014-06-24	重大 事项	6.39	2014- 07-08	6.70	2,637	17,114.41	16,850.43	-
000852	江钻股份	2014-05-28	重大	15.80	-	-	1,376	21,021.77	21,740.80	-

			事 项							
002635	安洁 科技	2014-06-30	重 大 事 项	31.99	-	-	564	24,701.02	18,042.36	-

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。

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

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。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

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。

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 2014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	78,489.2 5	-	-	-	-	-	-	-	-	78,489.2 5
结算备付 金	1,345,19 7.33	-	-	-	-	-	-	-	-	1,345,19 7.33
存出保证 金	2,461.54	-	-	-	-	-	-	-	-	2,461.54
交易性金 融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	15,304,1 79.35	15,304,1 79.35
应收证券 清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	43,957.3 2	43,957.3 2
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	517.41	517.41
应收申购 款	-	-	-	-	-	-	-	-	198.81	198.81
资产总计	1,426,14 8.12	-	-	-	-	-	-	-	15,348,8 52.89	16,775,0 01.01
负债										
应付赎回 款	-	-	-	-	-	-	-	-	45,979.5 6	45,979.5 6
应付管理 人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	13,975.7 2	13,975.7 2
应付托管 费	-	-	-	-	-	-	-	-	3,074.67	3,074.67
应付交易 费用	-	-	-	-	-	-	-	-	8,882.99	8,882.99
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	472,267. 40	472,267. 40

负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	544,180.34	544,180.34
利率敏感度缺口	1,426,148.12	-	-	-	-	-	-	-	14,804,672.55	16,230,820.67
上年度末 2013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	356,151.87	-	-	-	-	-	-	-	-	356,151.87
结算备付金	1,607,454.51	-	-	-	-	-	-	-	-	1,607,454.51
存出保证金	13,357.69	-	-	-	-	-	-	-	-	13,357.69
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	19,780,319.16	19,780,319.16
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	-	-	-	-	-	-	-	-	864.58	864.58
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	2,982.11	2,982.11
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,976,964.07	-	-	-	-	-	-	-	19,784,165.85	21,761,129.92
负债										
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	52,736.87	52,736.87

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	18,655.75	18,655.75
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	4,104.25	4,104.25
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	13,340.40	13,340.40
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	382,119.01	382,119.01
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	470,956.28	470,956.28
利率敏感度缺口	1,976,964.07	-	-	-	-	-	-	-	19,313,209.57	21,290,173.64

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：人民币元）	
		本期末 2014年6月30日	上年度末 2013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 2014 年 6 月 30 日		上年度末 2013 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	15,304,179.35	94.29	19,780,319.16	92.91
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	15,304,179.35	94.29	19,780,319.16	92.91

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：人民币元）	
		本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
	业绩比较基准变动+5%	786,847.11	3,599,204.25
	业绩比较基准变动-5%	-786,847.11	-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	15,304,179.35	91.23
	其中：股票	15,304,179.35	91.23
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-

4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,423,686.58	8.49
7	其他各项资产	47,135.08	0.28
8	合计	16,775,001.01	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	282,700.11	1.74
B	采矿业	473,220.28	2.92
C	制造业	9,264,273.84	57.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	417,057.08	2.57
E	建筑业	414,787.75	2.56
F	批发和零售业	1,015,471.15	6.26
G	交通运输、仓储和邮政业	426,411.19	2.63
H	住宿和餐饮业	22,974.00	0.14
I	信息传输、软件和信息技术服务业	776,656.67	4.79
J	金融业	189,169.44	1.17
K	房地产业	1,172,845.83	7.23
L	租赁和商务服务业	235,797.14	1.45
M	科学研究和技术服务业	62,604.00	0.39
N	水利、环境和公共设施管理业	141,348.75	0.87
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	152,446.75	0.94
S	综合	101,917.64	0.63
	合计	15,149,681.62	93.34

7.2.2 积极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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	154,497.73	0.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	154,497.73	0.95

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	600570	恒生电子	3,963	116,512.20	0.72
2	600418	江淮汽车	8,050	82,110.00	0.51
3	600587	新华医疗	1,100	82,005.00	0.51
4	600557	康缘药业	2,830	81,221.00	0.50
5	000559	万向钱潮	7,632	78,456.96	0.48
6	600879	航天电子	6,552	77,182.56	0.48
7	600312	平高电气	5,438	75,805.72	0.47
8	002190	成飞集成	1,282	75,638.00	0.47
9	000998	隆平高科	2,749	75,542.52	0.47

10	002022	科华生物	3,126	72,054.30	0.44
11	600201	金宇集团	2,300	71,576.00	0.44
12	601099	太平洋	11,200	71,344.00	0.44
13	600872	中炬高新	6,423	68,533.41	0.42
14	600398	海澜之家	7,200	66,240.00	0.41
15	002005	德豪润达	7,854	65,737.98	0.41
16	600967	北方创业	5,200	65,260.00	0.40
17	002063	远光软件	3,183	65,092.35	0.40
18	000977	浪潮信息	1,800	63,324.00	0.39
19	600645	中源协和	2,256	62,604.00	0.39
20	002405	四维图新	3,759	62,474.58	0.38
21	002250	联化科技	4,372	62,082.40	0.38
22	002152	广电运通	3,622	61,718.88	0.38
23	600759	正和股份	6,013	61,452.86	0.38
24	600517	置信电气	6,003	60,990.48	0.38
25	000511	烯碳新材	9,036	60,902.64	0.38
26	600525	长园集团	5,467	60,355.68	0.37
27	600584	长电科技	6,776	59,832.08	0.37
28	600138	中青旅	2,737	59,611.86	0.37
29	002440	闰土股份	3,194	59,089.00	0.36
30	600694	大商股份	2,300	58,719.00	0.36
31	600522	中天科技	4,473	58,551.57	0.36
32	600770	综艺股份	6,212	57,523.12	0.35
33	600643	爱建股份	6,169	56,693.11	0.35
34	600601	方正科技	17,610	56,175.90	0.35
35	600881	亚泰集团	15,200	55,936.00	0.34
36	600175	美都控股	9,500	54,625.00	0.34
37	600675	中华企业	11,251	54,567.35	0.34
38	600037	歌华有线	5,179	54,483.08	0.34
39	000712	锦龙股份	3,620	54,046.60	0.33
40	002219	恒康医疗	2,441	53,653.18	0.33
41	600654	飞乐股份	5,910	53,485.50	0.33
42	600811	东方集团	10,300	53,457.00	0.33
43	000897	津滨发展	10,566	52,935.66	0.33
44	600820	隧道股份	10,866	52,700.10	0.32
45	600200	江苏吴中	5,009	52,043.51	0.32
46	002092	中泰化学	8,400	51,912.00	0.32
47	002437	誉衡药业	1,002	51,603.00	0.32
48	600511	国药股份	2,261	51,324.70	0.32
49	002153	石基信息	1,000	51,300.00	0.32
50	002004	华邦颖泰	2,732	50,815.20	0.31

51	600635	大众公用	10,556	50,563.24	0.31
52	002701	奥瑞金	2,506	50,546.02	0.31
53	600747	大连控股	8,093	50,257.53	0.31
54	002340	格林美	4,488	50,220.72	0.31
55	002048	宁波华翔	3,365	50,138.50	0.31
56	000997	新大陆	2,876	49,927.36	0.31
57	600805	悦达投资	5,427	49,874.13	0.31
58	600158	中体产业	5,310	49,807.80	0.31
59	002191	劲嘉股份	3,706	49,289.80	0.30
60	600787	中储股份	3,751	49,025.57	0.30
61	600410	华胜天成	4,070	48,392.30	0.30
62	002266	浙富控股	6,800	48,212.00	0.30
63	600432	吉恩镍业	3,300	47,652.00	0.29
64	600110	中科英华	9,069	47,612.25	0.29
65	000550	江铃汽车	1,621	46,976.58	0.29
66	600422	昆明制药	2,233	46,915.33	0.29
67	600478	科力远	2,068	46,860.88	0.29
68	000848	承德露露	2,345	46,595.15	0.29
69	603766	隆鑫通用	5,259	46,489.56	0.29
70	600261	阳光照明	4,686	46,297.68	0.29
71	002073	软控股份	4,826	46,184.82	0.28
72	600978	宜华木业	9,389	45,818.32	0.28
73	600151	航天机电	5,965	45,572.60	0.28
74	000988	华工科技	4,847	45,513.33	0.28
75	600797	浙大网新	6,591	45,148.35	0.28
76	002049	同方国芯	1,880	44,650.00	0.28
77	600651	飞乐音响	5,992	44,340.80	0.27
78	000788	北大医药	2,900	44,022.00	0.27
79	000939	凯迪电力	5,944	43,985.60	0.27
80	600765	中航重机	3,645	43,740.00	0.27
81	000513	丽珠集团	925	43,687.75	0.27
82	601012	隆基股份	2,800	43,400.00	0.27
83	000735	罗牛山	7,053	43,164.36	0.27
84	000541	佛山照明	4,325	43,077.00	0.27
85	600500	中化国际	6,683	43,038.52	0.27
86	600139	西部资源	3,106	42,862.80	0.26
87	600572	康恩贝	3,056	42,386.72	0.26
88	600366	宁波韵升	2,852	42,323.68	0.26
89	002271	东方雨虹	1,700	42,245.00	0.26
90	600284	浦东建设	4,488	42,232.08	0.26
91	600112	天成控股	3,293	42,216.26	0.26

92	600320	振华重工	13,200	42,108.00	0.26
93	002223	鱼跃医疗	1,735	42,073.75	0.26
94	002155	辰州矿业	5,600	41,888.00	0.26
95	600198	大唐电信	2,800	41,720.00	0.26
96	000887	中鼎股份	4,318	41,711.88	0.26
97	600351	亚宝药业	4,501	41,409.20	0.26
98	000762	西藏矿业	3,916	41,274.64	0.25
99	600183	生益科技	6,674	41,111.84	0.25
100	600521	华海药业	3,693	40,807.65	0.25
101	000049	德赛电池	1,000	40,170.00	0.25
102	002309	中利科技	2,309	40,153.51	0.25
103	600038	哈飞股份	1,439	40,047.37	0.25
104	600776	东方通信	2,975	39,716.25	0.24
105	000690	宝新能源	9,654	39,388.32	0.24
106	600884	杉杉股份	2,278	39,158.82	0.24
107	002396	星网锐捷	1,388	38,850.12	0.24
108	000829	天音控股	4,592	38,848.32	0.24
109	600490	鹏欣资源	6,343	38,755.73	0.24
110	600835	上海机电	2,485	38,716.30	0.24
111	600611	大众交通	5,883	38,651.31	0.24
112	600426	华鲁恒升	5,327	38,354.40	0.24
113	000028	国药一致	960	38,352.00	0.24
114	600169	太原重工	13,500	38,340.00	0.24
115	002428	云南锗业	3,148	38,185.24	0.24
116	002273	水晶光电	2,067	37,826.10	0.23
117	600387	海越股份	2,504	37,760.32	0.23
118	002690	美亚光电	1,070	37,738.90	0.23
119	002595	豪迈科技	800	37,720.00	0.23
119	000969	安泰科技	4,100	37,720.00	0.23
121	600503	华丽家族	9,240	37,699.20	0.23
122	600699	均胜电子	1,500	37,695.00	0.23
123	600673	东阳光科	3,072	37,632.00	0.23
124	601519	大智慧	6,403	37,585.61	0.23
125	000809	铁岭新城	3,159	37,497.33	0.23
126	002508	老板电器	1,325	37,457.75	0.23
127	600596	新安股份	4,084	37,368.60	0.23
128	002573	国电清新	2,121	37,287.18	0.23
129	600161	天坛生物	2,016	37,054.08	0.23
130	002368	太极股份	1,100	36,839.00	0.23
131	600755	厦门国贸	7,589	36,806.65	0.23
132	600704	物产中大	4,414	36,547.92	0.23

133	002424	贵州百灵	1,475	36,373.50	0.22
134	000671	阳光城	4,118	36,197.22	0.22
135	000616	亿城投资	11,366	36,143.88	0.22
136	000528	柳工	6,200	36,084.00	0.22
137	000422	湖北宜化	7,200	36,072.00	0.22
138	600122	宏图高科	7,238	36,045.24	0.22
139	600171	上海贝岭	4,401	35,912.16	0.22
140	600816	安信信托	2,490	35,856.00	0.22
141	002317	众生药业	1,792	35,786.24	0.22
142	600435	北方导航	2,910	35,647.50	0.22
143	000759	中百集团	4,389	35,550.90	0.22
144	600545	新疆城建	4,326	35,473.20	0.22
145	002477	雏鹰农牧	3,768	35,456.88	0.22
146	600270	外运发展	2,928	35,370.24	0.22
147	600125	铁龙物流	7,300	35,186.00	0.22
148	600790	轻纺城	3,916	35,165.68	0.22
149	600056	中国医药	3,298	35,057.74	0.22
150	002414	高德红外	1,919	34,906.61	0.22
151	600509	天富热电	4,321	34,870.47	0.21
152	600160	巨化股份	7,200	34,848.00	0.21
153	000566	海南海药	3,193	34,739.84	0.21
154	000078	海王生物	4,672	34,619.52	0.21
155	002181	粤传媒	2,186	34,538.80	0.21
156	000006	深振业 A	7,493	34,317.94	0.21
157	002052	同洲电子	3,800	34,162.00	0.21
158	600580	卧龙电气	4,436	34,024.12	0.21
159	600761	安徽合力	3,455	33,997.20	0.21
160	002050	三花股份	3,122	33,904.92	0.21
161	002431	棕榈园林	1,900	33,820.00	0.21
162	600220	江苏阳光	11,348	33,703.56	0.21
163	600067	冠城大通	6,713	33,632.13	0.21
164	600416	湘电股份	3,488	33,380.16	0.21
165	000415	渤海租赁	4,250	32,640.00	0.20
166	600409	三友化工	7,461	32,604.57	0.20
167	600187	国中水务	7,100	32,518.00	0.20
168	600240	华业地产	6,661	32,505.68	0.20
169	600825	新华传媒	4,159	32,481.79	0.20
170	600458	时代新材	3,675	32,413.50	0.20
171	600812	华北制药	6,582	32,317.62	0.20
172	000510	金路集团	4,915	32,291.55	0.20
173	600536	中国软件	1,500	32,250.00	0.20

174	600325	华发股份	5,193	32,248.53	0.20
175	002041	登海种业	1,158	32,238.72	0.20
176	002018	华星化工	3,800	32,224.00	0.20
177	002069	獐子岛	2,300	32,154.00	0.20
178	600289	亿阳信通	3,591	32,139.45	0.20
179	600266	北京城建	4,300	32,121.00	0.20
180	600685	广船国际	1,875	32,118.75	0.20
181	000652	泰达股份	8,296	32,105.52	0.20
182	601717	郑煤机	6,600	32,076.00	0.20
183	000088	盐田港	6,307	32,039.56	0.20
184	000540	中天城投	6,205	31,645.50	0.19
185	600059	古越龙山	3,970	31,640.90	0.19
186	600064	南京高科	2,937	31,572.75	0.19
187	002161	远望谷	4,094	31,523.80	0.19
188	000933	神火股份	9,100	31,486.00	0.19
189	600292	中电远达	1,653	31,473.12	0.19
190	600720	祁连山	4,993	31,306.11	0.19
191	600563	法拉电子	939	31,221.75	0.19
192	000726	鲁泰 A	3,549	31,195.71	0.19
193	002444	巨星科技	3,275	31,112.50	0.19
194	000823	超声电子	2,563	31,089.19	0.19
195	600582	天地科技	3,900	31,083.00	0.19
196	000488	晨鸣纸业	7,128	31,078.08	0.19
197	002183	怡亚通	4,013	31,020.49	0.19
198	000697	炼石有色	2,242	31,006.86	0.19
199	600086	东方金钰	1,736	31,004.96	0.19
200	000786	北新建材	2,259	30,993.48	0.19
201	002056	横店东磁	1,588	30,902.48	0.19
202	600894	广日股份	2,800	30,884.00	0.19
203	600017	日照港	11,901	30,823.59	0.19
204	002168	深圳惠程	4,177	30,659.18	0.19
205	000612	焦作万方	5,036	30,618.88	0.19
206	002249	大洋电机	2,199	30,566.10	0.19
207	600481	双良节能	3,120	30,482.40	0.19
208	002064	华峰氨纶	3,559	30,465.04	0.19
209	000982	中银绒业	4,200	30,450.00	0.19
210	600851	海欣股份	4,691	30,444.59	0.19
211	000877	天山股份	4,966	30,342.26	0.19
212	601718	际华集团	12,300	30,258.00	0.19
213	600566	洪城股份	1,300	30,030.00	0.19
214	600859	王府井	1,900	30,020.00	0.18

215	600132	重庆啤酒	2,000	29,840.00	0.18
216	002029	七匹狼	3,650	29,492.00	0.18
217	000926	福星股份	4,520	29,470.40	0.18
218	000816	江淮动力	6,807	29,406.24	0.18
219	002118	紫鑫药业	2,076	29,375.40	0.18
220	000572	海马汽车	7,930	29,341.00	0.18
221	600640	号百控股	1,700	29,308.00	0.18
222	601369	陕鼓动力	5,200	29,172.00	0.18
223	600460	士兰微	4,917	29,108.64	0.18
224	600575	芜湖港	7,818	29,082.96	0.18
225	600073	上海梅林	3,961	28,796.47	0.18
226	601311	骆驼股份	2,683	28,761.76	0.18
227	000830	鲁西化工	8,158	28,716.16	0.18
228	002311	海大集团	2,600	28,626.00	0.18
229	600885	宏发股份	1,300	28,561.00	0.18
230	000973	佛塑科技	5,384	28,427.52	0.18
231	601000	唐山港	6,487	28,413.06	0.18
232	000669	金鸿能源	1,650	28,347.00	0.17
233	000050	深天马 A	2,262	28,275.00	0.17
234	000543	皖能电力	4,272	28,195.20	0.17
235	000667	美好集团	16,453	28,134.63	0.17
236	002262	恩华药业	1,261	28,006.81	0.17
237	000975	银泰资源	3,498	27,879.06	0.17
238	000021	长城开发	4,718	27,836.20	0.17
239	002028	思源电气	2,958	27,805.20	0.17
240	600874	创业环保	3,478	27,650.10	0.17
241	600757	长江传媒	3,117	27,585.45	0.17
242	600636	三爱富	2,184	27,583.92	0.17
243	000919	金陵药业	1,979	27,547.68	0.17
244	002325	洪涛股份	3,359	27,543.80	0.17
245	000979	中弘股份	9,234	27,424.98	0.17
246	000886	海南高速	6,310	27,322.30	0.17
247	000587	金叶珠宝	2,631	27,309.78	0.17
248	600401	海润光伏	3,418	27,275.64	0.17
249	600612	老凤祥	1,073	27,157.63	0.17
250	002663	普邦园林	2,269	27,137.24	0.17
251	600120	浙江东方	2,400	27,120.00	0.17
252	600300	维维股份	6,700	27,068.00	0.17
253	002648	卫星石化	1,882	26,931.42	0.17
254	600528	中铁二局	5,800	26,854.00	0.17
255	002011	盾安环境	3,386	26,850.98	0.17

256	601002	晋亿实业	3,176	26,678.40	0.16
257	600482	风帆股份	2,487	26,610.90	0.16
258	000518	四环生物	8,281	26,582.01	0.16
259	600141	兴发集团	2,709	26,575.29	0.16
260	600551	时代出版	1,592	26,538.64	0.16
261	002714	牧原股份	600	26,430.00	0.16
262	600251	冠农股份	1,764	26,371.80	0.16
263	600628	新世界	3,384	26,259.84	0.16
264	000636	风华高科	4,201	26,214.24	0.16
265	000900	现代投资	5,644	26,018.84	0.16
266	600311	荣华实业	5,385	25,955.70	0.16
267	000685	中山公用	2,526	25,689.42	0.16
268	600004	白云机场	3,645	25,660.80	0.16
269	000860	顺鑫农业	1,825	25,623.00	0.16
270	600993	马应龙	1,630	25,607.30	0.16
271	600748	上实发展	3,445	25,596.35	0.16
272	600329	中新药业	1,645	25,481.05	0.16
273	600740	山西焦化	4,874	25,442.28	0.16
274	002408	齐翔腾达	1,821	25,384.74	0.16
275	002025	航天电器	1,615	25,339.35	0.16
276	002179	中航光电	1,441	25,289.55	0.16
277	000563	陕国投 A	3,931	25,276.33	0.16
278	002277	友阿股份	2,658	25,251.00	0.16
279	000921	海信科龙	2,900	25,230.00	0.16
280	600380	健康元	4,984	25,119.36	0.15
281	001696	宗申动力	5,544	25,114.32	0.15
282	600456	宝钛股份	1,692	25,109.28	0.15
283	002013	中航机电	1,692	25,058.52	0.15
284	002384	东山精密	2,478	25,052.58	0.15
285	600826	兰生股份	1,683	24,942.06	0.15
286	002358	森源电气	1,000	24,860.00	0.15
287	600438	通威股份	2,618	24,844.82	0.15
288	600322	天房发展	7,253	24,805.26	0.15
289	600260	凯乐科技	3,758	24,765.22	0.15
290	002242	九阳股份	2,500	24,700.00	0.15
291	600729	重庆百货	1,257	24,561.78	0.15
292	002276	万马股份	3,887	24,526.97	0.15
293	002123	荣信股份	3,174	24,344.58	0.15
294	002254	泰和新材	2,851	24,090.95	0.15
295	002285	世联行	3,006	24,078.06	0.15
296	600864	哈投股份	2,772	24,060.96	0.15

297	600831	广电网络	3,111	24,048.03	0.15
298	600487	亨通光电	1,664	23,928.32	0.15
299	600823	世茂股份	2,800	23,912.00	0.15
300	002698	博实股份	959	23,898.28	0.15
301	600970	中材国际	3,500	23,870.00	0.15
302	002461	珠江啤酒	1,689	23,848.68	0.15
303	000099	中信海直	2,683	23,771.38	0.15
304	002140	东华科技	1,412	23,763.96	0.15
305	002083	孚日股份	5,778	23,632.02	0.15
306	000031	中粮地产	7,226	23,556.76	0.15
307	002345	潮宏基	1,370	23,454.40	0.14
308	000090	天健集团	3,034	23,392.14	0.14
309	002216	三全食品	1,295	23,374.75	0.14
310	000501	鄂武商 A	1,987	23,247.90	0.14
311	002237	恒邦股份	1,820	23,241.40	0.14
312	601886	江河创建	3,700	23,125.00	0.14
313	000426	兴业矿业	2,416	23,096.96	0.14
314	000930	中粮生化	6,217	23,065.07	0.14
315	600298	安琪酵母	1,578	23,007.24	0.14
316	600586	金晶科技	7,870	22,980.40	0.14
317	600754	锦江股份	1,400	22,974.00	0.14
318	000525	红太阳	1,638	22,948.38	0.14
319	600180	瑞茂通	2,167	22,861.85	0.14
320	600389	江山股份	700	22,827.00	0.14
321	601515	东风股份	1,918	22,785.84	0.14
322	000850	华茂股份	4,414	22,776.24	0.14
323	000627	天茂集团	8,646	22,652.52	0.14
324	600750	江中药业	1,443	22,611.81	0.14
325	000650	仁和药业	4,760	22,610.00	0.14
326	000417	合肥百货	4,366	22,572.22	0.14
327	600021	上海电力	5,164	22,566.68	0.14
328	000680	山推股份	7,900	22,515.00	0.14
329	600983	合肥三洋	1,728	22,429.44	0.14
330	600702	沱牌舍得	2,134	22,342.98	0.14
331	000931	中关村	4,230	22,249.80	0.14
332	000066	长城电脑	5,268	22,230.96	0.14
333	002371	七星电子	1,100	22,066.00	0.14
334	002308	威创股份	3,300	22,044.00	0.14
335	002091	江苏国泰	1,437	22,000.47	0.14
336	601101	昊华能源	3,900	21,957.00	0.14
337	002393	力生制药	748	21,834.12	0.13

338	600844	丹化科技	3,681	21,828.33	0.13
339	600496	精工钢构	3,342	21,823.26	0.13
340	000852	江钻股份	1,376	21,740.80	0.13
341	600176	中国玻纤	2,797	21,704.72	0.13
342	600639	浦东金桥	2,132	21,703.76	0.13
343	002646	青青稞酒	1,400	21,686.00	0.13
344	002122	天马股份	4,604	21,638.80	0.13
345	002672	东江环保	789	21,563.37	0.13
346	002275	桂林三金	1,412	21,434.16	0.13
347	600997	开滦股份	4,900	21,364.00	0.13
348	600971	恒源煤电	4,000	21,360.00	0.13
349	000693	华泽钴镍	900	21,312.00	0.13
350	002221	东华能源	1,900	21,261.00	0.13
351	000777	中核科技	1,832	21,049.68	0.13
352	600199	金种子酒	3,000	21,030.00	0.13
353	600425	青松建化	4,428	20,855.88	0.13
354	002128	露天煤业	3,200	20,800.00	0.13
355	601608	中信重工	6,637	20,773.81	0.13
356	600335	国机汽车	1,315	20,658.65	0.13
357	002342	巨力索具	3,818	20,540.84	0.13
358	600858	银座股份	2,921	20,476.21	0.13
359	600026	中海发展	5,062	20,450.48	0.13
360	002203	海亮股份	1,855	20,423.55	0.13
361	000732	泰禾集团	2,391	20,419.14	0.13
362	601880	大连港	7,711	20,279.93	0.12
363	000962	东方钨业	2,125	20,272.50	0.12
364	600439	瑞贝卡	5,218	20,245.84	0.12
365	600429	三元股份	2,784	20,128.32	0.12
366	002281	光迅科技	583	20,049.37	0.12
367	600039	四川路桥	3,590	20,032.20	0.12
368	600537	亿晶光电	1,936	19,979.52	0.12
369	601678	滨化股份	2,658	19,881.84	0.12
370	600736	苏州高新	5,095	19,819.55	0.12
371	600392	盛和资源	1,100	19,778.00	0.12
372	600428	中远航运	6,749	19,774.57	0.12
373	601801	皖新传媒	1,477	19,747.49	0.12
374	600479	千金药业	1,711	19,727.83	0.12
375	002480	新筑股份	2,740	19,700.60	0.12
376	000799	酒鬼酒	1,800	19,638.00	0.12
377	002482	广田股份	1,639	19,618.83	0.12
378	600830	香溢融通	2,530	19,481.00	0.12

379	600239	云南城投	4,512	19,446.72	0.12
380	000030	富奥股份	3,000	19,350.00	0.12
381	600006	东风汽车	6,493	19,349.14	0.12
382	002447	壹桥苗业	1,572	19,319.88	0.12
383	002332	仙琚制药	2,426	19,310.96	0.12
384	002588	史丹利	940	19,270.00	0.12
385	002204	大连重工	1,500	19,140.00	0.12
386	601126	四方股份	1,324	18,800.80	0.12
387	600616	金枫酒业	2,406	18,766.80	0.12
388	002244	滨江集团	3,300	18,711.00	0.12
389	600803	威远生化	1,600	18,688.00	0.12
390	600088	中视传媒	1,279	18,571.08	0.11
391	601616	广电电气	5,200	18,564.00	0.11
392	601965	中国汽研	1,500	18,555.00	0.11
393	600195	中牧股份	1,420	18,474.20	0.11
394	000703	恒逸石化	2,800	18,452.00	0.11
395	600773	西藏城投	1,862	18,415.18	0.11
396	600467	好当家	3,375	18,393.75	0.11
397	002479	富春环保	2,354	18,125.80	0.11
398	600508	上海能源	2,300	18,124.00	0.11
399	002572	索菲亚	1,100	18,084.00	0.11
400	002635	安洁科技	564	18,042.36	0.11
401	002093	国脉科技	2,729	18,038.69	0.11
402	002251	步步高	1,400	18,032.00	0.11
403	600337	美克股份	3,141	18,029.34	0.11
404	002233	塔牌集团	2,907	17,616.42	0.11
405	600963	岳阳林纸	5,842	17,584.42	0.11
406	002078	太阳纸业	5,556	17,501.40	0.11
407	002557	洽洽食品	1,051	17,425.58	0.11
408	600078	澄星股份	3,114	17,376.12	0.11
409	600614	鼎立股份	1,726	17,329.04	0.11
410	603366	日出东方	1,274	17,211.74	0.11
411	002463	沪电股份	5,326	17,202.98	0.11
412	000596	古井贡酒	900	17,163.00	0.11
413	002293	罗莱家纺	853	17,145.30	0.11
414	002392	北京利尔	1,864	17,130.16	0.11
415	000506	中润资源	4,421	17,065.06	0.11
416	002601	佰利联	919	17,001.50	0.10
417	600449	宁夏建材	2,310	16,909.20	0.10
418	601777	力帆股份	2,637	16,850.43	0.10
419	002574	明牌珠宝	658	16,772.42	0.10

420	600815	厦工股份	4,586	16,738.90	0.10
421	002194	武汉凡谷	1,310	16,702.50	0.10
422	600850	华东电脑	853	16,684.68	0.10
423	601011	宝泰隆	1,282	16,678.82	0.10
424	600888	新疆众和	3,050	16,653.00	0.10
425	000655	金岭矿业	2,418	16,611.66	0.10
426	600488	天药股份	3,783	16,380.39	0.10
427	002154	报喜鸟	2,816	16,304.64	0.10
428	600723	首商股份	2,645	16,240.30	0.10
429	000951	中国重汽	1,365	16,066.05	0.10
430	600780	通宝能源	3,679	15,856.49	0.10
431	600197	伊力特	1,730	15,639.20	0.10
432	600737	中粮屯河	3,262	15,592.36	0.10
433	600801	华新水泥	2,332	15,554.44	0.10
434	002489	浙江永强	1,482	15,442.44	0.10
435	600657	信达地产	4,866	15,425.22	0.10
436	603077	和邦股份	1,174	15,262.00	0.09
437	002267	陕天然气	1,668	15,178.80	0.09
438	600468	百利电气	1,522	15,159.12	0.09
439	600491	龙元建设	4,566	15,022.14	0.09
440	002327	富安娜	1,348	15,003.24	0.09
441	002315	焦点科技	351	14,973.66	0.09
442	601566	九牧王	1,400	14,756.00	0.09
443	600683	京投银泰	2,962	14,721.14	0.09
444	600333	长春燃气	2,127	14,697.57	0.09
445	002490	山东墨龙	1,717	14,594.50	0.09
446	000688	建新矿业	2,800	14,588.00	0.09
447	601908	京运通	2,041	14,552.33	0.09
448	002678	珠江钢琴	1,552	14,511.20	0.09
449	601233	桐昆股份	2,354	14,430.02	0.09
450	601999	出版传媒	1,800	14,274.00	0.09
451	601636	旗滨集团	1,991	14,255.56	0.09
452	601339	百隆东方	1,752	14,173.68	0.09
453	600280	中央商场	1,400	14,126.00	0.09
454	601100	恒立油缸	1,524	14,112.24	0.09
455	002075	沙钢股份	3,662	14,098.70	0.09
456	000620	新华联	2,512	14,092.32	0.09
457	600869	远东电缆	1,729	14,091.35	0.09
458	002226	江南化工	1,311	13,909.71	0.09
459	002305	南国置业	2,285	13,824.25	0.09
460	600162	香江控股	2,976	13,808.64	0.09

461	000552	靖远煤电	1,700	13,804.00	0.09
462	600724	宁波富达	3,479	13,707.26	0.08
463	002032	苏泊尔	1,000	13,690.00	0.08
464	000409	山东地矿	1,500	13,650.00	0.08
465	000927	一汽夏利	3,821	13,640.97	0.08
466	601388	怡球资源	1,262	13,616.98	0.08
467	600618	氯碱化工	1,832	13,611.76	0.08
468	600054	黄山旅游	1,061	13,527.75	0.08
469	000861	海印股份	1,409	13,512.31	0.08
470	603001	奥康国际	980	13,475.00	0.08
471	600507	方大特钢	4,232	13,373.12	0.08
472	600510	黑牡丹	2,567	13,348.40	0.08
473	601208	东材科技	1,974	13,324.50	0.08
474	000719	大地传媒	1,118	13,248.30	0.08
475	002238	天威视讯	1,057	13,244.21	0.08
476	002430	杭氧股份	1,935	13,177.35	0.08
477	600094	大名城	2,055	12,782.10	0.08
478	000987	广州友谊	1,399	12,744.89	0.08
479	603555	贵人鸟	1,000	12,730.00	0.08
480	600268	国电南自	2,551	12,652.96	0.08
481	601010	文峰股份	1,811	12,640.78	0.08
482	000780	平庄能源	3,200	12,608.00	0.08
483	002419	天虹商场	1,326	12,597.00	0.08
484	002498	汉缆股份	1,731	12,428.58	0.08
485	002378	章源钨业	700	12,306.00	0.08
486	600743	华远地产	4,340	12,065.20	0.07
487	002320	海峡股份	1,345	11,862.90	0.07
488	600397	安源煤业	3,397	11,515.83	0.07
489	002662	京威股份	1,420	11,402.60	0.07
490	000631	顺发恒业	2,474	11,182.48	0.07
491	002705	新宝股份	700	10,458.00	0.06
492	002503	搜于特	1,261	10,340.20	0.06
493	600184	光电股份	476	10,043.60	0.06
494	002225	濮耐股份	1,885	9,971.65	0.06
495	002612	朗姿股份	484	9,718.72	0.06
496	000603	盛达矿业	757	8,940.17	0.06
497	002534	杭锅股份	581	7,791.21	0.05
498	000935	四川双马	1,437	7,486.77	0.05

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

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	002252	上海莱士	1,265	80,074.50	0.49
2	002167	东方锆业	3,637	41,425.43	0.26
3	002638	勤上光电	2,332	32,997.80	0.20

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	600201	金宇集团	78,625.00	0.37
2	002266	浙富控股	78,256.00	0.37
3	601099	太平洋	74,899.00	0.35
4	600398	海澜之家	71,917.00	0.34
5	600694	大商股份	68,475.00	0.32
6	600967	北方创业	64,848.00	0.30
7	600811	东方集团	60,260.00	0.28
8	600175	美都控股	57,624.00	0.27
9	600432	吉恩镍业	49,538.00	0.23
10	002155	辰州矿业	44,040.00	0.21
11	002595	豪迈科技	41,166.20	0.19
12	600169	太原重工	41,160.00	0.19
13	000528	柳 工	40,256.00	0.19
14	600160	巨化股份	40,092.00	0.19
15	601012	隆基股份	38,444.00	0.18
16	600582	天地科技	38,010.00	0.18
17	600536	中国软件	37,509.00	0.18
18	002052	同洲电子	37,087.00	0.17
19	000933	神火股份	36,162.00	0.17
20	600187	国中水务	35,625.00	0.17

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	002008	大族激光	145,886.37	0.69
2	600594	益佰制药	130,061.00	0.61
3	600499	科达洁能	129,604.30	0.61

4	601929	吉视传媒	123,957.40	0.58
5	002400	省广股份	121,983.00	0.57
6	600388	龙净环保	109,822.00	0.52
7	600880	博瑞传播	102,518.63	0.48
8	002410	广联达	89,955.56	0.42
9	600717	天津港	79,173.96	0.37
10	002292	奥飞动漫	74,699.60	0.35
11	000413	东旭光电	69,172.00	0.32
12	002429	兆驰股份	60,806.40	0.29
13	600570	恒生电子	60,238.00	0.28
14	601216	内蒙君正	53,989.90	0.25
15	600373	中文传媒	53,284.22	0.25
16	600557	康缘药业	48,952.00	0.23
17	600138	中青旅	48,833.00	0.23
18	002470	金正大	48,026.26	0.23
19	601588	北辰实业	46,680.41	0.22
20	000977	浪潮信息	45,759.00	0.21

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

买入股票成本（成交）总额	5,139,686.49
卖出股票收入（成交）总额	10,207,642.00

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序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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金报告期末投资贵金属。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金报告期末投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本基金投资国债期货的投资政策****7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金报告期末投资国债期货。

7.11.3 本基金投资国债期货的投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	2,461.54
2	应收证券清算款	43,957.32
3	应收股利	-
4	应收利息	517.41
5	应收申购款	198.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	47,135.08

7.12.4 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。

7.12.5.1 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	600418	江淮汽车	82,110.00	0.51	重大资产重组

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	002252	上海莱士	80,074.50	0.49	重大事项
2	002167	东方锆业	41,425.43	0.26	重大事项
3	002638	勤上光电	32,997.80	0.20	重大事项

7.12.6 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	347	1,705.75	0.00	0.00%	591,895.00	100.00%
金鹰 500B	165	3,587.24	45,434.00	7.68%	546,461.00	92.32%
金鹰 500	451	32,600.61	0.00	0.00%	14,702,875.26	100.00%
合计	963	16,497.06	45,434.00	0.29%	15,841,231.26	99.71%

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	胡红云	52,500.00	8.87%

2	蔡笑英	50,100.00	8.46%
3	孟昭鸣	49,160.00	8.31%
4	屈敏茹	45,242.00	7.64%
5	胡葛芳	37,410.00	6.32%
6	王彩虹	33,503.00	5.66%
7	李冬华	26,504.00	4.48%
8	王菁菁	25,009.00	4.23%
9	谢晓虹	25,006.00	4.22%
10	于湘宾	25,003.00	4.22%

金鹰500B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	蔡晨珮	50,009.00	8.45%
2	屈敏茹	50,003.00	8.45%
3	钟金好	50,003.00	8.45%
4	国信证券股份有限 公司	45,433.00	7.68%
5	洪婉惠	39,303.00	6.64%
6	何嘉欣	35,622.00	6.02%
7	李冬华	26,504.00	4.48%
8	王菁菁	25,009.00	4.23%
9	谢晓虹	25,005.00	4.22%
10	唐君	25,002.00	4.22%

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	0.0169%
	金鹰 500B	0.00	0.0%
	金鹰 500	231.61	0.0016%
	合计	331.61	0.0021%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基 金	金鹰 500A	0
	金鹰 500B	0
	金鹰 500	0
	合计	0

本基金基金经理持有本开放式基金	金鹰 500A	0
	金鹰 500B	0
	金鹰 500	0
	合计	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	770,701	770,701	18,732,140.36
本报告期基金总申购份额	-	-	2,551,129.46
减：本报告期基金总赎回份额	-	-	7,571,388.97
本报告期基金拆分变动份额	-178,806	-178,806	990,994.41
本报告期期末基金份额总额	591,895	591,895	14,702,875.26

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 178,806.00 份，金鹰 500 增加份额 357,612.00 份。

2、2014 年 1 月 2 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 633,382.41 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，经公司第四届董事会第三十七次会议决议通过，公司原总经理殷克胜先生已于 2014 年 6 月 5 日离职，由公司董事长刘东先生代行总经理职务。该事项已于 2014 年 6 月 9 日公告，详情请查看 2014 年 6 月 9 日的《证券时报》和公司网站公告内容；

2、本报告期内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事项。

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 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

本报告期内管理人、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稽查或处罚。

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	
国海证券	1	8,337,892.65	54.39%	7,267.74	54.02%	-
广州证券	1	6,992,012.61	45.61%	6,187.27	45.98%	-

注：1、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
- 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
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注：本报告期内无租用证券公司交易单元进行其他证券投资情况。

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	证券时报等	2014-01-02
2	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2014年度约定年收益率的公告	证券时报等	2014-01-03
3	金鹰中证500指数分级证券投资基金定期份额折算期间金鹰中证500A份额停复牌的公告	证券时报等	2014-01-03
4	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	证券时报等	2014-01-06
5	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	证券时报等	2014-01-06
6	金鹰中证500指数分级基金更新招募说明书全文2013年第2号	证券时报等	2014-01-14
7	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	证券时报等	2014-01-14
8	金鹰中证500指数分级证券投资基金2013年第四季度报告	证券时报等	2014-01-20

9	金鹰基金管理有限公司关于调整特定投资群体通过直销中心申购费率优惠的公告	证券时报等	2014-01-30
10	金鹰基金管理有限公司关于网上直销工行支付渠道因升级维护暂停服务的公告	证券时报等	2014-02-18
11	金鹰基金管理有限公司关于网上直销升级维护暂停服务的通知	证券时报等	2014-02-21
12	金鹰基金管理有限公司关于增加北京恒天明泽基金销售有限公司为代销机构的公告	证券时报等	2014-02-26
13	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金调整长期停牌股票估值方法的公告	证券时报等	2014-02-27
14	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金调整长期停牌股票估值方法的公告	证券时报等	2014-03-04
15	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业务以及参加其费率优惠活动的公告	证券时报等	2014-03-13
16	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	证券时报等	2014-03-14
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	证券时报等	2014-03-17
18	金鹰中证500指数分级证券投资基金2013年年度报告	证券时报等	2014-03-26
19	金鹰中证500指数分级证券投资基金2014年第1季度报告	证券时报等	2014-04-22
20	金鹰基金管理有限公司关于设立西安分公司的公告	证券时报等	2014-04-26
21	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金调整长期停牌股票估值方法的公告	证券时报等	2014-04-29
22	金鹰基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼任职务情况的公告	证券时报等	2014-05-17
23	金鹰基金管理有限公司关于总经理离职及董事长代行总经理职务的公告	证券时报等	2014-06-09
24	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	证券时报等	2014-06-12
25	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金调整长期停牌股票估值方法的公告	证券时报等	2014-06-14
26	金鹰基金管理有限公司关于增加天源证券有限公司为代销机构的公告	证券时报等	2014-06-18
27	金鹰基金管理有限公司关于调整特定投资群体通过直销中心申购费率优惠的公告	证券时报等	2014-06-21
28	金鹰基金管理有限公司关于网上直销建行渠道暂停服务的通知	证券时报等	2014-06-27

11 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期后，经公司第四届董事会第三十九次会议审议通过，聘请刘岩先生担任我公司总经理，自 2014 年 8 月 7 日起，我公司董事长刘东先生不再代行总经理职务。上述事项已于 2014 年 8 月 8 日进行了公告，并向广东证监局备案。

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
二〇一四年八月二十五日