

**金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金**  
**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

|  |           |
|--|-----------|
| <b>1 重要提示及目录</b> .....                       | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2         |
| 1.2 目录.....                                  | 3         |
| <b>2 基金简介</b> .....                          | <b>5</b>  |
| 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.....                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 6         |
| <b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                 | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 7         |
| <b>4 管理人报告</b> .....                         | <b>8</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 8         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 10        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 10        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....             | 10        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 11        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 11        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 12        |
| <b>5 托管人报告</b> .....                         | <b>12</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 12        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 12        |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....      | 12        |
| <b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....               | <b>12</b> |
| 6.1 资产负债表.....                               | 13        |
| 6.2 利润表.....                                 | 14        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 15        |
| 6.4 报表附注.....                                | 17        |
| <b>7 投资组合报告</b> .....                        | <b>32</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                          | 32        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                      | 33        |
| 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.....       | 34        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 35        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 37        |
| 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.....      | 37        |
| 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.....   | 37        |
| 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.....   | 37        |
| 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.....      | 38        |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....               | 38        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....               | 38        |

|           |                                   |           |
|-----------|-----------------------------------|-----------|
| 7.12      | 投资组合报告附注 .....                    | 38        |
| <b>8</b>  | <b>基金份额持有人信息 .....</b>            | <b>39</b> |
| 8.1       | 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....           | 39        |
| 8.2       | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....        | 39        |
| <b>9</b>  | <b>开放式基金份额变动 .....</b>            | <b>39</b> |
| <b>10</b> | <b>重大事件揭示 .....</b>               | <b>40</b> |
| 10.1      | 基金份额持有人大会决议 .....                 | 40        |
| 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 ..... | 40        |
| 10.3      | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....      | 40        |
| 10.4      | 基金投资策略的改变 .....                   | 40        |
| 10.5      | 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....            | 40        |
| 10.6      | 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....    | 40        |
| 10.7      | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....           | 41        |
| 10.8      | 其他重大事件 .....                      | 42        |
| <b>11</b> | <b>影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>       | <b>44</b> |
| <b>12</b> | <b>备查文件目录 .....</b>               | <b>44</b> |
| 12.1      | 备查文件目录 .....                      | 44        |
| 12.2      | 存放地点 .....                        | 44        |
| 12.3      | 查阅方式 .....                        | 44        |

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                     |
|------------|---------------------|
| 基金名称       | 金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称       | 金鹰红利价值混合            |
| 基金主代码      | 210002              |
| 交易代码       | 210002              |
| 基金运作方式     | 契约型开放式              |
| 基金合同生效日    | 2008年12月4日          |
| 基金管理人      | 金鹰基金管理有限公司          |
| 基金托管人      | 交通银行股份有限公司          |
| 报告期末基金份额总额 | 96,838,431.02份      |
| 基金合同存续期    | 不定期                 |

### 2.2 基金产品说明

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

## 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人                        | 基金托管人               |
|---------|------|------------------------------|---------------------|
| 名称      |      | 金鹰基金管理有限公司                   | 交通银行股份有限公司          |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 苏文锋                          | 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 | <a href="http://www.gefund.com.cn">http://www.gefund.com.cn</a> |
| 基金半年度报告备置地点          | 广州市天河区体育西路 189 号城建大厦 22-23 层                                    |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称         | 办公地址                         |
|--------|------------|------------------------------|
| 注册登记机构 | 金鹰基金管理有限公司 | 广州市天河区体育西路 189 号城建大厦 22-23 层 |

## 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              | 6,254,320.88            |
| 本期利润                 | 10,175,118.89           |
| 加权平均基金份额本期利润         | 0.1091                  |
| 本期加权平均净值利润率          | 10.01%                  |
| 本期基金份额净值增长率          | 9.97%                   |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | <b>报告期末(2014年6月30日)</b> |
| 期末可供分配利润             | 12,563,965.10           |
| 期末可供分配基金份额利润         | 0.1297                  |
| 期末基金资产净值             | 109,402,396.12          |
| 期末基金份额净值             | 1.1297                  |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b>  | <b>报告期末(2014年6月30日)</b> |
| 基金份额累计净值增长率          | 52.60%                  |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月      | 2.23%    | 0.80%       | 0.89%      | 0.55%         | 1.34%  | 0.25% |
| 过去三个月      | 4.01%    | 0.68%       | 0.15%      | 0.57%         | 3.86%  | 0.11% |
| 过去六个月      | 9.97%    | 0.90%       | -0.23%     | 0.65%         | 10.20% | 0.25% |
| 过去一年       | 25.51%   | 0.96%       | 2.93%      | 0.73%         | 22.58% | 0.23% |
| 过去三年       | 6.03%    | 1.01%       | -15.28%    | 0.70%         | 21.31% | 0.31% |
| 自基金合同生效起至今 | 52.60%   | 1.24%       | 28.34%     | 0.92%         | 24.26% | 0.32% |

注：本基金的业绩比较基准为富时中国A股红利150指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%（自2013-6-29起，本基金的业绩比较基准变更为中证红利指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%）。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2008 年 12 月 4 日至 2014 年 6 月 30 日)



注：1、截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同规定的各项比例,股票资产占基金资产比例为30%—80%；现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为20%-70%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；权证投资占基金资产净值的比例不超过3%；2、本基金的业绩比较基准为富时中国A股红利150指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%（自2013-6-29起,本基金的业绩比较基准变更为中证红利指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%）。

## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

金鹰基金管理有限公司经中国证监会证监基字[2002]97号文批准,于2002年12月25日成立,是自律制度下中国证监会批准设立的首批基金管理公司之一。公司注册资本2.5亿元人民币,股东包括广州证券有限责任公司、广州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



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 |        |  |
| 朱丹 | 基金经理 | 2011-06-11      | -    | 8      | 朱丹女士，金融学硕士，曾任职于深圳晨星咨询公司，2007 年 5 月加入金鹰基金管理有限公司，先后担任行业研究员、研 |

|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  | 究组长、基金经理助理等职，现任本基金基金经理以及金鹰中小盘精选证券投资基金基金经理。 |
|--|--|--|--|--|--|

注：1、任职日期和离任日期指公司公告聘任或解聘日期；  
2、证券从业的含义遵从行业协会颁布的《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》和其他有关法律法规及其各项实施准则、《金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无出现重大违法违规或违反基金合同的行为，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014 年上半年小盘股票表现依旧活跃，但整体活跃度比去年同期有所下降，主题投

资大行其道，大盘股走势依旧乏善可陈。上半年上证综指跌-3.03%，深证成指跌-9.16%，中小盘指数上涨 4.78%，创业板指数上涨 7.83%。一季度开始计算机、通信行业和新能源汽车主题持续走强，并成为上半年市场重要的投资主题，市场经过 3、4 月份的持续下跌后，于 5 月中下旬定向降准等“微刺激”政策出台的带动触底反弹，创业板一马当先，军工主题提升市场做多氛围，主题和板块轮动，小盘股交投活跃。

本基金一季度保持较低仓位，二季度仓位有所提升，主要持有电子，通信和高端装备制造，其余仓位配置仍以自下而上的个股为主。

#### 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 1.1297 元，本报告期份额净值增长率为 9.97%，同期业绩比较基准增长率为-0.23%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从上半年看，经济增速依然较低，传统行业盈利未见明显回升，在经济结构转型期间，必定是机构化行情的格局，代表未来方向的行业中的优质股票虽然会有短期的波动和调整，但长期趋势向上，对此类标的的投资需要在长期成长和短期估值泡沫之间取得平衡。传统行业的股票虽然受经济面、资金面、情绪面等诸多因素的影响制约了估值的提升，但从历史经验来看，没有均有一次或两次整体性的估值修复行情，需要对此类投资机会加以重点关注。我们对下半年的行情判断是延续上半年的格局，投资上我们将继续寻找需求有亮点的行业，保持灵活仓位，保持较高的通信、软件、高端制造、新能源汽车等行业的资产配置比例。

#### 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、基金经理、基金会计和相关人员组成。基金经理可以发表相关意见和建议，

如估值委员会表决时，其仅有一票表决权，遵从少数服从多数的原则。

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

本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金未签约与估值相关的定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

### 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2014 年上半年度，基金托管人在金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2014 年上半年度，金鹰基金管理有限公司在金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，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红利价值灵活配置混合型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

### 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2014 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2013 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 965,734.79                     | 1,216,114.43                     |
| 结算备付金           |            | 6,451,427.85                   | 13,658,609.07                    |
| 存出保证金           |            | 60,766.07                      | 73,501.43                        |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 88,157,662.02                  | 69,396,243.13                    |
| 其中：股票投资         |            | 82,385,968.02                  | 64,959,579.13                    |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 5,771,694.00                   | 4,436,664.00                     |
| 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    | 14,800,000.00                  | 21,900,000.00                    |
| 应收证券清算款         |            | -                              | 1,938,984.05                     |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 171,451.21                     | 140,490.55                       |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | 112,655.25                     | 23,417.70                        |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            |            | -                              | -                                |
| <b>资产总计</b>     |            | <b>110,719,697.19</b>          | <b>108,347,360.36</b>            |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2014 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2013 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      |            |                                |                                  |
| 短期借款            |            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                              | -                                |
| 衍生金融负债          |            | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                              | -                                |
| 应付证券清算款         |            | -                              | 7,713,249.53                     |
| 应付赎回款           |            | 336,728.79                     | 175,159.55                       |
| 应付管理人报酬         |            | 133,817.18                     | 127,452.85                       |

|                   |         |                       |                       |
|-------------------|---------|-----------------------|-----------------------|
| 应付托管费             |         | 22,302.88             | 21,242.13             |
| 应付销售服务费           |         | -                     | -                     |
| 应付交易费用            | 6.4.7.6 | 76,549.19             | 182,058.22            |
| 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 | 747,903.03            | 932,660.11            |
| <b>负债合计</b>       |         | <b>1,317,301.07</b>   | <b>9,151,822.39</b>   |
| <b>所有者权益：</b>     |         |                       |                       |
| 实收基金              | 6.4.7.8 | 96,838,431.02         | 96,558,671.08         |
| 未分配利润             | 6.4.7.9 | 12,563,965.10         | 2,636,866.89          |
| <b>所有者权益合计</b>    |         | <b>109,402,396.12</b> | <b>99,195,537.97</b>  |
| <b>负债和所有者权益总计</b> |         | <b>110,719,697.19</b> | <b>108,347,360.36</b> |

注：报告截止日2014年6月30日，基金份额净值1.1297元，基金份额总额96,838,431.02份。

## 6.2 利润表

会计主体：金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：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                       | 上年度可比期间                  |
|------------------|--------------|--------------------------|--------------------------|
|                  |              | 2014年1月1日至<br>2014年6月30日 | 2013年1月1日至<br>2013年6月30日 |
| <b>一、收入</b>      |              | <b>11,568,495.23</b>     | <b>10,716,979.34</b>     |
| 1.利息收入           |              | 675,607.45               | 516,587.08               |
| 其中：存款利息收入        | 6.4.7.1<br>0 | 84,545.45                | 122,008.00               |
| 债券利息收入           |              | 105,989.73               | 138,676.51               |
| 资产支持证券利息收入       |              | -                        | -                        |
| 买入返售金融资产收入       |              | 485,072.27               | 255,902.57               |
| 其他利息收入           |              | -                        | -                        |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） |              | 6,943,851.12             | 12,799,389.72            |
| 其中：股票投资收益        | 6.4.7.11     | 6,569,706.36             | 13,489,494.96            |
| 基金投资收益           |              | -                        | -                        |
| 债券投资收益           |              | -                        | -992,071.10              |

|                            |              |                      |                     |
|----------------------------|--------------|----------------------|---------------------|
| 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                       | 6.4.7.1<br>2 | 374,144.76           | 301,965.86          |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 6.4.7.1<br>3 | 3,920,798.01         | -2,618,150.84       |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |              | -                    | -                   |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 6.4.7.1<br>4 | 28,238.65            | 19,153.38           |
| <b>减：二、费用</b>              |              | <b>1,393,376.34</b>  | <b>2,034,857.25</b> |
| 1. 管理人报酬                   |              | 755,380.39           | 810,157.14          |
| 2. 托管费                     |              | 125,896.72           | 135,026.21          |
| 3. 销售服务费                   |              | -                    | -                   |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.1<br>5 | 336,909.88           | 906,931.84          |
| 5. 利息支出                    |              | -                    | 7,739.09            |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |              | -                    | 7,739.09            |
| 6. 其他费用                    | 6.4.7.1<br>6 | 175,189.35           | 175,002.97          |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |              | <b>10,175,118.89</b> | <b>8,682,122.09</b> |
| 减：所得税费用                    |              | -                    | -                   |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |              | <b>10,175,118.89</b> | <b>8,682,122.09</b> |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                   | 本期<br>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）      | 96,558,671.08                         | 2,636,866.89  | 99,195,537.97 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本 | -                                     | 10,175,118.89 | 10,175,118.89 |

|  |                                 |                |                |
|--|---------------------------------|----------------|----------------|
| 期利润)                                   |                                 |                |                |
| 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)      | 279,759.94                      | -248,020.68    | 31,739.26      |
| 其中: 1.基金申购款                            | 20,819,154.05                   | 1,801,728.10   | 22,620,882.15  |
| 2.基金赎回款                                | -20,539,394.11                  | -2,049,748.78  | -22,589,142.89 |
| 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)                        | 96,838,431.02                   | 12,563,965.10  | 109,402,396.12 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>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)                        | 127,699,557.04                  | -21,582,229.90 | 106,117,327.14 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                               | 8,682,122.09   | 8,682,122.09   |
| 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)      | -8,458,906.17                   | 991,588.56     | -7,467,317.61  |
| 其中: 1.基金申购款                            | 8,919,893.06                    | -1,067,670.32  | 7,852,222.74   |
| 2.基金赎回款                                | -17,378,799.23                  | 2,059,258.88   | -15,319,540.35 |
| 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)                        | 119,240,650.87                  | -11,908,519.25 | 107,332,131.62 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：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

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

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释(统称"企业会计准则"),中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、关于发布《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>(试行)》等问题的通知及其他中国证监会颁布的相关规定而编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金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日止会计期间的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无差错更正。

### 6.4.6 税项

#### 1、印花税

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

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

经国务院批准,根据财政部、国家税务总局《关于调整证券(股票)交易印花税率的

通知》的规定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，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<br>2014 年 6 月 30 日 |
|------|------------------------|
| 活期存款 | 965,734.79             |
| 定期存款 | -                      |
| 其他存款 | -                      |
| 合计   | 965,734.79             |

### 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            |       | 76,339,846.19 | 82,385,968.02 | 6,046,121.83 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -             | -             | -            |
| 债券            | 交易所市场 | 5,685,137.21  | 5,771,694.00  | 86,556.79    |
|               | 银行间市场 | -             | -             | -            |
|               | 合计    | 5,685,137.21  | 5,771,694.00  | 86,556.79    |
| 资产支持证券        |       | -             | -             | -            |
| 基金            |       | -             | -             | -            |
| 其他            |       | -             | -             | -            |
| 合计            |       | 82,024,983.40 | 88,157,662.02 | 6,132,678.62 |

#### 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

单位：人民币元

| 项目       | 本期末<br>2014年6月30日 |           |
|----------|-------------------|-----------|
|          | 账面余额              | 其中：买断式逆回购 |
| 上交所质押式回购 | 14,800,000.00     | -         |
| 合计       | 14,800,000.00     | -         |

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2014年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息   | 141.75            |
| 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  | 2,477.72          |
| 应收债券利息     | 75,258.10         |
| 应收买入返售证券利息 | 93,240.72         |
| 应收申购款利息    | 308.35            |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                 |
| 其他         | 24.57             |

|    |            |
|----|------------|
| 合计 | 171,451.21 |
|----|------------|

**6.4.7.6 应付交易费用**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2014 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 76,549.19              |
| 银行间市场应付交易费用 | -                      |
| 合计          | 76,549.19              |

**6.4.7.7 其他负债**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2014 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | 250,000.00             |
| 应付赎回费       | 1,269.05               |
| 预提审计费       | 47,868.27              |
| 预提信息披露费     | 448,765.71             |
| 合计          | 747,903.03             |

**6.4.7.8 实收基金**

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>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          | 96,558,671.08                         | 96,558,671.08  |
| 本期申购          | 20,819,154.05                         | 20,819,154.05  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -20,539,394.11                        | -20,539,394.11 |
| 本期末           | 96,838,431.02                         | 96,838,431.02  |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

**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           | 11,474,411.05 | -8,837,544.16 | 2,636,866.89  |
| 本期利润           | 6,254,320.88  | 3,920,798.01  | 10,175,118.89 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 349,593.83    | -597,614.51   | -248,020.68   |
| 其中：基金申购款       | 3,489,088.69  | -1,687,360.59 | 1,801,728.10  |
| 基金赎回款          | -3,139,494.86 | 1,089,746.08  | -2,049,748.78 |

|         |               |               |               |
|---------|---------------|---------------|---------------|
| 本期已分配利润 | -             | -             | -             |
| 本期末     | 18,078,325.76 | -5,514,360.66 | 12,563,965.10 |

**6.4.7.10 存款利息收入**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 7,051.39                   |
| 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 | 77,191.56                  |
| 其他        | 302.50                     |
| 合计        | 84,545.45                  |

**6.4.7.11 股票投资收益**

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 118,224,469.80             |
| 减：卖出股票成本总额 | 111,654,763.44             |
| 买卖股票差价收入   | 6,569,706.36               |

**6.4.7.12 股利收益**

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 374,144.76                 |
| 基金投资产生的股利收益 | -                          |
| 合计          | 374,144.76                 |

**6.4.7.13 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产  | 3,920,798.01               |
| ——股票投资     | 3,717,040.21               |
| ——债券投资     | 203,757.80                 |
| ——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      | 3,920,798.01 |

**6.4.7.14 其他收入**

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 基金赎回费收入    | 27,832.95                  |
| 配股手续费      | -                          |
| 新股手续费返还    | -                          |
| 印花税返还      | -                          |
| 转出费        | 405.70                     |
| 新股申购返还利息收入 | -                          |
| 分销国债手续费返还  | -                          |
| 其他         | -                          |
| 合计         | 28,238.65                  |

**6.4.7.15 交易费用**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 336,909.88                 |
| 银行间市场交易费用 | -                          |
| 合计        | 336,909.88                 |

**6.4.7.16 其他费用**

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2014年1月1日至2014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     | 1,555.37                   |
| 银行间市场账户维护费 | 9,000.00                   |
| 合计         | 175,189.35                 |

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**

**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需作披露的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至资产负债表日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

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

本报告期内关联方无发生变化。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

| 关联方名称      | 与本基金的关系          |
|------------|------------------|
| 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<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |              | 上年度可比期间<br>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  | -                          | -            | 250,866,790.79                  | 41.14%       |

注：本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

**6.4.10.1.2 权证交易**

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

**6.4.10.1.3 债券交易**

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |              | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年6月30日 |              |
|-------|----------------------------|--------------|---------------------------------|--------------|
|       | 成交金额                       | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额                            | 占当期债券成交总额的比例 |
| 广州证券  | -                          | -            | 36,481,375.54                   | 100.00%      |

注：本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

**6.4.10.1.4 债券回购交易**

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |                | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年6月30日 |                |
|-------|----------------------------|----------------|---------------------------------|----------------|
|       | 成交金额                       | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额                            | 占当期债券回购成交总额的比例 |
| 广州证券  | -                          | -              | 21,000,000.00                   | 2.01%          |

注：本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>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  | -                          | -          | -        | -            |

  

| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>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  | 221,531.45                      | 41.83%     | 55,463.56 | 25.01%       |

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

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

#### 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<br>2014年1月1日至2014年<br>6月30日 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年<br>6月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 755,380.39                     | 810,157.14                          |



|                 |            |            |
|-----------------|------------|------------|
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 185,354.10 | 199,160.83 |
|-----------------|------------|------------|

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

$$H=E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

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

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2014年1月1日至2014年<br>6月30日 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年<br>6月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 125,896.72                     | 135,026.21                          |

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

$$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

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

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付给关联方的销售服务费。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

份额单位：份

| 项目         | 本期<br>2014年1月1日至2014年6<br>月30日 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年6<br>月30日 |
|------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 期初持有的基金份额  | 0.00                           | 8,988,673.14                        |
| 期间申购/买入总份额 | -                              | -                                   |

|                   |      |              |
|-------------------|------|--------------|
| 期间因拆分变动份额         | -    | -            |
| 减：期间赎回/卖出总份额      | -    | -            |
| 期末持有的基金份额         | 0.00 | 8,988,673.14 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0%   | 7.54%        |

#### 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<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |          | 上年度可比期间<br>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   |
| 交通银行股份有限公司 | 965,734.79                 | 7,051.39 | 2,276,972.58                    | 9,741.00 |

注：本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息，在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示。该科目2013年6月30日余额3,516,311.22元,2014年6月30日余额6,451,427.85元。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金报告期及上年度可比期间内均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金报告期及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（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<br>估值<br>单价 | 复<br>牌<br>日<br>期 | 复<br>牌<br>开<br>盘<br>单<br>价 | 数量<br>(股) | 期末<br>成本总额   | 期末<br>估值总额   | 备注 |
|--------|------|------------|------|----------------|------------------|----------------------------|-----------|--------------|--------------|----|
| 300050 | 世    | 2014-05-30 | 重大   | 17.78          | -                | -                          | 135,097   | 1,802,803.65 | 2,402,024.66 | -  |

|  |             |  |          |  |  |  |  |  |  |  |
|--|-------------|--|----------|--|--|--|--|--|--|--|
|  | 纪<br>鼎<br>利 |  | 资产<br>重组 |  |  |  |  |  |  |  |
|--|-------------|--|----------|--|--|--|--|--|--|--|

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

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度，在设定的风险权限额度内进行

投资决策；投资管理业绩评价制度等。

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

### （3）监察稽核制度

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

#### 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<br>2014年6<br>月30日 | 1个月<br>以内         | 1-3<br>个月 | 6个月<br>以内 | 3个月<br>-1年 | 6个月-1<br>年 | 1年以<br>内 | 1-5年 | 5年以<br>上         | 不计息               | 合计                 |
|-----------------------|-------------------|-----------|-----------|------------|------------|----------|------|------------------|-------------------|--------------------|
| 资产                    |                   |           |           |            |            |          |      |                  |                   |                    |
| 银行存款                  | 965,734.<br>79    | -         | -         | -          | -          | -        | -    | -                | -                 | 965,734.<br>79     |
| 结算备付<br>金             | 6,451,42<br>7.85  | -         | -         | -          | -          | -        | -    | -                | -                 | 6,451,42<br>7.85   |
| 存出保证<br>金             | 60,766.0<br>7     | -         | -         | -          | -          | -        | -    | -                | -                 | 60,766.0<br>7      |
| 交易性金<br>融资产           | -                 | -         | -         | -          | -          | -        | -    | 5,771,69<br>4.00 | 82,385,9<br>68.02 | 88,157,6<br>62.02  |
| 买入返售<br>金融资产          | 14,800,0<br>00.00 | -         | -         | -          | -          | -        | -    | -                | -                 | 14,800,0<br>00.00  |
| 应收利息                  | -                 | -         | -         | -          | -          | -        | -    | -                | 171,451.<br>21    | 171,451.<br>21     |
| 应收申购<br>款             | -                 | -         | -         | -          | -          | -        | -    | -                | 112,655.<br>25    | 112,655.<br>25     |
| 资产总计                  | 22,277,9<br>28.71 | -         | -         | -          | -          | -        | -    | 5,771,69<br>4.00 | 82,670,0<br>74.48 | 110,719,<br>697.19 |
| 负债                    |                   |           |           |            |            |          |      |                  |                   |                    |
| 应付赎回<br>款             | -                 | -         | -         | -          | -          | -        | -    | -                | 336,728.<br>79    | 336,728.<br>79     |
| 应付管理<br>人报酬           | -                 | -         | -         | -          | -          | -        | -    | -                | 133,817.<br>18    | 133,817.<br>18     |
| 应付托管<br>费             | -                 | -         | -         | -          | -          | -        | -    | -                | 22,302.8<br>8     | 22,302.8<br>8      |
| 应付交易<br>费用            | -                 | -         | -         | -          | -          | -        | -    | -                | 76,549.1<br>9     | 76,549.1<br>9      |
| 其他负债                  | -                 | -         | -         | -          | -          | -        | -    | -                | 747,903.<br>03    | 747,903.<br>03     |

|                     |               |       |       |        |        |      |      |              |               |                |
|---------------------|---------------|-------|-------|--------|--------|------|------|--------------|---------------|----------------|
| 负债总计                | -             | -     | -     | -      | -      | -    | -    | -            | 1,317,301.07  | 1,317,301.07   |
| 利率敏感度缺口             | 22,277,928.71 | -     | -     | -      | -      | -    | -    | 5,771,694.00 | 81,352,773.41 | 109,402,396.12 |
| 上年度末<br>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                | 1,216,114.43  | -     | -     | -      | -      | -    | -    | -            | -             | 1,216,114.43   |
| 结算备付金               | 13,658,609.07 | -     | -     | -      | -      | -    | -    | -            | -             | 13,658,609.07  |
| 存出保证金               | 73,501.43     | -     | -     | -      | -      | -    | -    | -            | -             | 73,501.43      |
| 交易性金融资产             | -             | -     | -     | -      | -      | -    | -    | 4,436,664.00 | 64,959,579.13 | 69,396,243.13  |
| 衍生金融资产              | -             | -     | -     | -      | -      | -    | -    | -            | -             | -              |
| 买入返售金融资产            | -             | -     | -     | -      | -      | -    | -    | -            | 21,900,000.00 | 21,900,000.00  |
| 应收证券清算款             | -             | -     | -     | -      | -      | -    | -    | -            | 1,938,984.05  | 1,938,984.05   |
| 应收利息                | -             | -     | -     | -      | -      | -    | -    | -            | 140,490.55    | 140,490.55     |
| 应收股利                | -             | -     | -     | -      | -      | -    | -    | -            | -             | -              |
| 应收申购款               | -             | -     | -     | -      | -      | -    | -    | -            | 23,417.70     | 23,417.70      |
| 其他资产                | -             | -     | -     | -      | -      | -    | -    | -            | -             | -              |
| 资产总计                | 14,948,224.93 | -     | -     | -      | -      | -    | -    | 4,436,664.00 | 88,962,471.43 | 108,347,360.36 |
| 负债                  |               |       |       |        |        |      |      |              |               |                |
| 卖出回购金融资产款           | -             | -     | -     | -      | -      | -    | -    | -            | -             | -              |
| 应付证券                | -             | -     | -     | -      | -      | -    | -    | -            | 7,713,240.00  | 7,713,240.00   |

|         |               |   |   |   |   |   |   |              |               |               |
|---------|---------------|---|---|---|---|---|---|--------------|---------------|---------------|
| 清算款     |               |   |   |   |   |   |   |              | 9.53          | 9.53          |
| 应付赎回款   | -             | - | - | - | - | - | - | -            | 175,159.55    | 175,159.55    |
| 应付管理人报酬 | -             | - | - | - | - | - | - | -            | 127,452.85    | 127,452.85    |
| 应付托管费   | -             | - | - | - | - | - | - | -            | 21,242.13     | 21,242.13     |
| 应付销售服务费 | -             | - | - | - | - | - | - | -            | -             | -             |
| 应付交易费用  | -             | - | - | - | - | - | - | -            | 182,058.22    | 182,058.22    |
| 应交税费    | -             | - | - | - | - | - | - | -            | -             | -             |
| 应付利息    | -             | - | - | - | - | - | - | -            | -             | -             |
| 应付利润    | -             | - | - | - | - | - | - | -            | -             | -             |
| 其他负债    | -             | - | - | - | - | - | - | -            | 932,660.11    | 932,660.11    |
| 负债总计    | -             | - | - | - | - | - | - | -            | 9,151,822.39  | 9,151,822.39  |
| 利率敏感度缺口 | 14,948,224.93 | - | - | - | - | - | - | 4,436,664.00 | 79,810,649.04 | 99,195,537.97 |

#### 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<br>2014年6月30日             | 上年度末<br>2013年12月31日 |
|    | 1. 利率上升25个基点                            | -90,192.46                    | -84,730.72          |
|    | 2. 利率下降25个基点                            | 90,192.46                     | 84,730.72           |

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价, 因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

## 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2014 年 6 月 30 日 |               | 上年度末<br>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  | 82,385,968.02          | 75.31         | 64,959,579.13            | 65.49         |
| 交易性金融资产-债券投资  | 5,771,694.00           | 5.28          | 4,436,664.00             | 4.47          |
| 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            | 88,157,662.02          | 80.58         | 69,396,243.13            | 69.96         |

## 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<br>2014 年 6 月 30 日      | 上年度末<br>2013 年 12 月 31 日 |
|    | 业绩比较基准变动+5%                              | 109,402,396.12              | 2,971,537.12             |
|    | 业绩比较基准变动-5%                              | -109,402,396.12             | -2,971,537.12            |

## 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本报告期无其他有助于理解和分析会计报表需要说明的事项。

## 7 投资组合报告

## 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元



| 序号 | 项目                | 金额             | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 82,385,968.02  | 74.41         |
|    | 其中：股票             | 82,385,968.02  | 74.41         |
| 2  | 固定收益投资            | 5,771,694.00   | 5.21          |
|    | 其中：债券             | 5,771,694.00   | 5.21          |
|    | 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          | 14,800,000.00  | 13.37         |
|    | 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      | 7,417,162.64   | 6.70          |
| 7  | 其他各项资产            | 344,872.53     | 0.31          |
| 8  | 合计                | 110,719,697.19 | 100.00        |

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

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值          | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -             | -             |
| B  | 采矿业              | 5,020,992.50  | 4.59          |
| C  | 制造业              | 56,092,708.96 | 51.27         |
| 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  | 11,781,020.56 | 10.77         |
| J  | 金融业              | 9,307,046.00  | 8.51          |
| 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 | 184,200.00    | 0.17  |
| 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            | 82,385,968.02 | 75.31 |

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）   | 公允价值         | 占基金资产<br>净值比例<br>（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|----------------------|
| 1  | 002345 | 潮宏基  | 385,481 | 6,599,434.72 | 6.03                 |
| 2  | 300203 | 聚光科技 | 401,995 | 6,391,720.50 | 5.84                 |
| 3  | 600894 | 广日股份 | 579,075 | 6,387,197.25 | 5.84                 |
| 4  | 601166 | 兴业银行 | 630,000 | 6,318,900.00 | 5.78                 |
| 5  | 002364 | 中恒电气 | 288,001 | 5,129,297.81 | 4.69                 |
| 6  | 300030 | 阳普医疗 | 404,456 | 5,035,477.20 | 4.60                 |
| 7  | 600028 | 中国石化 | 952,750 | 5,020,992.50 | 4.59                 |
| 8  | 002444 | 巨星科技 | 414,402 | 3,936,819.00 | 3.60                 |
| 9  | 002649 | 博彦科技 | 101,701 | 3,376,473.20 | 3.09                 |
| 10 | 300170 | 汉得信息 | 258,063 | 3,329,012.70 | 3.04                 |
| 11 | 002539 | 新都化工 | 300,000 | 3,267,000.00 | 2.99                 |
| 12 | 002369 | 卓翼科技 | 329,960 | 2,996,036.80 | 2.74                 |
| 13 | 002480 | 新筑股份 | 415,658 | 2,988,581.02 | 2.73                 |
| 14 | 601998 | 中信银行 | 699,800 | 2,988,146.00 | 2.73                 |
| 15 | 600085 | 同仁堂  | 158,639 | 2,765,077.77 | 2.53                 |
| 16 | 300104 | 乐视网  | 60,900  | 2,673,510.00 | 2.44                 |
| 17 | 300005 | 探路者  | 167,296 | 2,583,050.24 | 2.36                 |
| 18 | 300050 | 世纪鼎利 | 135,097 | 2,402,024.66 | 2.20                 |
| 19 | 300072 | 三聚环保 | 119,835 | 2,395,501.65 | 2.19                 |
| 20 | 300205 | 天喻信息 | 150,000 | 2,310,000.00 | 2.11                 |
| 21 | 002273 | 水晶光电 | 122,050 | 2,233,515.00 | 2.04                 |
| 22 | 300107 | 建新股份 | 100,000 | 1,074,000.00 | 0.98                 |

|    |        |       |        |            |      |
|----|--------|-------|--------|------------|------|
| 23 | 000888 | 峨眉山 A | 10,000 | 184,200.00 | 0.17 |
|----|--------|-------|--------|------------|------|

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额     | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------------|-----------------|
| 1  | 600028 | 中国石化 | 8,636,900.17 | 8.71            |
| 2  | 600894 | 广日股份 | 6,442,959.37 | 6.50            |
| 3  | 601166 | 兴业银行 | 6,400,538.00 | 6.45            |
| 4  | 300203 | 聚光科技 | 5,961,562.60 | 6.01            |
| 5  | 002364 | 中恒电气 | 5,704,631.58 | 5.75            |
| 6  | 300030 | 阳普医疗 | 5,126,346.96 | 5.17            |
| 7  | 300170 | 汉得信息 | 5,048,334.27 | 5.09            |
| 8  | 600378 | 天科股份 | 4,528,723.00 | 4.57            |
| 9  | 600085 | 同仁堂  | 4,506,944.91 | 4.54            |
| 10 | 002539 | 新都化工 | 3,885,530.30 | 3.92            |
| 11 | 601669 | 中国电建 | 3,842,200.00 | 3.87            |
| 12 | 002444 | 巨星科技 | 3,833,968.01 | 3.87            |
| 13 | 002474 | 榕基软件 | 3,346,788.54 | 3.37            |
| 14 | 002649 | 博彦科技 | 3,116,531.71 | 3.14            |
| 15 | 002369 | 卓翼科技 | 3,069,207.79 | 3.09            |
| 16 | 601998 | 中信银行 | 3,065,124.00 | 3.09            |
| 17 | 600016 | 民生银行 | 3,062,700.00 | 3.09            |
| 18 | 002345 | 潮宏基  | 3,017,698.95 | 3.04            |
| 19 | 002584 | 西陇化工 | 2,930,094.80 | 2.95            |
| 20 | 300104 | 乐视网  | 2,772,418.68 | 2.79            |
| 21 | 600594 | 益佰制药 | 2,727,032.77 | 2.75            |
| 22 | 300005 | 探路者  | 2,618,651.04 | 2.64            |
| 23 | 002273 | 水晶光电 | 2,296,014.01 | 2.31            |
| 24 | 300205 | 天喻信息 | 2,282,374.70 | 2.30            |
| 25 | 300072 | 三聚环保 | 2,196,550.99 | 2.21            |
| 26 | 000063 | 中兴通讯 | 2,086,666.00 | 2.10            |
| 27 | 002480 | 新筑股份 | 2,013,133.85 | 2.03            |

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

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称  | 本期累计卖出金额     | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|-------|--------------|----------------|
| 1  | 601669 | 中国电建  | 7,471,916.89 | 7.53           |
| 2  | 002480 | 新筑股份  | 6,358,798.59 | 6.41           |
| 3  | 600378 | 天科股份  | 5,669,421.98 | 5.72           |
| 4  | 600085 | 同仁堂   | 5,167,882.14 | 5.21           |
| 5  | 000063 | 中兴通讯  | 4,964,731.92 | 5.00           |
| 6  | 300030 | 阳普医疗  | 4,151,148.01 | 4.18           |
| 7  | 002549 | 凯美特气  | 3,783,991.74 | 3.81           |
| 8  | 002474 | 榕基软件  | 3,761,090.72 | 3.79           |
| 9  | 300170 | 汉得信息  | 3,708,461.67 | 3.74           |
| 10 | 600028 | 中国石化  | 3,649,191.87 | 3.68           |
| 11 | 002129 | 中环股份  | 3,628,225.97 | 3.66           |
| 12 | 000888 | 峨眉山 A | 3,588,869.82 | 3.62           |
| 13 | 600894 | 广日股份  | 3,527,538.25 | 3.56           |
| 14 | 002584 | 西陇化工  | 3,465,273.96 | 3.49           |
| 15 | 002484 | 江海股份  | 3,352,199.18 | 3.38           |
| 16 | 002364 | 中恒电气  | 3,133,198.01 | 3.16           |
| 17 | 600016 | 民生银行  | 3,079,920.00 | 3.10           |
| 18 | 600594 | 益佰制药  | 2,976,097.74 | 3.00           |
| 19 | 600256 | 广汇能源  | 2,819,809.00 | 2.84           |
| 20 | 600185 | 格力地产  | 2,745,856.32 | 2.77           |
| 21 | 300107 | 建新股份  | 2,455,224.82 | 2.48           |
| 22 | 300050 | 世纪鼎利  | 2,417,519.72 | 2.44           |
| 23 | 300079 | 数码视讯  | 2,248,163.64 | 2.27           |
| 24 | 002100 | 天康生物  | 2,127,803.47 | 2.15           |
| 25 | 300288 | 朗玛信息  | 2,066,665.40 | 2.08           |
| 26 | 600438 | 通威股份  | 2,060,997.76 | 2.08           |
| 27 | 002216 | 三全食品  | 2,022,607.75 | 2.04           |

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

**7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额**

金额单位：人民币元

|              |                |
|--------------|----------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 125,364,112.12 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 118,224,469.80 |

**7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合**

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值         | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|--------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 5,771,694.00 | 5.28         |
| 2  | 央行票据      | -            | -            |
| 3  | 金融债券      | -            | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -            | -            |
| 4  | 企业债券      | -            | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -            | -            |
| 6  | 中期票据      | -            | -            |
| 7  | 可转债       | -            | -            |
| 8  | 其他        | -            | -            |
| 9  | 合计        | 5,771,694.00 | 5.28         |

**7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细**

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量（张）  | 公允价值         | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 010107 | 21 国债(7) | 31,980 | 3,223,584.00 | 2.95         |
| 2  | 010303 | 03 国债(3) | 27,050 | 2,548,110.00 | 2.33         |

注：本基金期末持有2只债券。

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排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**

本基金本报告期内未进行贵金属投资。

## 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

注：本基金本报告期内未进行股指期货投资。

### 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

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

### 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** 本报告期本基金投资的前十名证券之一中国石化的发行主体中国石油化工股份有限公司最近一年内因输油管泄漏爆炸事件，部分董事、监事、高级管理人员受到国务院处罚。

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

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

| 序号 | 名称      | 金额         |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 60,766.07  |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 171,451.21 |
| 5  | 应收申购款   | 112,655.25 |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 344,872.53 |

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期期末未持有处于转股期的可转换债券。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本期末前十名股票中不存在流通受限情况。

**7.12.6 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

| 持有人<br>户数<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>比例 | 持有份额          | 占总份额<br>比例 |
| 6,630            | 14,606.10     | 14,866,054.53 | 15.35%     | 81,972,376.49 | 84.65%     |

**8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

| 项目                   | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|----------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有<br>本基金 | 9,615.04  | 0.0099%  |

**8.3 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                                     | 持有份额总数（份） |
|--|-----------|
| 本公司高级管理人员、基金投<br>资和研究部门负责人持有本开<br>放式基金 | 0         |
| 本基金基金经理持有本开放式<br>基金                    | 0         |

**9 开放式基金份额变动**

单位：份

|                                |                |
|--------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2008 年 12 月 4 日）基金份额总额 | 367,018,547.39 |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 96,558,671.08  |
| 本报告期基金总申购份额                    | 20,819,154.05  |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 20,539,394.11  |
| 本报告期基金拆分变动份额                   | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 96,838,431.02  |

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本报告期未改聘会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人、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 |    |
| 安信证券   | 1      | 6,467,768.36   | 2.66%        | 5,723.32   | 3.02%      | -  |
| 财通证券   | 1      | 5,778,630.26   | 2.37%        | 5,260.94   | 2.78%      | -  |
| 东兴证券   | 1      | 6,932,075.93   | 2.85%        | 6,134.18   | 3.24%      | -  |
| 国都证券   | 1      | 6,196,754.61   | 2.54%        | 5,526.07   | 2.92%      | -  |
| 国海证券   | 1      | 3,000,488.00   | 1.23%        | 2,631.49   | 1.39%      | -  |
| 海通证券   | 1      | 22,669,922.44  | 9.31%        | 20,639.27  | 10.91%     | -  |
| 开源证券   | 1      | 104,570,011.83 | 42.94%       | 71,620.42  | 37.84%     | -  |
| 齐鲁证券   | 1      | 13,668,067.88  | 5.61%        | 12,443.41  | 6.57%      | -  |
| 湘财证券   | 1      | 29,051,508.54  | 11.93%       | 19,163.63  | 10.13%     | -  |
| 银河证券   | 1      | 19,356,678.97  | 7.95%        | 17,253.85  | 9.12%      | -  |
| 中信建投证券 | 1      | 25,831,515.10  | 10.61%       | 22,858.25  | 12.08%     | -  |
| 合计     | 11     | 243,523,421.92 | 100.00%      | 189,254.83 | 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；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 |                      |
|------------|--------------|--------------------------|------------------|--------------------------|------|----------------------|
|            | 成交金额         | 占当期<br>债券成<br>交总额<br>的比例 | 成交金额             | 占当期<br>回购成<br>交总额<br>的比例 | 成交金额 | 占当期权证<br>成交总额的<br>比例 |
| 安信证券       | -            | -                        | -                | -                        | -    | -                    |
| 财通证券       | 102,608.40   | 9.07%                    | 291,900,000.00   | 15.13%                   | -    | -                    |
| 东兴证券       | -            | -                        | -                | -                        | -    | -                    |
| 国都证券       | 1,024,754.60 | 90.58%                   | 128,000,000.00   | 6.64%                    | -    | -                    |
| 国海证券       | -            | -                        | 227,500,000.00   | 11.79%                   | -    | -                    |
| 海通证券       | -            | -                        | 535,300,000.00   | 27.75%                   | -    | -                    |
| 开源证券       | -            | -                        | -                | -                        | -    | -                    |
| 齐鲁证券       | -            | -                        | 39,500,000.00    | 2.05%                    | -    | -                    |
| 湘财证券       | -            | -                        | 490,700,000.00   | 25.44%                   | -    | -                    |
| 银河证券       | 3,909.20     | 0.35%                    | 216,000,000.00   | 11.20%                   | -    | -                    |
| 中信建投证<br>券 | -            | -                        | -                | -                        | -    | -                    |
| 合计         | 1,131,272.20 | 100.00%                  | 1,928,900,000.00 | 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         | 证券时报等  | 2014-01-02 |
| 2  | 金鹰基金管理有限公司关于参加邮储银行基金代销业务费率优惠活动的公告   | 证券时报等  | 2014-01-03 |
| 3  | 金鹰基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新已过期身份证件的公告     | 证券时报等  | 2014-01-14 |
| 4  | 金鹰基金管理有限公司关于参加同花顺基金申购费率优惠活动的公告      | 证券时报等  | 2014-01-15 |
| 5  | 金鹰红利灵活配置基金2013年第4季度报告               | 证券时报等  | 2014-01-20 |
| 6  | 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 |
| 7  | 金鹰基金管理有限公司关于增加北京                    | 证券时报等  | 2014-02-17 |

|    |   |       |            |
|----|---|-------|------------|
|    | 钱景财富投资管理有限公司为代销机构的公告                    |       |            |
| 8  | 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 |
| 9  | 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 |
| 10 | 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 |
| 11 | 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 |
| 12 | 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 |
| 13 | 金鹰红利灵活配置基金2013年年度报告                     | 证券时报等 | 2014-03-26 |
| 14 | 金鹰基金管理有限公司关于继续参加工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告 | 证券时报等 | 2014-04-01 |
| 15 | 金鹰红利灵活配置基金2014年第1季度报告                   | 证券时报等 | 2014-04-22 |
| 16 | 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 |
| 17 | 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 |
| 18 | 金鹰基金管理有限公司关于增加中国国际期货有限公司为代销机构的公告        | 证券时报等 | 2014-05-30 |
| 19 | 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 |
| 20 | 金鹰基金管理有限公司关于基金经理朱丹休假由他人代为履行职责的公告        | 证券时报等 | 2014-06-10 |
| 21 | 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 |
| 22 | 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 |
| 23 | 金鹰基金管理有限公司关于增加天源                        | 证券时报等 | 2014-06-18 |

|    |                                     |       |            |
|----|-------------------------------------|-------|------------|
|    | 证券有限公司为代销机构的公告                      |       |            |
| 24 | 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 |
| 25 | 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红利价值灵活配置混合型证券投资基金发行及募集的文件。
- 2、《金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、《金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。
- 4、金鹰基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程。
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照。
- 6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、季度报告、半年度报告、更新的招募说明书及其他临时公告。

### 12.2 存放地点

广州市天河区体育西路 189 号城建大厦 22-23 层

### 12.3 查阅方式

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

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

金鹰基金管理有限公司  
二〇一四年八月二十五日