

**金鹰中证 500 指数分级证券投资基金**  
**2015 年半年度报告摘要**  
**2015 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：二〇一五年八月二十九日

## 1 重要提示

### 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 2015 年 8 月 28 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	金鹰中证 500 指数分级		
基金主代码	162107		
交易代码	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	108,280,125.10 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
下属分级基金的场内简称	金鹰 500A	金鹰 500B	-
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	41,982,768.00 份	41,982,768.00 份	24,314,589.10 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数基金，以跟踪指数为目标，力求将基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在 0.35% 以下、年跟踪误差控制在 4% 以下。		
投资策略	<p>本基金以中证 500 指数成分股在其指数中的基准权重为基础，在综合考察指数成分股的行业构成与市值占比、各行业成分股权重的构成与分散程度、成分股流动性与贝塔值等因素的基础上，采用重点抽样与分层抽样相结合的策略以构建指数化投资组合；若抽样组合内的股票停牌或出现流动性不足等情形时，本基金将根据变化了的新情况，对于抽样组合进行再调整。</p> <p>本基金投资于股票的资产占基金资产净值的比例为 90%~95%，其中，中证 500 指数成分股和备选成分股占基金资产净值的比例不低于 90%；债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产净值的 5%~10%，其中，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证投资的比例范围占基金资产净值的 0%~3%。</p>		
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为中证 500 指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%		
风险收益特征	本基金为被动跟踪指数的指数型证券投资基金，属于证券投资基金当中收益、风险较高的品种。一般情形下，其风险和预期收益高于混合型、债券型、货币市场基金。从本基金拆分的两级基金来看，金鹰 500A 具有低风险、预期收益相对稳定的特征，金鹰 500B 具有高风险、高预期收益的特征。		
下属分级基金的风险	本级基金具有低风险、	本级基金具有高风险、	本级基金为被动跟踪

收益特征	预期收益相对稳定的特征。	高预期收益的特征	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	汤嵩彦
	联系电话	020-83282627	95559
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	tangsy@bankcomm.com
客户服务电话		4006135888,020-83936180	95559
传真		020-83282856	021-62701216

### 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告摘要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

## 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（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	17,457,910.27
本期利润	8,716,104.48
加权平均基金份额本期利润	0.1956
本期基金份额净值增长率	57.79%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	0.4576
期末基金资产净值	108,904,571.60
期末基金份额净值	1.0058

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	-11.08%	3.79%	-10.07%	3.60%	-1.01%	0.19%
过去三个月	19.48%	2.79%	21.70%	2.75%	-2.22%	0.04%
过去六个月	57.79%	2.19%	63.34%	2.17%	-5.55%	0.02%
过去一年	105.02%	1.72%	118.28%	1.72%	-13.26%	0.00%
过去三年	120.55%	1.41%	145.96%	1.48%	-25.41%	-0.07%
自基金合同生效起至今	120.77%	1.39%	136.24%	1.47%	-15.47%	-0.08%

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 2015 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金字[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，股东包括广州证券股份有限公司、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。

公司目前下设权益投资部、研究部、集中交易部、指数及量化投资部、产品研发部、固定收益部、零售业务部、电子商务部、机构业务部、专户投资部、信息技术部、基金事务部、风险管理部、监察稽核部、财务管理部、综合管理部。权益投资部负责基金权利类投资；研究部负责宏观经济、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；指数及量化投资部负责指数量化产品的研究投资、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；固定收益部负责固定收益证券以及债券、货币市场的研究和投资管理工作；零售业务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；电子商务部负责公司电子商务的推广；机构业务部负责机构客户的开发、维护与管理；信息技术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,基金事务部负责基金会计核算、估值、开放式基金注册、登记和清算等业务；专户投资部负责特定客户资产的投资和管理；风险管理部负责公司风险的识别、评估、控制等管理工作；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；财务管理部负责公司财务管理；综合管理部负责公司企业文化建设、文字档案、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。

目前，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、金鹰行业优势混合型证券投资基金、金鹰稳健成长混合型证券投资基金、金鹰主题优势混合型证券投资基金、金鹰保本混合型证券投资基金、金鹰技术领先灵活配置混合型证券投资基金、金鹰策略配置混合型证券投资基金、金鹰持久增利债券型证券投资基金（LOF）、金鹰核心资源混合型证券投资基金、金鹰中证 500 指数分级证券投资基金、金鹰灵活配置混合型证券投资基金、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、金鹰元安保本混合型证券投资基金、金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）、金鹰科技创新股票型证券投资基金、金鹰民族新兴灵活配置混合型证券投资基金及金鹰产业整合灵活配置混合型证券投资基金等二十只开放式基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何晓春	权益投资部总监、基金经理	2015-03-06	-	16	何晓春先生，产业经济学博士，16 年金融行业从业经验，曾任世纪证券有限责任公司江西分公司筹办

					组负责人等职，2011 年 4 月加入金鹰基金管理有限公司，现任公司权益投资部总监、本基金、金鹰稳健成长混合型证券投资基金、金鹰行业优势混合型证券投资基金、金鹰民族新兴灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、任职日期和离任日期指公司公告聘任或解聘日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、本基金已于 2015 年 7 月 22 日增聘黄艳芳女士为本基金基金经理。

#### 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，通过投资交易系统中的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合；事后加强对不同投资组合的交易价差、收益率的分析，对公平交易执行情况进行检查。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

在报告期内，本基金的跟踪标的中证 500 指数上涨 67.32%，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 0.1194%、年化跟踪误差 3.41%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 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值为 1.0058 元，累计单位净值 2.1243 元，本报告期份额净值增长率 57.79%，同期业绩比较基准增长率为 63.34%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年市场经过大幅上涨后，6 月末展开快速回调。我们认为，下半年经济底部波动概率较大，政策密集出台时期已过，监管冲击引发市场风险偏好下行，短期震荡以消化高估值。

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、分管总经理助理、权益投资部总监、固定收益部总监、研究发展部总监、基金事务部总监、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，估值委员会集体决策，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。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内无应当说明的预警事项。

### 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

2015 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

2015 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

2015 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:2015 年 6 月 30 日

单位:人民币元

资产	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>	-	-
银行存款	1,273,681.06	637,013.56
结算备付金	14,014,484.59	893,568.69
存出保证金	61,743.30	7,417.43
交易性金融资产	101,938,059.51	16,492,790.83
其中：股票投资	101,938,059.51	16,492,790.83
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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	2,679,094.77	435,760.46
应收利息	5,594.16	2,918.63
应收股利	-	-
应收申购款	23,922.72	9,881.42
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>119,996,580.11</b>	<b>18,479,351.02</b>
负债和所有者权益	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<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	-	-
应付赎回款	10,149,682.37	219,416.47
应付管理人报酬	120,942.87	16,535.81
应付托管费	26,607.44	3,637.90
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	277,011.29	22,757.96
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	517,764.54	541,826.97
<b>负债合计</b>	<b>11,092,008.51</b>	<b>804,175.11</b>
<b>所有者权益：</b>	-	-
实收基金	49,333,853.13	12,633,978.16
未分配利润	59,570,718.47	5,041,197.75

所有者权益合计	<b>108,904,571.60</b>	<b>17,675,175.91</b>
负债和所有者权益总计	<b>119,996,580.11</b>	<b>18,479,351.02</b>

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，金鹰 500 份额净值 1.0058 元，基金份额总额 24,314,589.10 份；金鹰 500A 份额净值 1.0082 元，基金份额总额 41,982,768.00 份；金鹰 500B 份额净值 1.0034 元，基金份额总额 41,982,768.00 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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	<b>9,662,923.12</b>	<b>717,235.93</b>
1.利息收入	35,814.23	10,697.78
其中：存款利息收入	35,814.23	10,697.78
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	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	18,016,500.43	1,416,463.63
其中：股票投资收益	17,726,713.58	1,309,465.76
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	289,786.85	106,997.87
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-8,741,805.79	-717,650.06
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	352,414.25	7,724.58
<b>减：二、费用</b>	<b>946,818.64</b>	<b>432,086.53</b>
1. 管理人报酬	276,207.24	90,217.75
2. 托管费	60,765.55	19,847.93
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	467,606.27	25,540.47
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	142,239.58	296,480.38
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>8,716,104.48</b>	<b>285,149.40</b>

减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>8,716,104.48</b>	<b>285,149.40</b>

### 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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	12,633,978.16	5,041,197.75	17,675,175.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8,716,104.48	8,716,104.48
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）	36,699,874.97	45,813,416.24	82,513,291.21
其中：1.基金申购款	110,689,242.99	150,056,818.99	260,746,061.98
2.基金赎回款	-73,989,368.02	-104,243,402.75	-178,232,770.77
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）	49,333,853.13	59,570,718.47	108,904,571.60
项目	上年度可比期间 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
-----------------	---------------	--------------	---------------

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：刘岩，主管会计工作负责人：曾长兴，会计机构负责人：谢文君

## 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 日颁布并于 2014 年 7 月修改的《企业会计准则—基本准则》和 41 项具体会计准则及其应用指南、解释及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”), 中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《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>》和中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定而编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则和《证券投资基金会计核算业务指引》的要求, 真实、完整地反映了本基金 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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(2014 年)年度报告一致。

#### 6.4.5 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.5.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度, 即每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。

##### 6.4.5.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

##### 6.4.5.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产分类

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

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

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

###### (2) 金融负债分类

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

#### 6.4.5.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）。本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

##### (1) 股票投资

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

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

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

#### (2) 债券投资

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

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

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

卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券投资收益。

卖出未上市债券和银行间同业市场交易的债券于成交日确认债券投资收益。

卖出债券的成本按移动加权平均法结转。

#### (3) 权证投资

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

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

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

#### (4) 分离交易可转债

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

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算。

#### (5) 回购协议

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

### 6.4.5.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金目前金融资产和金融负债的估值原则和方法如下：

#### 1、股票估值原则和方法

##### (1) 上市流通股票的估值

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

#### (2) 未上市股票的估值

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

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

#### (3) 长期停牌股票的估值

已停牌股票且潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，本基金根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

#### (4) 有明确锁定期股票的估值

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

### 2、固定收益证券的估值原则和方法

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘净价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(2) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日第三方估值机构提供的相应品种估值净价估值，如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，采用估值技术确定公允价值。

(3) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日第三方估值机构提供的相应品种估值净价估值，如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，采用估值技术确定公允价值。

(4) 交易所上市交易的可转换债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到

的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

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

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

(7) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(8) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

### 3、权证估值原则和方法

(1) 配股权证的估值：

因持有股票而享有的配股权，类同权证处理方式的，采用估值技术进行估值。

(2) 认沽/认购权证的估值：

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

### 4、其他资产的估值原则和方法

其他资产按照国家有关规定或行业约定进行估值。

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

6、国家有最新规定的，按其规定进行估值。

### 6.4.5.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，

不予相互抵销。

#### 6.4.5.7 实收基金

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

#### 6.4.5.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。

损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现平准金与已实现平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.5.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

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

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

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

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

8、股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代

扣代缴的个人所得税后的净额入账；

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

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

#### **6.4.5.10 费用的确认和计量**

1、基金管理费按前一日基金资产净值的 1.0% 的年费率逐日计提；

2、基金托管费按前一日基金资产净值的 0.22% 的年费率逐日计提；

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

4、卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

5、其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第五位的，则采用待摊或预提的方法。

#### **6.4.5.11 基金的收益分配政策**

在存续期内，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。

#### **6.4.5.12 分部报告**

本基金本报告期内无分部报告。

#### **6.4.5.13 其他重要的会计政策和会计估计**

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《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》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会会计字[2007]21 号《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

#### **6.4.6 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.6.1 会计政策变更的说明**

本基金报告期内无会计政策变更。

##### **6.4.6.2 会计估计变更的说明**

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期内改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

##### **6.4.6.3 差错更正的说明**

本基金本报告期无差错更正。

#### **6.4.7 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）交易印花税率调整为单边征税,由出让方按证券(股票)交易印花税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变；

## 2、营业税、企业所得税

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

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

## 3、个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]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；

根据财政部、国家税务总局财税字【2012】85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

## 6.4.8 关联方关系

### 6.4.8.1 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。

**6.4.8.2 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
广州证券股份有限公司	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

**6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.9.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	60,835,745.91	18.09%	6,992,012.61	45.61%

**6.4.9.1.2 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。

**6.4.9.1.3 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。

**6.4.9.1.4 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。

**6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015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	53,833.70	17.92%	53,833.70	19.43%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日			
	当期	占当期佣金	期末应付佣金余额	占期末应付佣

	佣金	总量的比例		金总额的比例
广州证券	6,187.27	45.98%	3,957.57	44.56%

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。

## 6.4.9.2 关联方报酬

### 6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月 30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	276,207.24	90,217.75
其中：支付销售机构的客户维护费	40,540.52	29,391.63

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。

### 6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月 30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	60,765.55	19,847.93

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。

### 6.4.9.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
合计	0.00	
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
合计	-	

注：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。

### 6.4.9.3 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。

### 6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.9.4.1 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。

#### 6.4.9.4.2 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。

### 6.4.9.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年6月30日		2014年1月1日至2014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	1,273,681.06	17,213.18	78,489.25	3,188.74

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。2015年6月30日结算备付金余额 14,014,484.59 元，2014年6月30日结算备付金余额 1,345,197.33 元。

#### 6.4.9.6 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。

#### 6.4.10 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.10.1 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。

##### 6.4.10.2 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 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000066	长城电脑	2015-06-18	重大事项	21.54	-	-	18,668.00	344,761.07	402,108.72	-
000519	江南红箭	2015-06-15	重大事项	26.06	-	-	4,400.00	88,456.97	114,664.00	-
000543	皖能电力	2015-06-15	重大事项	21.36	2015-07-14	19.04	10,872.00	176,206.03	232,225.92	-
000566	海南海药	2015-06-18	重大事项	49.97	-	-	11,993.00	533,791.98	599,290.21	-
000592	平潭发展	2015-06-30	重大事项	29.76	2015-07-14	30.00	13,500.00	589,528.77	401,760.00	-
000650	仁和药业	2015-06-12	重大事项	17.17	-	-	14,825.00	164,697.37	254,545.25	-
000669	金鸿能源	2015-05-04	重大事项	37.72	2015-07-23	33.95	2,150.00	64,012.88	81,098.00	-
000688	建新矿业	2015-06-10	重大事项	17.07	-	-	7,800.00	90,561.31	133,146.00	-
000693	华泽钴镍	2015-06-30	重大事项	20.57	2015-08-18	22.63	4,900.00	147,742.15	100,793.00	-
000697	炼石有色	2015-05-18	重大事项	33.83	-	-	5,542.00	160,587.83	187,485.86	-
000732	泰禾集团	2015-06-25	重大事项	34.20	2015-07-02	30.58	10,691.00	341,204.64	365,632.20	-
000748	长城信息	2015-06-18	重大事项	34.88	-	-	18,400.00	578,424.81	641,792.00	-
000786	北新建材	2015-04-10	重大事项	18.58	-	-	4,318.00	54,293.67	80,228.44	-
000788	北大医药	2015-05-25	重大事项	20.72	2015-07-21	18.65	6,300.00	115,212.95	130,536.00	-

000850	华茂股份	2015-05-07	重大事项	10.98	-	-	6,414.00	54,945.70	70,425.72	-
000887	中鼎股份	2015-06-30	重大事项	24.75	-	-	12,618.00	379,140.06	312,295.50	-
000959	首钢股份	2015-04-23	重大事项	6.15	-	-	15,300.00	73,505.34	94,095.00	-
000979	中弘股份	2015-05-25	重大事项	6.04	-	-	30,294.00	133,019.25	182,975.76	-
000982	中银绒业	2014-08-25	重大事项	4.64	-	-	6,160.00	27,955.00	28,582.40	-
001696	宗申动力	2015-06-30	重大事项	17.25	2015-08-24	15.53	18,344.00	442,612.68	316,434.00	-
002018	华信国际	2015-06-15	重大事项	44.08	-	-	9,500.00	280,839.22	418,760.00	-
002069	獐子岛	2015-06-01	重大事项	19.76	-	-	8,800.00	160,897.37	173,888.00	-
002091	江苏国泰	2015-06-01	重大事项	26.22	-	-	6,337.00	142,015.86	166,156.14	-
002106	莱宝高科	2015-04-07	重大事项	18.92	-	-	4,100.00	61,506.44	77,572.00	-
002143	印纪传媒	2015-06-30	重大事项	32.01	2015-07-01	33.50	4,800.00	179,891.05	153,648.00	-
002183	怡亚通	2015-06-01	重大事项	73.15	-	-	17,913.00	897,319.62	1,310,335.95	-
002191	劲嘉股份	2015-06-18	重大事项	15.77	-	-	24,312.00	377,713.06	383,400.24	-
002194	武汉凡谷	2015-06-18	重大事项	21.07	2015-07-24	24.28	4,410.00	75,031.08	92,918.70	-
002203	海亮股份	2015-04-27	重大事项	12.71	-	-	4,710.00	42,180.46	59,864.10	-
002223	鱼跃医疗	2015-06-25	重大事项	67.20	2015-07-13	60.48	7,269.00	380,497.81	488,476.80	-
002226	江南化工	2015-06-08	重大事项	13.18	-	-	11,622.00	129,003.17	153,177.96	-
002238	天威视讯	2015-06-29	重大事项	23.76	-	-	3,764.00	95,349.78	89,432.64	-
002242	九阳股份	2015-06-15	重大事项	19.45	2015-07-07	17.51	6,400.00	102,611.93	124,480.00	-
002269	美邦服饰	2015-05-22	重大事项	11.86	2015-07-02	10.67	19,750.00	157,872.36	234,235.00	-
002276	万马股份	2015-06-30	重大事项	34.15	2015-07-20	30.74	10,687.00	334,073.79	364,961.05	-
002308	威创股份	2015-06-12	重大事项	31.00	-	-	3,400.00	40,306.95	105,400.00	-

002309	中利科技	2015-06-02	重大事项	33.39	2015-07-21	30.05	8,709.00	245,718.30	290,793.51	-
002325	洪涛股份	2015-06-03	重大事项	31.15	-	-	12,359.00	296,335.19	384,982.85	-
002345	潮宏基	2015-05-22	重大事项	19.58	-	-	8,440.00	118,882.93	165,255.20	-
002368	太极股份	2015-05-14	重大事项	65.52	-	-	3,150.00	142,199.34	206,388.00	-
002414	高德红外	2015-05-13	重大事项	39.36	-	-	2,919.00	77,708.79	114,891.84	-
002461	珠江啤酒	2015-06-04	重大事项	26.40	2015-07-24	23.76	5,989.00	115,732.10	158,109.60	-
002557	洽洽食品	2015-06-29	重大事项	16.38	2015-08-24	14.74	4,777.00	94,671.54	78,247.26	-
002574	明牌珠宝	2015-06-04	重大事项	22.90	-	-	8,248.00	130,468.40	188,879.20	-
002662	京威股份	2015-05-15	重大事项	17.84	2015-08-13	16.06	2,520.00	42,064.66	44,956.80	-
002665	首航节能	2015-06-30	重大事项	27.70	2015-07-01	30.00	8,300.00	265,145.68	229,910.00	-
002727	一心堂	2015-04-13	重大事项	78.24	2015-08-17	70.42	600.00	31,602.60	46,944.00	-
300144	宋城演艺	2015-06-18	重大事项	76.47	2015-07-20	68.82	7,700.00	528,383.50	588,819.00	-
300291	华录百纳	2015-06-30	重大事项	37.76	2015-07-13	34.65	9,300.00	473,198.35	351,168.00	-
600078	澄星股份	2015-06-09	重大事项	15.23	2015-07-01	13.71	11,314.00	123,199.13	172,312.22	-
600110	中科英华	2015-06-26	重大事项	13.73	-	-	23,169.00	225,065.10	318,110.37	-
600175	美都能源	2015-06-29	重大事项	10.64	2015-07-20	9.58	28,600.00	237,767.55	304,304.00	-
600312	平高电气	2015-06-23	重大事项	22.58	-	-	18,938.00	423,710.58	427,620.04	-
600333	长春燃气	2015-05-29	重大事项	11.97	2015-07-09	10.77	7,027.00	81,279.08	84,113.19	-
600335	国机汽车	2015-06-15	重大事项	37.93	2015-07-21	33.94	3,915.00	117,110.77	148,495.95	-
600366	宁波韵升	2015-05-22	重大事项	35.09	2015-08-12	31.58	7,152.00	191,453.51	250,963.68	-
600410	华胜天成	2015-05-28	重大事项	47.84	2015-07-22	43.06	10,870.00	341,769.47	520,020.80	-
600416	湘电股份	2015-05-22	重大事项	17.95	2015-07-20	20.35	8,988.00	158,606.34	161,334.60	-

600482	风帆股份	2015-05-28	重大事项	42.38	-	-	5,587.00	127,875.07	236,777.06	-
600499	科达洁能	2015-06-10	重大事项	29.64	-	-	13,100.00	346,392.43	388,284.00	-
600575	皖江物流	2014-09-09	重大事项	4.11	-	-	5,518.00	15,314.53	22,678.98	-
600587	新华医疗	2015-05-22	重大事项	58.63	2015-07-06	47.42	5,600.00	263,621.63	328,328.00	-
600643	爱建股份	2015-06-30	重大事项	16.73	-	-	22,670.00	405,364.44	379,269.10	-
600645	中源协和	2015-04-27	重大事项	81.33	-	-	2,756.00	145,979.40	224,145.48	-
600654	飞乐股份	2015-06-29	重大事项	30.91	-	-	17,410.00	448,321.29	538,143.10	-
600702	沱牌舍得	2015-06-29	重大事项	26.11	2015-08-20	28.00	5,934.00	149,636.13	154,936.74	-
600790	轻纺城	2015-05-25	重大事项	13.38	2015-08-18	12.04	13,071.00	132,909.12	174,889.98	-
600869	智慧能源	2015-05-11	重大事项	29.14	2015-07-31	26.23	2,429.00	41,641.13	70,781.06	-
600872	中炬高新	2015-05-04	重大事项	23.17	-	-	9,123.00	124,342.26	211,379.91	-
600879	航天电子	2015-05-15	重大事项	24.50	-	-	14,252.00	285,035.58	349,174.00	-
600967	北方创业	2015-04-13	重大事项	17.12	-	-	5,100.00	74,390.59	87,312.00	-
600978	宜华木业	2015-06-18	重大事项	22.44	-	-	31,989.00	542,700.34	717,833.16	-
601311	骆驼股份	2015-06-18	重大事项	28.20	2015-07-15	25.38	12,283.00	293,350.72	346,380.60	-
601718	际华集团	2015-06-17	重大事项	15.12	2015-07-02	13.56	33,700.00	330,173.22	509,544.00	-

### 6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.10.3.1 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。

#### 6.4.10.3.2 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。

### 6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

### 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的不含权固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2015 年 3 月 25 日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

## 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	101,938,059.51	84.95
	其中：股票	101,938,059.51	84.95
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	15,288,165.65	12.74
7	其他各项资产	2,770,354.95	2.31
8	合计	119,996,580.11	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	1,629,649.57	1.50
B	采矿业	2,754,603.73	2.53
C	制造业	59,510,891.23	54.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,052,996.80	2.80
E	建筑业	2,404,015.63	2.21
F	批发和零售业	7,052,828.64	6.48
G	交通运输、仓储和邮政业	3,245,333.14	2.98
H	住宿和餐饮业	113,240.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,657,990.19	5.20
J	金融业	851,533.07	0.78
K	房地产业	7,532,461.83	6.92
L	租赁和商务服务业	2,745,891.95	2.52
M	科学研究和技术服务业	371,469.48	0.34
N	水利、环境和公共设施管理业	586,831.71	0.54
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	260,214.00	0.24
R	文化、体育和娱乐业	2,218,916.61	2.04
S	综合	1,415,264.66	1.30

合计	101,404,132.24	93.11
----	----------------	-------

### 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	533,927.27	0.49
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	533,927.27	0.49

注：积极投资股票是因中证 500 指数成份股调整及股票停牌，未及时卖出而被动持有的股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	002183	怡亚通	17,913	1,310,335.95	1.20
2	600978	宜华木业	31,989	717,833.16	0.66
3	000748	长城信息	18,400	641,792.00	0.59
4	000566	海南海药	11,993	599,290.21	0.55
5	300144	宋城演艺	7,700	588,819.00	0.54
6	002405	四维图新	12,659	554,464.20	0.51
7	600654	中安消	17,410	538,143.10	0.49
8	600410	华胜天成	10,870	520,020.80	0.48
9	600376	首开股份	26,600	513,114.00	0.47
10	601718	际华集团	33,700	509,544.00	0.47

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

#### 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	300059	东方财富	2,879,233.00	16.29
2	300168	万达信息	1,249,696.00	7.07
3	601099	太平洋	1,233,669.00	6.98
4	600037	歌华有线	1,121,336.80	6.34
5	600601	方正科技	1,087,194.74	6.15
6	600219	南山铝业	1,065,480.00	6.03
7	600635	大众公用	1,039,235.00	5.88
8	002183	怡亚通	1,020,279.00	5.77
9	002030	达安基因	987,736.00	5.59
10	600881	亚泰集团	983,765.00	5.57
11	300253	卫宁软件	950,526.28	5.38
12	600820	隧道股份	943,695.00	5.34
13	600435	北方导航	943,470.00	5.34
14	600895	张江高科	937,412.85	5.30
15	600021	上海电力	928,329.00	5.25
16	600158	中体产业	913,482.23	5.17
17	600201	金宇集团	895,734.90	5.07
18	000748	长城信息	868,359.00	4.91
19	000998	隆平高科	861,743.98	4.88
20	000012	南玻A	844,178.00	4.78
21	601012	隆基股份	839,861.00	4.75

22	600169	太原重工	818,023.00	4.63
23	002022	科华生物	815,212.53	4.61
24	600978	宜华木业	814,292.00	4.61
25	600446	金证股份	812,886.00	4.60
26	000540	中天城投	807,945.00	4.57
27	000566	海南海药	804,026.00	4.55
28	601519	大智慧	792,528.00	4.48
29	600643	爱建股份	791,464.00	4.48
30	000616	海航投资	765,090.00	4.33
31	600122	宏图高科	764,512.00	4.33
32	000997	新大陆	759,740.03	4.30
33	600811	东方集团	759,180.00	4.30
34	600026	中海发展	758,714.00	4.29
35	601608	中信重工	748,854.00	4.24
36	600704	物产中大	744,417.60	4.21
37	002266	浙富控股	739,706.09	4.18
38	600694	大商股份	730,913.00	4.14
39	600528	中铁二局	722,846.00	4.09
40	600770	综艺股份	721,514.00	4.08
41	600584	长电科技	720,618.00	4.08
42	300144	宋城演艺	720,313.80	4.08
43	001696	宗申动力	709,676.16	4.02
44	000712	锦龙股份	708,967.00	4.01
45	002063	远光软件	706,349.80	4.00
46	600198	大唐电信	704,828.00	3.99
47	002004	华邦颖泰	699,018.00	3.95
48	000592	平潭发展	689,967.00	3.90
49	000977	浪潮信息	684,965.00	3.88
50	600755	厦门国贸	684,622.34	3.87
51	600320	振华重工	680,563.00	3.85
52	002424	贵州百灵	679,630.00	3.85
53	002285	世联行	677,213.20	3.83
54	600525	长园集团	673,489.00	3.81
55	600240	华业资本	670,642.17	3.79
56	000887	中鼎股份	667,194.00	3.77
57	600500	中化国际	661,566.00	3.74
58	000656	金科股份	657,918.00	3.72
59	600433	冠豪高新	657,386.00	3.72
60	000547	闽福发 A	657,064.00	3.72
61	600143	金发科技	655,878.84	3.71
62	000511	烯碳新材	655,619.78	3.71
63	600655	豫园商城	655,597.00	3.71
64	000829	天音控股	651,927.06	3.69
65	000078	海王生物	651,907.00	3.69

66	600594	益佰制药	644,412.00	3.65
67	002573	清新环境	643,993.00	3.64
68	600312	平高电气	623,756.99	3.53
69	000661	长春高新	622,420.00	3.52
70	002276	万马股份	620,062.00	3.51
71	002223	鱼跃医疗	619,947.00	3.51
72	600200	江苏吴中	619,621.00	3.51
73	601872	招商轮船	617,999.40	3.50
74	600611	大众交通	613,791.00	3.47
75	600079	人福医药	611,236.00	3.46
76	000758	中色股份	609,887.00	3.45
77	600536	中国软件	603,180.00	3.41
78	600685	中船防务	603,079.00	3.41
79	600737	中粮屯河	601,870.00	3.41
80	600125	铁龙物流	601,016.00	3.40
81	002405	四维图新	591,782.00	3.35
82	600759	洲际油气	591,018.15	3.34
83	601000	唐山港	585,450.00	3.31
84	000415	渤海租赁	584,614.00	3.31
85	002191	劲嘉股份	578,678.00	3.27
86	000939	凯迪电力	578,665.44	3.27
87	300273	和佳股份	577,736.26	3.27
88	600478	科力远	577,171.71	3.27
89	002073	软控股份	574,887.00	3.25
90	600171	上海贝岭	574,350.00	3.25
91	002340	格林美	574,018.00	3.25
92	300033	同花顺	569,909.54	3.22
93	600675	中华企业	564,689.00	3.19
94	601718	际华集团	562,023.00	3.18
95	000681	视觉中国	555,293.00	3.14
96	600138	中青旅	551,923.00	3.12
97	600376	首开股份	551,208.00	3.12
98	002013	中航机电	551,002.16	3.12
99	002250	联化科技	547,438.98	3.10
100	000988	华工科技	547,271.00	3.10
101	600380	健康元	542,565.00	3.07
102	002161	远望谷	537,245.00	3.04
103	002219	恒康医疗	536,153.00	3.03
104	600787	中储股份	534,947.00	3.03
105	600651	飞乐音响	530,651.00	3.00
106	600499	科达洁能	525,767.70	2.97
107	000816	智慧农业	520,672.00	2.95
108	600816	安信信托	519,440.00	2.94
109	600498	烽火通信	519,198.00	2.94

110	600673	东阳光科	515,476.00	2.92
111	600797	浙大网新	513,700.00	2.91
112	000732	泰禾集团	510,963.00	2.89
113	600067	冠城大通	509,473.00	2.88
114	600664	哈药股份	508,858.24	2.88
115	600120	浙江东方	507,571.00	2.87
116	600112	天成控股	506,120.59	2.86
117	000066	长城电脑	505,616.00	2.86
118	600517	置信电气	505,073.00	2.86
119	002092	中泰化学	502,649.00	2.84
120	000006	深振业 A	501,811.50	2.84
121	000652	泰达股份	500,800.00	2.83
122	000777	中核科技	500,168.00	2.83
123	002595	豪迈科技	499,867.00	2.83
124	600064	南京高科	499,200.50	2.82
125	600805	悦达投资	498,959.00	2.82
126	000671	阳光城	498,149.00	2.82
127	600266	北京城建	494,767.00	2.80
128	002018	华信国际	494,600.00	2.80
129	600161	天坛生物	492,134.50	2.78
130	600835	上海机电	488,810.00	2.77
131	600418	江淮汽车	484,271.79	2.74
132	600880	博瑞传播	481,372.00	2.72
133	002048	宁波华翔	481,247.00	2.72
134	600654	中安消	479,982.00	2.72
135	002179	中航光电	478,396.00	2.71
136	300291	华录百纳	478,286.50	2.71
137	600058	五矿发展	476,708.00	2.70
138	000930	中粮生化	475,136.00	2.69
139	300244	迪安诊断	471,472.00	2.67
140	000897	津滨发展	468,571.00	2.65
141	600582	天地科技	468,494.00	2.65
142	000528	柳工	468,486.00	2.65
143	002440	闰土股份	468,437.00	2.65
144	600557	康缘药业	468,378.00	2.65
145	002665	首航节能	467,300.50	2.64
146	300199	翰宇药业	466,144.00	2.64
147	600270	外运发展	465,625.00	2.63
148	600490	鹏欣资源	465,031.00	2.63
149	603766	隆鑫通用	462,440.00	2.62
150	600183	生益科技	461,704.00	2.61
151	601717	郑煤机	461,641.00	2.61
152	600187	国中水务	459,887.00	2.60
153	600511	国药股份	458,737.00	2.60

154	600220	江苏阳光	458,455.35	2.59
155	600808	马钢股份	458,159.00	2.59
156	600180	瑞茂通	457,742.00	2.59
157	600545	新疆城建	457,543.00	2.59
158	000587	金叶珠宝	452,846.00	2.56
159	600175	美都能源	452,264.00	2.56
160	300147	香雪制药	451,635.60	2.56
161	600410	华胜天成	451,562.00	2.55
162	600325	华发股份	450,398.41	2.55
163	600458	时代新材	448,431.71	2.54
164	600017	日照港	447,335.87	2.53
165	600422	昆药集团	440,590.00	2.49
166	300134	大富科技	439,315.50	2.49
167	000667	美好集团	436,696.00	2.47
168	600176	中国巨石	436,420.00	2.47
169	002273	水晶光电	432,420.22	2.45
170	600436	片仔癀	432,241.50	2.45
171	600284	浦东建设	431,990.00	2.44
172	002311	海大集团	431,028.00	2.44
173	002221	东华能源	428,684.00	2.43
174	002271	东方雨虹	427,848.00	2.42
175	600699	均胜电子	425,736.00	2.41
176	600289	亿阳信通	425,576.79	2.41
177	600851	海欣股份	424,661.00	2.40
178	600522	中天科技	423,565.00	2.40
179	002444	巨星科技	423,477.00	2.40
180	000090	天健集团	422,351.00	2.39
181	600426	华鲁恒升	422,018.00	2.39
182	600039	四川路桥	422,005.00	2.39
183	300274	阳光电源	421,868.00	2.39
184	002168	深圳惠程	421,841.57	2.39
185	000680	山推股份	421,718.00	2.39
186	002428	云南锗业	420,988.00	2.38
187	300202	聚龙股份	420,798.00	2.38
188	002011	盾安环境	419,815.60	2.38
189	600580	卧龙电气	419,657.00	2.37
190	300115	长盈精密	419,006.36	2.37
191	000685	中山公用	416,018.00	2.35
192	002489	浙江永强	415,378.00	2.35
193	000718	苏宁环球	414,871.00	2.35
194	600317	营口港	414,656.00	2.35
195	000099	中信海直	414,535.00	2.35
196	000088	盐田港	414,280.24	2.34
197	002690	美亚光电	412,662.02	2.33

198	600216	浙江医药	412,491.00	2.33
199	000031	中粮地产	410,649.00	2.32
200	002005	德豪润达	410,611.15	2.32
201	002508	老板电器	408,305.50	2.31
202	000975	银泰资源	407,478.00	2.31
203	000541	佛山照明	407,007.65	2.30
204	600428	中远航运	406,609.00	2.30
205	600062	华润双鹤	404,922.00	2.29
206	002390	信邦制药	404,429.00	2.29
207	000488	晨鸣纸业	403,074.59	2.28
208	601311	骆驼股份	402,880.00	2.28
209	600110	中科英华	402,478.00	2.28
210	600056	中国医药	401,727.00	2.27
211	600409	三友化工	401,429.00	2.27
212	300072	三聚环保	400,182.00	2.26
213	000028	国药一致	399,756.68	2.26
214	002195	二三四五	398,797.00	2.26
215	002237	恒邦股份	398,519.00	2.25
216	600260	凯乐科技	398,129.00	2.25
217	000690	宝新能源	397,731.00	2.25
218	600160	巨化股份	396,584.00	2.24
219	000735	罗牛山	394,604.20	2.23
220	002155	湖南黄金	392,671.00	2.22
221	000572	海马汽车	389,781.00	2.21
222	000848	承德露露	388,264.17	2.20
223	002029	七匹狼	388,112.00	2.20
224	300039	上海凯宝	387,737.01	2.19
225	600765	中航重机	387,403.80	2.19
226	600757	长江传媒	387,320.99	2.19
227	002466	天齐锂业	385,716.53	2.18
228	601002	晋亿实业	378,035.00	2.14
229	600885	宏发股份	376,753.00	2.13
230	002396	星网锐捷	376,228.00	2.13
231	600006	东风汽车	372,758.00	2.11
232	600884	杉杉股份	372,130.00	2.11
233	002093	国脉科技	371,255.00	2.10
234	600993	马应龙	371,068.00	2.10
235	000973	佛塑科技	368,383.00	2.08
236	000933	神火股份	367,797.00	2.08
237	000830	鲁西化工	367,226.90	2.08
238	000422	湖北宜化	366,116.00	2.07
239	600151	航天机电	365,837.00	2.07
240	600261	阳光照明	364,149.50	2.06
241	600481	双良节能	362,306.00	2.05

242	000513	丽珠集团	360,535.00	2.04
243	000762	西藏矿业	360,023.00	2.04
244	600859	王府井	359,185.60	2.03
245	600736	苏州高新	358,384.00	2.03
246	002064	华峰氨纶	357,049.00	2.02
247	600496	精工钢构	355,956.00	2.01
248	002663	普邦园林	355,029.00	2.01
249	600267	海正药业	354,878.92	2.01
250	002358	森源电气	354,305.00	2.00

#### 7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	300059	东方财富	3,614,247.00	20.45
2	300168	万达信息	1,774,997.00	10.04
3	601099	太平洋	1,515,065.00	8.57
4	600820	隧道股份	1,260,574.20	7.13
5	601519	大智慧	894,839.68	5.06
6	000977	浪潮信息	861,798.34	4.88
7	000712	锦龙股份	806,209.76	4.56
8	601872	招商轮船	787,837.00	4.46
9	600037	歌华有线	722,362.43	4.09
10	002030	达安基因	696,591.40	3.94
11	600635	大众公用	690,567.00	3.91
12	600895	张江高科	673,997.00	3.81
13	600219	南山铝业	673,741.00	3.81
14	600601	方正科技	673,279.00	3.81
15	600490	鹏欣资源	669,519.15	3.79
16	600266	北京城建	646,267.00	3.66
17	600881	亚泰集团	636,079.00	3.60
18	300253	卫宁软件	621,945.00	3.52
19	600201	金宇集团	605,305.00	3.42
20	600158	中体产业	602,503.00	3.41
21	600435	北方导航	586,483.00	3.32
22	600582	天地科技	578,874.00	3.28
23	002690	美亚光电	562,660.42	3.18
24	600317	营口港	559,304.00	3.16
25	000998	隆平高科	555,966.00	3.15
26	000997	新大陆	554,121.00	3.14
27	002022	科华生物	544,154.24	3.08
28	600098	广州发展	541,745.00	3.07

29	600643	爱建股份	537,479.00	3.04
30	600122	宏图高科	532,421.00	3.01
31	600169	太原重工	514,569.00	2.91
32	600694	大商股份	512,478.39	2.90
33	000012	南玻A	510,331.42	2.89
34	600811	东方集团	509,132.00	2.88
35	601012	隆基股份	506,794.00	2.87
36	600026	中海发展	494,321.00	2.80
37	002266	浙富控股	490,700.33	2.78
38	600021	上海电力	489,318.00	2.77
39	600200	江苏吴中	475,068.00	2.69
40	000050	深天马A	466,719.02	2.64
41	600770	综艺股份	465,090.00	2.63
42	600320	振华重工	463,751.00	2.62
43	000540	中天城投	456,326.00	2.58
44	600528	中铁二局	451,472.00	2.55
45	000616	海航投资	447,593.66	2.53
46	002063	远光软件	445,357.00	2.52
47	002285	世联行	439,449.00	2.49
48	002276	万马股份	437,291.00	2.47
49	600978	宜华木业	436,436.00	2.47
50	600433	冠豪高新	434,531.00	2.46
51	000748	长城信息	433,876.00	2.45
52	600432	吉恩镍业	432,449.00	2.45
53	600755	厦门国贸	427,862.00	2.42
54	000656	金科股份	427,125.00	2.42
55	600704	物产中大	425,461.00	2.41
56	600125	铁龙物流	425,060.00	2.40
57	600240	华业资本	422,904.00	2.39
58	000511	烯碳新材	421,646.00	2.39
59	000661	长春高新	420,512.00	2.38
60	002424	贵州百灵	415,459.00	2.35
61	600611	大众交通	411,385.00	2.33
62	000887	中鼎股份	401,793.00	2.27
63	600651	飞乐音响	401,500.00	2.27
64	000078	海王生物	401,385.98	2.27
65	000829	天音控股	400,303.00	2.26
66	002073	软控股份	400,032.00	2.26
67	600675	中华企业	399,882.00	2.26
68	002004	华邦颖泰	398,864.00	2.26
69	002505	大康牧业	394,848.00	2.23
70	600198	大唐电信	393,101.00	2.22
71	002123	荣信股份	390,818.00	2.21
72	000758	中色股份	388,421.00	2.20

73	002052	同洲电子	387,419.00	2.19
74	600685	中船防务	385,461.00	2.18
75	300273	和佳股份	385,457.00	2.18
76	600171	上海贝岭	382,856.79	2.17
77	600584	长电科技	376,756.00	2.13
78	600737	中粮屯河	376,551.00	2.13
79	000566	海南海药	371,971.00	2.10
80	001696	宗申动力	370,587.00	2.10
81	000555	神州信息	369,436.00	2.09
82	000988	华工科技	368,933.02	2.09
83	002161	远望谷	368,579.00	2.09
84	600759	洲际油气	366,473.00	2.07
85	002573	清新环境	366,252.00	2.07
86	002223	鱼跃医疗	362,616.00	2.05
87	601000	唐山港	361,669.00	2.05
88	600478	科力远	360,340.00	2.04
89	601718	际华集团	355,177.00	2.01

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	206,383,391.24
卖出股票的收入（成交）总额	129,923,030.35

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本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序的前五名权证投资明细

本基金本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 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。

**7.11.2 本期国债期货投资评价**

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	61,743.30
2	应收证券清算款	2,679,094.77
3	应收股利	-
4	应收利息	5,594.16
5	应收申购款	23,922.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,770,354.95

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告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****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	002183	怡亚通	1,310,335.95	1.20	重大事项
2	600978	宜华木业	717,833.16	0.66	重大事项
3	000748	长城信息	641,792.00	0.59	重大事项
4	000566	海南海药	599,290.21	0.55	重大事项
5	300144	宋城演艺	588,819.00	0.54	重大事项
6	600654	中安消	538,143.10	0.49	重大事项
7	600410	华胜天成	520,020.80	0.48	重大事项
8	601718	际华集团	509,544.00	0.47	重大事项

**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	600078	澄星股份	172,312.22	0.16	重大事项
2	002226	江南化工	153,177.96	0.14	重大事项
3	000959	首钢股份	94,095.00	0.09	重大事项
4	600333	长春燃气	84,113.19	0.08	重大事项
5	000982	中银绒业	28,582.40	0.03	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	1,181	35,548.49	7,228,687.00	17.22%	34,754,081.00	82.78%
金鹰 500B	1,982	21,182.02	7,683,201.00	18.30%	34,299,567.00	81.70%
金鹰 500	2,270	10,711.27	169,169.00	0.70%	24,145,420.10	99.30%
合计	5,433	19,930.08	15,081,057.00	13.93%	93,199,068.10	86.07%

## 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	李重庆	1,988,866.00	4.74%
2	中国对外经济贸易信托有限公司—外贸信托·或然赋利 1 期证券	1,987,414.00	4.73%
3	北京恒天财富投资管理有限公司—恒天华夏未来一期证券投资基金	1,942,313.00	4.63%
4	中信证券—华夏银行—中信证券贵宾定制 1 号集合资产管理计划	1,000,000.00	2.38%
5	宁波鼎锋海川投资管理中心（有限合伙）—鼎锋另类策略 2 期证	981,660.00	2.34%
6	深圳慧利资产管理有限公司—慧利优选 5 期证券投资基金	850,000.00	2.02%
7	张宪锁	813,900.00	1.94%
8	苏艳玲	632,000.00	1.51%
9	袁芳	598,300.00	1.43%
10	张小玲	558,985.00	1.33%

### 金鹰 500B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	长江证券—招商银行—长江证券超越理财基金管家 II 集合资产管	2,988,100.00	7.12%
2	深圳慧利资产管理有限公司—慧利优选 5 期证券投资基金	1,811,941.00	4.32%
3	深圳慧利资产管理有限公司—慧利瑞丰 3 号证券投资基金	1,280,000.00	3.05%
4	深圳慧利资产管理有限公司—共盈慧利瑞丰 2 号证券	750,000.00	1.79%

	投资基金		
5	董小真	746,750.00	1.78%
6	刘芳	705,000.00	1.68%
7	陈铭忠	673,900.00	1.61%
8	莫铖	516,574.00	1.23%
9	沈伟清	498,700.00	1.19%
10	吴永生	481,021.00	1.15%

### 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	139.00	0.00%
	金鹰 500B	2,970.33	0.01%
	金鹰 500	12.00	0.00%
	合计	3,121.33	0.00%

### 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的情况

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	26,209,859.00	26,209,859.00	341,051,468.50
本报告期期初基金份额总额	2,184,647.00	2,184,647.00	8,945,225.00
本报告期基金总申购份额	-	-	197,194,441.57
减：本报告期基金总赎回份额	-	-	-149,442,172.88
本报告期基金拆分变动份额	39,798,121.00	39,798,121.00	-32,382,904.59
本报告期期末基金份额总额	41,982,768.00	41,982,768.00	24,314,589.10

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 分别增加份额 39,798,121.00 份，金鹰 500 减少份额 79,596,242.00 份。

2、2015 年 1 月 5 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 327,751.28 份。

3、2015 年 5 月 13 日依据合同实施上拆折算，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 46,885,586.13 份。

## 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，无会议决议。

### 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、经本基金管理人第五届董事会第五次会议决议通过，经中国证券监督管理委员会证监许可[2014]1401 号核准，聘任凌富华先生担任公司董事长，该事项已于 2015 年 1 月 10 日公告，并已按规定报广东证监局备案。按照公司章程相关规定，“董事长为公司法定代表人”。本基金管理人总经理刘岩先生不再代行董事长职务。

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

本基金报告期内无涉及基金管理人、基金财产的诉讼。

本报告期内无涉及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 报告期内改聘会计师事务所情况

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

本基金报告期内无管理人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

本报告期内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	

爱建证券	1	88,791,906.06	26.40%	80,837.42	26.91%	-
广州证券	1	60,835,745.91	18.09%	53,833.70	17.92%	-
国海证券	1	58,224,380.25	17.31%	51,912.53	17.28%	-
国泰君安	1	47,940,566.06	14.26%	42,423.00	14.12%	-
银河证券	1	80,486,522.71	23.93%	71,420.72	23.77%	-

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

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。

### 11 影响投资者决策的其他重要信息

无影响投资者决策的其他重要信息。

金鹰基金管理有限公司  
二〇一五年八月二十九日