

金鹰中证 500 指数分级证券投资基金
2015 年年度报告摘要
2015 年 12 月 31 日

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年三月三十日

§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 2016 年 3 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经审计。中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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	16,854,087.68 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	2,625,743.00 份	2,625,743.00 份	11,602,601.68 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。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%。</p>		
业绩比较基准	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	金鹰 500A 具有低风	金鹰 500B 具有高风	金鹰 500 为被动跟踪指

收益特征	险、预期收益相对稳定的特征。	险、高预期收益的特征	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

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	http://www.gefund.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市天河区珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015 年	2014 年	2013 年
本期已实现收益	-6,097,328.71	4,131,281.25	12,869,084.63
本期利润	-11,558,357.94	4,399,481.50	11,381,058.45
加权平均基金份额本期利润	-0.2592	0.2794	0.2211
本期基金份额净值增长率	-2.21%	30.44%	11.65%

3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0884	0.3786	0.0712
期末基金资产净值	21,880,134.99	17,675,175.91	21,290,173.64
期末基金份额净值	1.2982	1.3275	1.0501

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
过去三个月	29.85%	1.97%	23.13%	1.94%	6.72%	0.03%
过去六个月	-15.41%	3.26%	-13.51%	3.07%	-1.90%	0.19%
过去一年	33.48%	2.79%	41.26%	2.68%	-7.78%	0.11%
过去三年	94.39%	1.91%	124.58%	1.86%	-30.19%	0.05%
成立至今	86.75%	1.78%	104.31%	1.79%	-17.56%	-0.01%

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的历史走势对比图

(2012 年 6 月 5 日至 2015 年 12 月 31 日)

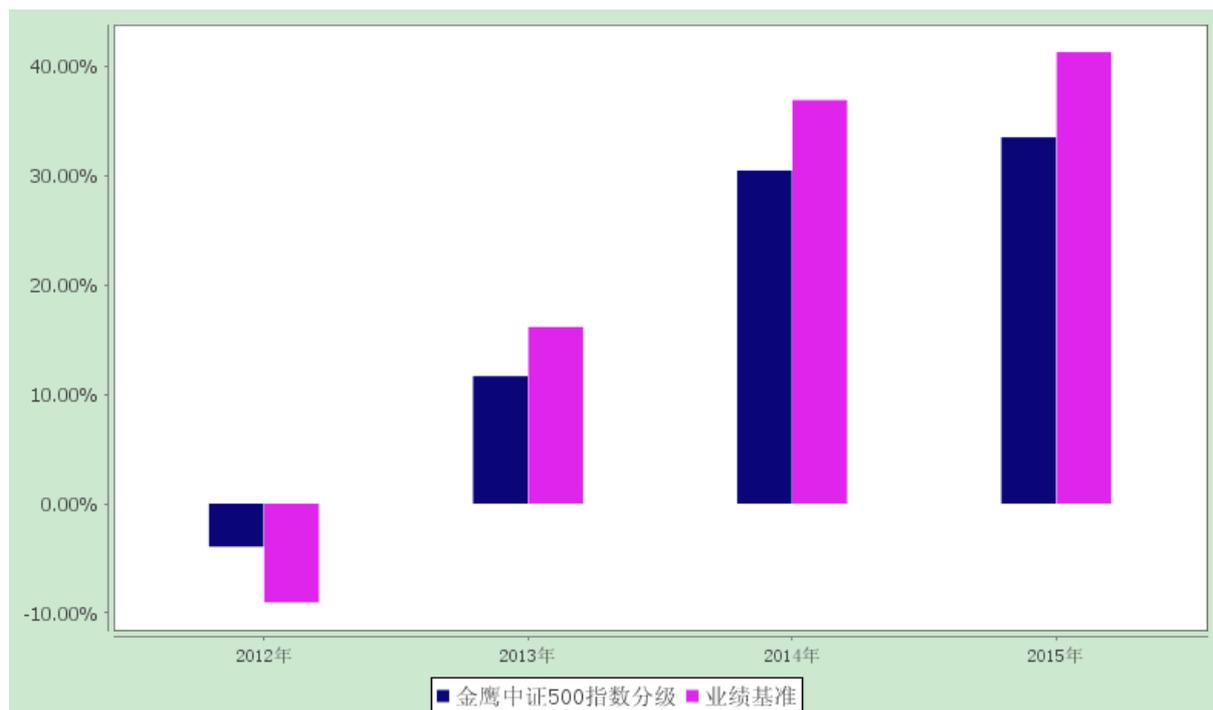


注：1、本基金于 2012 年 6 月 5 日成立。2、按基金合同规定，本基金建仓期为六个月。建仓期满后，本基金的各项投资比例应符合股票资产占基金资产净值的比例为 90%~95%，其中，中证 500 指数成分股和备选成分股占基金资产净值的比例不低于 90%；债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产净值的 5%~10%，其中，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证投资的比例范围占基金资产净值的 0%~3%；3、本基金业绩比较基准为中证 500 指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

金鹰中证 500 指数分级证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

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

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

金鹰基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[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 16 个一级职能部门，分别是权益投资部、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益类投资；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、客户服务及媒介宣传推广等业务；电子商务部负责公司网络平台及网上交易系统的建设、维护和电子商务的推广；机构业务部负责机构客户的开发、维护、管理及业务拓展；专户投资部负责特定客户资产的投资和管理；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；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的财务预算、财务管理及会计核算等工作；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。

截至 2015 年 12 月 31 日，公司共管理二十一只开放式基金：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、金鹰产业整合灵活配置混合型证券投资基金、金鹰改革红利灵活配置混合型证券投资基金。

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	-	17	何晓春先,生产业经济学博士。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、

					金鹰中证 500 指数分级证券投资基金、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及金鹰民族新兴灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
黄艳芳	基金经理	2015-07-22	-	9	黄艳芳女士,清华大学硕士研究生。 历任天相投资顾问有限公司分析师,中航证券资产管理分公司投资主办,量化投资负责人,广州证券股份有限公司资产管理部投资主办。2015 年 5 月加入金鹰基金管理有限公司,任指数及量化投资部数量策略研究员,现任金鹰中证 500 指数分级证券投资基金、金鹰持久增利债券型证券投资基金(LOF)基金经理。
林华显	基金经理	2012-06-05	2015-03-28	13	林华显先生 2002 年 10 月进入金鹰基金管理有限公司,2004 年后开始从事投资研究等工作,先后任交易员、交易主管、基金经理助理、基金经理等职。

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 3 月 6 日增聘何晓春先生为本基金基金经理,林华显先生于 2015 年 3 月 28 日离任。

4、2015 年 7 月 22 日增聘黄艳芳女士为本基金基金经理,目前本基金由何晓春先生与黄艳芳女士共同管理。

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》和其他有关法律法规及其各项实施准则,严格遵守本基金的基金合同、托管协议、招募说明书等法律文件的规定,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 公平交易制度和控制方法

为了保证本基金管理人管理的不同投资组合得到公平对待，本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，以及公司内控大纲的要求，制定了《金鹰基金管理有限公司公平交易管理规定》并严格执行，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。本基金管理人通过投资交易系统公平交易功能，对不同投资组合进行公平交易事前控制。同时，本基金管理人引入公平交易分析系统，定期或不定期对公司旗下投资组合在一定期间内买卖相同证券的情况进行监控和分析。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现。同时通过投资交易系统内的公平交易功能执行交易，以尽可能确保公平对待各投资组合。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未出现同日反向交易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。

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。

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，基金严格按照跟踪标的中证 500 指数的成份股进行投资。由于基金规模比较小，经历了两轮折算，客户申购赎回较为频繁，规模变动比较大，导致基金管理成本相对上升。报告期内，本基金的跟踪标的中证 500 指数涨幅为 43.12%，本基金净值增长 33.48%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 12 月 31 日, 基金单位份额净值为 1.2982 元, 本报告期份额净值增长率 33.48%, 同期业绩比较基准增长率为 41.26%, 较业绩基准落后 7.78%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015 年上半年, 市场在改革预期和资产配置需求的推动下, 经历了一场较快的上涨行情; 下半年市场快速下调, 全年市场大幅波动。我们认为, 明年国内经济底部波动概率较大, 人民币处于贬值预期通道; 当前市场虽然有调整, 但是由于经济处于转型过程中, 大部分上市公司业绩仍处于调整期, 股票估值仍有下调空间; 同时随着注册制的推进, 新股供给将改变目前的市场格局, 市场仍面临较大的资金压力。但是国内由于资产荒造成的配置需求仍然存在, 股市若经过一定调整后对资金的吸引力将逐渐显现; 同时在政府推行供给侧改革等政策调控下, 部分行业经历过阵痛后可能迎来底部布局机会。各种因素作用下, 2016 年市场形势较为复杂, 风险与机遇并存。

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 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

本报告期, 会计师事务所未对本基金出具非标准审计报告。

4.9 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

本基金自 2015 年 8 月 24 日起, 截至 2015 年 12 月 31 日已连续 87 个工作日资产净值低于五千万。

本公司已向监管部门上报情况说明及处理方案。

§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 年度, 金鹰基金管理有限公司在金鹰中证 500 指数分级证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上, 托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配, 符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2015 年度, 由金鹰基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关金鹰中证 500 指数分级证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经中审众环会计师事务所 (特殊普通合伙) 审计, 出具了众环审

字（2016）050131 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：金鹰中证 500 指数分级证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：	-	-
银行存款	183,742.34	637,013.56
结算备付金	1,415,217.54	893,568.69
存出保证金	86,205.86	7,417.43
交易性金融资产	20,693,713.14	16,492,790.83
其中：股票投资	20,693,713.14	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	198,990.28	435,760.46
应收利息	3,031.54	2,918.63
应收股利	-	-
应收申购款	1,543.27	9,881.42
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	22,582,443.97	18,479,351.02
负债和所有者权益	本期末	上年度末

	2015 年 12 月 31 日	2014 年 12 月 31 日
负 债:	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	67,185.14	-
应付赎回款	237,683.24	219,416.47
应付管理人报酬	19,724.95	16,535.81
应付托管费	4,339.50	3,637.90
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	17,480.39	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	355,895.76	541,826.97
负债合计	702,308.98	804,175.11
所有者权益:	-	-
实收基金	11,716,929.71	12,633,978.16
未分配利润	10,163,205.28	5,041,197.75
所有者权益合计	21,880,134.99	17,675,175.91
负债和所有者权益总计	22,582,443.97	18,479,351.02

7.2 利润表

会计主体：金鹰中证 500 指数分级证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015	2014 年 1 月 1 日至 2014 年

	年 12 月 31 日	12 月 31 日
一、收入	-10,053,146.74	5,283,931.02
1.利息收入	63,839.81	24,338.33
其中：存款利息收入	63,839.81	24,338.33
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）	-5,241,881.10	4,918,004.51
其中：股票投资收益	-5,625,711.35	4,774,094.44
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	383,830.25	143,910.07
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-5,461,029.23	268,200.25
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	585,923.78	73,387.93
减：二、费用	1,505,211.20	884,449.52
1. 管理人报酬	481,953.20	175,436.00
2. 托管费	106,029.66	38,595.98
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	630,107.89	79,315.29
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	287,120.45	591,102.25
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-11,558,357.94	4,399,481.50
减：所得税费用	-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-11,558,357.94	4,399,481.50
-------------------	----------------	--------------

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金鹰中证 500 指数分级证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	-11,558,357.94	-11,558,357.94
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）	-917,048.45	16,680,365.47	15,763,317.02
其中：1.基金申购款	116,354,964.99	154,242,634.83	270,597,599.82
2.基金赎回款	-117,272,013.44	-137,562,269.36	-254,834,282.80
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）	11,716,929.71	10,163,205.28	21,880,134.99
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基	19,847,283.12	1,442,890.52	21,290,173.64

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,399,481.50	4,399,481.50
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)	-7,213,304.96	-801,174.27	-8,014,479.23
其中: 1.基金申购款	43,908,113.93	14,310,251.65	58,218,365.58
2.基金赎回款	-51,121,418.89	-15,111,425.92	-66,232,844.81
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)	12,633,978.16	5,041,197.75	17,675,175.91

注: 本基金于 2012 年 6 月 5 日成立。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从 7.1 至 7.4, 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

金鹰中证 500 指数分级证券投资基金(简称“本基金”), 经中国证券监督管理委员会(简称“中国证监会”)证监许可[2012]247 号文《关于核准金鹰中证 500 指数分级证券投资基金募集的批复》、基金部函[2012]458 号文《关于金鹰中证 500 指数分级证券投资基金备案确认的函》批准, 于 2012 年 6 月 5 日募集成立。本基金为契约型开放式, 存续期限不定。

本基金募集期间自 2012 年 4 月 23 日起至 2012 年 5 月 29 日止, 认购金额及认购期银行利息合计 393,471,186.50 元, 于 2012 年 6 月 5 日划至托管银行账户。首次设立募集规模为 393,471,186.50 份, 根据《基金合同》约定, 其中场外募集资金及其利息确认金鹰 500 份额 341,051,468.50 份, 场

内募集资金及其利息按 1:1 的比例确认金鹰 500A 份额 26,209,859.00 份和金鹰 500B 份额 26,209,859.00 份。验资机构为立信会计师事务所。本基金的基金管理人为金鹰基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司（简称“交通银行”）。

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

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

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

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布并于 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编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本年度报告中财务报表的编制遵守了企业会计准则及其他有关规定，真实、完整地反映了本基金于 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和净值变动情况。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.4 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不变，会计估计与最近一期年度报告相比有调整。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金报告期会计政策无变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

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。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在报告期间不存在重大会计差错。

7.4.6 税项

1、印花税

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

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

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

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

2、营业税、企业所得税

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

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

3、个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税字【2005】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。

根据财政部、国家税务总局、证监会财税字[2015]101 号文《关于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，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。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；上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。（上市公司派发股息红利，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日之后的，股息红利所得按照本通知的规定执行。）

7.4.7 关联方关系

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
广州白云山医药集团股份有限公司	基金管理人股东
美的集团股份有限公司	基金管理人股东
东亚联丰投资管理有限公司	基金管理人股东
金鹰基金管理有限公司	基金发起人、管理人、销售机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
深圳前海金鹰资产管理有限公司	基金管理人子公司

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31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	83,380,137.47	19.63%	13,839,901.61	27.63%

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本年度及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

本基金本年度及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本年度及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.5 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12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
广州证券	73,860.37	19.48%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
广州证券	12,247.08	27.76%	2,348.66	10.32%

7.4.8.2 关联方报酬**7.4.8.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	481,953.20	175,436.00
其中：支付销售机构的客户维护费	77,655.99	63,645.84

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

$$H = E \times 1.0\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

3、本基金于 2012 年 6 月 5 日成立。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	106,029.66	38,595.98

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。

7.4.8.2.3 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12月31日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	金鹰 500A	金鹰 500B	金鹰 500	合计
金鹰直销	0.00	0.00	0.00	0.00
广州证券	0.00	0.00	0.00	0.00
交通银行	0.00	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	0.00	0.00	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12月31日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	金鹰500A	金鹰500B	金鹰500	合计
交通银行	-	-	-	0.00
广州证券	-	-	-	0.00
金鹰直销	-	-	-	0.00
合计	-	-	-	0.00

注：本基金本年度内及上年度可比期间内没有应支付关联方的销售服务费。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末其他关联方未投资本基金。

本基金本报告期末及上年度末其他关联方未投资本基金。

7.4.8.5 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12月31日		2014年1月1日至2014年12月31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	183,742.34	20,096.18	637,013.56	8,743.29

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 年年末结算备付金余额 1,415,217.54 元,当期结算备付金存款利息收入 42,454.67 元。2014 年年末结算备付金余额 893,568.69 元,当期结算备付金存款利息收入 13,277.68 元。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.9 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

7.4.9.2 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	复牌开盘价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600120	浙江东方	2015-10-12	重大事项	19.86	-	-	1,700.00	63,220.88	33,762.00	-
600122	宏图高科	2015-12-24	重大事项	19.42	-	-	4,238.00	74,233.24	82,301.96	-
600200	江苏吴中	2015-11-26	重大事项	27.89	2016-03-16	25.10	2,509.00	63,938.37	69,976.01	-
600219	南山铝业	2015-09-29	重大事项	6.58	2016-01-25	7.00	11,400.00	127,172.67	75,012.00	-
600282	南钢股份	2015-12-30	重大事项	3.17	2016-01-12	3.24	8,500.00	26,626.25	26,945.00	-
600429	三元股份	2015-09-21	重大事项	7.29	2016-01-27	7.49	3,584.00	40,858.58	26,127.36	-

600572	康恩贝	2015-12-29	重大事项	13.36	2016-01-04	13.18	3,015.00	42,818.52	40,280.40	-
600584	长电科技	2015-11-30	重大事项	22.02	-	-	3,676.00	84,536.71	80,945.52	-
600645	中源协和	2015-12-30	重大事项	65.01	2016-01-04	63.90	1,156.00	61,304.84	75,151.56	-
600654	中安肖	2015-12-14	重大事项	28.84	-	-	2,910.00	77,295.23	83,924.40	-
600699	均胜电子	2015-11-04	重大事项	35.91	2016-03-10	29.00	1,100.00	44,027.76	39,501.00	-
600729	重庆百货	2015-07-24	重大事项	32.39	2016-01-04	29.90	2,657.00	98,787.58	86,060.23	-
600759	洲际油气	2015-09-21	重大事项	7.85	-	-	10,037.00	128,927.76	78,790.45	-
600851	海欣股份	2015-12-21	重大事项	14.70	2016-01-19	13.23	3,391.00	51,332.57	49,847.70	-
600859	王府井	2015-12-21	重大事项	27.22	2016-01-04	27.22	1,300.00	40,563.52	35,386.00	-
600864	哈投股份	2015-10-09	重大事项	10.88	2016-01-14	11.97	1,872.00	38,086.13	20,367.36	-
600880	博瑞传播	2015-09-16	重大事项	7.50	2016-01-18	8.25	7,900.00	162,813.66	59,250.00	-
600978	宜华木业	2015-06-18	重大事项	21.31	2016-01-21	20.10	31,989.00	542,700.34	681,685.59	-
601000	唐山港	2015-10-29	重大事项	8.25	2016-02-17	7.98	4,587.00	61,554.83	37,842.75	-
601678	滨化股份	2015-12-31	重大事项	8.02	2016-01-05	7.22	2,987.00	27,833.96	23,955.74	-
601717	郑煤机	2015-12-18	重大事项	7.52	-	-	4,400.00	49,633.83	33,088.00	-
000028	国药一致	2015-10-21	重大事项	66.15	-	-	600.00	45,281.90	39,690.00	-
000066	长城电脑	2015-06-18	重大事项	15.19	2016-03-10	19.39	18,668.00	344,761.07	283,566.92	-
000426	兴业矿业	2015-10-28	重大事项	7.06	2016-03-21	7.77	3,032.00	22,854.33	21,405.92	-
000748	长城信息	2015-06-18	重大事项	24.68	2016-03-10	31.39	18,400.00	578,424.81	454,112.00	-
000829	天音控股	2015-11-09	重大事项	12.22	-	-	3,692.00	69,331.33	45,116.24	-
000973	佛塑科技	2015-12-18	重大事项	13.00	2016-02-22	11.70	3,484.00	38,175.45	45,292.00	-
000982	中银绒业	2014-08-25	重大事项	4.64	2016-02-25	5.10	6,160.00	27,955.00	28,582.40	-

002011	盾安环境	2015-12-28	重大事项	16.72	2016-02-22	15.05	2,286.00	42,215.65	38,221.92	-
002018	华信国际	2015-06-15	重大事项	30.62	-	-	9,500.00	280,839.22	290,890.00	-
002048	宁波华翔	2015-11-19	重大事项	17.40	-	-	2,065.00	51,869.13	35,931.00	-
002049	同方国芯	2015-12-11	重大事项	60.15	2016-03-11	54.14	1,100.00	55,428.54	66,165.00	-
002143	印纪传媒	2015-12-09	重大事项	40.55	2016-01-05	36.50	1,000.00	35,345.84	40,550.00	-
002174	游族网络	2015-07-23	重大事项	89.53	2016-02-15	80.58	800.00	85,650.10	71,624.00	-
002219	恒康医疗	2015-07-08	重大事项	14.90	-	-	14,603.00	229,669.84	217,584.70	-
002242	九阳股份	2015-12-24	重大事项	22.68	2016-01-11	20.41	1,400.00	26,504.15	31,752.00	-
002340	格林美	2015-12-29	重大事项	15.20	2016-01-06	14.35	4,305.00	70,303.76	65,436.00	-
002371	七星电子	2015-10-08	重大事项	19.28	2016-01-11	21.21	1,000.00	40,065.37	19,280.00	-
002568	百润股份	2015-12-21	重大事项	42.69	2016-01-18	38.42	700.00	29,824.00	29,883.00	-
002678	珠江钢琴	2015-12-21	重大事项	17.21	2016-01-19	15.49	852.00	17,119.97	14,662.92	-
002698	博实股份	2015-12-28	重大事项	29.33	2016-01-05	26.40	890.00	31,381.68	26,103.70	-
300043	互动娱乐	2015-12-17	重大事项	15.80	-	-	2,300.00	45,043.32	36,340.00	-
300088	长信科技	2015-12-14	重大事项	14.03	2016-03-29	12.63	3,100.00	44,599.03	43,493.00	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购。

7.4.10 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。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	20,693,713.14	91.64
	其中：股票	20,693,713.14	91.64
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,598,959.88	7.08

7	其他各项资产	289,770.95	1.28
8	合计	22,582,443.97	100.00

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

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	344,685.88	1.58
B	采矿业	637,631.90	2.91
C	制造业	12,505,805.70	57.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	568,804.73	2.60
E	建筑业	503,512.68	2.30
F	批发和零售业	1,233,701.37	5.64
G	交通运输、仓储和邮政业	552,783.59	2.53
H	住宿和餐饮业	46,188.00	0.21
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,239,274.79	5.66
J	金融业	204,613.97	0.94
K	房地产业	1,295,100.25	5.92
L	租赁和商务服务业	296,045.30	1.35
M	科学研究和技术服务业	98,316.56	0.45
N	水利、环境和公共设施管理业	141,533.21	0.65
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	48,678.00	0.22
R	文化、体育和娱乐业	287,655.37	1.31

S	综合	267,254.59	1.22
	合计	20,271,585.89	92.65

8.2.2 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	422,127.25	1.93
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	422,127.25	1.93

注：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。

8.3 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

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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	600978	宜华木业	31,989	681,685.59	3.12
2	000748	长城信息	18,400	454,112.00	2.08
3	000066	长城电脑	18,668	283,566.92	1.30
4	002219	恒康医疗	14,603	217,584.70	0.99
5	002405	四维图新	2,559	99,289.20	0.45
6	002466	天齐锂业	700	98,525.00	0.45
7	600160	巨化股份	3,900	91,533.00	0.42
8	600816	安信信托	3,975	90,510.75	0.41
9	600201	金宇集团	2,400	88,728.00	0.41
10	600079	人福医药	3,900	86,814.00	0.40

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	002018	华信国际	9,500.00	290,890.00	1.33
2	000959	首钢股份	15,300.00	62,424.00	0.29
3	600110	中科英华	4,169.00	40,230.85	0.18
4	000982	中银绒业	6,160.00	28,582.40	0.13

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	1,151,338.80	6.51

5	600601	方正科技	1,124,532.74	6.36
6	600219	南山铝业	1,103,892.00	6.25
7	600635	大众公用	1,071,061.00	6.06
8	002183	怡亚通	1,044,430.00	5.91
9	300253	卫宁健康	1,038,025.24	5.87
10	600881	亚泰集团	1,012,011.00	5.73
11	002030	达安基因	1,005,386.00	5.69
12	600435	北方导航	990,111.00	5.60
13	600895	张江高科	986,583.85	5.58
14	600158	中体产业	978,602.23	5.54
15	600021	上海电力	963,911.76	5.45
16	600201	生物股份	946,706.90	5.36
17	600820	隧道股份	943,695.00	5.34
18	000012	南玻A	925,626.00	5.24
19	000998	隆平高科	900,283.98	5.09
20	601012	隆基股份	892,840.00	5.05
21	000748	长城信息	868,359.00	4.91
22	600169	太原重工	847,719.00	4.80
23	000540	中天城投	845,376.00	4.78
24	002022	科华生物	840,294.53	4.75
25	600446	金证股份	826,734.00	4.68
26	600026	中海发展	815,036.00	4.61
27	600978	宜华木业	814,292.00	4.61
28	000566	海南海药	812,224.00	4.60
29	000616	海航投资	807,513.00	4.57
30	600643	爱建集团	799,203.00	4.52
31	600811	东方集团	795,489.00	4.50
32	000997	新大陆	794,225.03	4.49
33	601519	大智慧	792,528.00	4.48
34	601608	中信重工	775,210.00	4.39
35	600122	宏图高科	774,352.00	4.38
36	600704	物产中大	770,573.60	4.36
37	600694	大商股份	765,259.00	4.33
38	600528	中铁二局	763,338.00	4.32
39	002266	浙富控股	759,264.09	4.30
40	000592	平潭发展	754,969.00	4.27
41	600584	长电科技	754,364.00	4.27
42	600198	大唐电信	753,529.00	4.26
43	600770	综艺股份	745,736.00	4.22
44	002004	华邦健康	744,512.00	4.21
45	600320	振华重工	736,547.00	4.17
46	300144	宋城演艺	728,651.80	4.12
47	002063	远光软件	720,535.80	4.08
48	001696	宗申动力	715,676.16	4.05

49	002424	贵州百灵	714,891.00	4.04
50	600755	厦门国贸	713,235.34	4.04
51	000656	金科股份	712,194.00	4.03
52	000712	锦龙股份	708,967.00	4.01
53	600525	长园集团	708,742.00	4.01
54	600240	华业资本	706,361.17	4.00
55	600655	豫园商城	702,357.00	3.97
56	002285	世联行	699,826.20	3.96
57	000661	长春高新	687,173.00	3.89
58	601718	际华集团	686,857.00	3.89
59	600594	益佰制药	686,148.00	3.88
60	600737	中粮屯河	685,291.00	3.88
61	000977	浪潮信息	684,965.00	3.88
62	600500	中化国际	683,566.00	3.87
63	000547	航天发展	682,311.00	3.86
64	000887	中鼎股份	681,584.00	3.86
65	600143	金发科技	681,028.84	3.85
66	000829	天音控股	678,384.06	3.84
67	000511	烯碳新材	677,635.78	3.83
68	000078	海王生物	676,945.00	3.83
69	600079	人福医药	676,816.00	3.83
70	600433	冠豪高新	676,678.00	3.83
71	002405	四维图新	675,103.00	3.82
72	600685	中船防务	661,616.00	3.74
73	002573	清新环境	660,745.00	3.74
74	600200	江苏吴中	660,477.00	3.74
75	300273	和佳股份	651,826.26	3.69
76	002223	鱼跃医疗	644,360.00	3.65
77	002276	万马股份	642,600.00	3.64
78	000758	中色股份	640,789.00	3.63
79	600611	大众交通	640,135.00	3.62
80	300033	同花顺	630,829.54	3.57
81	600125	铁龙物流	625,800.00	3.54
82	600312	平高电气	625,753.99	3.54
83	600536	中国软件	619,034.00	3.50
84	601872	招商轮船	617,999.40	3.50
85	002073	软控股份	615,742.00	3.48
86	000415	渤海租赁	610,968.00	3.46
87	601000	唐山港	610,177.00	3.45
88	600759	洲际油气	604,165.15	3.42
89	600138	中青旅	599,395.00	3.39
90	002250	联化科技	597,627.98	3.38
91	000939	凯迪生态	595,329.44	3.37
92	002340	格林美	595,297.00	3.37

93	600171	上海贝岭	594,123.00	3.36
94	600478	科力远	591,964.71	3.35
95	600376	首开股份	584,786.00	3.31
96	600675	中华企业	583,471.00	3.30
97	000681	视觉中国	578,765.00	3.27
98	002191	劲嘉股份	578,678.00	3.27
99	002013	中航机电	575,679.16	3.26
100	600380	健康元	572,132.00	3.24
101	002161	远望谷	570,064.00	3.23
102	000988	华工科技	566,777.04	3.21
103	600787	中储股份	562,909.00	3.18
104	600651	飞乐音响	562,703.00	3.18
105	600797	浙大网新	562,041.00	3.18
106	600816	安信信托	561,457.00	3.18
107	300244	迪安诊断	555,922.00	3.15
108	600673	东阳光科	555,082.00	3.14
109	002595	豪迈科技	550,335.00	3.11
110	000930	中粮生化	548,094.00	3.10
111	000816	智慧农业	546,853.00	3.09
112	000006	深振业 A	544,127.50	3.08
113	600517	置信电气	540,207.00	3.06
114	002219	恒康医疗	536,153.00	3.03
115	600064	南京高科	535,683.50	3.03
116	000732	泰禾集团	534,698.00	3.03
117	600498	烽火通信	534,033.00	3.02
118	600067	冠城大通	532,133.00	3.01
119	600499	科达洁能	530,334.70	3.00
120	600805	悦达投资	528,266.00	2.99
121	600664	哈药股份	526,130.24	2.98
122	000652	泰达股份	525,760.00	2.97
123	000777	中核科技	525,162.00	2.97
124	600112	天成控股	524,717.59	2.97
125	002092	中泰化学	523,238.00	2.96
126	600418	江淮汽车	522,581.79	2.96
127	600120	浙江东方	517,481.00	2.93
128	300291	华录百纳	516,197.50	2.92
129	600835	上海机电	515,499.00	2.92
130	300199	翰宇药业	512,703.00	2.90
131	600808	马钢股份	512,245.00	2.90
132	000671	阳光城	509,890.00	2.88
133	000066	长城电脑	505,616.00	2.86
134	002048	宁波华翔	504,012.00	2.85
135	002179	中航光电	502,873.00	2.85
136	600557	康缘药业	501,913.00	2.84

137	600161	天坛生物	501,660.50	2.84
138	002440	闰土股份	499,890.00	2.83
139	600058	五矿发展	497,925.00	2.82
140	000897	津滨发展	496,146.00	2.81
141	600880	博瑞传播	495,399.00	2.80
142	600266	北京城建	494,767.00	2.80
143	000528	柳 工	494,647.00	2.80
144	002018	华信国际	494,600.00	2.80
145	600270	外运发展	494,354.00	2.80
146	002665	首航节能	490,439.50	2.77
147	600654	中安消	490,311.00	2.77
148	600183	生益科技	488,167.00	2.76
149	600017	日照港	487,756.87	2.76
150	600511	国药股份	481,557.00	2.72
151	600180	瑞茂通	481,051.00	2.72
152	300147	香雪制药	480,888.60	2.72
153	002271	东方雨虹	480,741.00	2.72
154	600187	国中水务	480,647.00	2.72
155	601717	郑煤机	480,420.00	2.72
156	600545	新疆城建	479,714.00	2.71
157	300115	长盈精密	479,554.36	2.71
158	600325	华发股份	478,441.41	2.71
159	600220	江苏阳光	477,419.35	2.70
160	002311	海大集团	476,832.00	2.70
161	600410	华胜天成	474,115.00	2.68
162	603766	隆鑫通用	470,580.00	2.66
163	600458	时代新材	468,876.71	2.65
164	600176	中国巨石	468,523.00	2.65
165	600582	天地科技	468,494.00	2.65
166	300072	三聚环保	467,644.00	2.65
167	600175	美都能源	466,306.00	2.64
168	600490	鹏欣资源	465,031.00	2.63
169	000031	中粮地产	464,575.00	2.63
170	000587	金叶珠宝	463,444.00	2.62
171	002273	水晶光电	463,347.22	2.62
172	000667	美好集团	460,940.00	2.61
173	600422	昆药集团	460,475.00	2.61
174	600426	华鲁恒升	457,023.00	2.59
175	600522	中天科技	455,489.00	2.58
176	600039	四川路桥	453,678.00	2.57
177	000088	盐 田 港	453,225.24	2.56
178	000090	天健集团	453,224.00	2.56
179	002444	巨星科技	452,584.00	2.56
180	600284	浦东建设	451,538.00	2.55

181	002489	浙江永强	450,257.00	2.55
182	000718	苏宁环球	449,968.00	2.55
183	002221	东华能源	449,855.00	2.55
184	600289	亿阳信通	449,053.79	2.54
185	300274	阳光电源	446,233.00	2.52
186	300202	聚龙股份	444,945.00	2.52
187	002168	深圳惠程	444,810.57	2.52
188	600699	均胜电子	444,074.00	2.51
189	600436	片仔癀	443,464.50	2.51
190	600428	中远航运	443,252.00	2.51
191	000680	山推股份	441,699.00	2.50
192	600851	海欣股份	440,801.00	2.49
193	002508	老板电器	439,603.50	2.49
194	300134	大富科技	439,315.50	2.49
195	600216	浙江医药	436,575.00	2.47
196	600409	三友化工	436,201.00	2.47
197	600580	卧龙电气	435,548.00	2.46
198	600062	华润双鹤	434,549.00	2.46
199	600056	中国医药	434,022.00	2.46
200	000685	中山公用	433,952.00	2.46
201	000690	宝新能源	432,559.00	2.45
202	600160	巨化股份	431,834.00	2.44
203	000099	中信海直	431,361.00	2.44
204	002466	天齐锂业	431,120.53	2.44
205	000541	佛山照明	430,262.65	2.43
206	000488	晨鸣纸业	430,136.59	2.43
207	000975	银泰资源	429,735.00	2.43
208	002390	信邦制药	429,093.00	2.43
209	002011	盾安环境	427,160.60	2.42
210	601311	骆驼股份	427,016.00	2.42
211	002237	恒邦股份	425,051.00	2.40
212	002428	云南锗业	423,482.00	2.40
213	000848	承德露露	423,390.17	2.40
214	000572	海马汽车	423,319.00	2.39
215	002155	湖南黄金	422,041.00	2.39
216	000735	罗牛山	421,420.20	2.38
217	600006	东风汽车	420,980.00	2.38
218	600885	宏发股份	419,586.00	2.37
219	000028	国药一致	418,776.68	2.37
220	002195	二三四五	417,498.00	2.36
221	600260	凯乐科技	414,762.00	2.35
222	600317	营口港	414,656.00	2.35
223	002690	美亚光电	412,662.02	2.33
224	002005	德豪润达	410,611.15	2.32

225	600765	中航重机	408,600.80	2.31
226	300039	上海凯宝	405,847.01	2.30
227	600110	中科英华	402,478.00	2.28
228	600757	长江传媒	400,614.99	2.27
229	002029	七匹狼	400,527.00	2.27
230	600261	阳光照明	395,641.50	2.24
231	002396	星网锐捷	394,419.00	2.23
232	000050	深天马 A	394,296.00	2.23
233	000422	湖北宜化	392,842.00	2.22
234	601002	晋亿实业	392,449.00	2.22
235	601880	大连港	391,473.00	2.21
236	600884	杉杉股份	389,353.00	2.20
237	002064	华峰氨纶	387,192.00	2.19
238	002093	国脉科技	387,161.00	2.19
239	600151	航天机电	386,778.00	2.19
240	600481	双良节能	385,861.00	2.18
241	600736	苏州高新	384,784.00	2.18
242	000830	鲁西化工	383,589.90	2.17
243	000973	佛塑科技	383,197.00	2.17
244	600859	王府井	382,959.60	2.17
245	601666	平煤股份	382,904.00	2.17
246	002358	森源电气	380,986.00	2.16
247	600993	马应龙	380,953.00	2.16
248	000933	神火股份	377,775.00	2.14
249	600894	广日股份	377,742.00	2.14
250	600496	精工钢构	375,038.00	2.12
251	600267	海正药业	373,743.92	2.11
252	000762	西藏矿业	371,097.00	2.10
253	002049	同方国芯	370,792.00	2.10
254	600812	华北制药	368,836.74	2.09
255	300267	尔康制药	367,507.00	2.08
256	000513	丽珠集团	367,232.00	2.08
257	601001	大同煤业	365,919.00	2.07
258	002277	友阿股份	365,675.60	2.07
259	002663	普邦园林	364,655.00	2.06
260	601010	文峰股份	363,366.00	2.06
261	000062	深圳华强	362,533.00	2.05
262	600879	航天电子	361,995.00	2.05
263	601369	陕鼓动力	360,386.88	2.04
264	002482	广田股份	360,090.00	2.04
265	600487	亨通光电	359,750.00	2.04
266	002642	荣之联	359,404.00	2.03
267	600300	维维股份	359,138.00	2.03
268	002028	思源电气	357,727.45	2.02

269	600004	白云机场	357,103.00	2.02
270	600521	华海药业	356,591.00	2.02
271	002463	沪电股份	355,822.68	2.01
272	000877	天山股份	354,562.00	2.01

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。

8.4.2 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	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	002183	怡亚通	1,153,304.48	6.52
6	600895	张江高科	1,100,523.54	6.23
7	600037	歌华有线	1,094,022.45	6.19
8	002030	达安基因	1,038,487.40	5.88
9	600635	大众公用	995,631.00	5.63
10	600601	方正科技	972,006.00	5.50
11	600201	生物股份	964,218.34	5.46
12	600881	亚泰集团	943,678.00	5.34
13	600219	南山铝业	941,218.00	5.33
14	600435	北方导航	922,983.00	5.22
15	300253	卫宁健康	922,568.00	5.22
16	600158	中体产业	911,580.00	5.16
17	601718	际华集团	896,061.90	5.07
18	601519	大智慧	894,839.68	5.06
19	000540	中天城投	886,679.40	5.02
20	000977	浪潮信息	861,798.34	4.88
21	000998	隆平高科	849,448.00	4.81
22	600021	上海电力	839,436.06	4.75
23	000997	新大陆	838,489.00	4.74
24	600737	中粮屯河	830,820.12	4.70
25	000012	南玻 A	825,190.42	4.67
26	300144	宋城演艺	822,354.20	4.65
27	600643	爱建集团	813,023.00	4.60
28	000712	锦龙股份	806,209.76	4.56
29	601872	招商轮船	787,837.00	4.46
30	600026	中海发展	787,422.00	4.45

31	002022	科华生物	781,394.24	4.42
32	601012	隆基股份	765,606.00	4.33
33	000566	海南海药	747,865.00	4.23
34	600694	大商股份	741,016.39	4.19
35	600122	宏图高科	737,610.00	4.17
36	600811	东方集团	730,699.00	4.13
37	600169	太原重工	723,711.00	4.09
38	600320	振华重工	719,748.00	4.07
39	002266	浙富控股	715,898.33	4.05
40	002424	贵州百灵	715,305.00	4.05
41	600200	江苏吴中	712,512.00	4.03
42	000661	长春高新	693,875.00	3.93
43	600770	综艺股份	678,221.00	3.84
44	000616	海航投资	673,533.66	3.81
45	002004	华邦健康	671,418.00	3.80
46	600240	华业资本	670,560.20	3.79
47	600490	鹏欣资源	669,519.15	3.79
48	600528	中铁二局	666,691.00	3.77
49	002276	万马股份	665,061.48	3.76
50	600685	中船防务	655,395.50	3.71
51	600675	中华企业	652,542.76	3.69
52	600525	长园集团	651,576.53	3.69
53	000511	烯碳新材	648,664.00	3.67
54	600266	北京城建	646,267.00	3.66
55	002223	鱼跃医疗	641,291.07	3.63
56	600584	长电科技	639,071.00	3.62
57	600704	物产中大	635,886.00	3.60
58	000887	中鼎股份	634,047.00	3.59
59	300273	和佳股份	630,726.00	3.57
60	002063	远光软件	628,488.53	3.56
61	600755	厦门国贸	626,808.00	3.55
62	002285	世联行	625,575.00	3.54
63	000656	金科股份	621,426.00	3.52
64	600125	铁龙物流	616,991.00	3.49
65	600198	大唐电信	614,853.00	3.48
66	600651	飞乐音响	612,203.00	3.46
67	600611	大众交通	606,733.00	3.43
68	600312	平高电气	606,622.00	3.43
69	600816	安信信托	605,042.00	3.42
70	000078	海王生物	595,831.66	3.37
71	002191	劲嘉股份	595,645.00	3.37
72	600446	金证股份	595,536.00	3.37
73	600433	冠豪高新	593,169.00	3.36
74	002073	软控股份	592,029.00	3.35

75	002573	清新环境	584,809.00	3.31
76	600654	中安消	579,223.00	3.28
77	002250	联化科技	578,954.77	3.28
78	600582	天地科技	578,874.00	3.28
79	600171	上海贝岭	570,013.79	3.22
80	002161	远望谷	570,004.00	3.22
81	002405	四维图新	568,320.78	3.22
82	000930	中粮生化	565,537.00	3.20
83	600478	科力远	564,727.00	3.20
84	002690	美亚光电	562,660.42	3.18
85	000758	中色股份	561,976.00	3.18
86	600317	营口港	559,304.00	3.16
87	000415	渤海租赁	557,779.00	3.16
88	601608	中信重工	556,096.30	3.15
89	600787	中储股份	555,793.00	3.14
90	600376	首开股份	554,008.00	3.13
91	000006	深振业 A	548,564.68	3.10
92	001696	宗申动力	546,139.00	3.09
93	000829	天音控股	546,022.00	3.09
94	000031	中粮地产	545,526.80	3.09
95	002340	格林美	544,804.88	3.08
96	600098	广州发展	541,745.00	3.07
97	002179	中航光电	540,201.00	3.06
98	600138	中青旅	540,171.82	3.06
99	000939	凯迪生态	538,986.00	3.05
100	000988	华工科技	535,729.02	3.03
101	002595	豪迈科技	529,407.96	3.00
102	600759	洲际油气	526,888.00	2.98
103	600175	美都能源	525,161.00	2.97
104	600064	南京高科	522,409.00	2.96
105	600418	江淮汽车	522,408.00	2.96
106	601000	唐山港	521,852.00	2.95
107	600517	置信电气	518,136.14	2.93
108	600805	悦达投资	516,616.00	2.92
109	600673	东阳光科	507,766.00	2.87
110	600835	上海机电	503,632.00	2.85
111	600017	日照港	502,294.00	2.84
112	600499	科达洁能	502,165.00	2.84
113	002489	浙江永强	501,593.00	2.84
114	600511	国药股份	497,418.19	2.81
115	300115	长盈精密	497,106.11	2.81
116	600270	外运发展	495,042.00	2.80
117	002092	中泰化学	490,633.00	2.78
118	600458	时代新材	489,219.30	2.77

119	002013	中航机电	488,418.00	2.76
120	600325	华发股份	488,101.62	2.76
121	600426	华鲁恒升	487,979.00	2.76
122	600536	中国软件	487,592.00	2.76
123	002665	首航节能	486,468.00	2.75
124	600557	康缘药业	486,240.00	2.75
125	000652	泰达股份	484,409.00	2.74
126	603766	隆鑫通用	480,305.32	2.72
127	600422	昆药集团	479,040.95	2.71
128	000050	深天马 A	477,379.02	2.70
129	600428	中远航运	474,671.00	2.69
130	600160	巨化股份	474,664.00	2.69
131	600220	江苏阳光	470,503.00	2.66
132	000732	泰禾集团	470,090.46	2.66
133	600067	冠城大通	469,632.00	2.66
134	600110	中科英华	469,393.00	2.66
135	600410	华胜天成	468,071.00	2.65
136	600380	健康元	466,369.00	2.64
137	000671	阳光城	465,744.00	2.64
138	002271	东方雨虹	464,190.00	2.63
139	300147	香雪制药	463,652.00	2.62
140	600120	浙江东方	460,051.73	2.60
141	000718	苏宁环球	458,227.00	2.59
142	000681	视觉中国	457,750.03	2.59
143	000897	津滨发展	457,076.00	2.59
144	000667	美好集团	453,770.00	2.57
145	002508	老板电器	451,054.00	2.55
146	002311	海大集团	450,072.89	2.55
147	000816	智慧农业	448,695.73	2.54
148	600161	天坛生物	447,962.00	2.53
149	600183	生益科技	446,278.00	2.52
150	000777	中核科技	445,723.00	2.52
151	000528	柳工	445,222.00	2.52
152	601717	郑煤机	438,518.00	2.48
153	600079	人福医药	438,073.00	2.48
154	000090	天健集团	436,837.02	2.47
155	002440	闰土股份	436,624.00	2.47
156	600176	中国巨石	436,441.00	2.47
157	600978	宜华木业	436,436.00	2.47
158	600006	东风汽车	434,679.00	2.46
159	600580	卧龙电气	434,497.00	2.46
160	000748	长城信息	433,876.00	2.45
161	600409	三友化工	433,452.00	2.45
162	600432	吉恩镍业	432,449.00	2.45

163	002048	宁波华翔	432,297.71	2.45
164	600284	浦东建设	430,518.00	2.44
165	000088	盐田港	430,152.28	2.43
166	300134	大富科技	429,688.00	2.43
167	600112	天成控股	425,101.92	2.41
168	300033	同花顺	423,200.96	2.39
169	002273	水晶光电	422,788.00	2.39
170	601311	骆驼股份	422,544.00	2.39
171	000587	金叶珠宝	422,031.88	2.39
172	600187	国中水务	421,574.00	2.39
173	600545	新疆城建	421,455.00	2.38
174	600655	豫园商城	420,243.00	2.38
175	000685	中山公用	419,833.00	2.38
176	600594	益佰制药	419,420.00	2.37
177	002358	森源电气	417,095.00	2.36
178	000735	罗牛山	417,070.06	2.36
179	600180	瑞茂通	415,479.00	2.35
180	600062	华润双鹤	414,293.00	2.34
181	600699	均胜电子	414,040.00	2.34
182	600797	浙大网新	408,924.00	2.31
183	000422	湖北宜化	407,737.00	2.31
184	000848	承德露露	407,626.00	2.31
185	600261	阳光照明	406,994.99	2.30
186	600056	中国医药	405,907.00	2.30
187	300202	聚龙股份	405,828.00	2.30
188	000028	国药一致	403,463.00	2.28
189	000541	佛山照明	402,980.40	2.28
190	000592	平潭发展	401,674.00	2.27
191	002428	云南锗业	401,009.00	2.27
192	600216	浙江医药	399,241.00	2.26
193	002505	大康牧业	398,101.00	2.25
194	000099	中信海直	397,256.44	2.25
195	600289	亿阳信通	395,862.92	2.24
196	000680	山推股份	395,617.00	2.24
197	600521	华海药业	394,469.00	2.23
198	600885	宏发股份	394,463.00	2.23
199	002123	荣信股份	391,860.66	2.22
200	000488	晨鸣纸业	390,821.00	2.21
201	002390	信邦制药	390,808.18	2.21
202	600481	双良节能	388,432.00	2.20
203	002299	圣农发展	387,618.00	2.19
204	002052	同洲电子	387,419.00	2.19
205	000973	佛塑科技	386,036.79	2.18
206	600143	金发科技	385,341.65	2.18

207	300039	上海凯宝	384,778.00	2.18
208	000830	鲁西化工	384,245.00	2.17
209	300072	三聚环保	383,698.00	2.17
210	000572	海马汽车	380,712.00	2.15
211	300244	迪安诊断	379,312.00	2.15
212	002219	恒康医疗	378,523.00	2.14
213	002005	德豪润达	377,886.00	2.14
214	000933	神火股份	377,226.99	2.13
215	600812	华北制药	375,684.00	2.13
216	000975	银泰资源	373,991.00	2.12
217	002029	七匹狼	373,540.00	2.11
218	002155	湖南黄金	373,508.98	2.11
219	600884	杉杉股份	372,044.54	2.10
220	600736	苏州高新	371,244.00	2.10
221	002444	巨星科技	370,349.00	2.10
222	600260	凯乐科技	369,472.00	2.09
223	000555	神州信息	369,436.00	2.09
224	002237	恒邦股份	368,932.00	2.09
225	002168	深圳惠程	368,350.00	2.08
226	000062	深圳华强	367,593.00	2.08
227	601666	平煤股份	367,369.00	2.08
228	600851	海欣股份	362,976.00	2.05
229	600757	长江传媒	360,155.00	2.04
230	002011	盾安环境	360,038.00	2.04
231	000513	丽珠集团	359,763.60	2.04
232	600522	中天科技	359,586.90	2.03
233	002221	东华能源	358,862.00	2.03
234	600487	亨通光电	356,175.00	2.02
235	600859	王府井	355,579.00	2.01
236	600039	四川路桥	354,842.00	2.01
237	600300	维维股份	354,478.00	2.01
238	601880	大连港	354,280.00	2.00
239	600993	马应龙	353,747.00	2.00
240	600500	中化国际	353,424.68	2.00

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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	220,044,789.40
卖出股票的收入（成交）总额	204,757,126.51

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货的持仓。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货持仓。

8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

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

8.12.3 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	86,205.86
2	应收证券清算款	198,990.28
3	应收股利	-
4	应收利息	3,031.54
5	应收申购款	1,543.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	289,770.95

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**8.12.5.1 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	600978	宜华木业	681,685.59	3.12	重大事项
2	000066	长城电脑	283,566.92	1.30	重大事项
3	000748	长城信息	454,112.00	2.08	重大事项
4	002219	恒康医疗	217,584.70	0.99	重大事项

8.12.5.2 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	002018	华信国际	290,890.00	1.33	重大事项
2	000982	中银绒业	28,582.40	0.13	重大事项

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
金鹰 500A	356	7,375.68	1,651,249.00	62.89%	974,494.00	37.11%
金鹰 500B	787	3,336.40	9,032.00	0.34%	2,616,711.00	99.66%
金鹰 500	2,010	5,772.44	28,760.00	0.25%	11,573,841.68	99.75%
合计	3,153	5,345.41	1,689,041.00	10.02%	15,165,046.68	89.98%

9.2 期末上市基金前十名持有人

金鹰 500A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	上海明法投资管理有限公司—明法 CTA 一号基金	1,113,453.00	42.41%
2	上海明法投资管理有限公司—明法多策略对冲 1 号基金	424,069.00	16.15%
3	杨长志	204,100.00	7.77%
4	北京千石创富—招商银行—千石资本—华宝证券明法套利 1 号资	94,562.00	3.60%
5	陈杰	86,754.00	3.30%
6	毛杰	52,318.00	1.99%
7	储彩娥	44,100.00	1.68%
8	贺敬	43,377.00	1.65%
9	陈运珍	42,800.00	1.63%
10	徐进	42,526.00	1.62%

注：金鹰中证 500 指数分级 A

金鹰500B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	邹璞如	152,000.00	5.79%
2	王鸿云	102,459.00	3.90%
3	王清	80,074.00	3.05%
4	孙爱华	59,934.00	2.28%
5	邵兵	58,754.00	2.24%
6	张荣法	57,981.00	2.21%
7	毛杰	52,496.00	2.00%
8	练鹏	51,574.00	1.96%
9	施双林	46,766.00	1.78%
10	黄文威	45,286.00	1.72%

注：金鹰中证 500 指数分级 B

金鹰500

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	杨志明	143,860.00	10.12%
2	岳贤利	138,349.00	9.73%
3	贺敬	109,859.00	7.73%
4	刘金云	73,239.00	5.15%
5	谢晓虹	57,480.00	4.04%
6	杨远明	29,296.00	2.06%
7	张润强	29,296.00	2.06%
8	平安证券有限责任公司	27,318.00	1.92%
9	刘振祥	27,100.00	1.91%
10	李冬华	25,452.00	1.79%

注：金鹰中证 500 指数基金场内份额

9.3 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	29.00	0.00%
	金鹰 500B	-	-
	金鹰 500	1,398.00	0.01%
	合计	1,427.00	0.01%

9.4 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

注：无

9.5 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金非发起式基金，本公司未持有基金份额。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	金鹰 500A	金鹰 500B	金鹰 500
基金合同生效日（2012 年 6 月 5 日）基金份额总额	26,209,859.00	26,209,859.00	341,051,468.50
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	-	-	208,435,162.84
减：本报告期基金总赎回份额	-	-	231,218,687.14
本报告期基金拆分变动份额	441,096.00	441,096.00	25,440,900.98
本报告期期末基金份额总额	2,625,743.00	2,625,743.00	11,602,601.68

根据本基金的基金合同、招募说明书及深圳证券交易所（以下简称“深交所”）和中国证券登记结算有限责任公司的规定：

1、本基金以 2015 年 1 月 5 日为份额折算基准日，对金鹰 500 场外、场内份额以及金鹰 500A 份额实施定期份额折算，金鹰 500B 份额不进行折算；本基金分别以 2015 年 5 月 13 日、2015 年 9 月 16 日为份折算基准日，对金鹰 500 场外、场内份额以及金鹰 500A 份额、金鹰 500B 份额实施上拆、下拆折算。

2、本基金三级份额之间转换拆分产生份额变化。

综上，本基金本报告期内，金鹰 500A 和金鹰 500B 分别增加份额 441,096 份，金鹰 500 增加份额 25,440,900.98 份。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、报告期内，本基金管理人的董事长由刘东先生变更为凌富华先生，相关事项已于 2015 年 1 月 10 日进行了信息披露。

2、报告期内，本基金托管人交通银行股份有限公司(以下简称“本行”)因工作需要，刘树军先生不再担任本行资产托管业务中心总裁，任命袁庆伟女士为本行资产托管业务中心总裁。袁庆伟女士的基金行业高级管理人员任职资格已在中国证券投资基金业协会备案。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金报告期内无涉及基金管理人、基金财产的诉讼。

本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金报告期内没有改变基金投资策略。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金审计的会计师事务所为中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）。

本报告期内实际应支付会计师事务所的审计费为 25000 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金报告期内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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华林证券	1	8,924,719.18	2.10%	6,348.36	1.67%	-
广州证券	1	83,380,137.47	19.63%	73,860.37	19.48%	-
国海证券	1	58,224,380.25	13.71%	51,912.53	13.69%	-

国泰君安	1	57,133,464.58	13.45%	50,800.25	13.40%	-
银河证券	2	80,486,522.71	18.95%	71,420.72	18.95%	-
海通证券	2	434,818.00	0.10%	396.26	0.10%	-
华创证券	1	373,842.00	0.09%	340.70	0.09%	-
东兴证券	1	205,099.00	0.05%	186.97	0.05%	-
安信证券	2	2,001,383.62	0.47%	1,823.98	0.48%	-
爱建证券	1	133,610,248.30	31.45%	122,133.86	32.21%	-

注：注：本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单位作为本基金的专用交易单位。

本基金专用交易单位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析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。

§12 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期，本基金原审计机构中审亚太会计师事务所（特殊普通合伙）广东分所已与众环海华会计师事务所（特殊普通合伙）合并为中审众环会计师事务所（特殊普通合伙），经公司第五届董事会第 20 次会议决议通过，旗下相关基金的审计机构由“中审亚太会计师事务所（特殊普通合伙）”相应变更为中审众环会计师事务所（特殊普通合伙），此项变更已于 2015 年 12 月 31 日在指定媒体公告，并按规定向证监会备案。

金鹰基金管理有限公司

二〇一六年三月三十日