

金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资

基金

2011 年半年度报告

2011 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：2011 年 8 月 25 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录.....	1
§ 2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
§ 4 管理人报告.....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
§ 5 托管人报告.....	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	12
§ 6 半年度财务报表（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15

§ 7 投资组合报告.....	28
7.1 期末基金资产组合情况.....	28
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	29
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	29
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	30
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	33
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	34
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资 投资明细.....	34
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	34
7.9 投资组合报告附注.....	34
§ 8 基金份额持有人信息.....	34
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	34
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	35
§ 9 开放式基金份额变动.....	35
§ 10 重大事件揭示.....	35
10.1 基金份额持有人大会决议.....	35
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 ..	35
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	35
10.4 基金投资策略的改变.....	35
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	35
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.....	35
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	35
10.8 其他重大事件.....	37
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	39
§ 12 备查文件目录.....	40
12.1 备查文件目录.....	40
12.2 存放地点.....	40

12.3 查阅方式..... 40

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	金鹰红利价值混合
基金主代码	210002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 12 月 4 日
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	128,830,126.30 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对分红能力良好且长期投资价值突出的优质股票投资,为基金资产获取稳定的当期收益和长期增值。
投资策略	本基金采取积极主动式投资管理,通过积极的资产配置策略,深入研究、调研基础上的主动性证券选择和市场时机选择,在合理控制投资风险的前提下,最大限度地获取投资收益。本基金主要投资于分红能力良好且长期价值突出的优质企业,股票资产占基金资产净值比例为 30%—80%;现金、债券资产、其他资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产净值的比例为 20%—70%,其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%;权证投资占基金资产净值的比例不超过 3%。
业绩比较基准	富时中国 A 股红利 150 指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。
风险收益特征	本基金风险收益特征从长期来看,其风险与预期收益高于债券型基金,低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	金鹰基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	苏文锋
	联系电话	020-83282627
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn
客户服务电话	020-83936180 4006135888	95559
传真	020-83282856	021-62701216
注册地址	广东省珠海市吉大九洲大道东段商业银行大厦 7 楼	上海市浦东新区银城中路 188 号
办公地址	广州市天河区体育西路 189 号城建大厦 22-23 层	上海市浦东新区银城中路 188 号
邮政编码	510620	200120
法定代表人	刘东	胡怀邦

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网	http://www.gefund.com.cn

址	
基金半年度报告备置地点	广州市天河区体育西路 189 号城建大厦 22-23 层

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-13,158,761.31
本期利润	-16,829,959.27
加权平均基金份额本期利润	-0.1280
本期加权平均净值利润率（%）	-11.25
本期基金份额净值增长率（%）	-11.14
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2011 年 6 月 30 日）
期末可供分配利润	8,439,413.29
期末可供分配基金份额利润	0.0655
期末基金资产净值	137,269,539.59
期末基金份额净值	1.0655
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2011 年 6 月 30 日）
基金份额累计净值增长率（%）	43.92

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

3.2 基金净值表现

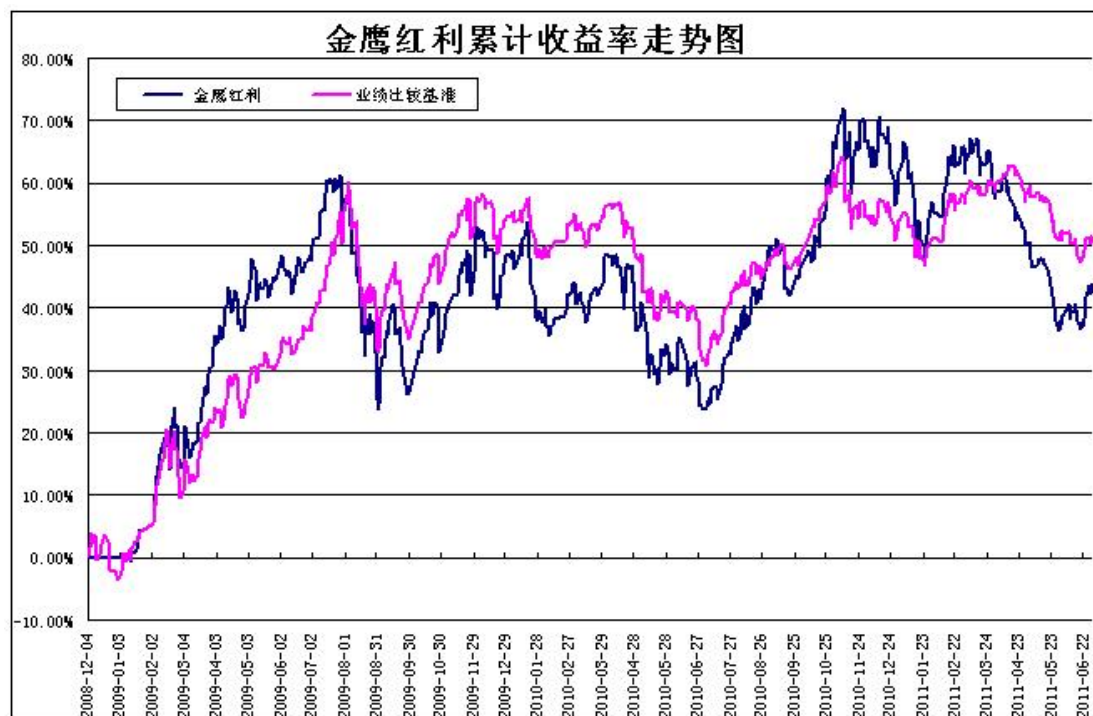
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率① (%)	份额净值增长率标准差② (%)	业绩比较基准收益率③ (%)	业绩比较基准收益率标准差④ (%)	①—③ (%)	②—④ (%)
过去一个月	4.42	0.98	-0.44	0.69	4.86	0.29
过去三个月	-8.65	0.89	-4.50	0.65	-4.15	0.24
过去六个	-11.14	1.20	-1.66	0.74	-9.48	0.46

月						
过去一年	15.82	1.34	14.49	0.83	1.33	0.51
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	43.92	1.47	51.48	1.12	-7.56	0.35

注：本基金成立不足 3 年。

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



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

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

有限公司、广东美的电器股份有限公司和东亚联丰投资管理有限公司，分别持有 49%、20%、20% 和 11% 的股份。

公司设立了投资决策委员会、风险控制委员会、资产估值委员会等专业委员会。投资决策委员会负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。风险控制委员会负责全面评估公司的经营过程中的各项风险，并提出防范措施。资产估值委员会负责依照基金合同和基金估值制度的规定，确定基金资产估值的原则、方法、程序及其他相关的估值事宜。

公司目前下设十二个部门，分别是：投资管理部、研究发展部、集中交易部、金融工程部、产品研发部、固定收益投资部、市场拓展部、机构客户部、专户投资部、运作保障部、监察稽核部、综合管理部。投资管理部负责根据投资决策委员会制定的投资决策进行基金投资；研究发展部负责宏观经济、行业、上市公司研究和投资策略研究；集中交易部负责完成基金经理投资指令；金融工程部负责金融工程研究、数量分析工作；产品研发部负责基金新产品、新业务的研究和设计工作；固定收益投资部负责固定收益证券以及债券、货币市场的研究和投资管理工作；市场拓展部负责市场营销策划、基金销售与渠道管理、客户服务等业务；机构客户部负责机构客户的开发、维护与管理；运作保障部负责公司信息系统的日常运行与维护，跟踪研究新技术，进行相应的技术系统规划与开发、基金会计核算、估值、开放式基金注册、登记和清算等业务；专户投资部负责特定客户资产的投资和管理；监察稽核部负责对公司和基金运作以及公司员工遵守国家相关法律、法规和公司内部规章制度等情况进行监督和检查；综合管理部负责公司企业文化建设、文字档案、公司财务、后勤服务、人力资源管理、薪酬制度、人员培训、人事档案等综合事务管理。

截至 2011 年 6 月 30 日，公司共管理金鹰成份股优选证券投资基金、金鹰中小盘精选证券投资基金、金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金、金鹰行业优势股票型证券投资基金、金鹰稳健成长股票型证券投资基金、金鹰主题优势股票型证券投资基金、金鹰保本混合型证券投资基金和金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金八只开放式基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的 基金经理 (助理) 期	证券 从业 年限	说明

		限			
		任职日期	离任日期		
蔡飞鸣	投资决策委员会委员、基金经理	2009年7月14日	2011年6月29日	6年	蔡飞鸣先生，国际金融硕士、管理学硕士，证券从业经历五年。曾任职于广州越秀集团有限公司、香港越秀财务公司资本经营部，香港越秀证券有限公司。2008年5月加入金鹰基金管理有限公司，先后担任研究员、交易主管、金鹰中小盘精选基金基金经理助理等职，现任投资决策委员会委员、本基金基金经理，并兼任金鹰稳健成长股票型证券投资基金基金经理。
朱丹	金鹰中小盘精选证券投资基金基金经理、金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2011年6月11日	-	5年	朱丹女士，金融学硕士，曾任职于深圳晨星咨询公司，2007年5月加入金鹰基金管理有限公司，先后担任行业研究员、研究组长、基金经理助理等职，现任本基金基金经理、金鹰中小盘精选证券投资基金及金鹰中证技术领先指数增强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颁布的《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定；3、蔡飞鸣先生已于2011年6月29日离职，自离职之日起，本基金由另一基金经理朱丹女士单独管理。

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并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，对在同一个交

易系统中交易的组合，启用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。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金本报告期无与其他投资风格相似的投资组合。

4.3.3 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。

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

2011 年上半年，市场处于震荡整理阶段。一季度小幅上涨后，二季度由于 CPI 上涨持续超出市场预期，央行多次采用从紧的货币政策，整个市场出现系统性下跌，其中预期偏高而流动性较差的创业板和中小板股票下跌明显。最为严重是 5 月下旬，市场恐慌情绪蔓延。部分结构化产品的强制平仓行为，使得市场的最后一波下跌威力巨大。略微幸运的是，二季度的最后一周，在建党 90 周年的前夕，市场迎来了期盼已久的全面反弹。上半年，上证指数下跌 1.64%，中小板指数下跌 12.68%，创业板指下跌 25.64%。上半年，我们继续偏好代表新兴产业发展方向、成长性好、业绩季环比增长开始确立的个股，二季度这类股票补跌非常明显。但通过对基本面、政策面、资金面、估值面等多方面因素的分析，我们认为市场下跌空间有限，市场进入寻底阶段，本基金上半年保持相对稳定的股票仓位，同时对持仓品种进行了调整，二季度末明显降低了机械行业的配置，增加了部分跌幅较大的周期性股票的配置，继续持有本公司长期看好的品种。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值为 1.0655 元，本报告期份额净值增长率为-11.14%，同期业绩比较基准增长率为-1.66%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经历了一季度微涨二季度系统性下跌，我们认为市场今年最艰难的时刻基本已经过去。通胀高点应该会在 3 季度内出现，而货币政策维持现状的可能性较大，应该不太会进一步持续性收紧。国内市场的坏消息基本已经反映，好消息值得期待。今年下半年，如果外围市场不发生剧烈变化，我们认为应该不会再有系统性的下跌了。而第一波全面系统性上涨也就是市场的报复性反弹完成后，市场应该进入震荡区间，相对平稳，等待基本面的改变，但三季度市场可能也缺乏大幅向上的推动因素，四季度基本面能否明显好转有待观察。由于猪肉的影响，3 季度

CPI 即使见顶了也难以明显回落，货币政策不再紧缩了也难以明显放松，国外经济复苏缓慢，我们经济转型还未见明显突破，整个市场估值上移或者业绩上调的概率都不明显。如果美国情况急剧变化，中国股市又会增加一个额外的变量，我们需要一直谨慎观察美国的经济情况。从大的方向来看，美国的 QE3 推出与否，或何时推出，对中国的经济、政策诸方面有较大的不确定性影响，对 A 股市场的影响可能更为复杂。下半年个股的研究更为重要，我们将不纠缠于对市场的走势判断，而要发扬金鹰投研团队自下而上挖掘优势个股的优势，对未来将可能成功转型、加速成长或迎来业绩向上拐点的公司进行重点投资。我们将会控制风险的前提下，采取主动的投资策略，不断从市场中寻找可能存在的超额收益，力争为基金持有人获得更好的收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

为确保公司估值程序的正常进行，本公司成立了资产估值委员会。资产估值委员会由公司总经理、分管副总经理或总经理助理、研究发展部总监、运作保障部总监、投资管理部总监、基金经理、基金会计和相关人员组成。基金经理可以发表相关意见和建议，如估值委员会表决时，其仅有一票表决权，遵从少数服从多数的原则。

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

本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金未签约与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2011 年上半年度，基金托管人在金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2011 年上半年度，金鹰基金管理有限公司在金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配。

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

2011 年上半年度，由金鹰基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务报表（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 (2011 年 6 月 30 日)	上年度末 (2010 年 12 月 31 日)
资 产：		
银行存款	4,980,996.40	10,408,745.21
结算备付金	11,045,767.74	22,489,723.86
存出保证金	1,250,000.00	1,250,000.00
交易性金融资产	96,418,260.70	122,317,680.98
其中：股票投资	96,418,260.70	122,317,680.98
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	25,955,840.56	3,964,494.19
应收利息	19,972.71	13,301.15

应收股利	-	-
应收申购款	81,187.44	240,650.51
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	139,752,025.55	160,684,595.90
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	(2011年6月30日)	(2010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	681,585.79	3,651,929.15
应付赎回款	86,929.08	460,110.93
应付管理人报酬	163,998.55	200,836.67
应付托管费	27,333.13	33,472.77
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	526,051.30	830,581.05
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	996,588.11	877,459.89
负债合计	2,482,485.96	6,054,390.46
所有者权益:		
实收基金	128,830,126.30	128,960,277.40
未分配利润	8,439,413.29	25,669,928.04
所有者权益合计	137,269,539.59	154,630,205.44
负债和所有者权益总计	139,752,025.55	160,684,595.90

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0655 元，基金份额总额 128,830,126.30 份。

6.2 利润表

会计主体：金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：（2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日）

单位：人民币元

项 目	本期 (2011年1月1日至2011 年6月30日)	上年度可比期间 (2010年1月1日至2010 年6月30日)
一、收入	-13,443,357.56	-26,627,596.07
1. 利息收入	404,483.59	290,161.00
其中：存款利息收入	197,418.95	290,161.00
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	207,064.64	-
其他利息收入	-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）	-10,230,753.88	-8,154,308.10
其中：股票投资收益	-10,542,552.80	-8,423,293.58
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	311,798.92	268,985.48
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-3,671,197.96	-18,825,286.96
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	54,110.69	61,837.99
减：二、费用	3,386,601.71	4,576,944.87
1. 管理人报酬	1,113,920.74	1,388,349.55
2. 托管费	185,653.50	231,391.62
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	1,900,101.01	2,769,860.05
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	186,926.46	187,343.65
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-16,829,959.27	-31,204,540.94
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-16,829,959.27	-31,204,540.94

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：（2011年1月1日至2011年6月30日）

单位：人民币元

项目	本期 (2011年1月1日至2011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）	128,960,277.40	25,669,928.04	154,630,205.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-16,829,959.27	-16,829,959.27
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）	-130,151.10	-400,555.48	-530,706.58
其中：1. 基金申购款	36,420,234.03	6,334,281.46	42,754,515.49
2. 基金赎回款	-36,550,385.13	-6,734,836.94	-43,285,222.07
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）	128,830,126.30	8,439,413.29	137,269,539.59
项目	上年度可比期间 (2010年1月1日至2010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）	186,849,702.61	37,414,101.42	224,263,804.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-31,204,540.94	-31,204,540.94
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）	-29,047,867.54	-5,741,874.04	-34,789,741.58
其中：1. 基金申购款	12,957,346.67	1,720,962.32	14,678,308.99
2. 基金赎回款	-42,005,214.21	-7,462,836.36	-49,468,050.57
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）	157,801,835.07	467,686.44	158,269,521.51

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 的财务报表由下列负责人签署：

 殷克胜 殷克胜 傅军
 基金管理公司负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释（统称“企业会计准则”），中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券

投资基金执行《企业会计准则》估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、关于发布《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉（试行）》等问题的通知及其他中国证监会颁布的相关规定而编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日止会计期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无差错更正。

6.4.6 税项

1、印花税

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

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

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

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

2、营业税、企业所得税

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

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

3、个人所得税

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末(2011年6月30日)
活期存款	4,980,996.40

定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计	4,980,996.40

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2011 年 6 月 30 日）		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	94,753,750.22	96,418,260.70	1,664,510.48
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	94,753,750.22	96,418,260.70	1,664,510.48

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末（2011 年 6 月 30 日）
应收活期存款利息	973.44
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	16,068.66
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	2,930.61
其他	-
合计	19,972.71

6.4.7.6 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末（2011 年 6 月 30 日）
交易所市场应付交易费用	526,051.30

银行间市场应付交易费用	-
合计	526,051.30

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2011年6月30日）
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	327.54
预提费用	496,260.57
合计	996,588.11

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期（2011年1月1日至2011年6月30日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	128,960,277.40	128,960,277.40
本期申购	36,420,234.03	36,420,234.03
本期赎回（以“-”号填列）	-36,550,385.13	-36,550,385.13
本期末	128,830,126.30	128,830,126.30

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	32,650,715.50	-6,980,787.46	25,669,928.04
本期利润	-13,158,761.31	-3,671,197.96	-16,829,959.27
本期基金份额交易产生的变动数	-158,895.76	-241,659.72	-400,555.48
其中：基金申购款	8,303,564.28	-1,969,282.82	6,334,281.46
基金赎回款	-8,462,460.04	1,727,623.10	-6,734,836.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	19,333,058.43	-10,893,645.14	8,439,413.29

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 (2011年1月1日至2011年6月30日)
活期存款利息收入	19,647.48
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	14.71
结算备付金利息收入	177,756.76
其他	-
合计	197,418.95

注：“其他存款利息收入”为申购款利息收入。

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 (2011年1月1日至2011年6月30日)
卖出股票成交总额	629,525,896.78
减：卖出股票成本总额	640,068,449.58
买卖股票差价收入	-10,542,552.80

6.4.7.12 债券投资收益

本基金本报告期末进行债券投资。

6.4.7.13 衍生工具收益**6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期末进行权证投资。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 (2011年1月1日至2011年6月30日)
股票投资产生的股利收益	311,798.92
基金投资产生的股利收益	-
合计	311,798.92

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 (2011年1月1日至2011年6月30日)
1、交易性金融资产	-3,671,197.96
——股票投资	-3,671,197.96
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2、衍生工具	-
——权证投资	-
3、其他	-
合计	-3,671,197.96

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 (2011年1月1日至2011年6月30日)
基金赎回费收入	54,110.69
合计	54,110.69

6.4.7.17 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 (2011年1月1日至2011年6月30日)
交易所市场交易费用	1,900,101.01
银行间市场交易费用	-
合计	1,900,101.01

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 (2011年1月1日至2011年6月30日)
审计费用	27,769.02
信息披露费	148,765.71
银行汇划费	1,391.73
银行间市场账户维护费	9,000.00
合计	186,926.46

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至资产负债表日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

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

本报告期内关联方无发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
金鹰基金管理有限公司	基金发起人、管理人
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付给关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期(2011年1月1日至2011年6月30日)	上年度可比期间(2010年1月1日至2010年6月30日)
当期发生的基金应支付的管理费	1,113,920.74	1,388,349.55
其中:应支付给销售机构的客户维护费	292,736.25	313,040.36

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

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期(2011年1月1日至2011年6月30日)	上年度可比期间(2010年1月1日至2010年6月30日)
当期发生的基金应支付的托管费	185,653.50	231,391.62

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

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

2、基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金管理人向基

金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内，从基金资产中一次性支付，若遇节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付给关联方的销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期(2011年1月1日至2011年6月30日)		上年度可比期间(2010年1月1日至2010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	4,980,996.40	19,647.48	1,164,105.42	16,640.17

注：本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息，在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示。该科目 2011 年 6 月 30 日余额为 11,045,767.74 元，2010 年 6 月 30 日余额为 103,066,462.46 元。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金报告期及上年度可比期间内均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金报告期及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末(2011年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金报告期末未持有因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险等。基金成立以来，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，致力于内控机制的建立和完善，公司内部管理制度及业务规范流程的制定和完善，加强内部风险的控制与有效防范，以保证各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

为保证公司规范化运作，有效地防范和化解经营风险，确保基金和公司财务和其他信息真实、准确、完整、及时，从而最大程度地保护基金持有人的合法权益，本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了科学合理、控制严密、运行高效的各项管理制度：

（1）风险管理控制制度

风险控制制度由总则、风险控制的目标和原则、风险控制的机构设置、风险控制的程序、风险类型的界定、风险控制的主要措施、风险控制的具体制度、风险控制制度的监督与评价等部分组成。

风险控制的具体制度主要包括投资风险管理制度、交易风险控制制度、财务风险控制制度、公司资产管理制度等业务风险控制制度，以及岗位分离制度、业务空间隔离制度、作业规则、岗位职责、反馈制度、资料保全制度、保密制度、员工行为守则等程序性风险管理制度。

（2）投资管理制度

投资管理制度包括研究业务管理制度、投资决策管理制度、基金交易管理制度等。

制订研究业务管理制度的目的是保持研究工作的独立、客观。研究业务管理制度包括：建立严密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法；根据基

金合同要求，在充分研究的基础上建立和维护投资对象备选库；建立研究与投资的业务交流制度，保持通畅的交流渠道；建立研究报告质量评价体系。

制订投资决策业务管理制度的目的是严格遵守法律法规的有关规定，确保基金的投资符合基金合同所规定的投资目标、投资范围、投资策略、投资组合和投资限制等要求。投资决策业务管理制度包括投资决策授权制度；投资决策支持制度，重要投资要有详细的研究报告和风险分析支持；投资风险评估与管理制度，在设定的风险权限额度内进行投资决策；投资管理业绩评价制度等。

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

（3）监察稽核制度

公司设立督察长，负责监察稽核工作，督察长由总经理提名，经董事会聘任，对董事会负责，报中国证监会核准。

除应当回避的情况外，督察长可以列席公司相关会议，调阅公司相关档案，就内部控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能。

督察长应当定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况，董事会应当对督察长的报告进行审议。

公司设立监察稽核部门，具体执行监察稽核工作。公司明确规定了监察稽核部门及内部各岗位的具体职责，严格审查监察稽核人员的专业任职条件，配备了充足的合格的监察稽核人员，明确规定了监察稽核的操作程序和组织纪律。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地

对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营

活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 (2011年6月30日)	1个月以内	不计息	合计
资产			
银行存款	4,980,996.40	-	4,980,996.40
结算备付金	11,045,767.74	-	11,045,767.74
存出保证金	-	1,250,000.00	1,250,000.00
交易性金融资产	-	96,418,260.70	96,418,260.70
应收证券清算款	-	25,955,840.56	25,955,840.56
应收利息	-	19,972.71	19,972.71
应收申购款	-	81,187.44	81,187.44
资产总计	16,026,764.14	123,725,261.41	139,752,025.55
负债			
应付证券清算款	-	681,585.79	681,585.79
应付赎回款	-	86,929.08	86,929.08
应付管理人报酬	-	163,998.55	163,998.55
应付托管费	-	27,333.13	27,333.13
应付交易费用	-	526,051.30	526,051.30
其他负债	-	996,588.11	996,588.11
负债总计	-	2,482,485.96	2,482,485.96
利率敏感度缺口	16,026,764.14	121,242,775.45	137,269,539.59

上年度末 (2010年12月31日)	1个月以内	不计息	合计
资产			
银行存款	10,408,745.21	-	10,408,745.21
结算备付金	22,489,723.86	-	22,489,723.86
存出保证金	-	1,250,000.00	1,250,000.00
交易性金融资产	-	122,317,680.98	122,317,680.98
应收证券清算款	-	3,964,494.19	3,964,494.19
应收利息	-	13,301.15	13,301.15
应收申购款	-	240,650.51	240,650.51
资产总计	32,898,469.07	127,786,126.83	160,684,595.90
负债			
应付证券清算款	-	3,651,929.15	3,651,929.15
应付赎回款	-	460,110.93	460,110.93
应付管理人报酬	-	200,836.67	200,836.67
应付托管费	-	33,472.77	33,472.77
应付交易费用	-	830,581.05	830,581.05
其他负债	-	877,459.89	877,459.89
负债总计	-	6,054,390.46	6,054,390.46

利率敏感度缺口	32,898,469.07	121,731,736.37	154,630,205.44
---------	---------------	----------------	----------------

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金暂无债券投资，市场利率变动对基金债券资产净值没有影响。

6.4.13.4.2 其他价格风险

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

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末（2011年6月30日）		上年度末（2010年12月31日）	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	96,418,260.70	70.24	122,317,680.98	79.10
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	96,418,260.70	70.24	122,317,680.98	79.10

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	市场其他变量保持不变，只有业绩比较基准所对应的市场组合价格发生合理、可能的变动		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 （2011年6月30日）	上年度末 （2010年12月31日）
	业绩比较基准变动+5%	9,507,735.54	10,604,788.65
业绩比较基准变动-5%	-9,507,735.54	-10,604,788.65	

§ 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	96,418,260.70	68.99
	其中：股票	96,418,260.70	68.99
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	16,026,764.14	11.47
6	其他各项资产	27,307,000.71	19.54
7	合计	139,752,025.55	100.00

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

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,315,224.08	1.69
B	采掘业	15,835,645.59	11.54
C	制造业	54,650,544.20	39.81
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	5,085,798.62	3.70
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	9,682,551.24	7.05
C5	电子	7,777,140.35	5.67
C6	金属、非金属	2,659,036.00	1.94
C7	机械、设备、仪表	29,446,017.99	21.45
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	8,309,718.83	6.05
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	6,122,390.00	4.46
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	7,211,018.00	5.25
L	传播与文化产业	1,973,720.00	1.44
M	综合类	-	-
	合计	96,418,260.70	70.24

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600028	中国石化	964,933	7,941,398.59	5.79
2	002129	中环股份	387,115	7,777,140.35	5.67
3	002480	新筑股份	230,756	6,913,449.76	5.04
4	600995	文山电力	607,698	6,520,599.54	4.75
5	000850	华茂股份	646,226	5,085,798.62	3.70
6	600316	洪都航空	150,247	4,842,460.81	3.53
7	000888	峨眉山A	255,609	4,652,083.80	3.39
8	002068	黑猫股份	309,248	4,617,072.64	3.36
9	002445	中南重工	162,476	4,614,318.40	3.36
10	000776	广发证券	97,600	3,830,800.00	2.79
11	300004	南风股份	145,857	3,465,562.32	2.52
12	000551	创元科技	234,070	3,396,355.70	2.47
13	002165	红宝丽	200,290	2,972,303.60	2.17
14	002297	博云新材	150,900	2,821,830.00	2.06
15	000780	平庄能源	176,100	2,799,990.00	2.04
16	000968	煤气化	109,550	2,774,901.50	2.02
17	002271	东方雨虹	157,900	2,659,036.00	1.94
18	002155	辰州矿业	70,950	2,319,355.50	1.69
19	002477	雏鹰农牧	72,396	2,315,224.08	1.69
20	601377	兴业证券	133,000	2,291,590.00	1.67
21	000698	沈阳化工	221,500	2,093,175.00	1.52
22	002177	御银股份	165,500	2,043,925.00	1.49
23	300148	天舟文化	148,960	1,973,720.00	1.44
24	002573	国电清新	57,100	1,879,161.00	1.37
25	600505	西昌电力	147,739	1,789,119.29	1.30
26	002337	赛象科技	92,400	1,348,116.00	0.98
27	300012	华测检测	39,430	679,773.20	0.50

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	600585	海螺水泥	28,255,981.75	18.27
2	002155	辰州矿业	26,302,582.09	17.01
3	000972	新中基	19,331,465.38	12.50
4	000401	冀东水泥	18,858,578.49	12.20
5	600518	康美药业	16,912,747.43	10.94
6	000568	泸州老窖	16,843,393.42	10.89
7	600760	中航黑豹	16,290,802.92	10.54
8	600887	伊利股份	16,042,924.26	10.38
9	600337	美克股份	14,978,713.30	9.69
10	600995	文山电力	14,636,579.61	9.47
11	601888	中国国旅	14,269,126.57	9.23
12	000157	中联重科	13,705,925.68	8.86

13	000099	中信海直	10,026,189.44	6.48
14	002139	拓邦股份	9,972,401.98	6.45
15	600028	中国石化	9,918,201.35	6.41
16	600549	厦门钨业	9,364,137.37	6.06
17	601398	工商银行	9,183,602.06	5.94
18	600015	华夏银行	8,839,323.78	5.72
19	600000	浦发银行	8,761,354.63	5.67
20	600528	中铁二局	8,697,338.61	5.62
21	601106	中国一重	8,654,769.96	5.60
22	601288	农业银行	8,637,985.00	5.59
23	000528	柳 工	8,478,430.72	5.48
24	600809	山西汾酒	8,229,012.39	5.32
25	002129	中环股份	7,891,467.41	5.10
26	002068	黑猫股份	7,707,719.52	4.98
27	000425	徐工机械	7,108,833.17	4.60
28	002165	红 宝 丽	6,766,162.50	4.38
29	600068	葛洲坝	6,509,216.74	4.21
30	600031	三一重工	6,348,464.14	4.11
31	000850	华茂股份	5,865,177.00	3.79
32	600468	百利电气	5,763,523.64	3.73
33	600316	洪都航空	5,513,782.13	3.57
34	600416	湘电股份	5,358,506.09	3.47
35	002445	中南重工	5,266,561.30	3.41
36	300136	信维通信	5,165,496.90	3.34
37	300135	宝利沥青	5,100,632.42	3.30
38	000983	西山煤电	4,975,867.34	3.22
39	002023	海特高新	4,918,026.54	3.18
40	601989	中国重工	4,904,823.42	3.17
41	000960	锡业股份	4,657,266.10	3.01
42	000888	峨眉山A	4,647,055.20	3.01
43	600351	亚宝药业	4,606,174.96	2.98
44	000903	云内动力	4,598,988.36	2.97
45	600383	金地集团	4,589,725.16	2.97
46	000968	煤 气 化	4,562,646.83	2.95
47	600535	天士力	4,454,931.29	2.88
48	601939	建设银行	4,406,640.00	2.85
49	000898	鞍钢股份	4,395,138.20	2.84
50	000024	招商地产	4,381,689.70	2.83
51	601992	金隅股份	4,369,892.61	2.83
52	000002	万 科A	4,338,519.22	2.81
53	600016	民生银行	4,321,699.00	2.79
54	000001	深发展A	4,315,768.81	2.79
55	600036	招商银行	4,312,980.00	2.79
56	300048	合康变频	4,300,989.56	2.78
57	000423	东阿阿胶	4,269,927.42	2.76
58	000538	云南白药	4,158,869.57	2.69
59	002327	富安娜	4,154,163.80	2.69
60	600079	人福医药	4,143,340.74	2.68

61	600802	福建水泥	4,105,208.09	2.65
62	000709	河北钢铁	4,030,097.00	2.61
63	600694	大商股份	3,988,558.31	2.58
64	600505	西昌电力	3,351,387.30	2.17
65	000009	中国宝安	3,347,831.80	2.17
66	000776	广发证券	3,321,194.79	2.15
67	300004	南风股份	3,301,843.14	2.14
68	002177	御银股份	3,266,586.99	2.11
69	000551	创元科技	3,143,026.50	2.03

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600585	海螺水泥	32,459,181.54	20.99
2	002155	辰州矿业	25,153,663.91	16.27
3	000157	中联重科	23,740,469.38	15.35
4	000972	新中基	21,143,947.21	13.67
5	000528	柳工	18,576,636.45	12.01
6	600031	三一重工	18,215,232.68	11.78
7	601888	中国国旅	17,894,472.77	11.57
8	000401	冀东水泥	17,481,381.95	11.31
9	000568	泸州老窖	16,528,321.02	10.69
10	600760	中航黑豹	15,740,288.55	10.18
11	600887	伊利股份	15,540,303.87	10.05
12	600518	康美药业	15,508,392.17	10.03
13	600337	美克股份	15,090,719.97	9.76
14	600068	葛洲坝	12,628,397.22	8.17
15	000099	中信海直	12,332,563.17	7.98
16	600362	江西铜业	9,404,269.08	6.08
17	600048	保利地产	9,287,044.98	6.01
18	000425	徐工机械	9,135,688.08	5.91
19	601106	中国一重	8,997,564.53	5.82
20	601398	工商银行	8,989,368.20	5.81
21	002131	利欧股份	8,810,502.30	5.70
22	000983	西山煤电	8,773,929.99	5.67
23	600528	中铁二局	8,682,408.50	5.61
24	600809	山西汾酒	8,457,324.68	5.47
25	600549	厦门钨业	8,457,224.09	5.47
26	601288	农业银行	8,446,294.69	5.46
27	600015	华夏银行	8,434,904.87	5.45
28	600000	浦发银行	8,294,566.23	5.36
29	300048	合康变频	8,202,979.40	5.30
30	002139	拓邦股份	7,618,212.45	4.93
31	600416	湘电股份	5,863,035.92	3.79

32	600378	天科股份	5,620,964.38	3.64
33	600995	文山电力	5,421,215.32	3.51
34	002023	海特高新	5,290,494.37	3.42
35	600468	百利电气	5,136,515.13	3.32
36	002129	中环股份	5,045,885.57	3.26
37	600491	龙元建设	4,856,570.54	3.14
38	300136	信维通信	4,679,438.69	3.03
39	600535	天士力	4,651,244.10	3.01
40	601989	中国重工	4,649,030.90	3.01
41	300135	宝利沥青	4,588,441.00	2.97
42	600351	亚宝药业	4,509,538.25	2.92
43	002261	拓维信息	4,464,974.71	2.89
44	601939	建设银行	4,370,348.53	2.83
45	000630	铜陵有色	4,367,126.84	2.82
46	000898	鞍钢股份	4,363,928.99	2.82
47	600348	阳泉煤业	4,362,354.00	2.82
48	000960	锡业股份	4,308,592.33	2.79
49	600079	人福医药	4,284,534.46	2.77
50	600383	金地集团	4,279,341.80	2.77
51	000903	云内动力	4,242,678.17	2.74
52	600036	招商银行	4,204,913.45	2.72
53	000538	云南白药	4,197,197.67	2.71
54	000709	河北钢铁	4,190,487.26	2.71
55	000423	东阿阿胶	4,177,069.06	2.70
56	000002	万科A	4,175,535.00	2.70
57	000024	招商地产	4,157,104.39	2.69
58	600016	民生银行	4,154,517.00	2.69
59	000001	深发展A	4,134,974.00	2.67
60	601992	金隅股份	4,126,027.56	2.67
61	002068	黑猫股份	4,049,691.69	2.62
62	002327	富安娜	4,043,368.68	2.61
63	600802	福建水泥	3,962,322.27	2.56
64	002165	红宝丽	3,831,553.72	2.48
65	600694	大商股份	3,755,705.89	2.43
66	002480	新筑股份	3,461,237.47	2.24
67	600072	中船股份	3,186,462.68	2.06

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	617,840,227.26
卖出股票的收入（成交）总额	629,525,896.78

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金报告期期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金报告期期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金报告期期末未持有资产支持证券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金报告期期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注**7.9.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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**

本基金报告期内投资的前十名证券的发行主体本期未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。

7.9.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金报告期投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.9.3 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	1,250,000.00
2	应收证券清算款	25,955,840.56
3	应收股利	-
4	应收利息	19,972.71
5	应收申购款	81,187.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,307,000.71

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差

§ 8 基金份额持有人信息**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数 (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 (%)
9,605	13,412.82	2,236,002.62	1.74	126,594,123.68	98.26

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

本报告期末无基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2008年12月4日）基金份额总额	367,018,547.39
本报告期期初基金份额总额	128,960,277.40
本报告期基金总申购份额	36,420,234.03
减：本报告期基金总赎回份额	36,550,385.13
本报告期期末基金份额总额	128,830,126.30

§ 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，因此无会议决议。

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

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

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

- 1、 本报告期内基金管理人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。
- 2、 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

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券回购交易		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 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
华创证券	1	144,664,099.54	11.60	125,600,000.00	14.45	122,964.68	11.86	
银河证券	1	301,392,761.21	24.16	453,000,000.00	52.11	255,567.09	24.65	
湘财证券	1	34,546,217.48	2.77	45,500,000.00	5.23	29,364.03	2.83	
中金公司	1	43,507,011.06	3.49	0.00		36,980.85	3.57	
国信证券	1	51,863,030.29	4.16	171,400,000.00	19.72	44,083.73	4.25	
安信证券	1	119,518,702.92	9.58	0.00		97,109.88	9.37	
中信证券	1	470,915,938.03	37.75	0.00		382,623.36	36.91	
财通证券	1	55,818,196.60	4.47	20,000,000.00	2.30	47,446.37	4.58	
信达证券	1	25,140,166.91	2.02	53,800,000.00	6.19	20,443.45	1.97	
合计	9	1,247,366,124.04	100.00	869,300,000.00	100.00	1,036,583.44	100.00	

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。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	金鹰基金管理有限公司关于旗下开放式基金净值的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年1月4日
2	金鹰基金管理有限公司关于开通网上交易工商银行支付渠道定投申购业务并对前端收费基金实行申购费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年1月4日
3	金鹰基金管理有限公司关于继续参加邮储银行网上前端申购费率优惠活动的公告	证券时报	2011年1月6日
4	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金停牌股票估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年1月11日
5	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金因停牌股票复牌后估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年1月14日
6	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金停牌股票估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年2月11日
7	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金因停牌股票复牌后估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年2月16日
8	金鹰基金管理有限公司北京分公司营业场所及负责人变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年2月18日
9	金鹰基金管理有限公司关于柜台直销业务专用账号变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年2月21日
10	金鹰基金管理有限公司关于参加光大证券开放式基金网上交易定期定额投资申购费率优惠活动的	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年3月8日

	公告		
11	金鹰基金管理有限公司关于网上交易开通“天天盈账户”第三方支付业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年3月11日
12	金鹰基金管理有限公司关于更改纸质对账单寄送方式的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年3月11日
13	金鹰基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新已过期身份证件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年3月12日
14	金鹰基金管理有限公司关于开通基金直销网上下单汇款交易业务及费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年3月25日
15	金鹰基金管理有限公司关于暂停网上交易系统农业银行支付渠道服务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年3月25日
16	金鹰基金管理有限公司关于新增英大证券为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年3月28日
17	金鹰基金管理有限公司关于开通中国邮政储蓄银行定期定额投资及参加定投申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年4月15日
18	金鹰基金管理有限公司关于全面开展网上交易申购、定投业务费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年4月29日
19	金鹰基金管理有限公司关于本周末暂停网上交易系统民生银行支付渠道服务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年5月6日
20	金鹰基金管理有限公司关于新增日信证券为代销机构并参加网上交易费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年5月9日
21	金鹰基金管理有限公司关于网上直销平台开通旗下部分开放式证券投资基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年5月11日
22	金鹰基金管理有限公司关于新增浙商证券为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年5月11日
23	更正公告	证券时报	2011年5月12日
24	金鹰基金管理有限公司关于调整网上交易农行支付渠道定投业务费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年5月17日
25	金鹰基金管理有限公司关于增加注册资本及修改公司章程的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年5月17日
26	金鹰基金管理有限公司关于新增金元证券为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年5月27日
27	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金在宁波银行开通定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年6月8日
28	金鹰基金管理有限公司关于设立上海分公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年6月20日
29	金鹰基金管理有限公司关于开通网上交易智能定投业务和预约交	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年6月29日

	易业务的公告		
30	金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金关于基金经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 6 月 29 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 公司增加注册资本

根据本公司股东会会议决议，并报经中国证券监督管理委员会（证监许可[2011] 538 号）、中华人民共和国商务部（商外资资审 A 字[2010]0016 号）批准，本公司的注册资本由人民币 10000 万元增加到人民币 25000 万元，同时，就增加公司注册资本、股东出资等内容修改了公司章程。公司现有股东按其在本公司的出资比例同比例认缴增资额，股东出资比例不变，增加注册资本后，公司股东出资额及出资占公司注册资本比例为：广州证券有限责任公司 12250 万元人民币，占注册资本总额的 49%；广州美的电器股份有限公司 5000 万元人民币，占注册资本总额的 20%；广州药业股份有限公司 5000 万元人民币，占注册资本总额的 20%；东亚联丰投资管理有限公司 2750 万元人民币，占注册资本总额的 11%。

本次增加注册资本及修改公司章程的工商变更手续已于 2011 年 5 月 16 日在广东省工商行政管理局办理完毕。详情请参见本公司于 2011 年 5 月 17 日刊登于《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上的公告。

11.2 上海分公司成立

本报告期，经公司董事会决议通过，并经中国证券监督管理委员会上海监管局《关于核准金鹰基金管理有限公司设立上海分公司的批复》（沪证监基金字（2011）15 号）批复同意，我公司向上海市工商行政管理局申请登记设立上海分公司，上海分公司负责人为郭容辰，营业场所位于上海市静安区南京西路 758 号 17E 室，经营范围是基金销售及公司授权的其他业务。目前相关工商登记注册手续已办理完毕。公司已于 2011 年 6 月 20 日对此事项进行了公开披露。

11.3 广州分公司（主要办公场所）地址变更

经我公司第三届董事会第三十二次会议审议通过，我公司决定将广州分公司（主要办公场所）由原来的“广州市沿江中路 298 号江湾商业中心 22 层”搬迁至“广州市天河区体育西路 189 号城建大厦 22-23 层”，并自 2011 年 7 月 19 日起在新址正常办公，详见我公司 7 月 12、21 日搬迁公告。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会批准金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金发行及募集的文件。

2、《金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

3、《金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。

4、金鹰基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程。

5、基金托管人业务资格批件和营业执照。

6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、季度报告、半年度报告、更新的招募说明书及其他临时公告。

12.2 存放地点

广州市天河区体育西路 189 号城建大厦 22-23 层

12.3 查阅方式

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

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

金鹰基金管理有限公司

2011 年 8 月 25 日