

金鹰策略配置股票型证券投资基金

2011 年年度报告

2011 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：中信银行股份有限公司

报告送出日期：2012 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

本基金管理人的董事会及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。

本基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同的规定，于 2012 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、财务会计报告相关内容、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。

本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。

本报告财务资料已经审计，立信会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期为 2011 年 9 月 1 日起至 2011 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§ 4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作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.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
§ 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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 审计报告.....	13
§ 7 年度财务报表.....	14
7.1 资产负债表.....	14

7.2 利润表.....	15
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
7.4 报表附注.....	17
§ 8 投资组合报告.....	37
8.1 期末基金资产组合情况.....	37
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
8.3 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.....	38
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
8.6 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 41	
8.7 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.....	41
8.8 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 41	
8.9 投资组合报告附注.....	41
§ 9 基金份额持有人信息.....	42
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	42
§ 10 开放式基金份额变动.....	42
§ 11 重大事件揭示.....	42
11.1 基金份额持有人大会决议.....	42
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.....	42
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	42
11.4 基金投资策略的改变.....	42
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
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.....	43
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
11.8 其他重大事件.....	44
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	45

§ 13 备查文件目录.....	46
13.1 备查文件目录.....	46
13.2 存放地点.....	46
13.3 查阅方式.....	47

§ 2 基金简介

1.1 基金基本情况

基金名称	金鹰策略配置股票型证券投资基金
基金简称	金鹰策略配置股票
基金主代码	210008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 9 月 1 日
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	385,477,940.89 份
基金合同存续期	不定期

1.2 基金产品说明

投资目标	在对基本面进行深入分析的基础上，制定适当的投资策略，以策略指导投资运作，在充分控制风险的前提下，分享中国经济快速发展的成果以及企业经营绩效提升所带来的股权溢价，力争实现基金资产的长期可持续稳健增值。
投资策略	“防御”与“进取”的权衡与取舍是本基金进行大类资产配置、行业配置过程中的重要决策依据。通过对宏观经济所处投资时钟象限的判断、对股票市场与资金市场之间套利空间的测度，综合考察国内外宏观经济、财政政策与货币政策新动向、资本市场运行状况，对“防御”与“进取”目标适时、适度地有所侧重，将是本基金在投资策略上的现实选择。
业绩比较基准	沪深 300 指数增长率×75%+中信标普国债指数增长率×25%
风险收益特征	本基金为主动操作的股票型证券投资基金，属于证券投资基金中的预期收益与风险较高的品种。一般情形下，其风险和预期收益均高于货币型基金、债券型基金和混合型基金。

1.3 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	中信银行股份有限公司
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	95558
传真	020-83282856	010-65550832
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	北京东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座
办公地址	广州市天河区体育西路 189 号城建大厦 22-23 层	北京东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座
邮政编码	510620	100027
法定代表人	刘东	田国立

1.4 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gefund.com.cn

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

1.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	立信会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区南京东路 61 号四楼
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

§ 2 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

2.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

1.1.1 期间数据和指标	2011 年
本期已实现收益	-5,993,605.97
本期利润	-17,355,990.36
加权平均基金份额本期利润	-0.0329
本期加权平均净值利润率（%）	-3.31
本期基金份额净值增长率（%）	-4.51
1.1.2 期末数据和指标	2011 年末
期末可供分配利润	-17,402,942.52
期末可供分配基金份额利润	-0.0451
期末基金资产净值	368,074,998.37
期末基金份额净值	0.9549
1.1.3 累计期末指标	2011 年末
基金份额累计净值增长率（%）	-4.51

注：1、本基金于 2011 年 9 月 1 日成立，存续期不足一年；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、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。

1.2 基金净值表现

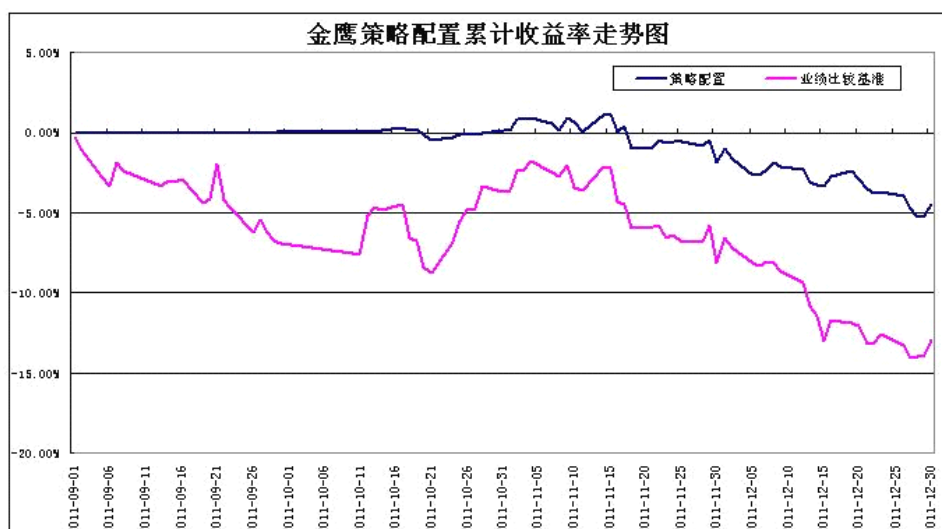
1.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-4.64	0.50	-6.46	1.05	1.82	-0.55
自基金合	-4.51	0.43	-12.93	1.05	8.42	-0.62

同生效起 至今						
------------	--	--	--	--	--	--

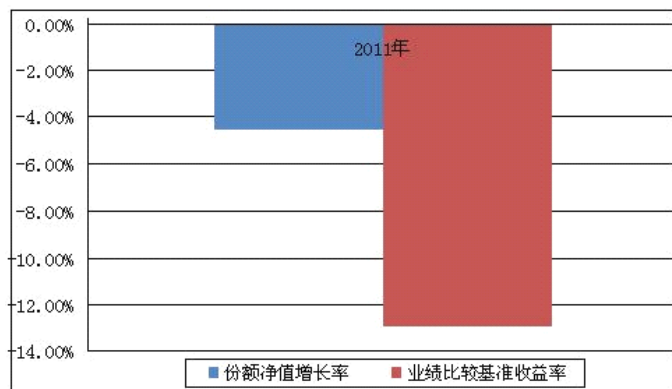
注：本基金成立不足一年。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数增长率×75% + 中信标普国债指数增长率×25%。

1.2.2 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、本基金合同于 2011 年 9 月 1 日正式生效。按基金合同规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期，截止报告日本基金处建仓期；2、本基金投资范围：股票资产占基金资产净值的比例为 60%~95%；债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券等其他金融工具占基金资产净值的 5%~40%；3、本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数增长率×75%+中信标普国债指数增长率×25%。

1.2.3 过去五年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



注：本基金成立不足一年。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数增长率×75% + 中信标普国债指数增长率×25%。

1.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金成立不足一年，报告期无利润分配情况。

§ 2 管理人报告

2.1 基金管理人及基金经理情况

2.1.1 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 12 月 31 日,公司共管理金鹰成份股优选证券投资基金、金鹰中小盘精选证券投资基金、金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金、金鹰行业优势股票型证券投资基金、金鹰稳健成长股票型证券投资基金、金鹰主题优势股票型证券投资基金、金鹰保本混合型证券投资基金、金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金和金鹰策略配置股票型证券投资基金九只开放式基金。

2.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨绍基	投资管理部总监,投资决策委员会委员,基金经理	2011年9月1日	-	8	杨绍基先生, 经济学博士, 证券从业经历 8 年。曾任职于广东发展银行资产管理部, 2007 年 8 月加入金鹰基金管理有限公司, 先后担任行业研究员、基金经理助理、基金经理、研究发展部副总监等职, 现任公司投资管理部总监、投资决策委员会委员, 现任金鹰策略股票型股票型证券投资基金、金鹰稳健成长股票型证券投资基金及金鹰中小盘精选证券投资基金基金经理。

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

2.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》和其他有关法律法规及其各项实施准则、《金鹰策略配置股票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，无损害基金持有人利益的行为。

2.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

2.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期，本基金管理人根据新颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，梳理完善了本基金管理人相关公平交易制度和投资制度，主要通过建立有纪律、规范化的投资、研究和决策流程，加强对交易组合的分析和评估环节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、股票备选库管理制度、债券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，启用投资交易系统内的公平交易模块，加强对不同投资组合的交易价差、收益率的分析，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。本基金管理人将严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》以及其他法律法规的要求，不断完善公平交易的相关内控制度并严格执行。

2.3.2 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。

2.3.3 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。

2.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

2.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金自成立以后，采取轻仓试盘、缓慢建仓的策略，希望在深入研究个股的基础上，通过基本面研究和交易试盘沉淀出未来能成为基金核心资产的成长型股票，但从基金成立之后的运作来看，由于市场基本呈单边下跌，成长类股跌幅尤甚，虽然一些个股已进入长期价值投资区间，但市场下跌后期脱离基本面的情绪性杀跌，不仅使我们在这方面的尝试并没有体现出相应的效果，还造成损失。在 10 月份的市场反弹中，我们曾经一度将仓位推至相对较高的位置，但随后反

弹迅速结束，个股快速下跌，虽然我们及时把仓位降至低位，但仍出现一定的净值损失。

2.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值为 0.9549 元，本报告期份额净值增长率为-4.51%，同期业绩比较基准收益率为-12.93%。

2.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2012 年，A 股市场所面临的宏观面、政策面、资金面、估值面乃至情绪面均优于 2011 年，至少上半年应有明显改善。从一个相对较长的时间段来看，2012 年 A 股市场总体上很可能仍是筑底年，因为目前仍未观察到由相当数量的盈利持续增长的行业和公司大面积出现或者流动性宽松所带来的新牛市，但由预期改善所带来的阶段性投资机会值得把握。由于本基金仍处于建仓期，稳定净值、不使基金资产出现大幅损失仍是本基金运作的要点，在此基础上尽量选择安全区间和品质稳步推高仓位。就全年的运作策略来说，保持仓位的灵活和弹性是应对市场波动的重要手段。资产配置方面，在经济增速趋缓的大环境下，强周期、重资产品种的交易机会更多来自于估值修复的反弹行情，轻资产、服务类、技术类、消费类等盈利成长空间更大的领域中的成长股是我们坚定看好的品种，符合国家产业规划，代表未来经济社会发展和进步方向的行业和公司将仍是我们战略核心资产配置的方向。

2.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，监察稽核工作根据独立、客观、公正的原则，按照规定的权限和程序独立开展本基金运作的合规性监察，认真履行职责，通过材料审阅、监督监控、覆盖检查、重点抽查等多种方法开展工作，督促各项业务的合规运作，发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告，定期向公司董事会和监管部门出具监察稽核报告。

本报告期有关本基金的监察稽核内容包括投资、交易、研究、市场营销、信息披露等各项业务的每个环节以及信息技术、运营保障、行政管理等后台支持工作，重点对基金投资、研究、营销宣传的合规性进行检查。监察结果显示，本报告期内公司对本基金的管理始终都能按照法律法规、基金合同、基金招募说明书的要求和公司制度的规定进行。本基金的投资决策、投资交易程序、投资权限等各方面均符合规定的要求；交易行为合法合规，未出现异常交易、操纵市场的现

象；未发现内幕交易的情况；基金持有的证券符合规定的比例要求；基金专用交易席位年度交易量比例符合证监会的有关规定；相关的信息披露真实、完整、准确、及时；销售工作合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

2.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

为确保公司估值程序的正常进行，本公司还成立了资产估值委员会。资产估值委员会由公司总经理、分管副总经理或总经理助理、研究发展部总监、运作保障部总监、投资管理部总监、基金经理、基金会计和相关人员组成。在特殊情况下，公司召集估值委员会会议，讨论和决策特殊估值事项，估值委员会问题决策，需到会的三分之二估值委员会成员表决通过。

本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金未签约与估值相关的定价服务。

2.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金成立不足一年，报告期内无利润分配情况。

§ 3 托管人报告

3.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

自 2011 年 9 月 1 日金鹰策略配置股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）成立以来，作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，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份额持有人利益的行为。

3.2 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

报告期内，本托管人按照国家有关法律法规、基金合同和托管协议要求，对基金管理人—金鹰基金管理有限公司在本基金投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。本报告期，本基金未进行分红，本托管人按照基金合同要求进行了严格审核，符合基金合同相关约定。

3.3 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

由本基金管理人—金鹰基金管理有限公司编制，并经本托管人复核审查的本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§ 4 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	金鹰策略配置股票型证券投资基金全体份额持有人：
引言段	我们审计了后附的金鹰策略配置股票型证券投资基金（以下简称“金鹰策略配置基金”）2011年12月31日的资产负债表和2011年9月1日至2011年12月31日的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是金鹰策略配置基金的基金管理人的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为，金鹰策略配置基金财务报表已经按照企业会计准则的规定编制，在所有重大方面公允反映了金鹰策略配置基金2011年12月31日的财务状况和2011年9月1日至2011年12月31日的经营成果和净值变动情况。
注册会计师的姓名	张宁 黄毅杰

会计师事务所的名称	立信会计师事务所（特殊普通合伙）
会计师事务所的地址	上海市黄浦区南京东路 61 号四楼
审计报告日期	2012 年 3 月 30 日

§ 5 年度财务报表

5.1 资产负债表

会计主体：金鹰策略配置股票型证券投资基金

报告截止日：2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 (2011 年 12 月 31 日)	上年度末 ()
资产：		
银行存款	20,261,513.85	-
结算备付金	1,764,839.21	-
存出保证金	250,000.00	-
交易性金融资产	288,236,592.85	-
其中：股票投资	95,223,592.85	-
基金投资	-	-
债券投资	193,013,000.00	-
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	60,000,530.00	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	2,452,261.36	-
应收股利	-	-
应收申购款	7,065.02	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	372,972,802.29	-
负债和所有者权益	本期末 (2011 年 12 月 31 日)	上年度末 ()
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	1,777,750.08	-
应付赎回款	1,689,634.93	-
应付管理人报酬	486,252.67	-
应付托管费	81,042.08	-
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	489,156.21	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-

应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	373,967.95	-
负债合计	4,897,803.92	-
所有者权益：		
实收基金	385,477,940.89	-
未分配利润	-17,402,942.52	-
所有者权益合计	368,074,998.37	-
负债和所有者权益总计	372,972,802.29	-

注：本基金 2011 年 9 月 1 日成立，存续期不足一年，无上年度可比数据。报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9549 元，基金份额总额 385,477,940.89 份。

5.2 利润表

会计主体：金鹰策略配置股票型证券投资基金

本报告期：（2011 年 9 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日）

单位：人民币元

项目	本期 (2011 年 9 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日)	上年度可比期间 (至)
一、收入	-13,150,531.72	-
1. 利息收入	4,705,652.31	-
其中：存款利息收入	851,852.96	-
债券利息收入	1,673,342.18	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	2,180,457.17	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-7,023,216.25	-
其中：股票投资收益	-7,375,940.84	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	352,724.59	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-11,362,384.39	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	529,416.61	-
减：二、费用	4,205,458.64	-
1. 管理人报酬	2,707,223.94	-
2. 托管费	451,203.95	-
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	908,934.92	-
5. 利息支出	4,034.85	-

其中：卖出回购金融资产支出	4,034.85	-
6. 其他费用	134,060.98	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-17,355,990.36	-
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-17,355,990.36	-

注：本基金 2011 年 9 月 1 日成立，存续期不足一年，无上年度可比数据。

5.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金鹰策略配置股票型证券投资基金

本报告期：（2011 年 9 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日）

单位：人民币元

项目	本期 (2011 年 9 月 1 日至 2011 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）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-17,355,990.36	-17,355,990.36
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）	385,477,940.89	-46,952.16	385,430,988.73
其中：1. 基金申购款	809,004,855.33	-44,404.05	808,960,451.28
2. 基金赎回款	-423,526,914.44	-2,548.11	-423,529,462.55
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）	385,477,940.89	-17,402,942.52	368,074,998.37
项目	上年度可比期间 (至)		
	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）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-	-
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	-	-	-

注：本基金 2011 年 9 月 1 日成立，存续期不足一年，无上年度可比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人殷克胜 主管会计工作负责人殷克胜 会计机构负责人傅军

5.4 报表附注

5.4.1 基金基本情况

金鹰策略配置股票型证券投资基金(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[2011]970号文《关于核准金鹰策略配置股票型证券投资基金募集的批复》、基金部函[2011]691号文《关于金鹰策略配置股票型证券投资基金备案确认的函》批准,于2011年9月1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2011年7月20日起至2011年8月26日止,认购金额及认购期银行利息合计805,601,019.15元,于2011年9月1日划至托管银行账户,首次设立募集规模为805,601,019.15份基金份额。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,基金托管人为中信银行股份有限公司。

5.4.2 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。

5.4.3 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2011年12月31日的财务状况以及2011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。

5.4.4 重要会计政策和会计估计

1.1.1.1 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。

1.1.1.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

1.1.1.3 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。

1.1.1.4 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。

1.1.1.5 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，则相应股票采用指数收益法确定其公允价值。指数收益法是指对于需要进行估值的股票，在估值日以公开发布的相应交易市场和相应行业指数的日收益率作为该股票的收益率，然后根据此收益率计算该股票当日的公允价值。

（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）证券交易所市场未实行净价交易的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（自债券计息起始日或上一付息日至估值当日的利息）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所含的最近交易日债券应收利息后的净价估值；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。

（3）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。

(4) 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。

(5) 交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，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，按成本进行后续计量。

(6) 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价格估值。

6、国家有最新规定的，按其规定进行估值。

1.1.1.6 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。

1.1.1.7 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。

1.1.1.8 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。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)。

1.1.1.9 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。

1.1.1.10 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 1.5% 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 0.25% 的年费率逐日计提；

3、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；

4、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。

1.1.1.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，基金注册登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

1.1.1.12 外币交易

本基金本年度无外币交易。

1.1.1.13 分部报告

本基金本年度无分部报告。

1.1.1.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本年度无其他重要的会计政策和会计估计。

1.1.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

1.1.2.1 会计政策变更的说明

本基金本年度无会计政策变更。

1.1.2.2 会计估计变更的说明

本基金本年度无会计估计变更。

1.1.2.3 差错更正的说明

本基金本年度无差错更正。

1.1.3 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]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。

1.1.4 重要财务报表项目的说明

1.1.4.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末（2011 年 12 月 31 日）
活期存款	20,261,513.85
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计	20,261,513.85

1.1.4.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2011 年 12 月 31 日）			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	106,648,396.82	95,223,592.85	-11,424,803.97	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	192,950,580.42	193,013,000.00	62,419.58
	合计	192,950,580.42	193,013,000.00	62,419.58
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	299,598,977.24	288,236,592.85	-11,362,384.39	

1.1.4.3 买入返售金融资产

1.1.1.1.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末（2011年12月31日）	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间质押式逆回购	60,000,530.00	-
合计	60,000,530.00	-

1.1.1.2 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末（2011年12月31日）
应收活期存款利息	17,620.03
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	794.20
应收债券利息	2,358,109.55
应收买入返售证券利息	75,737.58
应收申购款利息	-
其他	-
合计	2,452,261.36

1.1.1.3 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末（2011年12月31日）
交易所市场应付交易费用	476,944.66
银行间市场应付交易费用	12,211.55
合计	489,156.21

1.1.1.4 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2011年12月31日）
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	6,367.95
预提费用	117,600.00
合计	373,967.95

1.1.1.5 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期（2011年9月1日至2011年12月31日）	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	805,601,019.15	805,601,019.15
本期申购	3,403,836.18	3,403,836.18
本期赎回（以“-”号填列）	-423,526,914.44	-423,526,914.44
本期末	385,477,940.89	385,477,940.89

注：本基金于 2011 年 9 月 1 日募集成立，募集期认购资金确认份额 805,515,838.34 份，认购资金利息折算份额 85,180.81 份，合同生效日共确认 805,601,019.15 份基金份额。

1.1.1.6 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-5,993,605.97	-11,362,384.39	-17,355,990.36
本期基金份额交易产生的变动数	-265,752.66	218,800.50	-46,952.16
其中：基金申购款	-14,549.76	-29,854.29	-44,404.05
基金赎回款	-251,202.90	248,654.79	-2,548.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-6,259,358.63	-11,143,583.89	-17,402,942.52

1.1.1.7 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 (2011 年 9 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日)
活期存款利息收入	802,688.06
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	49,164.90
其他	-
合计	851,852.96

1.1.1.8 股票投资收益

1.1.1.8.1 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 9 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日)
卖出股票成交总额	260,329,709.07
减：卖出股票成本总额	267,705,649.91
买卖股票差价收入	-7,375,940.84

1.1.1.9 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 (2011 年 9 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日)
卖出债券成交总额	995,472,233.33

减：卖出债券成本总额	982,399,441.81
减：应收利息总额	12,720,066.93
债券投资收益	352,724.59

1.1.1.10 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 (2011年9月1日至2011年12月31日)
1、交易性金融资产	-11,362,384.39
——股票投资	-11,424,803.97
——债券投资	62,419.58
——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	-11,362,384.39

1.1.1.11 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 (2011年9月1日至2011年12月31日)
基金赎回费收入	529,416.61
合计	529,416.61

1.1.1.12 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 (2011年9月1日至2011年12月31日)
交易所市场交易费用	899,147.42
银行间市场交易费用	9,787.50
合计	908,934.92

1.1.1.13 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 (2011年9月1日至2011年12月31日)
审计费用	18,600.00
信息披露费	99,000.00
银行汇划费	15,560.98
其他	900.00
合计	134,060.98

1.1.2 或有事项、资产负债表日后事项的说明

1.1.2.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

1.1.2.2 资产负债表日后事项

截止本财务报告批准报出日，本基金没有重大须作披露的资产负债表日后事项。

1.1.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
广州证券有限责任公司(“广州证券”)	基金管理人股东、基金代销机构
广州药业股份有限公司	基金管理人股东
广东美的电器股份有限公司	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
中信银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

1.1.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**1.1.4.1 通过关联方交易单元进行的交易****1.1.4.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 (2011年9月1日至2011年12月31日)	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
广州证券	440,049,797.93	69.33

1.1.4.1.2 权证交易

本基金本年度未通过关联方进行权证交易。

1.1.4.1.3 债券交易

本基金本年度未通过关联方进行债券交易。

1.1.4.1.4 债券回购交易

本基金本年度未通过关联方进行债券回购交易。

1.1.4.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2011年9月1日至2011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	357,543.77	68.57	334,444.03	70.12

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

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

1.1.4.2 关联方报酬

1.1.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2011年9月1日至2011年12月31日）
当期发生的基金应支付的管理费	2,707,223.94
其中：应支付给销售机构的客户维护费	873,339.09

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。

1.1.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2011年9月1日至2011年12月31日）	上年度可比期间（至）
当期发生的基金应支付的托管费	451,203.95	-

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。

1.1.4.2.3 销售服务费

本基金报告期内没有应支付关联方的销售服务费。

1.1.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本年度未与关联方进行银行间同业市场的债券（回购）交易。

1.1.4.4 各关联方投资本基金的情况**1.1.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

1.1.4.4.2 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

本报告期末未有其他关联方投资本基金情况。

1.1.4.5 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9月1日至2011年12月31日）	
	期末余额	当期利息收入
中信银行	20,261,513.85	802,688.06

注：本基金用于证券交易结算的资金通过“中信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。2011年年末结算备付金余额

1,764,839.21 元, 当期结算备付金存款利息收入 49,164.90 元。

1.1.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金报告期没有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

1.1.5 利润分配情况

本基金报告期无利润分配情况。

1.1.6 期末（2011年12月31日）本基金持有的流通受限证券**1.1.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金期末未持有因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

1.1.6.2 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。

1.1.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**1.1.6.3.1 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。

1.1.6.3.2 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。

1.1.7 金融工具风险及管理**1.1.7.1 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。

1.1.7.2 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。

1.1.7.3 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约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。

1.1.7.4 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。

1.1.7.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

1.1.1.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 (2011 年 12 月 31 日)	1 个月以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	20,261,513.85	-	-	-	20,261,513.85
结算备付金	1,764,839.21	-	-	-	1,764,839.21
存出保证金	-	-	-	250,000.00	250,000.00
交易性	-	59,967,000.00	133,046,000.00	95,223,592.85	288,236,592.85

金融资产					
买入返售金融资产	-	-	-	60,000,530.00	60,000,530.00
衍生金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	2,452,261.36	2,452,261.36
应收申购款	-	-	-	7,065.02	7,065.02
资产总计	22,026,353.06	59,967,000.00	133,046,000.00	157,933,449.23	372,972,802.29
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,689,634.93	1,689,634.93
应付证券清算款	-	-	-	1,777,750.08	1,777,750.08
应付管理人报酬	-	-	-	486,252.67	486,252.67
应付托管费	-	-	-	81,042.08	81,042.08
应付交易费用	-	-	-	489,156.21	489,156.21
其他负债	-	-	-	373,967.95	373,967.95
负债总计	-	-	-	4,897,803.92	4,897,803.92
利率敏感度缺口	22,026,353.06	59,967,000.00	133,046,000.00	153,035,645.31	368,074,998.37

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。

1.1.1.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 其他变量不变，只有利率变动通过债券公允价值变动对基金资产净值产生影响。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 (2011年12月31日)	上年度末 ()
	1. 利率上升 25 个基点	-1,696,100.08	-

	2. 利率下降 25 个基点	1,696,100.08	-
--	----------------	--------------	---

1.1.1.1.2 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。

1.1.1.1.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末（2011 年 12 月 31 日）	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	95,223,592.85	25.87
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	193,013,000.00	52.44
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	288,236,592.85	78.31

1.1.1.1.2.2 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 12 月 31 日）	上年度末（）
	业绩比较基准变动+5%	4,612,842.41	-
	业绩比较基准变动-5%	-4,612,842.41	-

§ 2 投资组合报告

2.1 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	95,223,592.85	25.53
	其中：股票	95,223,592.85	25.53
2	固定收益投资	193,013,000.00	51.75
	其中：债券	193,013,000.00	51.75
	资产支持证券	-	-

3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	60,000,530.00	16.09
	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	22,026,353.06	5.91
6	其他各项资产	2,709,326.38	0.73
7	合计	372,972,802.29	100.00

注：其他各项资产包括：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、买入返售证券。

2.2 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	5,812,412.00	1.58
B	采掘业	-	-
C	制造业	70,300,248.70	19.10
C0	食品、饮料	8,863,207.40	2.41
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	23,263,710.75	6.32
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	28,102,433.75	7.63
C8	医药、生物制品	10,070,896.80	2.74
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	7,031,333.35	1.91
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	1,769,598.80	0.48
K	社会服务业	10,310,000.00	2.80
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	95,223,592.85	25.87

2.3 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	002638	勤上光电	434,000	11,700,640.00	3.18
2	300267	尔康制药	579,120	10,070,896.80	2.74

3	002414	高德红外	438,600	8,943,054.00	2.43
4	300260	新莱应材	350,846	8,904,471.48	2.42
5	002311	海大集团	497,933	8,863,207.40	2.41
6	300115	长盈精密	221,085	8,080,656.75	2.20
7	002129	中环股份	600,000	6,240,000.00	1.70
8	000998	隆平高科	225,200	5,812,412.00	1.58
9	600763	通策医疗	250,000	5,270,000.00	1.43
10	000826	桑德环境	200,000	5,040,000.00	1.37
11	600893	航空动力	287,853	3,911,922.27	1.06
12	300210	森远股份	130,000	3,585,400.00	0.97
13	002474	榕基软件	91,500	3,568,500.00	0.97
14	300101	国腾电子	109,757	3,462,833.35	0.94
15	000656	金科股份	149,966	1,769,598.80	0.48

2.4 报告期内股票投资组合的重大变动

2.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000858	五粮液	22,213,315.32	6.03
2	002129	中环股份	18,045,739.06	4.90
3	002638	勤上光电	17,605,755.22	4.78
4	600104	上海汽车	16,484,650.36	4.48
5	000998	隆平高科	14,574,910.96	3.96
6	300267	尔康制药	13,292,659.70	3.61
7	600416	湘电股份	12,900,607.40	3.50
8	601933	永辉超市	12,321,127.97	3.35
9	300260	新莱应材	12,008,408.71	3.26
10	300115	长盈精密	11,507,506.55	3.13
11	300127	银河磁体	11,172,693.36	3.04
12	601318	中国平安	11,117,759.14	3.02
13	002460	赣锋锂业	10,344,366.51	2.81
14	000826	桑德环境	10,212,501.84	2.77
15	300183	东软载波	10,152,008.11	2.76
16	601678	滨化股份	9,928,576.28	2.70
17	002063	远光软件	9,722,346.97	2.64
18	600763	通策医疗	9,580,625.56	2.60
19	002311	海大集团	9,535,077.04	2.59
20	300224	正海磁材	9,327,681.81	2.53
21	002414	高德红外	8,821,639.42	2.40
22	002607	亚夏汽车	8,692,915.93	2.36
23	600967	北方创业	8,667,358.48	2.35
24	300101	国腾电子	8,078,562.40	2.19

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。

2.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000858	五粮液	22,632,724.40	6.15
2	600104	上海汽车	15,692,158.34	4.26
3	601933	永辉超市	12,710,675.43	3.45
4	300127	银河磁体	12,035,340.04	3.27
5	600416	湘电股份	11,407,707.08	3.10
6	002063	远光软件	11,179,488.04	3.04
7	300183	东软载波	11,067,308.00	3.01
8	601318	中国平安	10,101,721.00	2.74
9	601678	滨化股份	9,691,716.50	2.63
10	002460	赣锋锂业	9,185,436.33	2.50
11	002129	中环股份	8,761,118.07	2.38
12	002607	亚夏汽车	8,337,874.58	2.27
13	000998	隆平高科	7,854,229.24	2.13
14	300224	正海磁材	7,840,911.42	2.13
15	300170	汉得信息	7,820,884.80	2.12
16	600967	北方创业	7,785,836.97	2.12
17	002638	勤上光电	7,018,085.71	1.91
18	002535	林州重机	6,653,112.01	1.81
19	002091	江苏国泰	5,731,348.00	1.56
20	300199	瀚宇药业	4,718,821.69	1.28

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。

2.4.3 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	374,354,046.73
卖出股票的收入(成交)总额	260,329,709.07

2.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	38,908,000.00	10.57
	其中：政策性金融债	38,908,000.00	10.57
4	企业债券	94,138,000.00	25.58
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	59,967,000.00	16.29
7	可转债	-	-

8	其他	-	-
9	合计	193,013,000.00	52.44

2.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	100217	10 国开 17	400,000	38,908,000.00	10.57
2	B80177	11 国网债 01	300,000	30,345,000.00	8.24
3	B82304	11 恒逸 MTN1	300,000	29,997,000.00	8.15
4	B82395	11 宾国资 MTN1	300,000	29,970,000.00	8.14
5	098008	09 华菱债	300,000	29,502,000.00	8.02

注：本基金报告期末持有 7 只债券。

2.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金报告期末未持有资产支持证券。

2.8 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

本基金报告期末未持有权证。

2.9 投资组合报告附注

2.9.1 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

本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内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。

2.9.2 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

本基金报告期内投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

2.9.3 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	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,452,261.36
5	应收申购款	7,065.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,709,326.38

2.9.4 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。

2.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的。

2.9.6 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。

§ 3 基金份额持有人信息**3.1 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 (%)
5,286	72,924.32	60,700,820.61	15.75	324,777,120.28	84.25

3.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	148,223.42	0.04

§ 4 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2011 年 9 月 1 日) 基金份额总额	805,601,019.15
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	3,403,836.18
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	423,526,914.44
本报告期期末基金份额总额	385,477,940.89

§ 5 重大事件揭示**5.1 基金份额持有人大会决议**

报告期内未召开基金份额持有人大会。

5.2 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无重大人事变动。

2、本基金托管人中信银行股份有限公司收到国家工商行政管理总局重新核发的《企业法人营业执照》，公司已于 2011 年 8 月 4 日完成了法定代表人变更的工商变更手续。公司的法定代表人已变更为田国立先生。

5.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

5.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

5.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金审计的原会计师事务所立信羊城会计师事务所已于 2012 年初整体加入立信会计师事务所（特殊普通合伙），经公司董事会和基金托管银行同意，公司已将负责公司基金审计事务的会计师事务所变更为立信会计师事务所（特殊普通合伙），并于 2012 年 1 月 20 日进行了公告。

本报告期内支付会计师事务所的审计费为 18,600.00 元。

5.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、基金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。

5.7 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	占当期佣金总额的比例 (%)	
国泰君安	1	142,956,968.65	22.52	9,471,200,000.00	100.00	121,512.80	23.31	
齐鲁证券	1	23,202,342.81	3.66	0.00		19,005.15	3.65	
广州证券	1	440,049,797.93	69.33	0.00		357,543.77	68.57	
方正证券	1	7,979,733.38	1.26	0.00		6,483.71	1.24	
西南证券	1	20,494,913.03	3.23	0.00		16,849.66	3.23	
两地合计	5	634,683,755.80	100.00	9,471,200,000.00	100.00	521,395.09	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。

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。

5.8 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	金鹰策略配置股票型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年9月2日
2	金鹰基金管理有限公司关于新增华夏银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年9月8日
3	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金增加江海证券为代销机构并在其开通基金定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年9月8日
4	金鹰基金管理有限公司关于调整网上交易工行和招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9月19日
5	金鹰策略配置股票型证券投资基金开放日常申购赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年9月30日
6	金鹰基金管理有限公司关于在部分代销机构开通金鹰策略配置股票型证券投资基金定投业务并参加其定投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10月10日
7	金鹰基金管理有限公司关于在浦发银行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10月10日
8	金鹰基金管理有限公司关于在网上交易开通金鹰策略配置股票型证券投资基金定投业务并参加定投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10月10日
9	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加五矿证券网上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10月10日
10	金鹰基金管理有限公司关于在直销平台开通金鹰策略配置股票型证券投资基金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10月11日
11	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金在浙商证券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10月13日
12	金鹰基金管理有限公司关于增加广发证券为金鹰策略配置股票型证券投资基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年10月21日
13	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金开通招商银行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10月24日
14	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中信万通证券为代销机构并在其开通基金定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011年11月2日
15	金鹰基金管理有限公司关于在中国银行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11月7日
16	金鹰基金管理有限公司关于在广发证券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11月28日

17	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金在广发证券开通定投业务以及参加其网上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 11 月 28 日
18	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金在平安证券开通定投业务以及参加其网上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 12 月 1 日
19	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金在万联证券开通定投业务以及参加其网上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 12 月 1 日
20	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金在东莞证券开通定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 12 月 1 日
21	金鹰基金管理有限公司关于在东莞证券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 12 月 1 日
22	金鹰基金管理有限公司关于在平安证券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 12 月 1 日
23	金鹰基金管理有限公司关于开通网上直销网上下单汇款支付开户业务及继续开展费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2011 年 12 月 21 日
24	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华夏银行基金网上银行和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 12 月 31 日

§ 6 影响投资者决策的其他重要信息

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。

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。

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2011年7月12日、21日刊登的相关搬迁公告。

4 变更会计师事务所

因负责本公司旗下基金审计事务的立信羊城会计师事务所有限公司已整体加入立信会计师事务所（特殊普通合伙），经公司第四届董事会第三次会议决议通过，并经旗下基金的相关托管银行同意，已将负责公司基金审计事务的会计师事务所变更为立信会计师事务所（特殊普通合伙）。上述事项已向监管机关备案并于2012年1月20日公告。

§ 7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准金鹰策略配置股票型证券投资基金发行及募集的文件。
- 2、《金鹰策略配置股票型证券投资基金基金合同》。
- 3、《金鹰策略配置股票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。

7.2 存放地点

广州市天河区体育西路 189 号城建大厦 22-23 层

7.3 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

2012 年 3 月 30 日