

金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金
2012 年半年度报告
2012 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：中国银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一二年八月二十八日

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 8 月 16 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 2012 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
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	6
2.4 信息披露方式	6
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	7
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合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 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合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	39
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	47
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	48
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	48
7.9 投资组合报告附注	48
8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
9 开放式基金份额变动	49
10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49

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.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....	50
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件.....	52
11 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
12 备查文件目录.....	53
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	54
12.3 查阅方式.....	54

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金
基金简称	金鹰中证技术领先指数增强
基金主代码	210007
交易代码	210007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年6月1日
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	106,907,557.08份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，跟踪指数为本基金的首要目标，力求实现对中证技术领先指数的有效跟踪；对于指数增强部分，采取适当的增强策略，力争取得超越标的指数的投资收益。
投资策略	本基金将在基金合同规定的投资范围内，采用“自上而下”的分析视角，综合考量中国宏观经济所处投资时钟的象限、国内股票市场的估值、国内债券市场收益率的期限结构、CPI与PPI变动趋势、外围主要经济体宏观经济与资本市场的运行状况等因素，分析研判股票市场、债券市场、货币市场的预期收益与风险，合理确定并适时动态地调整本基金在股票、债券、现金等金融工具上的投资比例，力争取得超越标的指数的投资收益。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为中证技术领先指数×90%+活期存款利率（税后）×10%。
风险收益特征	本基金为以跟踪指数为主，主动投资为辅的股票型证券投资基金，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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	苏文锋	唐州徽
	联系电话	020-83282627	010-66594855
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		4006135888,020-83936180	95566
传真		020-83282856	010-66594942
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	北京西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		广州市天河区体育西路 189 号城建大厦 22-23 楼	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		510620	100818
法定代表人		刘东	肖钢

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基金管理人互联网网址	http://www.gefund.com.cn
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
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

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-9,412,078.34

本期利润	268,523.65
加权平均基金份额本期利润	0.0023
本期加权平均净值利润率	0.30%
本期基金份额净值增长率	0.25%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012年6月30日)
期末可供分配利润	-26,550,621.46
期末可供分配基金份额利润	-0.2484
期末基金资产净值	80,356,935.62
期末基金份额净值	0.7516
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2012年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-24.84%

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、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；

3、期末可供分配利润，指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

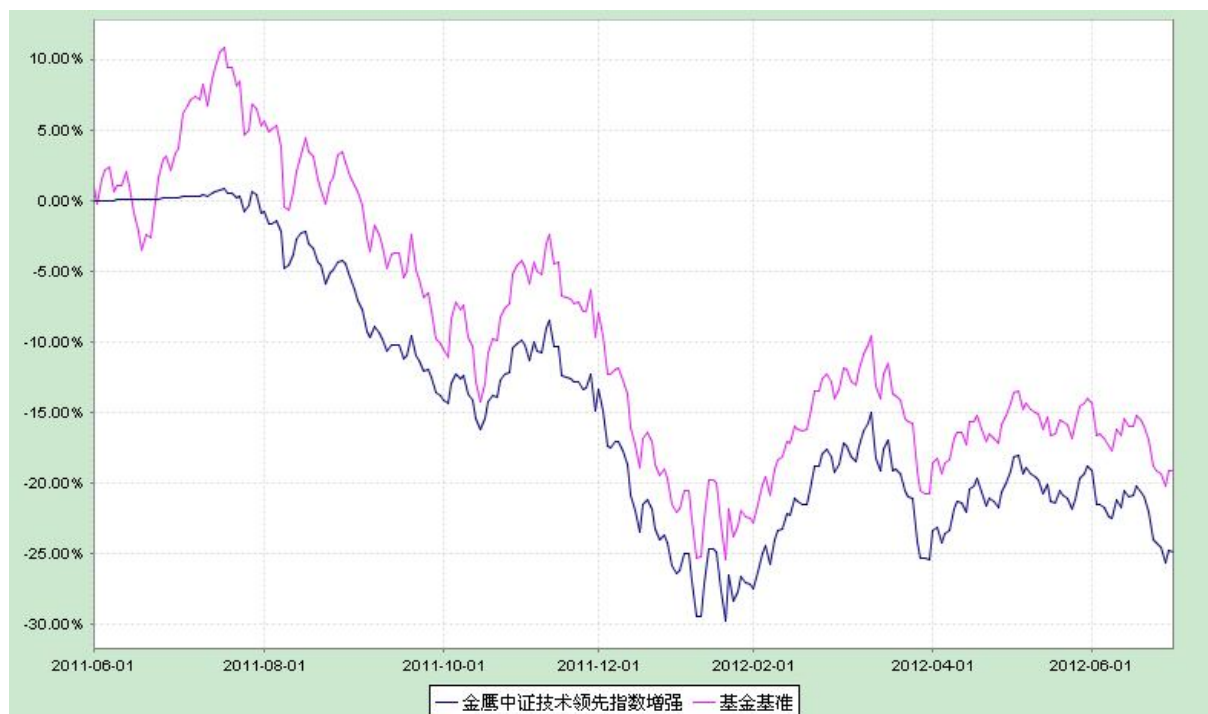
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-7.39%	1.15%	-5.91%	1.08%	-1.48%	0.07%
过去三个月	0.72%	1.12%	2.02%	1.06%	-1.30%	0.06%
过去六个月	0.25%	1.46%	1.81%	1.47%	-1.56%	-0.01%
过去一年	-25.00%	1.25%	-21.69%	1.44%	-3.31%	-0.19%
自基金合同生效起至今	-24.84%	1.20%	-19.11%	1.43%	-5.73%	-0.23%

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

金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2011 年 6 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日)



注：1、本基金于2011年6月1日成立。

2、截至报告日本基金的各项投资比例符合本基金基金合同规定的各项比例，即股票资产占基金资产净值的比例为85%~95%，其中，不低于80%的基金净资产将投资于中证技术领先指数的成分股和备选成分股；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%~15%，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技术领先指数×90%+活期存款利率（税后）×10%。

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：基金管理部、研究发展部、集中交易部、金融工程部、产品研发部、固定收益投资部、市场拓展部、机构客户部、专户投资部、运作保障部、监察稽核部、综合管理部。基金管理部负责根据投资决策委员会制定的投资决策进行基金投资；研究发展部负责宏观经济、行业、上市公司研究和投资策略研究；集中交易部负责完成基金经理投资指令；金融工程部负责金融工程研究、数量分析工作；产品研发部负责基金新产品、新业务的研究和设计工作；固定收益投资部负责固定收益证券以及债券、货币市场的研究和投资管理；市场拓展部负责市场营销策划、基金销售与渠道管理、客户服务等业务；机构客户部负责机构客户的开发、维护与管理；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 2012 年 6 月 30 日，公司共管理金鹰成份股优选证券投资基金、金鹰中小盘精选证券投资基金、金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金、金鹰行业优势股票型证券投资基金、金鹰稳健成长股票型证券投资基金、金鹰主题优势股票型证券投资基金、金鹰保本混合型证券投资基金、金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金、金鹰策略配置股票型证券投资基金、金鹰持久回报分级债券型证券投资基金、金鹰核心资源股票型证券投资基金以及金鹰中证 500 指数分级证券投资基金 12 只开放式基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
朱丹	基金经理	2011-06-01	-	6 年	朱丹女士，金融学硕士，证券从业经历 6 年，具备基金从业资格，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、金鹰中小盘精选证券投资基金以及金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
张永东	金融工程部总监	2012-02-16	-	9 年	张永东，工学博士，FRM（金融风险管理师），中山大学数学与计算科学学院兼职研究生导师，曾任广发证券和中山大学联合博士后工作站研究人员、广发证券发展研究中心金融工程组负责人、华南理工大学副教授、硕士生导师以及广发基金、天治基金、益民基金金融工程负责人等职。2010 年 7 月加入金鹰基金管理有限公司，现任金融工程部总监、本基金以及金鹰中证 500 指数分级证券投资基金基金经理。

注：1、任职日期和离任日期指公司公告聘任或解聘日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定；

3、本基金于2012年8月1日免去朱丹女士担任基金经理。本基金目前由另一基金经理张永东先生单独管理。变更基金经理的公告于2012年8月1日披露。

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、《金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份

额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无出现重大违法违规或违反基金合同的行为，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2012 年上半年，由于同时受到海外欧债问题、美国经济复苏乏力、国内经济持续下行等因素对市场的抑制作用以及稳增长的政策基调对市场的支撑作用，A 股市场两起两落、走势曲折，期末上证指数几乎回到年初水平，市场呈现明显的结构分化行情，其中，在行业表现上，房地产、有色金属、食品饮料、餐饮旅游、医药生物等行业季度涨幅居前，信息服务、黑色金属、采掘、信息设备、农林牧渔等行业表现较差；在风格特征上，高市净率组合、中市盈率组合、高价股组合显著跑赢其它风格组合。

在报告期内，本基金年化跟踪误差 2.00% 控制在限定范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值为 0.7516 元，累计净值 0.7516 元；本报告期份额净值增长率 0.25%，同期业绩比较基准增长率为 1.81%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为，在经济潜在增速持续放缓、总供应收缩和总需求不足的宏观背景下，市场的机会更多是结构性的而非趋势性的，同时在稳增长的政策基调下，继续出台结构化政策的概率较大，因此我们判断下半年市场可能继续维持震荡格局，在经济转型和市场寻底的过程中，结构性分化行情将持续。

本基金将继续坚持采用量化策略进行指数增强和风险管理，适时对投资组合进行再平衡调整，在控制跟踪误差在限定范围内的同时，力争获取适度的增强收益。

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，公司估值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。

本报告期内,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

本基金本报告期没有实施利润分配。

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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了义务。

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

本报告期内，本托管人根据《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，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金

报告截止日：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	5,203,723.64	4,087,571.71
结算备付金		279,959.32	1,018,156.68
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	75,400,088.78	85,546,978.05
其中：股票投资		75,400,088.78	85,546,978.05
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	6.4.7.3	-	8,000,000.00
应收证券清算款		-	2,717.78
应收利息	6.4.7.4	1,045.60	2,299.49
应收股利		4,577.68	-
应收申购款		33,913.31	6,956.03
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		80,923,308.33	98,664,679.74
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 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		-	-
应付赎回款		12,788.92	1,454.94
应付管理人报酬		68,851.72	89,115.55
应付托管费		10,327.76	13,367.34
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.5	114,344.83	71,942.44
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	360,059.48	191,005.49
负债合计		566,372.71	366,885.76
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.7	106,907,557.08	131,108,302.99
未分配利润	6.4.7.8	-26,550,621.46	-32,810,509.01
所有者权益合计		80,356,935.62	98,297,793.98
负债和所有者权益总计		80,923,308.33	98,664,679.74

注：1、本基金合同自2011年6月1日生效，至本报告期末基金成立未满三年；

2、截至报告期末2012年6月30日，基金份额净值0.7516元，基金份额总额106,907,557.08份。

6.2 利润表

会计主体：金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金

本报告期：2012年1月1日至2012年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012年1月1日至 2012年6月30日	上年度可比期间 2011年6月1日(基 金合同生效日)至 2011年6月30日
一、收入		1,599,835.01	-
1.利息收入		52,275.52	-
其中：存款利息收入	6.4.7.9	30,748.50	-
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		21,527.02	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-8,161,078.90	-
其中：股票投资收益	6.4.7.1 0	-8,775,986.27	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.1 2	614,907.37	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 3	9,680,601.99	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 4	28,036.40	-
减：二、费用		1,331,311.36	-
1. 管理人报酬		452,039.68	-
2. 托管费		67,805.98	-
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.1 5	523,939.85	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.1 6	287,525.85	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		268,523.65	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		268,523.65	-

注：本基金合同自2011年6月1日生效，故无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金

本报告期：2012年1月1日至2012年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 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)	131,108,302.99	-32,810,509.01	98,297,793.98
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	268,523.65	268,523.65
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)	-24,200,745.91	5,991,363.90	-18,209,382.01
其中：1.基金申购款	6,058,606.01	-1,220,655.92	4,837,950.09
2.基金赎回款	-30,259,351.92	7,212,019.82	-23,047,332.10
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)	106,907,557.08	-26,550,621.46	80,356,935.62
项目	上年度可比期间 2011 年 6 月 1 日(基金合同生效日)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)	-	-	-
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：本基金合同自2011年6月1日生效，故无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金(简称"本基金")，经中国证券监督管理委员会(简称"中国证监会")证监基金字[2011]342号文《关于同意金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金备案确认的函》批准，于2011年6月1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431,551,810.02份基金份额。本基金募集期间自2011年4月26日起至2011年5月27日止，净认购额431,530,928.80元，认购资金在认购期间的银行利息20,881.22元折算成基金资产。上述资金已于2011年6月1日全额划入本基金在基金托管人中国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，基金托管人为中国银行股份有限公司(简称："中国银行")。

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

本基金本半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2012年6月30日的财务状况以及2012年上半年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。

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

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。

6.4.4.2 记账本位币

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。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成一个单位的金融资产（负债），并形成其他单位的金融负债（资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

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

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

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

(2) 金融负债分类

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

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投

资收益，其中包括同时结转的公允价值变动收益。

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

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

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

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

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

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

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

(2) 债券投资

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

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

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

卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券投资收益。

卖出未上市债券和银行间同业市场交易的债券于成交日确认债券投资收益。

卖出债券的成本按移动加权平均法结转。

(3) 权证投资

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

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

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

(4) 分离交易可转债

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

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算。

(5) 回购协议

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

6.4.4.5 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起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。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

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

6.4.4.8 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。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在"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)"。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在"损益平准金"科目中核算，并于期末全额转入"未分配利润/(累计亏损)"。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

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

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

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

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

8、股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

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

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

- 1、基金管理费按前一日基金资产净值的 1.0% 的年费率逐日计提；
- 2、基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

- 1、基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；选择红利再投资的，现金红利则按除权日经除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；
- 2、每一基金份额享有同等分配权；
- 3、基金当期收益先弥补前期亏损后，方可进行当期收益分配；
- 4、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，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；
- 5、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多 12 次；每次基金收益分配比例不得低于期末可供分配利润的 20%。基金的收益分配比例以期末可供分配利润为基准计算，期末可供分配利润以期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数为准。基金合同生效不满三个月，收益可不分配；
- 6、基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日；
- 7、投资者的现金红利和分红再投资形成的基金份额均保留到小数点后第 2 位，小数点后第 3 位开始舍去，舍去部分归基金资产；
- 8、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 外币交易

本基金本报告期内无外币交易。

6.4.4.13 分部报告

本基金本报告期内无分部报告。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无其他重要的会计政策和会计估计。

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

本基金本报告期内无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无差错更正。

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 2012年6月30日
活期存款	5,203,723.64
定期存款	-
其他存款	-
合计	5,203,723.64

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2012年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		85,612,937.42	75,400,088.78	-10,212,848.64
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		85,612,937.42	75,400,088.78	-10,212,848.64

6.4.7.3 买入返售金融资产

6.4.7.3.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末买入返售金融资产无余额。

6.4.7.3.2 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。

6.4.7.4 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	928.41
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	113.40
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	3.79
其他	-
合计	1,045.60

6.4.7.5 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	114,344.83
银行间市场应付交易费用	-
合计	114,344.83

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	33.54
预提审计费	60,847.82
预提信息披露费	199,178.12
指数使用费	100,000.00
合计	360,059.48

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	131,108,302.99	131,108,302.99
本期申购	6,058,606.01	6,058,606.01
本期赎回（以“-”号填列）	-30,259,351.92	-30,259,351.92
本期末	106,907,557.08	106,907,557.08

6.4.7.8 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	-13,874,703.56	-18,935,805.45	-32,810,509.01
本期利润	-9,412,078.34	9,680,601.99	268,523.65
本期基金份额交易产生的变动数	3,716,147.33	2,275,216.57	5,991,363.90
其中：基金申购款	-966,003.31	-254,652.61	-1,220,655.92
基金赎回款	4,682,150.64	2,529,869.18	7,212,019.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-19,570,634.57	-6,979,986.89	-26,550,621.46

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	27,125.30
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	3,619.41
其他	3.79
合计	30,748.50

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	177,542,304.53
减：卖出股票成本总额	186,318,290.80
买卖股票差价收入	-8,775,986.27

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期内没有实施债券投资。

6.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
股票投资产生的股利收益	614,907.37
基金投资产生的股利收益	-
合计	614,907.37

6.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
1.交易性金融资产	9,680,601.99
——股票投资	9,680,601.99
——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	9,680,601.99

6.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
基金赎回费收入	28,010.83
转换费收入	25.57
合计	28,036.40

6.4.7.15 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2012年1月1日至2012年6月30日
交易所市场交易费用	523,939.85
银行间市场交易费用	-
合计	523,939.85

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2012年1月1日至2012年6月30日
审计费用	27,847.82
信息披露费	149,178.12
银行汇划费用	1,499.91
银行间市场账户维护费	9,000.00
指数使用费	100,000.00
合计	287,525.85

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，本基金没有须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截止本财务报告批注报出日，本基金没有重大须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

本基金本报告期不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。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
广州证券有限责任公司(“广州证券”)	基金管理人股东、基金代销机构
金鹰基金管理有限公司	基金发起人、管理人
中国银行股份有限公司	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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年6月1日（基金合同生效日）至2011年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广州证券	58,390,081.98	16.98%	-	-

注：本基金合同自2011年6月1日起生效，故无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.2 权证交易

- 1、本基金合同自2011年6月1日起生效，故无上年度可比期间数据；
- 2、本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

- 1、本基金合同自2011年6月1日起生效，故无上年度可比期间数据；
- 2、本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

- 1、本基金合同自2011年6月1日起生效，故无上年度可比期间数据；
- 2、本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广州证券	48,153.76	17.11%	38,674.30	33.82%
关联方名称	上年度可比期间 2011年6月1日（基金合同生效日）至2011年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广州证券	-	-	-	-

注：1、本基金合同自2011年6月1日起生效，故无上年度可比期间数据；

- 2、上述佣金按市场佣金率计算，并以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示；
- 3、向关联方支付的交易佣金采用公允的交易佣金比率计算。关联方席位租用合同还规定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。

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 2012年1月1日至2012年 6月30日	上年度可比期间 2011年6月1日（基金合 同生效日）至2011年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	452,039.68	-
其中：支付销售机构的客户维护 费	206,916.24	-

注：1、本基金合同自2011年6月1日起生效，故无上年度可比期间数据；

2、基金管理费按前一日基金资产净值的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

3、基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年 6月30日	上年度可比期间 2011年6月1日（基金合 同生效日）至2011年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	67,805.98	-

注：1、本基金合同自2011年6月1日起生效，故无上年度可比期间数据；

2、基金托管人的基金托管费按基金财产净值的0.15%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金财产净值

3、基金托管费每日计提，按月支付。基金管理人应于次月首日起5个工作日内做出划付指令；基金托管人应在次月首日起10个工作日内完成复核，并从该基金财产中一次性支

付托管费给该基金托管人。

6.4.10.2.3 销售服务费

- 1、本基金合同自2011年6月1日起生效，故无上年度可比期间数据；
- 2、本基金报告期内没有应支付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

- 1、本基金合同自2011年6月1日起生效，故无上年度可比期间数据；
- 2、本基金报告期内没有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

本基金报告期及上年度可比期间内基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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

本报告期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 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年6月1日（基金合同生效日） 至2011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
中国银行	5,203,723.64	27,125.30	-	-
合计	5,203,723.64	27,125.30	-	-

注：1、本基金合同自2011年6月1日起生效，故无上年度可比期间数据；
2、本基金清算备付金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算公司等结算账户，2012年6月30日期末余额279,959.32元，清算备付金利息收入3,619.41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

- 1、本基金合同自2011年6月1日起生效，故无上年度可比期间数据；
- 2、本基金报告期内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

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内没有实施利润分配。

6.4.12 期末（2012 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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600499	科达机电	2012-06-20	证监会就公司向特定对象发行股份购买资产并募集配套资金事项进行审核，按照相关规定，待审核结果公布后复牌。	10.28	2012-07-02	10.11	40,200	430,120.38	413,256.00	-

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

截至本报告期末2012年6月30日，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

截至本报告期末 2012 年 6 月 30 日，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。

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。

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

6.4.13.3 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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012年6月 30日	1个月以 内	6个月以 内	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	-	-	5,203,723.64	-	-	-	5,203,723.64

结算备付金	-	-	279,959.32	-	-	-	279,959.32
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-	75,400,088.78	75,400,088.78
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	1,045.60	1,045.60
应收股利	-	-	-	-	-	4,577.68	4,577.68
应收申购款	-	-	-	-	-	33,913.31	33,913.31
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	-	-	5,483,682.96	-	-	75,439,625.37	80,923,308.33
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	12,788.92	12,788.92
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	68,851.72	68,851.72
应付托管费	-	-	-	-	-	10,327.76	10,327.76
应付交易费用	-	-	-	-	-	114,344.83	114,344.83
其他负债	-	-	-	-	-	360,059.48	360,059.48
负债总计	-	-	-	-	-	566,372.71	566,372.71
利率敏感度缺口	-	-	5,483,682.96	-	-	74,873,252.66	80,356,935.62
上年度末 2011年12月 31日	1个月以 内	6个月以 内	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	-	-	4,087,571.71	-	-	-	4,087,571.71
结算备付金	-	-	1,018,156.68	-	-	-	1,018,156.68
交易性金融资产	-	-	-	-	-	85,546,978.05	85,546,978.05
应收证券清	-	-	-	-	-	2,717.78	2,717.78

算款							
应收利息	-	-	-	-	-	2,299.49	2,299.49
应收申购款	-	-	-	-	-	6,956.03	6,956.03
买入返售金 融资产	-	-	8,000,000.00	-	-	-	8,000,000.00
资产总计	-	-	13,105,728.39	-	-	85,558,951.35	98,664,679.74
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,454.94	1,454.94
应付管理人 报酬	-	-	-	-	-	89,115.55	89,115.55
应付托管费	-	-	-	-	-	13,367.34	13,367.34
应付交易费 用	-	-	-	-	-	71,942.44	71,942.44
其他负债	-	-	-	-	-	191,005.49	191,005.49
负债总计	-	-	-	-	-	366,885.76	366,885.76
利率敏感度 缺口	-	-	13,105,728.39	-	-	85,192,065.59	98,297,793.98

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	-		
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）	
		本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
	1.利率上升25个基点	-	-
	2.利率下降25个基点	-	-

注：注：截至本报告期末本基金无债券投资。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2012 年 6 月 30 日		2011 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	75,400,088.78	93.83	85,546,978.05	87.03
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	75,400,088.78	93.83	85,546,978.05	87.03

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	市场其他变量保持不变，只有业绩比较基准所对应的市场组合价格发生合理、可能的变动；		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币）	
		本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
	业绩比较基准变动 +5%	3,957,142.48	3,234,522.08
	业绩比较基准变动 -5%	-3,957,142.48	-3,234,522.08

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	75,400,088.78	93.17
	其中：股票	75,400,088.78	93.17
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	5,483,682.96	6.78
6	其他各项资产	39,536.59	0.05
7	合计	80,923,308.33	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	58,822,277.99	73.20
C0	食品、饮料	706,490.00	0.88
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	2,239,711.20	2.79
C5	电子	7,860,427.28	9.78
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	33,973,037.97	42.28
C8	医药、生物制品	13,033,671.54	16.22
C99	其他制造业	1,008,940.00	1.26
D	电力、煤气及水的生产和供应业	397,602.00	0.49
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	12,326,478.77	15.34
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-

K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	1,455,183.00	1.81
	合计	73,001,541.76	90.85

7.2.2 积极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	采掘业	-	-
C	制造业	1,257,615.02	1.57
C0	食品、饮料	-	-
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	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	709,424.22	0.88
C8	医药、生物制品	548,190.80	0.68
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	1,140,932.00	1.42
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	2,398,547.02	2.98

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

7.3.1 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	002106	莱宝高科	43,600	875,052.00	1.09
2	002007	华兰生物	34,000	835,720.00	1.04
3	000423	东阿阿胶	20,089	803,760.89	1.00
4	300050	世纪鼎利	72,000	803,520.00	1.00
5	002153	石基信息	31,200	800,280.00	1.00
6	002252	上海莱士	58,456	789,740.56	0.98
7	600066	宇通客车	34,630	777,789.80	0.97
8	600468	百利电气	61,400	768,114.00	0.96
9	002121	科陆电子	86,500	766,390.00	0.95
10	600118	中国卫星	60,396	760,385.64	0.95
11	300002	神州泰岳	42,100	759,063.00	0.94
12	000518	四环生物	169,700	756,862.00	0.94
13	300082	奥克股份	59,100	751,752.00	0.94
14	002048	宁波华翔	107,000	750,070.00	0.93
15	600143	金发科技	124,960	746,011.20	0.93
16	600517	置信电气	64,600	740,962.00	0.92
17	002093	国脉科技	136,400	737,924.00	0.92
18	000623	吉林敖东	42,380	734,869.20	0.91
19	002179	中航光电	53,164	729,410.08	0.91
20	600770	综艺股份	63,400	727,832.00	0.91
21	002028	思源电气	65,600	727,504.00	0.91
22	600584	长电科技	151,500	727,200.00	0.90
23	600151	航天机电	112,200	725,934.00	0.90
24	600742	一汽富维	36,800	719,440.00	0.90
25	002008	大族激光	113,700	714,036.00	0.89
26	600866	星湖科技	133,300	706,490.00	0.88
27	600435	北方导航	90,200	706,266.00	0.88
28	600523	贵航股份	74,900	703,311.00	0.88
29	600183	生益科技	136,200	701,430.00	0.87
30	300077	国民技术	34,200	694,602.00	0.86

31	002123	荣信股份	60,900	692,433.00	0.86
32	600460	士兰微	156,400	691,288.00	0.86
33	600765	中航重机	89,300	688,503.00	0.86
34	601218	吉鑫科技	75,053	684,483.36	0.85
35	000650	仁和药业	78,600	674,388.00	0.84
36	600184	光电股份	38,670	665,897.40	0.83
37	000559	万向钱潮	131,500	661,445.00	0.82
38	002594	比亚迪	33,200	659,352.00	0.82
39	002230	科大讯飞	33,300	656,010.00	0.82
40	002006	精功科技	61,200	651,168.00	0.81
41	002073	软控股份	69,900	585,762.00	0.73
42	002475	立讯精密	16,064	474,691.20	0.59
43	002038	双鹭药业	14,200	457,240.00	0.57
44	002376	新北洋	23,500	454,020.00	0.57
45	600594	益佰制药	22,900	453,420.00	0.56
46	002287	奇正藏药	24,500	450,065.00	0.56
47	600572	康恩贝	42,300	449,649.00	0.56
48	300039	上海凯宝	19,939	444,639.70	0.55
49	600535	天士力	10,100	441,572.00	0.55
50	002334	英威腾	28,038	439,635.84	0.55
51	002410	广联达	17,900	439,266.00	0.55
52	002275	桂林三金	30,600	432,990.00	0.54
53	600276	恒瑞医药	14,980	430,075.80	0.54
54	002437	誉衡药业	21,300	421,740.00	0.52
55	000661	长春高新	8,900	420,614.00	0.52
56	002424	贵州百灵	25,087	419,203.77	0.52
57	300068	南都电源	31,500	413,910.00	0.52
58	600268	国电南自	46,300	413,459.00	0.51
59	600499	科达机电	40,200	413,256.00	0.51
60	002152	广电运通	25,000	412,500.00	0.51
61	300142	沃森生物	10,754	411,663.12	0.51
62	002223	鱼跃医疗	27,670	410,899.50	0.51
63	600072	中船股份	22,900	406,704.00	0.51
64	002022	科华生物	37,400	405,790.00	0.50
65	600869	三普药业	17,200	403,340.00	0.50
66	000823	超声电子	28,900	403,155.00	0.50

67	600196	复星医药	39,000	402,090.00	0.50
68	300122	智飞生物	15,700	400,350.00	0.50
69	600718	东软集团	46,400	399,504.00	0.50
70	300003	乐普医疗	30,200	398,942.00	0.50
71	002393	力生制药	12,800	397,696.00	0.49
72	601179	中国西电	99,900	397,602.00	0.49
73	002011	盾安环境	37,100	395,115.00	0.49
74	000503	海虹控股	67,700	393,337.00	0.49
75	002249	大洋电机	42,250	392,925.00	0.49
76	002309	中利科技	40,104	390,612.96	0.49
77	601877	正泰电器	25,500	389,130.00	0.48
78	000738	中航动控	38,800	388,000.00	0.48
79	600271	航天信息	20,500	387,655.00	0.48
80	600588	用友软件	25,400	387,604.00	0.48
81	600161	天坛生物	27,000	385,290.00	0.48
82	600261	阳光照明	32,270	384,013.00	0.48
83	000927	一汽夏利	52,247	382,970.51	0.48
84	600195	中牧股份	22,400	382,144.00	0.48
85	600388	龙净环保	15,400	380,996.00	0.47
86	600067	冠城大通	68,400	380,988.00	0.47
87	002463	沪电股份	85,200	379,992.00	0.47
88	600685	广船国际	25,600	377,600.00	0.47
89	000768	西飞国际	48,100	377,585.00	0.47
90	002440	闰土股份	26,000	377,520.00	0.47
91	002396	星网锐捷	25,200	377,496.00	0.47
92	000572	海马汽车	115,400	376,204.00	0.47
93	600835	上海机电	42,700	372,771.00	0.46
94	000997	新大陆	36,700	372,505.00	0.46
95	002315	焦点科技	10,750	372,487.50	0.46
96	601777	力帆股份	54,500	372,235.00	0.46
97	002449	国星光电	44,700	371,457.00	0.46
98	002242	九阳股份	50,400	370,944.00	0.46
99	000800	一汽轿车	34,000	369,240.00	0.46
100	600100	同方股份	43,700	367,954.00	0.46
101	600601	方正科技	146,300	367,213.00	0.46
102	002534	杭锅股份	20,400	366,792.00	0.46

103	600879	航天电子	46,500	366,420.00	0.46
104	002194	武汉凡谷	53,800	365,302.00	0.45
105	600602	仪电电子	86,500	365,030.00	0.45
106	600352	浙江龙盛	63,600	364,428.00	0.45
107	000021	长城开发	67,600	363,688.00	0.45
108	601616	广电电气	80,240	363,487.20	0.45
109	002362	汉王科技	32,757	363,275.13	0.45
110	601519	大智慧	70,200	362,934.00	0.45
111	600006	东风汽车	115,000	362,250.00	0.45
112	000528	柳 工	29,100	361,131.00	0.45
113	002097	山河智能	41,600	361,088.00	0.45
114	002050	三花股份	32,700	359,373.00	0.45
115	601106	中国一重	113,700	359,292.00	0.45
116	600741	华域汽车	40,000	358,800.00	0.45
117	300134	大富科技	31,000	358,050.00	0.45
118	000951	中国重汽	29,300	355,702.00	0.44
119	601311	骆驼股份	38,140	354,320.60	0.44
120	600380	健康元	72,300	353,547.00	0.44
121	600198	大唐电信	35,000	352,450.00	0.44
122	600651	飞乐音响	49,900	352,294.00	0.44
123	000550	江铃汽车	16,500	352,275.00	0.44
124	002122	天马股份	54,500	352,070.00	0.44
125	600416	湘电股份	53,000	351,920.00	0.44
126	600550	天威保变	40,200	350,946.00	0.44
127	000541	佛山照明	40,600	350,378.00	0.44
128	300102	乾照光电	29,000	350,320.00	0.44
129	600893	航空动力	26,900	349,969.00	0.44
130	600110	中科英华	90,100	349,588.00	0.44
131	601268	二重重装	57,000	349,410.00	0.43
132	601369	陕鼓动力	37,700	349,102.00	0.43
133	600038	哈飞股份	20,900	348,821.00	0.43
134	600804	鹏博士	58,700	348,678.00	0.43
135	002283	天润曲轴	42,300	345,591.00	0.43
136	600580	卧龙电气	68,900	345,189.00	0.43
137	600312	平高电气	49,200	344,400.00	0.43
138	601717	郑煤机	29,660	344,056.00	0.43

139	600482	风帆股份	40,100	342,053.00	0.43
140	600316	洪都航空	25,900	337,477.00	0.42
141	600418	江淮汽车	62,300	337,043.00	0.42
142	600522	中天科技	39,380	335,911.40	0.42
143	600169	太原重工	95,550	335,380.50	0.42
144	600805	悦达投资	35,800	334,014.00	0.42
145	600582	天地科技	23,100	333,795.00	0.42
146	002405	四维图新	27,840	332,409.60	0.41
147	000581	威孚高科	12,100	331,540.00	0.41
148	000680	山推股份	56,550	330,817.50	0.41
149	002480	新筑股份	32,200	330,694.00	0.41
150	600330	天通股份	47,000	330,410.00	0.41
151	002430	杭氧股份	25,940	313,614.60	0.39
152	002498	汉缆股份	29,500	313,585.00	0.39
153	600406	国电南瑞	10,750	200,917.50	0.25
154	000066	长城电脑	47,600	187,544.00	0.23
155	300124	汇川技术	7,456	169,996.80	0.21
156	601126	四方股份	10,200	149,226.00	0.19
157	002308	威创股份	14,200	139,870.00	0.17
158	300105	龙源技术	4,360	118,984.40	0.15
159	002281	光迅科技	5,100	114,240.00	0.14
160	002603	以岭药业	2,730	75,211.50	0.09
161	600498	烽火通信	2,200	58,322.00	0.07

注：此表为指数投资部分的股票投资明细，其中，备选成份股纳入此表统计列示。

7.3.2 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	002603	以岭药业	12,788	352,309.40	0.44
2	600498	烽火通信	11,900	315,469.00	0.39
3	300105	龙源技术	11,124	303,573.96	0.38
4	002308	威创股份	27,300	268,905.00	0.33
5	601126	四方股份	15,822	231,475.86	0.29
6	002281	光迅科技	9,300	208,320.00	0.26

7	000650	仁和药业	22,830	195,881.40	0.24
8	600406	国电南瑞	10,200	190,638.00	0.24
9	300124	汇川技术	7,648	174,374.40	0.22
10	000066	长城电脑	40,000	157,600.00	0.20

注：由于本指数基金还兼具积极投资，按照要求于此表中列示积极投资的前五名股票明细。

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	002056	横店东磁	1,894,651.08	1.93
2	600435	北方导航	1,871,317.94	1.90
3	600460	士兰微	1,851,451.33	1.88
4	000518	四环生物	1,769,437.19	1.80
5	002028	思源电气	1,765,615.50	1.80
6	000623	吉林敖东	1,726,851.00	1.76
7	002073	软控股份	1,715,924.63	1.75
8	601311	骆驼股份	1,696,598.90	1.73
9	600072	中船股份	1,660,114.20	1.69
10	002594	比亚迪	1,641,074.42	1.67
11	002038	双鹭药业	1,640,484.53	1.67
12	002129	中环股份	1,572,981.35	1.60
13	600866	星湖科技	1,482,168.95	1.51
14	600143	金发科技	1,467,177.07	1.49
15	000823	超声电子	1,457,598.34	1.48
16	600468	百利电气	1,446,973.45	1.47
17	002480	新筑股份	1,436,598.52	1.46
18	600765	中航重机	1,412,727.08	1.44
19	600690	青岛海尔	1,411,003.31	1.44
20	600252	中恒集团	1,408,848.40	1.43

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	002056	横店东磁	2,391,777.14	2.43
2	002129	中环股份	2,117,296.30	2.15
3	600436	片仔癀	1,961,299.51	2.00
4	002168	深圳惠程	1,896,956.40	1.93
5	600690	青岛海尔	1,851,705.58	1.88
6	600252	中恒集团	1,825,171.70	1.86
7	000636	风华高科	1,811,980.58	1.84
8	600072	中船股份	1,760,258.57	1.79
9	000970	中科三环	1,751,929.89	1.78
10	002038	双鹭药业	1,716,823.65	1.75
11	600410	华胜天成	1,680,278.66	1.71
12	000823	超声电子	1,599,974.21	1.63
13	002396	星网锐捷	1,598,229.98	1.63
14	002353	杰瑞股份	1,594,690.93	1.62
15	600435	北方导航	1,568,091.88	1.60
16	600067	冠城大通	1,562,976.40	1.59
17	002063	远光软件	1,503,006.71	1.53
18	600166	福田汽车	1,498,111.11	1.52
19	002376	新北洋	1,497,280.11	1.52
20	002249	大洋电机	1,466,292.33	1.49

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	166,490,799.54
卖出股票的收入（成交）总额	177,542,304.53

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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

本基金本报告期末未持有权证投资。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

7.9.3 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	4,577.68
4	应收利息	1,045.60
5	应收申购款	33,913.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	39,536.59

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

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
2,040	52,405.67	6,022,745.69	5.63%	100,884,811.39	94.37%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	5,328.13	0.005%

注：1、截至本报告期末，本基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0。

2、截至本报告期末，本基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年6月1日）基金份额总额	431,551,810.02
本报告期期初基金份额总额	131,108,302.99
本报告期基金总申购份额	6,058,606.01
减：本报告期基金总赎回份额	30,259,351.92
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	106,907,557.08

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会，无会议决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

- 1、本报告期基金管理人无重大人事变动；
- 2、本报告期基金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

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金报告期内没有改变基金投资策略。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

因负责本公司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），并已经完成相关变更登记手续，经公司第四届董事会第三次会议决议通过，并经基金托管银行同意，本报告期公司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 日进行了公告。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

本报告期基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰联合	1	112,860,569.26	32.81%	91,700.08	32.58%	-
国信证券	1	63,099,946.76	18.34%	50,630.81	17.99%	-
广州证券	1	58,390,081.98	16.98%	48,153.76	17.11%	-
中金公司	1	49,709,776.89	14.45%	42,252.98	15.01%	-
国元证券	1	20,827,124.19	6.06%	16,611.64	5.90%	-
华创证券	1	20,662,538.63	6.01%	17,260.48	6.13%	-
招商证券	1	4,789,642.45	1.39%	3,891.70	1.38%	-
国金证券	1	4,557,953.89	1.33%	3,733.06	1.33%	-
世纪证券	1	2,924,153.10	0.85%	2,342.83	0.83%	-
平安证券	2	2,664,856.52	0.77%	2,165.24	0.77%	-
安信证券	1	2,178,902.91	0.63%	1,709.09	0.61%	-
光大证券	1	1,106,419.09	0.32%	873.78	0.31%	-
英大证券	1	191,683.00	0.06%	153.55	0.05%	-
中投证券	1	-	-	-	-	-

东海证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中银证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字[1998]29号）的有关规定要求及金鹰行业优势证券投资基金基金合同规定的选择券商的标准，选择券商租用其席位。本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的专用交易单元。本基金专用交易单元的选择标准如下：

- (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、个股分析报告及丰富全面的信息服务；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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰联合	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	41,700,000.00	39.01%	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	40,900,000.00	38.26%	-	-

国元证券	-	-	7,600,000.00	7.11%	-	-
华创证券	-	-	10,200,000.00	9.54%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	3,000,000.00	2.81%	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	3,500,000.00	3.27%	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中银证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

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》	2012-01-04
2	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》	2012-01-06
3	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金新增国海证券为代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2012-01-11
4	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金变更会计师事务所的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2012-01-20
5	金鹰基金关于增加中信证券（浙江）为代销机构以	《中国证券报》、《上	2012-02-16

	及开通基金定投业务的公告	海证券报》、《证券时报》	
6	金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金关于增聘基金经理的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2012-02-16
7	关于网上直销增加通联支付第三方支付业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2012-03-01
8	关于继续参加工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2012-04-06
9	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》	2012-04-20
10	金鹰基金管理有限公司关于网站、网上直销、客服电话暂停服务的通知	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2012-04-28
11	关于网上直销中国农业银行支付渠道升级维护暂停服务的通知	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2012-05-18
12	关于旗下部分基金增加众禄基金为代销机构并开通定投、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2012-06-06
13	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华龙证券为代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2012-06-13
14	金鹰基金管理有限公司关于旗下开放式基金资产净值等的公告	《证券时报》	2012-06-30

11 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资组决策的其他重要信息。

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中证技术领先指数增强型证券投资基金发行及募集的文件。

- 2、《金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金基金合同》。
- 3、《金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金托管协议》。
- 4、金鹰基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程。
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照。
- 6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、季度报告、半年度报告、更新的招募说明书及其他临时公告。

12.2 存放地点

广州市天河区体育西路 189 号城建大厦 22-23 层

12.3 查阅方式

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

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

金鹰基金管理有限公司
二〇一二年八月二十八日