

# 金鹰主题优势股票型证券投资基金

## 2012 年半年度报告摘要

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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 8 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	金鹰主题优势股票
基金主代码	210005
交易代码	210005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月20日
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,094,208,923.53份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	以追求资本可持续增值为目的，以深入的基本面分析为基础，把握主题投资的脉络，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	本基金坚持“自上而下”为主、“自下而上”为辅的投资视角，在实际投资过程中充分体现“主题优势”这个核心理念，以主题情景分析法把握经济发展不同阶段的主题投资节奏，优选并深挖不同阶段热点主题投资机会，优化资产配置，降低市场波动的冲击，扩大投资收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×75%+中信标普国债指数收益率×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高收益、高风险品种。

### 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	中国工商银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	苏文锋	赵会军
	联系电话	020-83282627	010-66105799
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-6135-888, 020-83936180	95588
传真		020-83282856	010-66105798

## 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告摘要的管理人互联网网址	<a href="http://www.gefund.com.cn">http://www.gefund.com.cn</a>
基金半年度报告备置地点	广州市天河区体育西路 189 号城建大厦 22-23 层

## 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	-129,678,741.54
本期利润	6,709,530.84
加权平均基金份额本期利润	0.0059
本期基金份额净值增长率	0.62%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.3481
期末基金资产净值	713,317,512.36
期末基金份额净值	0.652

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；

2、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。

### 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

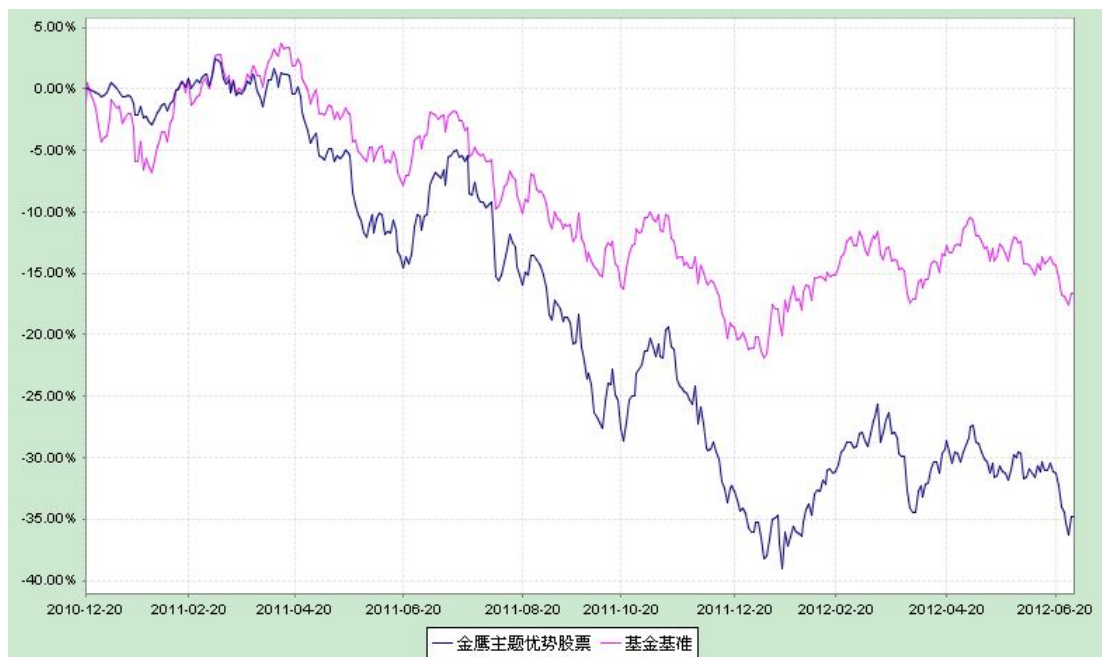
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-7.39%	1.26%	-4.78%	0.82%	-2.61%	0.44%
过去三个月	-0.46%	1.21%	0.57%	0.84%	-1.03%	0.37%
过去六个月	0.62%	1.45%	4.39%	0.99%	-3.77%	0.46%
过去一年	-27.23%	1.46%	-13.34%	1.01%	-13.89%	0.45%
自基金合同生效起至今	-34.80%	1.27%	-16.67%	0.98%	-18.13%	0.29%

#### 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

金鹰主题优势股票型证券投资基金

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

(2010年12月20日至2012年6月30日)



注：1、截至报告日本基金各项投资比例符合基金合同规定的各项比例，股票资产占基金总资产的比例为 60%~95%，其中，不低于 80% 的股票资产将配置于投资主题驱动下的行业与上市公司；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证券品种占基金总资产的 5%~40%，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%；

2、本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×75%+中信标普国债指数收益率×25%。

## 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 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（助理） 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
彭培祥	投资管理部 副总监，投 资决策委员 会委员，基 金经理	2011-01-20	-	19 年	MBA 研究生, 19 年证券 业从业经历, 1993 年进 入广州证券工作, 2007 年加入金鹰基金管理公 司, 担任研究发展部副 总监、高级策略分析师、 基金经理助理。现任基 金管理部总监、投资决 策委员会委员以及本基 金基金经理。
洗鸿鹏	基金经理	2010-12-20	-	6 年	洗鸿鹏先生, 数量经济 学专业硕士, 证券从业 经历六年。曾任职于广 发证券, 2007 年 4 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、金鹰中 小盘精选基金基金经理 助理等职。现任本基金 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。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运

作合法合规，无出现重大违法违规或违反基金合同的行为，无损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本基金管理人事前规定了严格的股票备选库管理制度、投资权限管理制度、债券库管理制度和集中交易制度等；事中重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，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未发生过同日反向交易的情况；与本公司管理的被动型投资组合发生的同日反向交易，未发生过成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2012 年上半年，上证指数基本为区间震荡走势，期初震荡上行至 3 月中旬达 2478 点后快速下跌，4 月初再次震荡上升至 5 月初达 2453 点后再次震荡下行，收盘位于震荡区间的下部。在年初上升行情中煤炭、有色、非银行金融等周期类、高弹性资产出现了较好的上升行情，引领市场信心逐步恢复，之后市场出现了层次较丰富的轮动行情；2 季度以白酒为首的消费类行业中的多数行业股票有较好的上升行情，但煤炭、有色等周期类、高弹性资产出现了明显的下跌。

本基金 2012 年初加仓并在维持中高仓位的基础上灵活调整仓位，净值在 3 月中旬前出现了较快回升，虽利用反弹机会减仓、调仓，但 3 月中下旬市场下跌速度较快，在下跌中净



值损失也较大，之后判断市场走势震荡筑底的概率较高，在 3 月底 4 月初再次推高了仓位，而 5、6 月的市场震荡行情也基本按市场情况正向加减了仓位。但在持仓结构方面，由于过分关注经济“见底”时间及对经济“见底”后市场行情的预期过高，在资产结构配置上主要偏向高弹性即以制造业、周期类资产为主，消费类资产配置比例相对较低，因此虽仓位加减做到了基本与市场同步，但净值表现却差强人意。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值为 0.652 元，报告期内基金份额净值增长率为 0.62%，业绩比较基准增长率为 4.39%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年出现两次先升后跌走势，主要基于对经济增速见底预期及宏观政策见底预期的双重影响，但二季度行业、主题及个股的轮动行情却明显弱于 1 季度。在上半年后期震荡下跌行情出现后，展望 2012 年下半年，我们认为 A 股走势有机会确认底部回升的行情。从历史经验及上半年形势来看，经济增速见底基本可以确认，随着货币政策的逐步宽松，市场的流动性也将随之出现改善，虽然在政策底、经济底之后，企业盈利见底时间还会滞后，市场可能因为担心公司盈利大幅度转坏而继续观望，但投资时钟转向权益类资产的时间窗口逐步临近，市场已现黎明曙光。当然，新股发行节奏仍未放缓，大小非减持等行为仍然对市场流动性造成负面影响，加上欧洲债务危机有可能再次冲击全球资本市场，这些都成为潜在的风险因素，使得我们在看好市场前景的前提下仍会谨慎关注各种扰动因素，并因应环境变化而对仓位及结构及时进行微调甚至止损。

本基金在 2012 年下半年将会继续增加基金仓位的灵活性，采取相对互补配置的策略，继续增加蓝筹类、业绩稳定增长类、高分红潜力类公司股票的配置。对于下半年的操作，我们将在兼顾周期、成长及消费类资产的配置机会的前提下加强主题投资机会的研究，我们看好国家战略板块（稀土、军工）、低负债（高现金流）、消费刺激（汽车、家电、保障房等）、投资拉动（水利、军工、油田服务、农业、环保等）等方面的主题投资机会。

我们将会控制风险的前提下，采取主动的投资策略，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负责估值工作的高管、合规人员、基金经理、负责估值工作的部门负责人、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。

#### 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

2012 年上半年，本基金托管人在对金鹰主题优势股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 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

2012 年上半年，金鹰主题优势股票型证券投资基金的管理人——金鹰基金管理有限公

司在金鹰主题优势股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，金鹰主题优势股票型证券投资基金未进行利润分配。

### 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

本托管人依法对金鹰基金管理有限公司编制和披露的金鹰主题优势股票型证券投资基金 2012 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：金鹰主题优势股票型证券投资基金

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	31,786,231.73	51,702,678.86
结算备付金		2,291,079.24	1,425,648.59
存出保证金		1,844,578.60	1,284,546.04
交易性金融资产	6.4.7.2	671,351,214.35	649,345,251.99
其中：股票投资		671,351,214.35	578,227,951.99
基金投资		-	-
债券投资		-	71,117,300.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	70,000,425.00
应收证券清算款		8,834,566.92	31,491,500.61
应收利息	6.4.7.3	12,551.24	2,605,232.35
应收股利		-	-

应收申购款		163,244.47	5,223.11
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		716,283,466.55	807,860,506.55
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2012 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2011 年 12 月 31 日</b>
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		-	28,697,118.32
应付赎回款		493,010.27	13,012,388.64
应付管理人报酬		922,798.85	1,052,044.77
应付托管费		153,799.80	175,340.83
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.4	1,118,191.83	605,477.51
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	278,153.44	404,647.19
负债合计		2,965,954.19	43,947,017.26
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.6	1,094,208,923.53	1,178,181,786.98
未分配利润	6.4.7.7	-380,891,411.17	-414,268,297.69
所有者权益合计		713,317,512.36	763,913,489.29
负债和所有者权益总计		716,283,466.55	807,860,506.55

## 6.2 利润表

会计主体：金鹰主题优势股票型证券投资基金

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 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
一、收入		18,472,119.27	-132,986,079.29

1.利息收入		848,897.02	7,679,727.01
其中：存款利息收入	6.4.7.8	249,315.88	1,322,331.14
债券利息收入		29,948.20	826,364.87
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		569,632.94	5,531,031.00
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-118,813,847.57	-6,473,923.16
其中：股票投资收益	6.4.7.9	-121,764,988.20	-15,886,286.34
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.10	28,799.25	1,317,913.83
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.11	2,922,341.38	8,094,449.35
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.12	136,388,272.38	-135,185,534.79
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	48,797.44	993,651.65
<b>减：二、费用</b>		<b>11,762,588.43</b>	<b>18,572,657.04</b>
1. 管理人报酬		5,776,588.68	11,469,976.91
2. 托管费		962,764.76	1,911,662.91
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.14	4,832,437.30	4,979,703.27
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.15	190,797.69	211,313.95
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>6,709,530.84</b>	<b>-151,558,736.33</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>6,709,530.84</b>	<b>-151,558,736.33</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金鹰主题优势股票型证券投资基金

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）	1,178,181,786.98	-414,268,297.69	763,913,489.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,709,530.84	6,709,530.84
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）	-83,972,863.45	26,667,355.68	-57,305,507.77
其中：1. 基金申购款	8,376,961.35	-2,602,239.44	5,774,721.91
2. 基金赎回款	-92,349,824.80	29,269,595.12	-63,080,229.68
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）	1,094,208,923.53	-380,891,411.17	713,317,512.36
项目	上年度可比期间 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）	2,051,271,200.80	5,168,184.89	2,056,439,385.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-151,558,736.33	-151,558,736.33
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）	-744,040,456.74	10,209,405.75	-733,831,050.99
其中：1. 基金申购款	61,648,799.96	-563,408.72	61,085,391.24
2. 基金赎回款	-805,689,256.70	10,772,814.47	-794,916,442.23
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）	1,307,230,744.06	-136,181,145.69	1,171,049,598.37

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：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

金鹰主题优势股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会证监许可【2010】1480 号文核准《关于核准金鹰主题优势股票型证券投资基金募集的批复》批准募集，于 2010 年 12 月 20 日正式成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定，设立募集规模为 2,051,271,200.80 份基金份额。本基金募集期间自 2010 年 11 月 18 日起至 2010 年 12 月 16 日止，募集资金于 2010 年 12 月 20 日全额划入本基金在基金托管人中国工商银行股份有限公司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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 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、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会 2010 年 2 月 8 日颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、《金鹰主题优势股票型证券投资基金基金合同》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于 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 年半年度的经营成果和净值变动情况等有关信息。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金报告期内所采用的会计政策与上年度会计报表相一致。

### 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 关联方关系

##### 6.4.7.1 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。

##### 6.4.7.2 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
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
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

#### 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.8.1.1 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1月1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	537,858,176.93	16.58%	1,214,726,165.92	34.13%

###### 6.4.8.1.2 权证交易

本基金报告期及上年度可比期间内未通过关联方进行权证交易。

###### 6.4.8.1.3 债券交易

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1月1日至2011年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广州证券	0.00	0.00%	1,279,549.80	100.00%

###### 6.4.8.1.4 债券回购交易

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1月1日至2011年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
广州证券	669,500,000.00	26.50%	0.00	0.00%

#### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	431,200.44	16.43%	162,227.35	14.51%
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1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	1,026,904.00	34.66%	832,887.75	69.08%

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，并扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取、由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。2、向关联方支付的交易佣金采用公允的交易佣金比率计算。

#### 6.4.8.2 关联方报酬

##### 6.4.8.2.1 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1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,776,588.68	11,469,976.91
其中：支付销售机构的客户维护费	2,242,963.85	3,611,737.63

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。

##### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012年1月1日至2012年6月30日	2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	962,764.76	1,911,662.91

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；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

#### 6.4.8.2.3 销售服务费

本基金报告期及上年度可比期间内均没有应支付关联方的销售服务费。

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金报告期及上年度可比期间内均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金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。

##### 6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本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。

#### 6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2012年1月1日至2012年6月30日		2011年1月1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
中国工商银行股份有限公司	31,786,231.73	211,982.18	81,843,367.70	1,274,993.52
合计	31,786,231.73	211,982.18	81,843,367.70	1,274,993.52

注：本基金截止报告期末结算备付金余额为 2,291,079.24 元，当期产生的利息收入为 36,907.44 元；上年度可比期间结算备付金余额为 2,035,088.15 元，当期产生的利息收入为 47,337.62 元。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金报告期及上年度可比期间内均没有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.9 期末（2012年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金报告期末未持有因认购新发/增发而持有的流通受限证券。

#### 6.4.9.2 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。

#### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金报告期末无银行间市场正回购抵押债券。

##### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金报告期末交易所市场正回购抵押债券。

## 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	671,351,214.35	93.73
	其中：股票	671,351,214.35	93.73
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	34,077,310.97	4.76
6	其他各项资产	10,854,941.23	1.52
7	合计	716,283,466.55	100.00

### 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	-	-
B	采掘业	55,418,051.45	7.77
C	制造业	367,829,801.02	51.57
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	26,665,637.98	3.74

C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	13,598,055.82	1.91
C5	电子	80,479,619.52	11.28
C6	金属、非金属	118,340,124.42	16.59
C7	机械、设备、仪表	128,746,363.28	18.05
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	34,600,000.00	4.85
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	16,674,096.00	2.34
H	批发和零售贸易	50,553,730.78	7.09
I	金融、保险业	88,828,257.62	12.45
J	房地产业	14,408,437.12	2.02
K	社会服务业	9,711,852.80	1.36
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	33,326,987.56	4.67
	合计	671,351,214.35	94.12

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产 净值比例 （%）
1	600468	百利电气	4,794,400	59,977,944.00	8.41
2	600111	包钢稀土	1,378,325	54,388,704.50	7.62
3	002129	中环股份	3,450,000	44,332,500.00	6.21
4	600259	广晟有色	666,265	43,926,851.45	6.16
5	600995	文山电力	5,000,000	34,600,000.00	4.85
6	601688	华泰证券	2,827,721	29,691,070.50	4.16
7	000503	海虹控股	4,505,073	26,174,474.13	3.67
8	300004	南风股份	1,120,000	24,304,000.00	3.41
9	601336	新华保险	699,998	23,967,931.52	3.36
10	600858	银座股份	2,002,046	23,584,101.88	3.31

### 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	600111	包钢稀土	58,655,298.86	7.68
2	601336	新华保险	54,573,031.82	7.14
3	600259	广晟有色	47,067,858.49	6.16
4	000338	潍柴动力	46,487,970.26	6.09
5	000503	海虹控股	42,957,427.64	5.62
6	000568	泸州老窖	39,652,789.22	5.19
7	600116	三峡水利	36,650,983.68	4.80
8	600068	葛洲坝	32,143,845.73	4.21
9	601688	华泰证券	30,118,349.79	3.94
10	600694	大商股份	29,993,839.18	3.93
11	000933	神火股份	29,545,379.73	3.87
12	600177	雅戈尔	25,864,895.41	3.39
13	600773	西藏城投	24,733,688.89	3.24
14	601601	中国太保	24,696,649.91	3.23
15	002024	苏宁电器	24,481,855.03	3.20
16	000012	南玻A	24,025,286.70	3.15
17	000629	攀钢钒钛	23,599,288.22	3.09
18	600664	哈药股份	23,197,279.60	3.04
19	601377	兴业证券	22,844,780.29	2.99
20	600089	特变电工	22,841,380.02	2.99
21	600858	银座股份	22,664,215.32	2.97
22	600765	中航重机	22,601,058.10	2.96
23	600107	美尔雅	21,207,587.74	2.78
24	002480	新筑股份	20,358,845.50	2.67
25	601989	中国重工	19,876,427.23	2.60
26	000728	国元证券	19,726,579.43	2.58
27	300297	蓝盾股份	19,200,000.00	2.51
28	000063	中兴通讯	18,717,018.71	2.45
29	600150	中国船舶	18,462,700.83	2.42
30	601628	中国人寿	17,585,142.72	2.30
31	002588	史丹利	17,071,635.35	2.23
32	600309	烟台万华	16,799,316.92	2.20
33	300224	正海磁材	16,244,617.92	2.13
34	600415	小商品城	16,178,875.63	2.12
35	002129	中环股份	16,084,940.30	2.11
36	600366	宁波韵升	15,760,854.04	2.06
37	000407	胜利股份	15,740,487.27	2.06
38	600176	中国玻纤	15,409,824.14	2.02
39	002115	三维通信	15,369,778.62	2.01

## 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	000568	泸州老窖	61,223,016.46	8.01
2	600116	三峡水利	39,328,221.80	5.15
3	600694	大商股份	35,419,851.27	4.64
4	601336	新华保险	34,852,163.30	4.56
5	600068	葛洲坝	32,543,375.75	4.26
6	000338	潍柴动力	30,387,278.21	3.98
7	600177	雅戈尔	26,546,087.12	3.48
8	600664	哈药股份	24,335,492.01	3.19
9	000012	南玻A	24,315,059.28	3.18
10	002024	苏宁电器	24,252,259.74	3.17
11	002480	新筑股份	23,836,244.26	3.12
12	600050	中国联通	23,517,961.74	3.08
13	601006	大秦铁路	22,726,645.12	2.98
14	601601	中国太保	22,351,112.39	2.93
15	002115	三维通信	22,025,095.42	2.88
16	600089	特变电工	20,274,454.20	2.65
17	600150	中国船舶	19,869,565.03	2.60
18	600016	民生银行	19,774,770.34	2.59
19	600000	浦发银行	19,022,133.75	2.49
20	002452	长高集团	18,494,197.75	2.42
21	300297	蓝盾股份	18,304,118.70	2.40
22	600176	中国玻纤	18,292,877.88	2.39
23	601989	中国重工	18,015,142.43	2.36
24	600309	烟台万华	17,804,834.70	2.33
25	002129	中环股份	17,411,055.77	2.28
26	600415	小商品城	17,321,524.40	2.27
27	600481	双良节能	17,293,017.96	2.26
28	601628	中国人寿	16,860,438.66	2.21
29	000503	海虹控股	16,715,799.41	2.19
30	601377	兴业证券	16,446,028.08	2.15
31	002142	宁波银行	16,293,642.42	2.13
32	000063	中兴通讯	16,205,902.02	2.12
33	000933	神火股份	16,129,565.73	2.11
34	000651	格力电器	15,773,369.68	2.06
35	002588	史丹利	15,402,925.97	2.02

## 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	1,677,909,889.51
卖出股票的收入（成交）总额	1,599,029,897.31

**7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合**

本基金报告期末未持有债券。

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

本基金报告期末未持有债券。

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

本基金报告期内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**

本基金报告期内未持有权证。

**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	1,844,578.60
2	应收证券清算款	8,834,566.92
3	应收股利	-
4	应收利息	12,551.24
5	应收申购款	163,244.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,854,941.23

**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**

本基金报告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
15,139	72,277.49	79,791,614.58	7.29%	1,014,417,308.95	92.71%

**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**

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	622,290.67	0.0569%

注：1、截至本报告期末，本基金管理人高级管理人员持有本基金份额总量的数量区间为 10 万份至 50 万份；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(2010年12月20日)基金份额总额	2,051,271,200.80
本报告期期初基金份额总额	1,178,181,786.98
本报告期基金总申购份额	8,376,961.35
减：本报告期基金总赎回份额	92,349,824.80
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,094,208,923.53

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 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

本基金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。

### 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等情况

本基金报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

### 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	
广州证券	1	537,858,176.93	16.58%	431,200.44	16.43%	-
东北证券	1	450,792,305.22	13.89%	372,036.87	14.18%	-
红塔证券	1	425,526,025.82	13.11%	346,281.51	13.20%	-
江海证券	1	311,563,431.25	9.60%	252,965.81	9.64%	-
东兴证券	1	290,334,224.38	8.95%	231,942.19	8.84%	-
西南证券	1	253,313,877.59	7.81%	203,014.38	7.74%	-
国信证券	1	193,048,335.60	5.95%	153,949.31	5.87%	-
浙商证券	2	185,301,817.98	5.71%	157,946.20	6.02%	-
兴业证券	1	169,940,737.92	5.24%	138,077.79	5.26%	-
齐鲁证券	3	98,832,616.93	3.05%	83,760.69	3.19%	-
长江证券	1	78,863,191.32	2.43%	62,097.38	2.37%	-
民生证券	2	71,716,983.72	2.21%	58,270.60	2.22%	-
长城证券	2	71,343,716.85	2.20%	43,698.60	1.67%	-
国泰君安	1	66,872,231.73	2.06%	56,840.53	2.17%	-
东方证券	1	34,102,998.00	1.05%	27,708.69	1.06%	-
安信证券	1	5,320,215.58	0.16%	4,095.46	0.16%	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-

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
- 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
- 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
广州证券	-	-	669,500,000.00	26.50%	-	-
东北证券	2,285,592.17	100.00%	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	285,000,000.00	11.28%	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	66,000,000.00	2.61%	-	-
国信证券	-	-	536,000,000.00	21.22%	-	-
浙商证券	-	-	294,000,000.00	11.64%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	310,000,000.00	12.27%	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	266,000,000.00	10.53%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	100,000,000.00	3.96%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

金鹰基金管理有限公司  
二〇一二年八月二十八日