

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

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年三月三十日

§1 重要提示及目录

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。

基金托管人根据相关法规及本基金合同规定，于 2016 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
§6 审计报告	错误!未定义书签。
§7 年度财务报表	15
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	21
§8 投资组合报告	51
8.1 期末基金资产组合情况.....	51
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	52
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.....	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	65
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	78
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.....	78
8.7 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.....	78
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.....	78
8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	78

8.10 告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	78
8.11 投资组合报告附注	79
§9 基金份额持有人信息	80
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	80
9.2 期末上市基金前十名持有人	80
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	81
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况	82
§10 开放式基金份额变动	82
§11 重大事件揭示	83
11.1 基金份额持有人大会决议	83
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	83
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	83
11.4 基金投资策略的改变	83
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	83
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	83
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	83
11.8 其他重大事件	85
§12 发起式基金发起资金持有份额情况	错误!未定义书签。
§13 影响投资者决策的其他重要信息	92
§14 备查文件目录	92
14.1 备查文件目录	92
14.2 存放地点	92
14.3 查阅方式	92

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	金鹰中证 500 指数分级证券投资基金		
基金简称	金鹰中证 500 指数分级		
基金主代码	162107		
交易代码	162107		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012 年 6 月 5 日		
基金管理人	金鹰基金管理有限公司		
基金托管人	交通银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	16,854,087.68 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳		
上市日期	2012 年 7 月 3 日		
下属分级基金的基金简称	金鹰 500A	金鹰 500B	金鹰 500
下属分级基金的场内简称	金鹰 500A	金鹰 500B	-
下属分级基金的交易代码	150088	150089	162107
报告期末下属分级基金的份额总额	2,625,743.00 份	2,625,743.00 份	11,602,601.68 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数基金，以跟踪指数为目标，力求将基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在 0.35% 以下、年跟踪误差控制在 4% 以下。
投资策略	<p>本基金以中证 500 指数成分股在其指数中的基准权重为基础，在综合考察指数成分股的行业构成与市值占比、各行业成分股权重的构成与分散程度、成分股流动性与贝塔值等因素的基础上，采用重点抽样与分层抽样相结合的策略以构建指数化投资组合；若抽样组合内的股票停牌或出现流动性不足等情形时，本基金将根据变化了的新情况，对于抽样组合进行再调整。</p> <p>本基金为股票型指数基金，以跟踪指数为目标，力求将基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在 0.35% 以下、年跟踪误差控制在 4% 以下。股票资产占基金资产净值的比例为 90%~95%，其中，中证 500 指数成分股和备选成分股占基金资产净值的比例不低于 90%；债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产净值的 5%~10%。</p>
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为被动跟踪指数的指数型证券投资基金，属于证券投资基金当中收益、风险较高的品种。一般情形下，其风险和预期收益高于混合型、债券型、货币市场基金。从本基金拆分的两级基金来看，金鹰 500A 具有低风险、预期收益相对稳定的特征，金鹰 500B 具有高风险、高预期收益的特征。

下属分级基金的风险收益特征	金鹰 500A 具有低风险、预期收益相对稳定的特征。	金鹰 500B 具有高风险、高预期收益的特征	金鹰 500 为被动跟踪指数的指数型证券投资基金，属于证券投资基金当中收益、风险较高的品种。一般情形下，其风险和预期收益高于混合型、债券型、货币市场基金。
---------------	----------------------------	------------------------	---

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		金鹰基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	苏文锋	汤嵩彦
	联系电话	020-83282627	95559
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	tangsy@bankcomm.com
客户服务电话		4006135888,020-83936180	95559
传真		020-83282856	021-62701216
注册地址		广东省珠海市吉大九洲大道东 段商业银行大厦7楼	上海市浦东新区银城中路188 号
办公地址		广州市天河区珠江东路28号越 秀金融大厦30层	上海市浦东新区银城中路188 号
邮政编码		510623	200120
法定代表人		凌富华	牛锡明

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	广州市天河区珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
----	----	------

会计师事务所	中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）	武汉市武昌区东湖路 169 号众环海华大厦 2-9 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015 年	2014 年	2013 年
本期已实现收益	-6,097,328.71	4,131,281.25	12,869,084.63
本期利润	-11,558,357.94	4,399,481.50	11,381,058.45
加权平均基金份额本期利润	-0.2592	0.2794	0.2211
本期加权平均净值利润率	-23.37%	25.25%	22.05%
本期基金份额净值增长率	-2.21%	30.44%	11.65%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配利润	1,489,604.40	5,041,197.75	1,442,890.52
期末可供分配基金份额利润	0.0884	0.3786	0.0712
期末基金资产净值	21,880,134.99	17,675,175.91	21,290,173.64
期末基金份额净值	1.2982	1.3275	1.0501
3.1.3 累计期末指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
基金份额累计净值增长率	86.75%	39.91%	7.26%

注：1、本基金于 2012 年 6 月 5 日成立。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

3、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

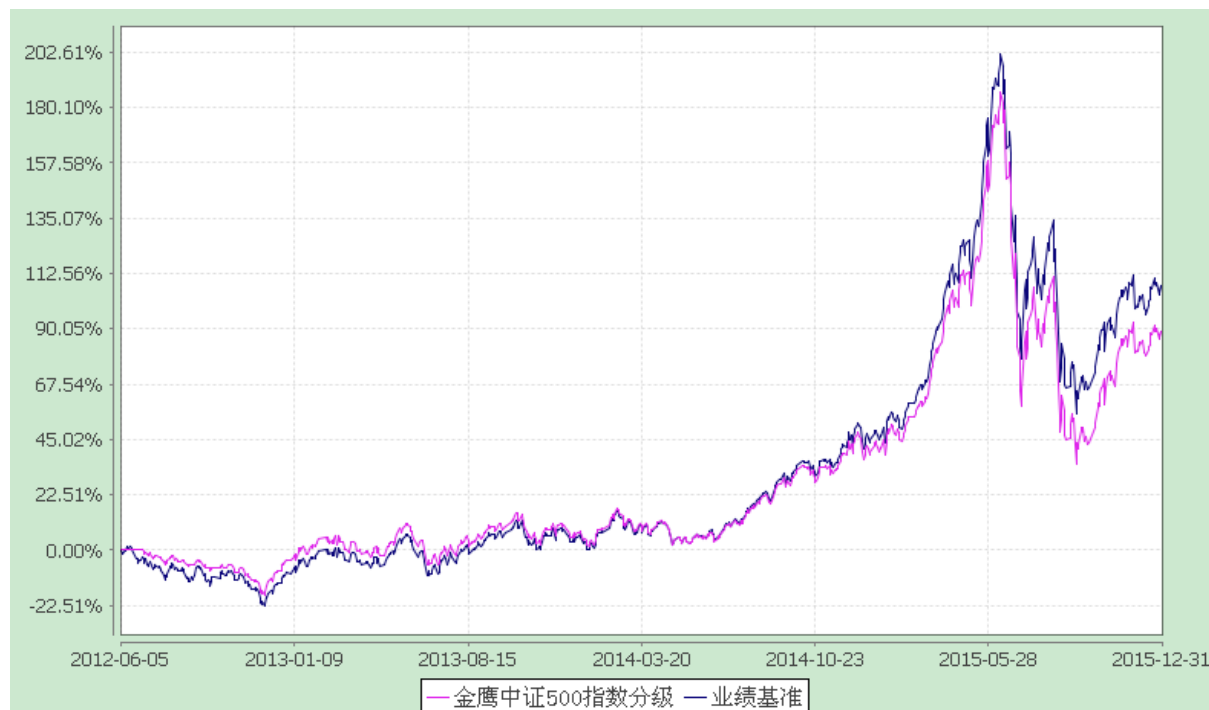
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	29.85%	1.97%	23.13%	1.94%	6.72%	0.03%
过去六个月	-15.41%	3.26%	-13.51%	3.07%	-1.90%	0.19%
过去一年	33.48%	2.79%	41.26%	2.68%	-7.78%	0.11%
过去三年	94.39%	1.91%	124.58%	1.86%	-30.19%	0.05%
成立至今	86.75%	1.78%	104.31%	1.79%	-17.56%	-0.01%

注：本基金业绩比较基准为中证 500 指数收益率 $\times 95\%$ + 活期存款利率（税后） $\times 5\%$

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

金鹰中证 500 指数分级证券投资基金

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2012 年 6 月 5 日至 2015 年 12 月 31 日)



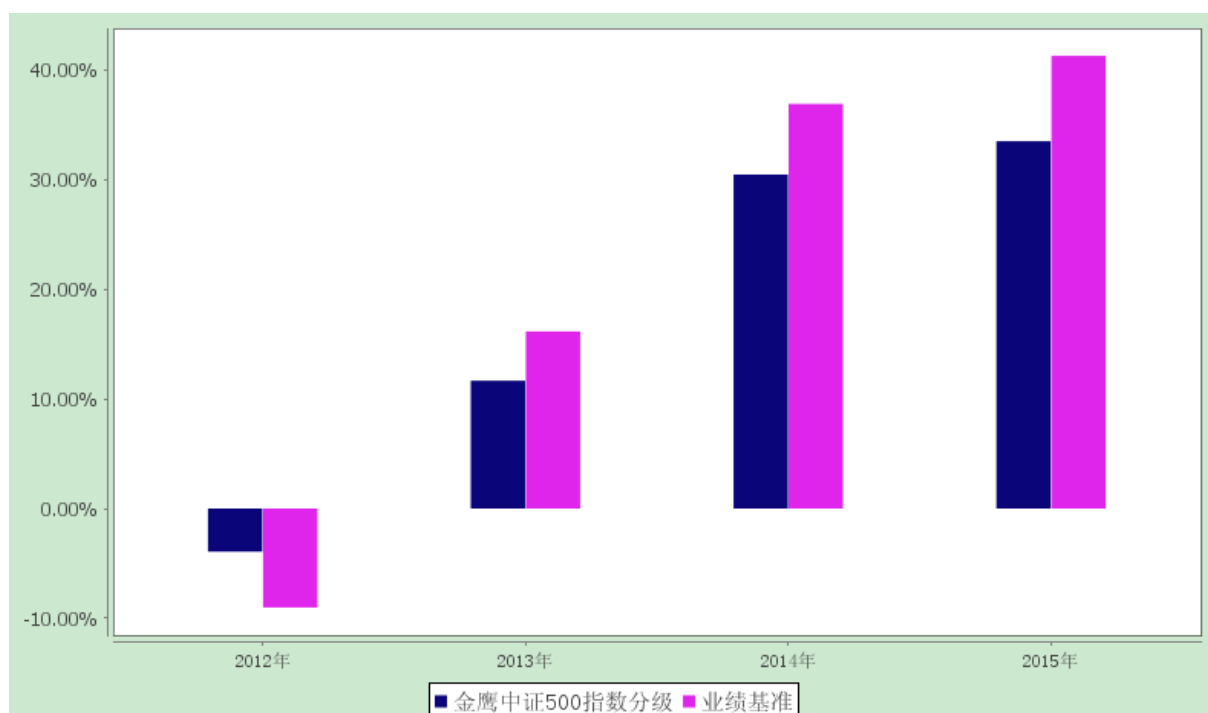
注：1、本基金于 2012 年 6 月 5 日成立。2、按基金合同规定，本基金建仓期为六个月。建仓期满后，本基金的各项投资比例应符合股票资产占基金资产净值的比例为 90%~95%，其中，中证 500 指数成分股和备选成分股占基金资产净值的比例不低于 90%；债券、货币市场工具、现金、权证、

资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产净值的 5%~10%，其中，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证投资的比例范围占基金资产净值的 0%~3%；3、本基金业绩比较基准为中证 500 指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%

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

金鹰中证 500 指数分级证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

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

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

包括广州证券股份有限公司、广州白云山医药集团股份有限公司、美的集团股份有限公司和东亚联丰投资管理有限公司，分别持有 49%、20%、20%和 11%的股份。

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

公司目前下设 16 个一级职能部门，分别是权益投资部、研究部、集中交易部、指数及量化投资部、产品研发部、固定收益部、零售业务部、电子商务部、机构业务部、专户投资部、信息技术部、基金事务部、风险管理部、监察稽核部、财务管理部、综合管理部。

权益投资部负责基金权益类投资；研究部负责宏观经济、行业、上市公司研究和投资策略研究；集中交易部负责完成基金经理投资指令；指数及量化投资部负责指数量化产品的研究投资、金融工程研究、数量分析工作；产品研发部负责基金新产品、新业务的研究和设计工作；固定收益部负责固定收益证券以及债券、货币市场的研究和投资管理；零售业务部负责市场营销策划、基金销售与渠道管理、客户服务及媒介宣传推广等业务；电子商务部负责公司网络平台及网上交易系统的建设、维护和电子商务的推广；机构业务部负责机构客户的开发、维护、管理及业务拓展；专户投资部负责特定客户资产的投资和管理；信息技术部负责公司信息系统的日常运行与维护,跟踪研究新技术,进行相应的技术系统规划与开发；基金事务部负责基金会计核算、估值、开放式基金注册、登记和清算等业务；风险管理部负责公司风险的识别、评估、控制等管理工作；监察稽核部负责对公司和基金运作以及公司员工遵守国家相关法律、法规和公司内部规章制度等情况进行监督和检查；财务管理部负责公司的财务预算、财务管理及会计核算等工作；综合管理部负责公司企业文化建设、文字档案、后勤服务、人力资源管理、薪酬制度、人员培训、人事档案等综合事务管理。

截至 2015 年 12 月 31 日，公司共管理二十一开放式基金：金鹰成份股优选证券投资基金、金鹰中小盘精选证券投资基金、金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金、金鹰行业优势混合型证券投资基金、金鹰稳健成长混合型证券投资基金、金鹰主题优势混合型证券投资基金、金鹰保本混合型证券投资基金、金鹰技术领先灵活配置混合型证券投资基金、金鹰策略配置混合型证券投资基金、金鹰持久增利债券型证券投资基金（LOF）、金鹰核心资源混合型证券投资基金、金鹰中证 500 指数分级证券投资基金、金鹰灵活配置混合型证券投资基金、金鹰货币市场证券投资基金、金鹰元丰保本混合型证券投资基金、金鹰元安保本混合型证券投资基金、金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）、金鹰科技创新股票型证券投资基金、金鹰民族新兴灵活配置混合型证券投资基金、金鹰产业整合灵活配置混合型证券投资基金、金鹰改革红利灵活配置混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何晓春	权益投资部总监、基金经理	2015-03-06	-	17	何晓春先生,生产业经济学博士。曾任世纪证券有限责任公司江西分公司筹办组负责人等职, 2011 年 4 月加入金鹰基金管理有限公司, 现任公司权益投资部总监、金鹰中证 500 指数分级证券投资基金、金鹰稳健成长混合型证券投资基金、金鹰行业优势混合型证券投资基金及金鹰民族新兴灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
黄艳芳	基金经理	2015-07-22	-	9	黄艳芳女士,清华大学硕士研究生。历任天相投资顾问有限公司分析师, 中航证券资产管理分公司投资主办, 量化投资负责人, 广州证券股份有限公司资产管理部投资主办。2015 年 5 月加入金鹰基金管理有限公司, 任指数及量化投资部数量策略研究员, 现任金鹰中证 500 指数分级证券投资基金、金鹰持久增利债券型证券投资基金 (LOF) 基金经理。
林华显	基金经理	2012-06-05	2015-03-28	13	林华显先生 2002 年 10 月进入金鹰基金管理有限公司, 2004 年后开始从事投资研究等工作, 先后任交易员、交易主管、基金经理助理、基金经理等职。

注：1、任职日期和离任日期指公司公告聘任或解聘日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》和其他有关法律法规及其各项实施准则，严格遵守本基金的基金合同、托管协议、招募说明书等法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

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

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

本基金为股票型指数基金，以跟踪指数为目标，本基金将继续坚持采用量化策略进行指数复制和风险管理，适时对投资组合进行再平衡调整，力求将跟踪误差控制在投资目标限定范围内，获取与跟踪标的指数相近的收益率。

4.6 管理人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。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。

4.7 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、分管总经理助理、权益投资部总监、固定收益部总监、研究发展部总监、基金事务部总监、基金经理、投资经理、基金会计和相关人员组成。在特殊情况下，公司召集估值委员会会议，讨论和决策特殊估值事项，估值委员会集体决策，需到会的三分之二估值委员会成员表决通过。

本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

报告期内,本基金未签约与估值相关的定价服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

本报告期，会计师事务所未对本基金出具非标准审计报告。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

本公司已向监管部门上报情况说明及处理方案。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2015 年度，基金托管人在金鹰中证 500 指数分级证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2015 年度，金鹰基金管理有限公司在金鹰中证 500 指数分级证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 审计报告

众环审字（2016）050131 号

金鹰中证 500 指数分级证券投资基金全体份额持有人：

我们审计了后附的金鹰中证 500 指数分级证券投资基金（以下简称“金鹰中证 500 指数分级基金”）财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表和 2015 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是金鹰中证 500 指数分级基金管理人金鹰基金管理有限公司管理层的

责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，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。

6.2 注册会计师的责任

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。

6.3 审计意见

我们认为，金鹰中证 500 指数分级基金财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作的规定编制，公允反映了金鹰中证 500 指数分级基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况。

中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

龚静伟 邵先取

武汉市武昌区东湖路 169 号众环海华大厦 2-9 层

2016 年 3 月 25 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：金鹰中证 500 指数分级证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	183,742.34	637,013.56
结算备付金		1,415,217.54	893,568.69
存出保证金		86,205.86	7,417.43
交易性金融资产	7.4.7.2	20,693,713.14	16,492,790.83
其中：股票投资		20,693,713.14	16,492,790.83
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		198,990.28	435,760.46
应收利息	7.4.7.5	3,031.54	2,918.63
应收股利		-	-
应收申购款		1,543.27	9,881.42
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		22,582,443.97	18,479,351.02
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		67,185.14	-

应付赎回款		237,683.24	219,416.47
应付管理人报酬		19,724.95	16,535.81
应付托管费		4,339.50	3,637.90
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.6	17,480.39	22,757.96
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.7	355,895.76	541,826.97
负债合计		702,308.98	804,175.11
所有者权益：		-	-
实收基金	7.4.7.8	11,716,929.71	12,633,978.16
未分配利润	7.4.7.9	10,163,205.28	5,041,197.75
所有者权益合计		21,880,134.99	17,675,175.91
负债和所有者权益总计		22,582,443.97	18,479,351.02

7.2 利润表

会计主体：金鹰中证 500 指数分级证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入		-10,053,146.74	5,283,931.02
1.利息收入		63,839.81	24,338.33
其中：存款利息收入	7.4.7.10	63,839.81	24,338.33
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-

其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-5,241,881.10	4,918,004.51
其中：股票投资收益	7.4.7.11	-5,625,711.35	4,774,094.44
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	7.4.7.12	383,830.25	143,910.07
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.13	-5,461,029.23	268,200.25
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	585,923.78	73,387.93
减：二、费用		1,505,211.20	884,449.52
1. 管理人报酬		481,953.20	175,436.00
2. 托管费		106,029.66	38,595.98
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.15	630,107.89	79,315.29
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.16	287,120.45	591,102.25
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-11,558,357.94	4,399,481.50
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-11,558,357.94	4,399,481.50

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金鹰中证 500 指数分级证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	12,633,978.16	5,041,197.75	17,675,175.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-11,558,357.94	-11,558,357.94
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-917,048.45	16,680,365.47	15,763,317.02
其中：1.基金申购款	116,354,964.99	154,242,634.83	270,597,599.82
2.基金赎回款	-117,272,013.44	-137,562,269.36	-254,834,282.80
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	11,716,929.71	10,163,205.28	21,880,134.99
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	19,847,283.12	1,442,890.52	21,290,173.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,399,481.50	4,399,481.50
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-7,213,304.96	-801,174.27	-8,014,479.23

(净值减少以“-”号填列)			
其中: 1.基金申购款	43,908,113.93	14,310,251.65	58,218,365.58
2.基金赎回款	-51,121,418.89	-15,111,425.92	-66,232,844.81
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	12,633,978.16	5,041,197.75	17,675,175.91

注: 本基金于 2012 年 6 月 5 日成立。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从 7.1 至 7.4, 财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人: 刘岩, 主管会计工作负责人: 曾长兴, 会计机构负责人: 谢文君

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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

本基金募集期间自 2012 年 4 月 23 日起至 2012 年 5 月 29 日止, 认购金额及认购期银行利息合计 393,471,186.50 元, 于 2012 年 6 月 5 日划至托管银行账户。首次设立募集规模为 393,471,186.50 份, 根据《基金合同》约定, 其中场外募集资金及其利息确认金鹰 500 份额 341,051,468.50 份, 场内募集资金及其利息按 1:1 的比例确认金鹰 500A 份额 26,209,859.00 份和金鹰 500B 份额 26,209,859.00 份。验资机构为立信会计师事务所。本基金的基金管理人为金鹰基金管理有限公司, 基金托管人为交通银行股份有限公司(简称“交通银行”)。

根据《基金合同》约定, 每 2 份金鹰中证 500 指数基金场内份额(初始面值为 1 元)按照 1:1 的比例, 分拆成预期收益与风险特性不同的两种份额, 即: 优先获得收益分配权的优先级(称为金

鹰 500A，初始面值为 1 元），获得剩余收益分配权的进取级（称为金鹰 500B，初始面值为 1 元）金鹰 500、金鹰 500A、金鹰 500B 三类基金份额的基金资产合并运作。

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

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

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布并于 2014 年 7 月修改的《企业会计准则—基本准则》和 41 项具体会计准则及其应用指南、解释及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”），中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》和中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 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。

7.4.4.3 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。

7.4.4.4 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。

7.4.4.5 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，本基金根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(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) 交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

(2) 交易所市场上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息后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债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价。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) 交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(4) 交易所市场发行未上市或未挂牌转让的固定收益品种，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，按成本估值；

(5) 银行间市场交易的固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。

(6) 对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的固定收益品种，按成本估值。

(7) 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

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、股指期货估值原则和方法

股指期货合约，一般以估值当日股指期货的结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。当日结算价及结算规则以《中国金融期货交易所结算细则》为准。如法律法规今后另有规定的，从其规定。

5、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。

6、在任何情况下，基金管理人采用上述 1-5 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方法估值。

7、国家有最新规定的，按其规定进行估值。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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。

7.4.4.9 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，2007 年 7 月 1 日前，按协议金额及约定利率，在回购期内采用直线法逐日计提；2007 年 7 月 1 日后，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。

7.4.4.10 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 0.22% 的年费率逐日计提；

3、基金指数使用费按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率逐日计提，收取下限为每季度 5 万元整，不足 5 万元按 5 万元收取；

4、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；

5、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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

7.4.4.12 分部报告

本基金本年度无分部报告。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《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》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金报告期会计政策无变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期内改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在报告期间不存在重大会计差错。

7.4.6 税项

1、印花税

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

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

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

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

2、营业税、企业所得税

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

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

3、个人所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税字【2012】85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至

1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、证监会财税字[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。（上市公司派发股息红利，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日之后的，股息红利所得按照本通知的规定执行。）

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2015 年 12 月 31 日	2014 年 12 月 31 日
活期存款	183,742.34	637,013.56
定期存款	-	-
存款期限 3 个月-1 年	-	-
存款期限 1 个月以内	-	-
其他存款	-	-
合计	183,742.34	637,013.56

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	23,796,044.33	20,693,713.14	-3,102,331.19
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
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		23,796,044.33	20,693,713.14	-3,102,331.19
项目	上年度末			
	2014 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票		14,134,092.79	16,492,790.83	2,358,698.04
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
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		14,134,092.79	16,492,790.83	2,358,698.04

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

报告期末本基金未持有衍生金融资产金融负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2015 年 12 月 31 日	2014 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	24.24	184.98

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	701.35	490.85
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	2,267.15	2,239.50
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	38.80	3.30
合计	3,031.54	2,918.63

7.4.7.6 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	17,480.39	22,757.96
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	17,480.39	22,757.96

7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	895.76	826.97
预提审计费	25,000.00	31,000.00
预提信息披露费	120,000.00	400,000.00
预提上市年费	60,000.00	60,000.00
预提指数使用费	150,000.00	50,000.00
合计	355,895.76	541,826.97

7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	13,314,519.00	12,633,978.16
本期申购	208,435,162.84	116,354,964.99
本期赎回 (以“-”号填列)	-231,218,687.14	-117,272,013.44
本期末	16,854,087.68	11,716,929.71

注：根据基金合同，本基金在本报告期内分别于 2015 年 1 月 5 日进行定期折算，调增份额 3274751.28 份；于 2015 年 5 月 13 日进行上拆折算，调增份额 46885586.13 份；于 2015 年 9 月 16 日进行下拆折算，调减份额 20890244.43 份，合计调增份额 26323092.98 份。

7.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,349,626.15	-1,308,428.40	5,041,197.75
本期利润	-6,097,328.71	-5,461,029.23	-11,558,357.94
本期基金份额交易产生的变动数	1,237,306.96	15,443,058.51	16,680,365.47
其中：基金申购款	90,367,078.10	63,875,556.73	154,242,634.83
基金赎回款	-89,129,771.14	-48,432,498.22	-137,562,269.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,489,604.40	8,673,600.88	10,163,205.28

7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	20,096.18	8,743.29
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	42,543.69	13,277.68
其他	1,199.94	2,317.36
合计	63,839.81	24,338.33

7.4.7.11 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
卖出股票成交总额	204,757,126.51	29,220,710.74
减：卖出股票成本总额	210,382,837.86	24,446,616.30
买卖股票差价收入	-5,625,711.35	4,774,094.44

7.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
股票投资产生的股利收益	383,830.25	143,910.07
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	383,830.25	143,910.07

7.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
1.交易性金融资产	-5,461,029.23	268,200.25
——股票投资	-5,461,029.23	268,200.25
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-

——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
合计	-5,461,029.23	268,200.25

7.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
基金赎回费收入	305,923.78	73,387.93
其他	280,000.00	-
合计	585,923.78	73,387.93

7.4.7.15 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
交易所市场交易费用	630,107.89	79,315.29
银行间市场交易费用	-	-
合计	630,107.89	79,315.29

7.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
审计费用	25,000.00	24,000.00
信息披露费	0.00	300,000.00
银行汇划费	2,120.45	1,102.25
上市费	60,000.00	60,000.00
指数使用费	200,000.00	200,000.00

其他	-	-
银行间市场账户维护费	-	6,000.00
合计	287,120.45	591,102.25

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据《金鹰中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》、《金鹰中证 500 指数分级证券投资基金招募说明书》、《金鹰中证 500 指数分级证券投资基金定期份额折算结果公告》及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，基金管理人金鹰基金管理有限公司以 2016 年 1 月 4 日为份额折算基准日，对金鹰中证 500 份额（交易代码：162107，场内简称：金鹰 500）的场外份额、场内份额以及金鹰中证 500A 份额（交易代码：150088，场内简称：金鹰 500A）实施定期份额折算。

除以上情况外，无其他需要说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	成交金额	占当期股	成交金额	占当期股

		票成交总 额的比例		票成交总 额的比例
广州证券	83,380,137.47	19.63%	13,839,901.61	27.63%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本年度及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本年度及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本年度及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
广州证券	73,860.37	19.48%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
广州证券	12,247.08	27.76%	2,348.66	10.32%

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

当期发生的基金应支付的管理费	481,953.20	175,436.00
其中：支付销售机构的客户维护费	77,655.99	63,645.84

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

$$H = E \times 1.0\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

3、本基金于 2012 年 6 月 5 日成立。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

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

注：1、基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.22% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.22\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期
	2015年1月1日至2015年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	金鹰 500A	金鹰 500B	金鹰 500	合计
金鹰直销	0.00	0.00	0.00	0.00
广州证券	0.00	0.00	0.00	0.00
交通银行	0.00	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	0.00	0.00	0.00
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	金鹰500A	金鹰500B	金鹰500	合计
交通银行	-	-	-	0.00
广州证券	-	-	-	0.00
金鹰直销	-	-	-	0.00
合计	-	-	-	0.00

注：本基金本年度内及上年度可比期间内没有应支付关联方的销售服务费。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末其他关联方未投资本基金。

本基金本报告期末及上年度末其他关联方未投资本基金。

7.4.10.5 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 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	183,742.34	20,096.18	637,013.56	8,743.29

注：1、本基金用于证券交易结算的资金通过"交通银行基金托管结算资金专用存款账户"转存于

中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息，在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示。2015 年年末结算备付金余额 1,415,217.54 元,当期结算备付金存款利息收入 42,454.67 元。

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

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.11 利润分配情况

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

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

7.4.12.1 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。

7.4.12.2 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	复牌开盘价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600120	浙江东方	2015-10-12	重大事项	19.86	-	-	1,700.00	63,220.88	33,762.00	-
600122	宏图高科	2015-12-24	重大事项	19.42	-	-	4,238.00	74,233.24	82,301.96	-
600200	江苏吴中	2015-11-26	重大事项	27.89	2016-03-16	25.10	2,509.00	63,938.37	69,976.01	-
600219	南山铝业	2015-09-29	重大事项	6.58	2016-01-25	7.00	11,400.00	127,172.67	75,012.00	-
600282	南钢股份	2015-12-30	重大事项	3.17	2016-01-12	3.24	8,500.00	26,626.25	26,945.00	-
600429	三元股份	2015-09-21	重大事项	7.29	2016-01-27	7.49	3,584.00	40,858.58	26,127.36	-
600572	康恩贝	2015-12-29	重大事项	13.36	2016-01-04	13.18	3,015.00	42,818.52	40,280.40	-

600584	长电科技	2015-11-30	重大事项	22.02	-	-	3,676.00	84,536.71	80,945.52	-
600645	中源协和	2015-12-30	重大事项	65.01	2016-01-04	63.90	1,156.00	61,304.84	75,151.56	-
600654	中安肖	2015-12-14	重大事项	28.84	-	-	2,910.00	77,295.23	83,924.40	-
600699	均胜电子	2015-11-04	重大事项	35.91	2016-03-10	29.00	1,100.00	44,027.76	39,501.00	-
600729	重庆百货	2015-07-24	重大事项	32.39	2016-01-04	29.90	2,657.00	98,787.58	86,060.23	-
600759	洲际油气	2015-09-21	重大事项	7.85	-	-	10,037.00	128,927.76	78,790.45	-
600851	海欣股份	2015-12-21	重大事项	14.70	2016-01-19	13.23	3,391.00	51,332.57	49,847.70	-
600859	王府井	2015-12-21	重大事项	27.22	2016-01-04	27.22	1,300.00	40,563.52	35,386.00	-
600864	哈投股份	2015-10-09	重大事项	10.88	2016-01-14	11.97	1,872.00	38,086.13	20,367.36	-
600880	博瑞传播	2015-09-16	重大事项	7.50	2016-01-18	8.25	7,900.00	162,813.66	59,250.00	-
600978	宜华木业	2015-06-18	重大事项	21.31	2016-01-21	20.10	31,989.00	542,700.34	681,685.59	-
601000	唐山港	2015-10-29	重大事项	8.25	2016-02-17	7.98	4,587.00	61,554.83	37,842.75	-
601678	滨化股份	2015-12-31	重大事项	8.02	2016-01-05	7.22	2,987.00	27,833.96	23,955.74	-
601717	郑煤机	2015-12-18	重大事项	7.52	-	-	4,400.00	49,633.83	33,088.00	-
000028	国药一致	2015-10-21	重大事项	66.15	-	-	600.00	45,281.90	39,690.00	-
000066	长城电脑	2015-06-18	重大事项	15.19	2016-03-10	19.39	18,668.00	344,761.07	283,566.92	-
000426	兴业矿业	2015-10-28	重大事项	7.06	2016-03-21	7.77	3,032.00	22,854.33	21,405.92	-
000748	长城信息	2015-06-18	重大事项	24.68	2016-03-10	31.39	18,400.00	578,424.81	454,112.00	-
000829	天音控股	2015-11-09	重大事项	12.22	-	-	3,692.00	69,331.33	45,116.24	-
000973	佛塑科技	2015-12-18	重大事项	13.00	2016-02-22	11.70	3,484.00	38,175.45	45,292.00	-
000982	中银绒业	2014-08-25	重大事项	4.64	2016-02-25	5.10	6,160.00	27,955.00	28,582.40	-
002011	盾安环境	2015-12-28	重大事项	16.72	2016-02-22	15.05	2,286.00	42,215.65	38,221.92	-

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

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购。

7.4.13 金融工具风险及管理

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。

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

(1) 风险管理控制制度

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

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

(2) 投资管理制度

投资管理制度包括研究业务管理制度、投资决策管理制度、基金交易管理制度等。

制订研究业务管理制度的目的是保持研究工作的独立、客观。研究业务管理制度包括：建立严密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法；根据基金合同要求，在充分研究的基础上建立和维护投资对象备选库；建立研究与投资的业务交流制度，保持通畅的交流渠道；建立研究报告质量评价体系。

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

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

(3) 监察稽核制度

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

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

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

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

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

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

7.4.13.2 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度的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估控制证券发行人的信用风险，建立了内部评级体系，通过内部评级与外部评级相结合的方法充分评估证券以及交易对手的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2015年12月31日	上年末 2014年12月31日
A-1	-	0.00
A-1 以下	-	0.00
未评级	-	0.00
合计	-	0.00

注：本统计数据未包含国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2015年12月31日	上年末 2014年12月31日
AAA	-	0.00
AAA 以下	-	0.00
未评级	-	0.00
合计	-	0.00

注：本统计数据未包含国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债。

7.4.13.3 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 年 12 月 31 日	1 个月 以内	1-3 个月	6 个月 以内	3 个月 -1 年	6 个月 -1 年	1 年以 内	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产										
银行存款	183,742.34	-	-	-	-	-	-	-	-	183,742.34
结算备付金	1,415,217.54	-	-	-	-	-	-	-	-	1,415,217.54
存出保证金	86,205.86	-	-	-	-	-	-	-	-	86,205.86
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	20,693,713.14	20,693,713.14
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	198,990.28	198,990.28
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	3,031.54	3,031.54
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	1,543.27	1,543.27
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,685,165.74	-	-	-	-	-	-	-	20,897,278.23	22,582,443.97
负债										
短期借款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	67,185.1	67,185.1

									4	4
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	237,683.24	237,683.24
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	19,724.95	19,724.95
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	4,339.50	4,339.50
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	17,480.39	17,480.39
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	355,895.76	355,895.76
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	702,308.98	702,308.98
利率敏感度缺口	1,685,165.74	-	-	-	-	-	-	-	20,194,969.25	21,880,134.99
上年度末 2014 年 12 月 31 日	1 个月 以内	1-3 个月	6 个月 以内	3 个月 -1 年	6 个月 -1 年	1 年以 内	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产										
银行存款	637,013.56	-	-	-	-	-	-	-	-	637,013.56
结算备付金	893,568.69	-	-	-	-	-	-	-	-	893,568.69
存出保证金	7,417.43	-	-	-	-	-	-	-	-	7,417.43
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	16,492,790.83	16,492,790.83
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	435,760.46	435,760.46
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	2,918.63	2,918.63
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	9,881.42	9,881.42
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

资产总计	1,537,999.68	-	-	-	-	-	-	-	16,941,351.34	18,479,351.02
负债										
应付证券清算款		-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款		-	-	-	-	-	-	-	219,416.47	219,416.47
应付管理人报酬		-	-	-	-	-	-	-	16,535.81	16,535.81
应付托管费		-	-	-	-	-	-	-	3,637.90	3,637.90
应付销售服务费		-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用		-	-	-	-	-	-	-	22,757.96	22,757.96
应交税费		-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付利息		-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付利润		-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他负债		-	-	-	-	-	-	-	541,826.97	541,826.97
负债总计		-	-	-	-	-	-	-	804,175.11	804,175.11
利率敏感度缺口	1,537,999.68	-	-	-	-	-	-	-	16,137,176.23	17,675,175.91

7.4.13.4.1.2 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 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
	2.利率下降 25 个基点	-	-
	1.利率上升 25 个基点	-	-

注：本基金报告期末未持有债券投资组合

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他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。本基金所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		上年度末 2014 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	20,693,713.14	94.58	16,492,790.83	93.31
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	20,693,713.14	94.58	16,492,790.83	93.31

7.4.13.4.3.2 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：人民币元）	
		本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
	业绩比较基准变动+5%	1,146,759.95	839,482.42
	业绩比较基准变动-5%	-1,146,759.95	-839,482.42

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的不含权固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2015 年 3 月 25 日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	20,693,713.14	91.64
	其中：股票	20,693,713.14	91.64
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融	-	-

	资产		
6	银行存款和结算备付金合计	1,598,959.88	7.08
7	其他各项资产	289,770.95	1.28
8	合计	22,582,443.97	100.00

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

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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

Q	卫生和社会工作	48,678.00	0.22
R	文化、体育和娱乐业	287,655.37	1.31
S	综合	267,254.59	1.22
	合计	20,271,585.89	92.65

8.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	422,127.25	1.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

合计	422,127.25	1.93
----	------------	------

注：积极投资股票是因中证 500 指数成份股调整及股票停牌，未及时卖出而被动持有的股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600978	宜华木业	31,989	681,685.59	3.12
2	000748	长城信息	18,400	454,112.00	2.08
3	000066	长城电脑	18,668	283,566.92	1.30
4	002219	恒康医疗	14,603	217,584.70	0.99
5	002405	四维图新	2,559	99,289.20	0.45
6	002466	天齐锂业	700	98,525.00	0.45
7	600160	巨化股份	3,900	91,533.00	0.42
8	600816	安信信托	3,975	90,510.75	0.41
9	600201	金宇集团	2,400	88,728.00	0.41
10	600079	人福医药	3,900	86,814.00	0.40
11	600729	重庆百货	2,657	86,060.23	0.39
12	600635	大众公用	8,584	84,638.24	0.39
13	600654	中安消	2,910	83,924.40	0.38
14	002439	启明星辰	2,600	83,200.00	0.38
15	002030	达安基因	2,020	83,183.60	0.38
16	600122	宏图高科	4,238	82,301.96	0.38
17	600584	长电科技	3,676	80,945.52	0.37
18	600482	风帆股份	1,687	79,373.35	0.36
19	600759	洲际油气	10,037	78,790.45	0.36
20	600158	中体产业	2,910	75,892.80	0.35
21	600673	东阳光科	7,447	75,884.93	0.35
22	002004	华邦健康	5,330	75,419.50	0.34
23	600503	华丽家族	5,500	75,350.00	0.34
24	600645	中源协和	1,156	75,151.56	0.34
25	600219	南山铝业	11,400	75,012.00	0.34
26	000997	新大陆	2,937	74,364.84	0.34
27	000566	海南海药	1,893	73,561.98	0.34
28	600410	华胜天成	2,770	73,432.70	0.34
29	600643	爱建集团	4,970	72,810.50	0.33
30	600522	中天科技	3,173	72,661.70	0.33
31	002701	奥瑞金	2,550	72,063.00	0.33
32	002276	万马股份	2,387	71,848.70	0.33

33	002174	游族网络	800	71,624.00	0.33
34	000998	隆平高科	2,998	71,202.50	0.33
35	600655	豫园商城	4,400	71,104.00	0.32
36	600525	长园集团	3,767	70,932.61	0.32
37	600200	江苏吴中	2,509	69,976.01	0.32
38	000718	苏宁环球	5,290	69,775.10	0.32
39	300253	卫宁软件	1,650	69,102.00	0.32
40	000887	中鼎股份	2,918	68,864.80	0.31
41	600694	大商股份	1,300	67,119.00	0.31
42	601012	隆基股份	4,900	66,885.00	0.31
43	002049	同方国芯	1,100	66,165.00	0.30
44	600074	保千里	4,000	65,880.00	0.30
45	600498	烽火通信	2,300	65,573.00	0.30
46	002340	格林美	4,305	65,436.00	0.30
47	000078	海王生物	2,700	64,692.00	0.30
48	002085	万丰奥威	2,000	64,360.00	0.29
49	600388	龙净环保	3,700	63,936.00	0.29
50	600879	航天电子	3,552	63,474.24	0.29
51	600770	综艺股份	3,412	62,337.24	0.28
52	000930	中粮生化	4,217	62,327.26	0.28
53	600436	片仔癀	900	61,911.00	0.28
54	002573	清新环境	2,742	61,530.48	0.28
55	000012	南玻 A	4,600	61,410.00	0.28
56	600376	首开股份	4,900	61,250.00	0.28
57	600478	科力远	2,784	61,025.28	0.28
58	601168	西部矿业	8,200	60,598.00	0.28
59	600487	亨通光电	3,792	60,444.48	0.28
60	000661	长春高新	500	60,225.00	0.28
61	300182	捷成股份	2,500	60,000.00	0.27
62	600664	哈药股份	5,000	59,650.00	0.27
63	600138	中青旅	2,555	59,557.05	0.27
64	600601	方正科技	9,610	59,389.80	0.27
65	600594	益佰制药	2,800	59,360.00	0.27
66	600880	博瑞传播	7,900	59,250.00	0.27
67	002308	威创股份	2,400	59,160.00	0.27
68	000547	航天发展	3,100	59,055.00	0.27
69	000511	烯碳新材	5,036	58,971.56	0.27
70	300257	开山股份	1,900	58,615.00	0.27
71	601929	吉视传媒	9,400	58,092.00	0.27
72	002161	远望谷	2,594	57,846.20	0.26
73	300072	三聚环保	1,700	57,749.00	0.26
74	600500	中化国际	4,500	57,645.00	0.26
75	600143	金发科技	6,700	57,620.00	0.26
76	002384	东山精密	2,878	57,617.56	0.26

77	600312	平高电气	2,938	57,291.00	0.26
78	002368	太极股份	850	57,035.00	0.26
79	002191	劲嘉股份	3,712	57,016.32	0.26
80	600198	大唐电信	2,300	56,741.00	0.26
81	600499	科达洁能	2,500	56,575.00	0.26
82	000656	金科股份	10,700	56,496.00	0.26
83	600881	亚泰集团	7,800	56,472.00	0.26
84	600516	方大炭素	4,500	56,295.00	0.26
85	600418	江淮汽车	3,850	56,171.50	0.26
86	000988	华工科技	2,647	56,063.46	0.26
87	002657	中科金财	700	55,993.00	0.26
88	002273	水晶光电	1,373	55,743.80	0.25
89	002444	巨星科技	2,675	55,372.50	0.25
90	600240	华业地产	3,661	55,098.05	0.25
91	600611	大众交通	3,583	54,999.05	0.25
92	000031	中粮地产	3,900	54,795.00	0.25
93	600026	中海发展	5,862	54,164.88	0.25
94	000697	炼石有色	1,942	54,026.44	0.25
95	300291	华录百纳	1,500	53,400.00	0.24
96	002022	科华生物	1,826	53,136.60	0.24
97	000671	阳光城	5,845	52,780.35	0.24
98	000970	中科三环	3,700	51,911.00	0.24
99	600017	日照港	7,901	51,672.54	0.24
100	600797	浙大网新	3,591	51,638.58	0.24
101	000690	宝新能源	5,254	51,384.12	0.23
102	600704	物产中大	2,894	50,992.28	0.23
103	002489	浙江永强	4,700	50,948.00	0.23
104	300122	智飞生物	1,400	50,932.00	0.23
105	600521	华海药业	1,993	50,602.27	0.23
106	600325	华发股份	3,093	50,415.90	0.23
107	300085	银之杰	900	50,310.00	0.23
108	300147	香雪制药	2,010	50,270.10	0.23
109	002179	中航光电	1,323	50,221.08	0.23
110	000541	佛山照明	3,003	50,150.10	0.23
111	600884	杉杉股份	1,278	50,148.72	0.23
112	000592	平潭发展	2,500	49,950.00	0.23
113	600094	大名城	4,700	49,914.00	0.23
114	600108	亚盛集团	6,800	49,912.00	0.23
115	600851	海欣股份	3,391	49,847.70	0.23
116	600967	北方创业	2,800	49,700.00	0.23
117	600811	东方集团	5,700	49,476.00	0.23
118	002508	老板电器	1,088	48,905.60	0.22
119	002266	浙富控股	6,000	48,840.00	0.22
120	002271	东方雨虹	2,500	48,825.00	0.22

121	002665	首航节能	1,600	48,800.00	0.22
122	002223	鱼跃医疗	1,269	48,793.05	0.22
123	600171	上海贝岭	2,301	48,758.19	0.22
124	300244	迪安诊断	700	48,678.00	0.22
125	002250	联化科技	2,572	48,533.64	0.22
126	000616	海航投资	6,166	48,464.76	0.22
127	600176	中国巨石	1,906	48,431.46	0.22
128	000939	凯迪生态	3,344	48,153.60	0.22
129	600511	国药股份	1,260	47,779.20	0.22
130	300055	万邦达	2,200	47,762.00	0.22
131	002073	软控股份	2,826	47,759.40	0.22
132	002325	洪涛股份	3,049	47,655.87	0.22
133	600497	驰宏锌锗	4,300	47,472.00	0.22
134	600787	中储股份	4,702	47,208.08	0.22
135	000006	深振业 A	4,100	47,191.00	0.22
136	600536	中国软件	1,300	46,904.00	0.21
137	300199	翰宇药业	1,900	46,797.00	0.21
138	600380	健康元	3,384	46,766.88	0.21
139	002390	信邦制药	3,250	46,637.50	0.21
140	300274	阳光电源	1,700	46,614.00	0.21
141	600151	航天机电	3,765	46,535.40	0.21
142	600435	北方导航	1,610	46,207.00	0.21
143	600754	锦江股份	900	46,188.00	0.21
144	002013	中航机电	2,030	45,999.80	0.21
145	000681	视觉中国	1,200	45,612.00	0.21
146	002595	豪迈科技	2,000	45,380.00	0.21
147	000973	佛塑科技	3,484	45,292.00	0.21
148	000829	天音控股	3,692	45,116.24	0.21
149	600422	昆药集团	1,133	45,116.06	0.21
150	600755	厦门国贸	4,814	44,866.48	0.21
151	600528	中铁二局	3,100	44,423.00	0.20
152	600316	洪都航空	1,900	44,346.00	0.20
153	600651	飞乐音响	2,992	44,132.00	0.20
154	600270	外运发展	1,628	44,053.68	0.20
155	000667	美好集团	8,853	43,910.88	0.20
156	002181	粤传媒	2,758	43,714.30	0.20
157	600064	南京高科	2,306	43,698.70	0.20
158	300267	尔康制药	1,300	43,680.00	0.20
159	600587	新华医疗	1,200	43,596.00	0.20
160	300088	长信科技	3,100	43,493.00	0.20
161	002498	汉缆股份	5,800	43,152.00	0.20
162	002005	德豪润达	4,254	43,135.56	0.20
163	600058	五矿发展	1,900	43,130.00	0.20
164	002063	远光软件	2,037	43,062.18	0.20

165	600320	振华重工	7,200	42,984.00	0.20
166	600597	光明乳业	2,700	42,984.00	0.20
167	603766	隆鑫通用	1,800	42,714.00	0.20
168	300273	和佳股份	2,040	42,636.00	0.19
169	000762	西藏矿业	1,616	42,500.80	0.19
170	600169	太原重工	7,400	42,476.00	0.19
171	000050	深天马 A	2,000	42,420.00	0.19
172	002217	合力泰	2,500	42,375.00	0.19
173	600426	华鲁恒升	2,927	42,236.61	0.19
174	600835	上海机电	1,385	41,979.35	0.19
175	000777	中核科技	1,332	41,811.48	0.19
176	002299	圣农发展	1,900	41,781.00	0.19
177	002285	世联行	2,550	41,386.50	0.19
178	000563	陕国投 A	2,731	41,292.72	0.19
179	002373	千方科技	900	41,175.00	0.19
180	601311	骆驼股份	1,883	41,105.89	0.19
181	002050	三花股份	3,844	40,938.60	0.19
182	000816	智慧农业	4,907	40,924.38	0.19
183	000926	福星股份	2,420	40,752.80	0.19
184	001696	宗申动力	2,944	40,686.08	0.19
185	002143	印纪传媒	1,000	40,550.00	0.19
186	600517	置信电气	3,203	40,549.98	0.19
187	002642	荣之联	700	40,523.00	0.19
188	600808	马钢股份	12,800	40,320.00	0.18
189	300115	长盈精密	1,200	40,284.00	0.18
190	600572	康恩贝	3,015	40,280.40	0.18
191	002431	棕榈园林	1,500	40,260.00	0.18
192	600765	中航重机	2,045	40,163.80	0.18
193	002001	新 和 成	2,300	40,112.00	0.18
194	002168	深圳惠程	3,377	39,949.91	0.18
195	600187	国中水务	6,400	39,744.00	0.18
196	000028	国药一致	600	39,690.00	0.18
197	600039	四川路桥	7,780	39,678.00	0.18
198	600267	海正药业	2,500	39,625.00	0.18
199	002428	云南锗业	1,948	39,505.44	0.18
200	600699	均胜电子	1,100	39,501.00	0.18
201	600067	冠城大通	4,513	39,443.62	0.18
202	000543	皖能电力	4,652	39,402.44	0.18
203	000650	仁和药业	3,725	39,373.25	0.18
204	600175	美都能源	5,400	39,042.00	0.18
205	600161	天坛生物	1,116	38,981.88	0.18
206	000732	泰禾集团	1,591	38,979.50	0.18
207	000587	金叶珠宝	1,831	38,908.75	0.18
208	000758	中色股份	2,600	38,688.00	0.18

209	300202	聚龙股份	1,200	38,628.00	0.18
210	000021	深科技	3,200	38,592.00	0.18
211	000519	江南红箭	2,260	38,374.80	0.18
212	002477	雏鹰农牧	2,268	38,351.88	0.18
213	600557	康缘药业	1,530	38,280.60	0.17
214	002011	盾安环境	2,286	38,221.92	0.17
215	002440	闰土股份	1,994	37,985.70	0.17
216	600894	广日股份	1,900	37,981.00	0.17
217	002437	誉衡药业	1,255	37,963.75	0.17
218	600872	中炬高新	2,423	37,919.95	0.17
219	601000	唐山港	4,587	37,842.75	0.17
220	600433	冠豪高新	3,300	37,818.00	0.17
221	002714	牧原股份	800	37,656.00	0.17
222	000861	海印股份	4,864	37,598.72	0.17
223	600580	卧龙电气	2,436	37,563.12	0.17
224	600351	亚宝药业	2,401	37,503.62	0.17
225	600428	中远航运	3,649	37,438.74	0.17
226	002244	滨江集团	4,700	37,412.00	0.17
227	600289	亿阳信通	1,891	37,252.70	0.17
228	600805	悦达投资	2,927	37,055.82	0.17
229	002092	中泰化学	4,200	36,960.00	0.17
230	002311	海大集团	2,640	36,880.80	0.17
231	002344	海宁皮城	2,400	36,816.00	0.17
232	600125	铁龙物流	4,000	36,760.00	0.17
233	000860	顺鑫农业	1,725	36,742.50	0.17
234	002269	美邦服饰	5,450	36,569.50	0.17
235	600056	中国医药	2,198	36,552.74	0.17
236	600062	华润双鹤	1,600	36,496.00	0.17
237	603019	中科曙光	400	36,468.00	0.17
238	300043	互动娱乐	2,300	36,340.00	0.17
239	002603	以岭药业	2,000	36,260.00	0.17
240	600366	宁波韵升	1,652	36,079.68	0.16
241	000685	中山公用	2,547	36,040.05	0.16
242	002048	宁波华翔	2,065	35,931.00	0.16
243	300026	红日药业	1,700	35,870.00	0.16
244	600885	宏发股份	1,200	35,868.00	0.16
245	600220	江苏阳光	6,248	35,863.52	0.16
246	600970	中材国际	3,000	35,850.00	0.16
247	600086	东方金钰	2,908	35,797.48	0.16
248	002672	东江环保	1,773	35,761.41	0.16
249	002051	中工国际	1,400	35,462.00	0.16
250	600859	王府井	1,300	35,386.00	0.16
251	002221	东华能源	1,500	35,070.00	0.16
252	002681	奋达科技	800	34,960.00	0.16

253	600216	浙江医药	2,800	34,636.00	0.16
254	002396	星网锐捷	1,432	34,582.80	0.16
255	000488	晨鸣纸业	3,828	34,145.76	0.16
256	600292	中电远达	1,649	34,101.32	0.16
257	600736	苏州高新	3,095	34,045.00	0.16
258	601880	大连港	5,711	34,037.56	0.16
259	600120	浙江东方	1,700	33,762.00	0.15
260	300134	大富科技	1,120	33,712.00	0.15
261	603188	亚邦股份	1,500	33,570.00	0.15
262	002482	广田股份	1,139	33,315.75	0.15
263	002064	华峰氨纶	5,118	33,215.82	0.15
264	601717	郑煤机	4,400	33,088.00	0.15
265	000600	建投能源	3,100	33,046.00	0.15
266	600348	阳泉煤业	5,100	32,946.00	0.15
267	000062	深圳华强	900	32,940.00	0.15
268	002551	尚荣医疗	999	32,937.03	0.15
269	600416	湘电股份	1,588	32,919.24	0.15
270	000680	山推股份	4,300	32,895.00	0.15
271	600284	浦东建设	2,388	32,691.72	0.15
272	002463	沪电股份	5,026	32,467.96	0.15
273	000979	中弘股份	8,094	32,376.00	0.15
274	000090	天健集团	1,900	32,338.00	0.15
275	000513	丽珠集团	563	32,333.09	0.15
276	002180	艾派克	700	32,305.00	0.15
277	600628	新世界	1,784	32,272.56	0.15
278	000572	海马汽车	5,030	32,192.00	0.15
279	600481	双良节能	3,540	32,072.40	0.15
280	002588	史丹利	980	31,879.40	0.15
281	002242	九阳股份	1,400	31,752.00	0.15
282	000848	承德露露	1,918	31,647.00	0.14
283	600409	三友化工	4,061	31,472.75	0.14
284	600183	生益科技	3,174	31,390.86	0.14
285	000652	泰达股份	4,396	31,343.48	0.14
286	000897	津滨发展	5,466	31,156.20	0.14
287	002345	潮宏基	1,840	31,059.20	0.14
288	002414	高德红外	1,019	31,048.93	0.14
289	600006	东风汽车	3,493	30,947.98	0.14
290	000961	中南建设	2,000	30,920.00	0.14
291	000830	鲁西化工	4,458	30,893.94	0.14
292	600812	华北制药	3,582	30,841.02	0.14
293	002653	海思科	1,400	30,646.00	0.14
294	002190	成飞集成	700	30,632.00	0.14
295	600823	世茂股份	2,500	30,575.00	0.14
296	600826	兰生股份	883	30,410.52	0.14

297	600180	瑞茂通	1,367	30,183.36	0.14
298	603369	今世缘	900	30,177.00	0.14
299	600112	天成控股	1,793	30,050.68	0.14
300	300039	上海凯宝	2,160	29,937.60	0.14
301	002254	泰和新材	1,881	29,889.09	0.14
302	002568	百润股份	700	29,883.00	0.14
303	000969	安泰科技	2,300	29,854.00	0.14
304	002505	大康牧业	3,500	29,715.00	0.14
305	600614	鼎立股份	2,552	29,679.76	0.14
306	600458	时代新材	1,675	29,647.50	0.14
307	000931	中关村	2,330	29,591.00	0.14
308	002028	思源电气	1,858	29,523.62	0.13
309	002025	航天电器	1,130	29,368.70	0.13
310	600460	士兰微	3,317	29,355.45	0.13
311	000088	盐田港	3,399	29,299.38	0.13
312	601010	文峰股份	4,028	29,283.56	0.13
313	600260	凯乐科技	1,958	29,252.52	0.13
314	603077	和邦生物	4,344	29,235.12	0.13
315	600073	上海梅林	2,061	29,163.15	0.13
316	002727	一心堂	500	28,915.00	0.13
317	600993	马应龙	1,309	28,824.18	0.13
318	000786	北新建材	2,418	28,774.20	0.13
319	000975	银泰资源	2,298	28,770.96	0.13
320	600757	长江传媒	2,617	28,734.66	0.13
321	002093	国脉科技	1,929	28,703.52	0.13
322	600850	华东电脑	553	28,562.45	0.13
323	000612	焦作万方	3,736	28,505.68	0.13
324	000049	德赛电池	500	28,390.00	0.13
325	601777	力帆股份	1,637	28,385.58	0.13
326	000528	柳工	3,400	28,186.00	0.13
327	002106	莱宝高科	2,100	28,014.00	0.13
328	600280	中央商场	2,500	27,925.00	0.13
329	600004	白云机场	1,945	27,677.35	0.13
330	600566	济川药业	1,000	27,660.00	0.13
331	601005	重庆钢铁	8,400	27,636.00	0.13
332	000550	江铃汽车	921	27,611.58	0.13
333	002479	富春环保	2,054	27,523.60	0.13
334	600496	精工钢构	4,572	27,477.72	0.13
335	000869	张裕 A	600	27,468.00	0.13
336	600586	金晶科技	4,470	27,311.70	0.12
337	002251	步步高	1,670	27,221.00	0.12
338	600831	广电网络	1,711	27,050.91	0.12
339	600825	新华传媒	2,259	26,972.46	0.12
340	002155	湖南黄金	3,000	26,970.00	0.12

341	600282	南钢股份	8,500	26,945.00	0.12
342	600298	安琪酵母	878	26,708.76	0.12
343	002029	七匹狼	1,950	26,656.50	0.12
344	000099	中信海直	1,800	26,604.00	0.12
345	600563	法拉电子	639	26,588.79	0.12
346	000726	鲁泰 A	1,949	26,350.48	0.12
347	000636	风华高科	2,301	26,254.41	0.12
348	600750	江中药业	743	26,220.47	0.12
349	000401	冀东水泥	2,400	26,160.00	0.12
350	600429	三元股份	3,584	26,127.36	0.12
351	002041	登海种业	1,550	26,117.50	0.12
352	002698	博实股份	890	26,103.70	0.12
353	000417	合肥百货	2,366	25,860.38	0.12
354	002358	森源电气	1,400	25,830.00	0.12
355	600300	维维股份	3,600	25,812.00	0.12
356	600790	轻纺城	3,171	25,780.23	0.12
357	600545	新疆城建	2,326	25,748.82	0.12
358	600337	美克家居	1,641	25,632.42	0.12
359	000900	现代投资	3,044	25,539.16	0.12
360	000501	鄂武商 A	1,187	25,401.80	0.12
361	000620	新华联	2,512	25,396.32	0.12
362	601801	皖新传媒	777	25,392.36	0.12
363	600639	浦东金桥	1,132	25,345.48	0.12
364	002342	巨力索具	3,318	25,249.98	0.12
365	601886	江河创建	2,000	25,220.00	0.12
366	002078	太阳纸业	4,456	25,087.28	0.11
367	000631	顺发恒业	2,524	25,038.08	0.11
368	002056	横店东磁	888	24,961.68	0.11
369	002317	众生药业	1,884	24,944.16	0.11
370	000933	神火股份	5,000	24,900.00	0.11
371	002281	光迅科技	383	24,829.89	0.11
372	600761	安徽合力	1,855	24,764.25	0.11
373	600748	上实发展	1,845	24,759.90	0.11
374	002332	仙琚制药	1,626	24,633.90	0.11
375	600392	盛和资源	2,000	24,620.00	0.11
376	002309	中利科技	1,309	24,583.02	0.11
377	000603	盛达矿业	1,357	24,493.85	0.11
378	601369	陕鼓动力	2,800	24,472.00	0.11
379	600869	智慧能源	2,558	24,428.90	0.11
380	002277	友阿股份	1,758	24,418.62	0.11
381	002237	恒邦股份	2,440	24,351.20	0.11
382	600596	新安股份	2,384	24,316.80	0.11
383	002203	海亮股份	2,210	24,310.00	0.11
384	002315	焦点科技	251	24,098.51	0.11

385	601678	滨化股份	2,987	23,955.74	0.11
386	601002	晋亿实业	2,076	23,936.28	0.11
387	600720	祁连山	2,693	23,779.19	0.11
388	601666	平煤股份	5,100	23,766.00	0.11
389	600259	广晟有色	600	23,760.00	0.11
390	002233	塔牌集团	1,607	23,542.55	0.11
391	601515	东风股份	1,418	23,510.44	0.11
392	000669	金鸿能源	1,050	23,446.50	0.11
393	002663	普邦园林	2,930	23,264.20	0.11
394	601126	四方股份	1,748	23,213.44	0.11
395	600236	桂冠电力	3,100	23,188.00	0.11
396	600575	皖江物流	3,718	23,014.42	0.11
397	600395	盘江股份	2,800	22,988.00	0.11
398	600773	西藏城投	1,262	22,968.40	0.10
399	600251	冠农股份	2,028	22,916.40	0.10
400	002327	富安娜	1,896	22,808.88	0.10
401	600509	天富能源	2,321	22,769.01	0.10
402	600059	古越龙山	2,070	22,749.30	0.10
403	600022	山东钢铁	7,300	22,703.00	0.10
404	600657	信达地产	3,266	22,698.70	0.10
405	000030	富奥股份	2,200	22,440.00	0.10
406	000693	华泽钴镍	1,200	22,356.00	0.10
407	000919	金陵药业	1,279	21,998.80	0.10
408	603699	纽威股份	1,000	21,820.00	0.10
409	601233	桐昆股份	1,654	21,750.10	0.10
410	600184	光电股份	752	21,740.32	0.10
411	002122	天马股份	2,604	21,691.32	0.10
412	002293	罗莱生活	1,183	21,577.92	0.10
413	000877	天山股份	2,666	21,407.98	0.10
414	000426	兴业矿业	3,032	21,405.92	0.10
415	603883	老百姓	300	21,291.00	0.10
416	600743	华远地产	3,140	21,289.20	0.10
417	601908	京运通	2,582	21,224.04	0.10
418	600809	山西汾酒	1,100	21,197.00	0.10
419	600425	青松建化	3,628	21,187.52	0.10
420	002118	紫鑫药业	1,076	20,992.76	0.10
421	002503	搜于特	1,322	20,940.48	0.10
422	603567	珍宝岛	400	20,720.00	0.09
423	600803	新奥股份	1,300	20,618.00	0.09
424	600141	兴发集团	1,409	20,599.58	0.09
425	002392	北京利尔	2,628	20,445.84	0.09
426	600864	哈投股份	1,872	20,367.36	0.09
427	600551	时代出版	892	20,293.00	0.09
428	603005	晶方科技	400	20,120.00	0.09

429	600329	中新药业	945	20,015.10	0.09
430	601001	大同煤业	3,600	19,980.00	0.09
431	600617	国新能源	1,300	19,929.00	0.09
432	600874	创业环保	1,878	19,812.90	0.09
433	600195	中牧股份	920	19,669.60	0.09
434	603001	奥康国际	580	19,499.60	0.09
435	002371	七星电子	1,000	19,280.00	0.09
436	002354	天神娱乐	200	19,196.00	0.09
437	600537	亿晶光电	1,280	19,174.40	0.09
438	600776	东方通信	1,675	19,162.00	0.09
439	600640	号百控股	900	19,089.00	0.09
440	600546	山煤国际	4,300	19,049.00	0.09
441	600483	福能股份	1,100	18,909.00	0.09
442	002408	齐翔腾达	1,420	18,900.20	0.09
443	000703	恒逸石化	1,700	18,887.00	0.09
444	002267	陕天然气	1,468	18,496.80	0.08
445	002646	青青稞酒	800	18,256.00	0.08
446	000596	古井贡酒	500	18,250.00	0.08
447	600456	宝钛股份	892	18,107.60	0.08
448	603555	贵人鸟	500	17,715.00	0.08
449	603328	依顿电子	600	17,706.00	0.08
450	600397	安源煤业	2,997	17,502.48	0.08
451	002635	安洁科技	628	17,458.40	0.08
452	600088	中视传媒	579	17,433.69	0.08
453	002140	东华科技	812	17,295.60	0.08
454	601139	深圳燃气	1,900	17,290.00	0.08
455	002194	武汉凡谷	1,010	17,170.00	0.08
456	600618	氯碱化工	1,032	16,656.48	0.08
457	002204	大连重工	1,651	16,510.00	0.08
458	601101	昊华能源	2,100	16,506.00	0.08
459	600510	黑牡丹	1,367	16,445.01	0.08
460	600132	重庆啤酒	1,000	15,990.00	0.07
461	601965	中国汽研	1,700	15,963.00	0.07
462	002216	三全食品	1,390	15,832.10	0.07
463	002493	荣盛石化	1,000	15,500.00	0.07
464	600335	国机汽车	815	15,273.10	0.07
465	000921	海信科龙	1,600	15,248.00	0.07
466	600997	开滦股份	2,700	15,066.00	0.07
467	603806	福斯特	300	14,997.00	0.07
468	603366	日出东方	1,400	14,840.00	0.07
469	002238	天威视讯	664	14,740.80	0.07
470	002678	珠江钢琴	852	14,662.92	0.07
471	603169	兰石重装	800	14,600.00	0.07
472	600507	方大特钢	2,332	14,225.20	0.07

473	000525	红太阳	838	14,195.72	0.06
474	600780	通宝能源	1,979	14,031.11	0.06
475	002419	天虹商场	1,026	13,851.00	0.06
476	000951	中国重汽	765	13,846.50	0.06
477	002461	珠江啤酒	889	13,575.03	0.06
478	600751	天海投资	1,400	13,468.00	0.06
479	600971	恒源煤电	2,100	13,209.00	0.06
480	002430	杭氧股份	1,135	13,052.50	0.06
481	603589	口子窖	300	12,882.00	0.06
482	600468	百利电气	722	12,793.84	0.06
483	601226	华电重工	1,000	12,650.00	0.06
484	603899	晨光文具	300	12,618.00	0.06
485	000852	石化机械	576	12,303.36	0.06
486	002249	大洋电机	898	11,907.48	0.05
487	002128	露天煤业	1,400	11,830.00	0.05
488	002648	卫星石化	1,082	11,696.42	0.05
489	600917	重庆燃气	700	10,633.00	0.05
490	000719	大地传媒	518	10,567.20	0.05
491	603698	航天工程	300	10,515.00	0.05
492	603568	伟明环保	200	10,140.00	0.05
493	603355	莱克电气	200	9,340.00	0.04
494	000552	靖远煤电	900	9,072.00	0.04
495	000582	北部湾港	400	9,004.00	0.04
496	002745	木林森	200	8,186.00	0.04
497	603025	大豪科技	200	8,182.00	0.04
498	600801	华新水泥	832	6,780.80	0.03

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

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

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资
----	------	------	----------	--------

				产净值比例 (%)
1	300059	东方财富	2,879,233.00	16.29
2	300168	万达信息	1,249,696.00	7.07
3	601099	太平洋	1,233,669.00	6.98
4	600037	歌华有线	1,151,338.80	6.51
5	600601	方正科技	1,124,532.74	6.36
6	600219	南山铝业	1,103,892.00	6.25
7	600635	大众公用	1,071,061.00	6.06
8	002183	怡亚通	1,044,430.00	5.91
9	300253	卫宁健康	1,038,025.24	5.87
10	600881	亚泰集团	1,012,011.00	5.73
11	002030	达安基因	1,005,386.00	5.69
12	600435	北方导航	990,111.00	5.60
13	600895	张江高科	986,583.85	5.58
14	600158	中体产业	978,602.23	5.54
15	600021	上海电力	963,911.76	5.45
16	600201	生物股份	946,706.90	5.36
17	600820	隧道股份	943,695.00	5.34
18	000012	南玻 A	925,626.00	5.24
19	000998	隆平高科	900,283.98	5.09
20	601012	隆基股份	892,840.00	5.05
21	000748	长城信息	868,359.00	4.91
22	600169	太原重工	847,719.00	4.80
23	000540	中天城投	845,376.00	4.78
24	002022	科华生物	840,294.53	4.75
25	600446	金证股份	826,734.00	4.68
26	600026	中海发展	815,036.00	4.61
27	600978	宜华木业	814,292.00	4.61
28	000566	海南海药	812,224.00	4.60
29	000616	海航投资	807,513.00	4.57
30	600643	爱建集团	799,203.00	4.52
31	600811	东方集团	795,489.00	4.50
32	000997	新大陆	794,225.03	4.49
33	601519	大智慧	792,528.00	4.48
34	601608	中信重工	775,210.00	4.39
35	600122	宏图高科	774,352.00	4.38
36	600704	物产中大	770,573.60	4.36
37	600694	大商股份	765,259.00	4.33
38	600528	中铁二局	763,338.00	4.32
39	002266	浙富控股	759,264.09	4.30
40	000592	平潭发展	754,969.00	4.27
41	600584	长电科技	754,364.00	4.27

42	600198	大唐电信	753,529.00	4.26
43	600770	综艺股份	745,736.00	4.22
44	002004	华邦健康	744,512.00	4.21
45	600320	振华重工	736,547.00	4.17
46	300144	宋城演艺	728,651.80	4.12
47	002063	远光软件	720,535.80	4.08
48	001696	宗申动力	715,676.16	4.05
49	002424	贵州百灵	714,891.00	4.04
50	600755	厦门国贸	713,235.34	4.04
51	000656	金科股份	712,194.00	4.03
52	000712	锦龙股份	708,967.00	4.01
53	600525	长园集团	708,742.00	4.01
54	600240	华业资本	706,361.17	4.00
55	600655	豫园商城	702,357.00	3.97
56	002285	世联行	699,826.20	3.96
57	000661	长春高新	687,173.00	3.89
58	601718	际华集团	686,857.00	3.89
59	600594	益佰制药	686,148.00	3.88
60	600737	中粮屯河	685,291.00	3.88
61	000977	浪潮信息	684,965.00	3.88
62	600500	中化国际	683,566.00	3.87
63	000547	航天发展	682,311.00	3.86
64	000887	中鼎股份	681,584.00	3.86
65	600143	金发科技	681,028.84	3.85
66	000829	天音控股	678,384.06	3.84
67	000511	烯碳新材	677,635.78	3.83
68	000078	海王生物	676,945.00	3.83
69	600079	人福医药	676,816.00	3.83
70	600433	冠豪高新	676,678.00	3.83
71	002405	四维图新	675,103.00	3.82
72	600685	中船防务	661,616.00	3.74
73	002573	清新环境	660,745.00	3.74
74	600200	江苏吴中	660,477.00	3.74
75	300273	和佳股份	651,826.26	3.69
76	002223	鱼跃医疗	644,360.00	3.65
77	002276	万马股份	642,600.00	3.64
78	000758	中色股份	640,789.00	3.63
79	600611	大众交通	640,135.00	3.62
80	300033	同花顺	630,829.54	3.57
81	600125	铁龙物流	625,800.00	3.54
82	600312	平高电气	625,753.99	3.54
83	600536	中国软件	619,034.00	3.50
84	601872	招商轮船	617,999.40	3.50
85	002073	软控股份	615,742.00	3.48

86	000415	渤海租赁	610,968.00	3.46
87	601000	唐山港	610,177.00	3.45
88	600759	洲际油气	604,165.15	3.42
89	600138	中青旅	599,395.00	3.39
90	002250	联化科技	597,627.98	3.38
91	000939	凯迪生态	595,329.44	3.37
92	002340	格林美	595,297.00	3.37
93	600171	上海贝岭	594,123.00	3.36
94	600478	科力远	591,964.71	3.35
95	600376	首开股份	584,786.00	3.31
96	600675	中华企业	583,471.00	3.30
97	000681	视觉中国	578,765.00	3.27
98	002191	劲嘉股份	578,678.00	3.27
99	002013	中航机电	575,679.16	3.26
100	600380	健康元	572,132.00	3.24
101	002161	远望谷	570,064.00	3.23
102	000988	华工科技	566,777.04	3.21
103	600787	中储股份	562,909.00	3.18
104	600651	飞乐音响	562,703.00	3.18
105	600797	浙大网新	562,041.00	3.18
106	600816	安信信托	561,457.00	3.18
107	300244	迪安诊断	555,922.00	3.15
108	600673	东阳光科	555,082.00	3.14
109	002595	豪迈科技	550,335.00	3.11
110	000930	中粮生化	548,094.00	3.10
111	000816	智慧农业	546,853.00	3.09
112	000006	深振业 A	544,127.50	3.08
113	600517	置信电气	540,207.00	3.06
114	002219	恒康医疗	536,153.00	3.03
115	600064	南京高科	535,683.50	3.03
116	000732	泰禾集团	534,698.00	3.03
117	600498	烽火通信	534,033.00	3.02
118	600067	冠城大通	532,133.00	3.01
119	600499	科达洁能	530,334.70	3.00
120	600805	悦达投资	528,266.00	2.99
121	600664	哈药股份	526,130.24	2.98
122	000652	泰达股份	525,760.00	2.97
123	000777	中核科技	525,162.00	2.97
124	600112	天成控股	524,717.59	2.97
125	002092	中泰化学	523,238.00	2.96
126	600418	江淮汽车	522,581.79	2.96
127	600120	浙江东方	517,481.00	2.93
128	300291	华录百纳	516,197.50	2.92
129	600835	上海机电	515,499.00	2.92

130	300199	翰宇药业	512,703.00	2.90
131	600808	马钢股份	512,245.00	2.90
132	000671	阳光城	509,890.00	2.88
133	000066	长城电脑	505,616.00	2.86
134	002048	宁波华翔	504,012.00	2.85
135	002179	中航光电	502,873.00	2.85
136	600557	康缘药业	501,913.00	2.84
137	600161	天坛生物	501,660.50	2.84
138	002440	闰土股份	499,890.00	2.83
139	600058	五矿发展	497,925.00	2.82
140	000897	津滨发展	496,146.00	2.81
141	600880	博瑞传播	495,399.00	2.80
142	600266	北京城建	494,767.00	2.80
143	000528	柳工	494,647.00	2.80
144	002018	华信国际	494,600.00	2.80
145	600270	外运发展	494,354.00	2.80
146	002665	首航节能	490,439.50	2.77
147	600654	中安消	490,311.00	2.77
148	600183	生益科技	488,167.00	2.76
149	600017	日照港	487,756.87	2.76
150	600511	国药股份	481,557.00	2.72
151	600180	瑞茂通	481,051.00	2.72
152	300147	香雪制药	480,888.60	2.72
153	002271	东方雨虹	480,741.00	2.72
154	600187	国中水务	480,647.00	2.72
155	601717	郑煤机	480,420.00	2.72
156	600545	新疆城建	479,714.00	2.71
157	300115	长盈精密	479,554.36	2.71
158	600325	华发股份	478,441.41	2.71
159	600220	江苏阳光	477,419.35	2.70
160	002311	海大集团	476,832.00	2.70
161	600410	华胜天成	474,115.00	2.68
162	603766	隆鑫通用	470,580.00	2.66
163	600458	时代新材	468,876.71	2.65
164	600176	中国巨石	468,523.00	2.65
165	600582	天地科技	468,494.00	2.65
166	300072	三聚环保	467,644.00	2.65
167	600175	美都能源	466,306.00	2.64
168	600490	鹏欣资源	465,031.00	2.63
169	000031	中粮地产	464,575.00	2.63
170	000587	金叶珠宝	463,444.00	2.62
171	002273	水晶光电	463,347.22	2.62
172	000667	美好集团	460,940.00	2.61
173	600422	昆药集团	460,475.00	2.61

174	600426	华鲁恒升	457,023.00	2.59
175	600522	中天科技	455,489.00	2.58
176	600039	四川路桥	453,678.00	2.57
177	000088	盐田港	453,225.24	2.56
178	000090	天健集团	453,224.00	2.56
179	002444	巨星科技	452,584.00	2.56
180	600284	浦东建设	451,538.00	2.55
181	002489	浙江永强	450,257.00	2.55
182	000718	苏宁环球	449,968.00	2.55
183	002221	东华能源	449,855.00	2.55
184	600289	亿阳信通	449,053.79	2.54
185	300274	阳光电源	446,233.00	2.52
186	300202	聚龙股份	444,945.00	2.52
187	002168	深圳惠程	444,810.57	2.52
188	600699	均胜电子	444,074.00	2.51
189	600436	片仔癀	443,464.50	2.51
190	600428	中远航运	443,252.00	2.51
191	000680	山推股份	441,699.00	2.50
192	600851	海欣股份	440,801.00	2.49
193	002508	老板电器	439,603.50	2.49
194	300134	大富科技	439,315.50	2.49
195	600216	浙江医药	436,575.00	2.47
196	600409	三友化工	436,201.00	2.47
197	600580	卧龙电气	435,548.00	2.46
198	600062	华润双鹤	434,549.00	2.46
199	600056	中国医药	434,022.00	2.46
200	000685	中山公用	433,952.00	2.46
201	000690	宝新能源	432,559.00	2.45
202	600160	巨化股份	431,834.00	2.44
203	000099	中信海直	431,361.00	2.44
204	002466	天齐锂业	431,120.53	2.44
205	000541	佛山照明	430,262.65	2.43
206	000488	晨鸣纸业	430,136.59	2.43
207	000975	银泰资源	429,735.00	2.43
208	002390	信邦制药	429,093.00	2.43
209	002011	盾安环境	427,160.60	2.42
210	601311	骆驼股份	427,016.00	2.42
211	002237	恒邦股份	425,051.00	2.40
212	002428	云南锗业	423,482.00	2.40
213	000848	承德露露	423,390.17	2.40
214	000572	海马汽车	423,319.00	2.39
215	002155	湖南黄金	422,041.00	2.39
216	000735	罗牛山	421,420.20	2.38
217	600006	东风汽车	420,980.00	2.38

218	600885	宏发股份	419,586.00	2.37
219	000028	国药一致	418,776.68	2.37
220	002195	二三四五	417,498.00	2.36
221	600260	凯乐科技	414,762.00	2.35
222	600317	营口港	414,656.00	2.35
223	002690	美亚光电	412,662.02	2.33
224	002005	德豪润达	410,611.15	2.32
225	600765	中航重机	408,600.80	2.31
226	300039	上海凯宝	405,847.01	2.30
227	600110	中科英华	402,478.00	2.28
228	600757	长江传媒	400,614.99	2.27
229	002029	七匹狼	400,527.00	2.27
230	600261	阳光照明	395,641.50	2.24
231	002396	星网锐捷	394,419.00	2.23
232	000050	深天马 A	394,296.00	2.23
233	000422	湖北宜化	392,842.00	2.22
234	601002	晋亿实业	392,449.00	2.22
235	601880	大连港	391,473.00	2.21
236	600884	杉杉股份	389,353.00	2.20
237	002064	华峰氨纶	387,192.00	2.19
238	002093	国脉科技	387,161.00	2.19
239	600151	航天机电	386,778.00	2.19
240	600481	双良节能	385,861.00	2.18
241	600736	苏州高新	384,784.00	2.18
242	000830	鲁西化工	383,589.90	2.17
243	000973	佛塑科技	383,197.00	2.17
244	600859	王府井	382,959.60	2.17
245	601666	平煤股份	382,904.00	2.17
246	002358	森源电气	380,986.00	2.16
247	600993	马应龙	380,953.00	2.16
248	000933	神火股份	377,775.00	2.14
249	600894	广日股份	377,742.00	2.14
250	600496	精工钢构	375,038.00	2.12
251	600267	海正药业	373,743.92	2.11
252	000762	西藏矿业	371,097.00	2.10
253	002049	同方国芯	370,792.00	2.10
254	600812	华北制药	368,836.74	2.09
255	300267	尔康制药	367,507.00	2.08
256	000513	丽珠集团	367,232.00	2.08
257	601001	大同煤业	365,919.00	2.07
258	002277	友阿股份	365,675.60	2.07
259	002663	普邦园林	364,655.00	2.06
260	601010	文峰股份	363,366.00	2.06
261	000062	深圳华强	362,533.00	2.05

262	600879	航天电子	361,995.00	2.05
263	601369	陕鼓动力	360,386.88	2.04
264	002482	广田股份	360,090.00	2.04
265	600487	亨通光电	359,750.00	2.04
266	002642	荣之联	359,404.00	2.03
267	600300	维维股份	359,138.00	2.03
268	002028	思源电气	357,727.45	2.02
269	600004	白云机场	357,103.00	2.02
270	600521	华海药业	356,591.00	2.02
271	002463	沪电股份	355,822.68	2.01
272	000877	天山股份	354,562.00	2.01

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300059	东方财富	3,614,247.00	20.45
2	300168	万达信息	1,774,997.00	10.04
3	601099	太平洋	1,515,065.00	8.57
4	600820	隧道股份	1,260,574.20	7.13
5	002183	怡亚通	1,153,304.48	6.52
6	600895	张江高科	1,100,523.54	6.23
7	600037	歌华有线	1,094,022.45	6.19
8	002030	达安基因	1,038,487.40	5.88
9	600635	大众公用	995,631.00	5.63
10	600601	方正科技	972,006.00	5.50
11	600201	生物股份	964,218.34	5.46
12	600881	亚泰集团	943,678.00	5.34
13	600219	南山铝业	941,218.00	5.33
14	600435	北方导航	922,983.00	5.22
15	300253	卫宁健康	922,568.00	5.22
16	600158	中体产业	911,580.00	5.16
17	601718	际华集团	896,061.90	5.07
18	601519	大智慧	894,839.68	5.06
19	000540	中天城投	886,679.40	5.02
20	000977	浪潮信息	861,798.34	4.88
21	000998	隆平高科	849,448.00	4.81
22	600021	上海电力	839,436.06	4.75
23	000997	新大陆	838,489.00	4.74

24	600737	中粮屯河	830,820.12	4.70
25	000012	南 玻 A	825,190.42	4.67
26	300144	宋城演艺	822,354.20	4.65
27	600643	爱建集团	813,023.00	4.60
28	000712	锦龙股份	806,209.76	4.56
29	601872	招商轮船	787,837.00	4.46
30	600026	中海发展	787,422.00	4.45
31	002022	科华生物	781,394.24	4.42
32	601012	隆基股份	765,606.00	4.33
33	000566	海南海药	747,865.00	4.23
34	600694	大商股份	741,016.39	4.19
35	600122	宏图高科	737,610.00	4.17
36	600811	东方集团	730,699.00	4.13
37	600169	太原重工	723,711.00	4.09
38	600320	振华重工	719,748.00	4.07
39	002266	浙富控股	715,898.33	4.05
40	002424	贵州百灵	715,305.00	4.05
41	600200	江苏吴中	712,512.00	4.03
42	000661	长春高新	693,875.00	3.93
43	600770	综艺股份	678,221.00	3.84
44	000616	海航投资	673,533.66	3.81
45	002004	华邦健康	671,418.00	3.80
46	600240	华业资本	670,560.20	3.79
47	600490	鹏欣资源	669,519.15	3.79
48	600528	中铁二局	666,691.00	3.77
49	002276	万马股份	665,061.48	3.76
50	600685	中船防务	655,395.50	3.71
51	600675	中华企业	652,542.76	3.69
52	600525	长园集团	651,576.53	3.69
53	000511	烯碳新材	648,664.00	3.67
54	600266	北京城建	646,267.00	3.66
55	002223	鱼跃医疗	641,291.07	3.63
56	600584	长电科技	639,071.00	3.62
57	600704	物产中大	635,886.00	3.60
58	000887	中鼎股份	634,047.00	3.59
59	300273	和佳股份	630,726.00	3.57
60	002063	远光软件	628,488.53	3.56
61	600755	厦门国贸	626,808.00	3.55
62	002285	世联行	625,575.00	3.54
63	000656	金科股份	621,426.00	3.52
64	600125	铁龙物流	616,991.00	3.49
65	600198	大唐电信	614,853.00	3.48
66	600651	飞乐音响	612,203.00	3.46
67	600611	大众交通	606,733.00	3.43

68	600312	平高电气	606,622.00	3.43
69	600816	安信信托	605,042.00	3.42
70	000078	海王生物	595,831.66	3.37
71	002191	劲嘉股份	595,645.00	3.37
72	600446	金证股份	595,536.00	3.37
73	600433	冠豪高新	593,169.00	3.36
74	002073	软控股份	592,029.00	3.35
75	002573	清新环境	584,809.00	3.31
76	600654	中安消	579,223.00	3.28
77	002250	联化科技	578,954.77	3.28
78	600582	天地科技	578,874.00	3.28
79	600171	上海贝岭	570,013.79	3.22
80	002161	远望谷	570,004.00	3.22
81	002405	四维图新	568,320.78	3.22
82	000930	中粮生化	565,537.00	3.20
83	600478	科力远	564,727.00	3.20
84	002690	美亚光电	562,660.42	3.18
85	000758	中色股份	561,976.00	3.18
86	600317	营口港	559,304.00	3.16
87	000415	渤海租赁	557,779.00	3.16
88	601608	中信重工	556,096.30	3.15
89	600787	中储股份	555,793.00	3.14
90	600376	首开股份	554,008.00	3.13
91	000006	深振业 A	548,564.68	3.10
92	001696	宗申动力	546,139.00	3.09
93	000829	天音控股	546,022.00	3.09
94	000031	中粮地产	545,526.80	3.09
95	002340	格林美	544,804.88	3.08
96	600098	广州发展	541,745.00	3.07
97	002179	中航光电	540,201.00	3.06
98	600138	中青旅	540,171.82	3.06
99	000939	凯迪生态	538,986.00	3.05
100	000988	华工科技	535,729.02	3.03
101	002595	豪迈科技	529,407.96	3.00
102	600759	洲际油气	526,888.00	2.98
103	600175	美都能源	525,161.00	2.97
104	600064	南京高科	522,409.00	2.96
105	600418	江淮汽车	522,408.00	2.96
106	601000	唐山港	521,852.00	2.95
107	600517	置信电气	518,136.14	2.93
108	600805	悦达投资	516,616.00	2.92
109	600673	东阳光科	507,766.00	2.87
110	600835	上海机电	503,632.00	2.85
111	600017	日照港	502,294.00	2.84

112	600499	科达洁能	502,165.00	2.84
113	002489	浙江永强	501,593.00	2.84
114	600511	国药股份	497,418.19	2.81
115	300115	长盈精密	497,106.11	2.81
116	600270	外运发展	495,042.00	2.80
117	002092	中泰化学	490,633.00	2.78
118	600458	时代新材	489,219.30	2.77
119	002013	中航机电	488,418.00	2.76
120	600325	华发股份	488,101.62	2.76
121	600426	华鲁恒升	487,979.00	2.76
122	600536	中国软件	487,592.00	2.76
123	002665	首航节能	486,468.00	2.75
124	600557	康缘药业	486,240.00	2.75
125	000652	泰达股份	484,409.00	2.74
126	603766	隆鑫通用	480,305.32	2.72
127	600422	昆药集团	479,040.95	2.71
128	000050	深天马 A	477,379.02	2.70
129	600428	中远航运	474,671.00	2.69
130	600160	巨化股份	474,664.00	2.69
131	600220	江苏阳光	470,503.00	2.66
132	000732	泰禾集团	470,090.46	2.66
133	600067	冠城大通	469,632.00	2.66
134	600110	中科英华	469,393.00	2.66
135	600410	华胜天成	468,071.00	2.65
136	600380	健康元	466,369.00	2.64
137	000671	阳光城	465,744.00	2.64
138	002271	东方雨虹	464,190.00	2.63
139	300147	香雪制药	463,652.00	2.62
140	600120	浙江东方	460,051.73	2.60
141	000718	苏宁环球	458,227.00	2.59
142	000681	视觉中国	457,750.03	2.59
143	000897	津滨发展	457,076.00	2.59
144	000667	美好集团	453,770.00	2.57
145	002508	老板电器	451,054.00	2.55
146	002311	海大集团	450,072.89	2.55
147	000816	智慧农业	448,695.73	2.54
148	600161	天坛生物	447,962.00	2.53
149	600183	生益科技	446,278.00	2.52
150	000777	中核科技	445,723.00	2.52
151	000528	柳工	445,222.00	2.52
152	601717	郑煤机	438,518.00	2.48
153	600079	人福医药	438,073.00	2.48
154	000090	天健集团	436,837.02	2.47
155	002440	闰土股份	436,624.00	2.47

156	600176	中国巨石	436,441.00	2.47
157	600978	宜华木业	436,436.00	2.47
158	600006	东风汽车	434,679.00	2.46
159	600580	卧龙电气	434,497.00	2.46
160	000748	长城信息	433,876.00	2.45
161	600409	三友化工	433,452.00	2.45
162	600432	吉恩镍业	432,449.00	2.45
163	002048	宁波华翔	432,297.71	2.45
164	600284	浦东建设	430,518.00	2.44
165	000088	盐田港	430,152.28	2.43
166	300134	大富科技	429,688.00	2.43
167	600112	天成控股	425,101.92	2.41
168	300033	同花顺	423,200.96	2.39
169	002273	水晶光电	422,788.00	2.39
170	601311	骆驼股份	422,544.00	2.39
171	000587	金叶珠宝	422,031.88	2.39
172	600187	国中水务	421,574.00	2.39
173	600545	新疆城建	421,455.00	2.38
174	600655	豫园商城	420,243.00	2.38
175	000685	中山公用	419,833.00	2.38
176	600594	益佰制药	419,420.00	2.37
177	002358	森源电气	417,095.00	2.36
178	000735	罗牛山	417,070.06	2.36
179	600180	瑞茂通	415,479.00	2.35
180	600062	华润双鹤	414,293.00	2.34
181	600699	均胜电子	414,040.00	2.34
182	600797	浙大网新	408,924.00	2.31
183	000422	湖北宜化	407,737.00	2.31
184	000848	承德露露	407,626.00	2.31
185	600261	阳光照明	406,994.99	2.30
186	600056	中国医药	405,907.00	2.30
187	300202	聚龙股份	405,828.00	2.30
188	000028	国药一致	403,463.00	2.28
189	000541	佛山照明	402,980.40	2.28
190	000592	平潭发展	401,674.00	2.27
191	002428	云南锗业	401,009.00	2.27
192	600216	浙江医药	399,241.00	2.26
193	002505	大康牧业	398,101.00	2.25
194	000099	中信海直	397,256.44	2.25
195	600289	亿阳信通	395,862.92	2.24
196	000680	山推股份	395,617.00	2.24
197	600521	华海药业	394,469.00	2.23
198	600885	宏发股份	394,463.00	2.23
199	002123	荣信股份	391,860.66	2.22

200	000488	晨鸣纸业	390,821.00	2.21
201	002390	信邦制药	390,808.18	2.21
202	600481	双良节能	388,432.00	2.20
203	002299	圣农发展	387,618.00	2.19
204	002052	同洲电子	387,419.00	2.19
205	000973	佛塑科技	386,036.79	2.18
206	600143	金发科技	385,341.65	2.18
207	300039	上海凯宝	384,778.00	2.18
208	000830	鲁西化工	384,245.00	2.17
209	300072	三聚环保	383,698.00	2.17
210	000572	海马汽车	380,712.00	2.15
211	300244	迪安诊断	379,312.00	2.15
212	002219	恒康医疗	378,523.00	2.14
213	002005	德豪润达	377,886.00	2.14
214	000933	神火股份	377,226.99	2.13
215	600812	华北制药	375,684.00	2.13
216	000975	银泰资源	373,991.00	2.12
217	002029	七匹狼	373,540.00	2.11
218	002155	湖南黄金	373,508.98	2.11
219	600884	杉杉股份	372,044.54	2.10
220	600736	苏州高新	371,244.00	2.10
221	002444	巨星科技	370,349.00	2.10
222	600260	凯乐科技	369,472.00	2.09
223	000555	神州信息	369,436.00	2.09
224	002237	恒邦股份	368,932.00	2.09
225	002168	深圳惠程	368,350.00	2.08
226	000062	深圳华强	367,593.00	2.08
227	601666	平煤股份	367,369.00	2.08
228	600851	海欣股份	362,976.00	2.05
229	600757	长江传媒	360,155.00	2.04
230	002011	盾安环境	360,038.00	2.04
231	000513	丽珠集团	359,763.60	2.04
232	600522	中天科技	359,586.90	2.03
233	002221	东华能源	358,862.00	2.03
234	600487	亨通光电	356,175.00	2.02
235	600859	王府井	355,579.00	2.01
236	600039	四川路桥	354,842.00	2.01
237	600300	维维股份	354,478.00	2.01
238	601880	大连港	354,280.00	2.00
239	600993	马应龙	353,747.00	2.00
240	600500	中化国际	353,424.68	2.00

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末无股指期货的持仓。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.11.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末无国债期货持仓。

8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

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

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

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

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600978	宜华木业	681,685.59	3.12	重大事项
2	000066	长城电脑	283,566.92	1.30	重大事项
3	000748	长城信息	454,112.00	2.08	重大事项
4	002219	恒康医疗	217,584.70	0.99	重大事项

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002018	华信国际	290,890.00	1.33	重大事项
2	000982	中银绒业	28,582.40	0.13	重大事项

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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

9.2 期末上市基金前十名持有人

金鹰 500A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	上海明法投资管理有限公司—明法CTA 一号基金	1,113,453.00	42.41%
2	上海明法投资管理有限公司—明法多策略对冲 1 号基金	424,069.00	16.15%
3	杨长志	204,100.00	7.77%
4	北京千石创富—招商银行—千石资本—华宝证券明法套利 1 号资	94,562.00	3.60%
5	陈杰	86,754.00	3.30%

6	毛杰	52,318.00	1.99%
7	储彩娥	44,100.00	1.68%
8	贺敬	43,377.00	1.65%
9	陈运珍	42,800.00	1.63%
10	徐进	42,526.00	1.62%

注：金鹰中证500指数分级A

金鹰500B

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

注：金鹰中证500指数分级B

金鹰500

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

注：金鹰中证500指数基金场内份额

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	金鹰 500A	29.00	0.00%
	金鹰 500B	-	-
	金鹰 500	1,398.00	0.01%
	合计	1,427.00	0.01%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	金鹰 500A	0
	金鹰 500B	0
	金鹰 500	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	金鹰 500A	0
	金鹰 500B	0
	金鹰 500	0
	合计	0

注：无

9.5 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金非发起式基金，本公司未持有基金份额。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	金鹰 500A	金鹰 500B	金鹰 500
基金合同生效日（2012 年 6 月 5 日）基金份额总额	26,209,859.00	26,209,859.00	341,051,468.50
本报告期期初基金份额总额	2,184,647.00	2,184,647.00	8,945,225.00
本报告期基金总申购份额	-	-	208,435,162.84
减：本报告期基金总赎回份额	-	-	231,218,687.14
本报告期基金拆分变动份额	441,096.00	441,096.00	25,440,900.98
本报告期期末基金份额总额	2,625,743.00	2,625,743.00	11,602,601.68

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

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

2、本基金三级份额之间转换拆分产生份额变化。

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

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

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

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金报告期内无涉及基金管理人、基金财产的诉讼。

本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金报告期内没有改变基金投资策略。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金审计的会计师事务所为中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）。

本报告期内实际应支付会计师事务所的审计费为 25000 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金报告期内无管理人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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

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

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

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

本基金专用交易单位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单位的证券经营机构。
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单位租用协议。

11.7.2 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
华林证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

爱建证券	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---

11.8 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资产净值等的公告	证券时报等	2015-01-05
2	金鹰中证 500 指数分级证券投资基金定期份额折算期间金鹰中证 500A 份额停复牌的公告	证券时报等	2015-01-06
3	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金参加中国工商银行“2015 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	证券时报等	2015-01-06
4	金鹰中证 500A 定期份额折算后前收盘价调整的公告	证券时报等	2015-01-07
5	金鹰中证 500 指数分级证券投资基金定期份额折算结果公告	证券时报等	2015-01-07
6	关于金鹰中证 500 指数分级证券投资基金之金鹰中证 500A 份额第四个运作周年约定年基准收益率的公告	证券时报等	2015-01-07
7	金鹰中证 500 指数分级基金更新的招募说明书摘要 2014 年第 2 号	证券时报等	2015-01-09
8	金鹰基金管理有限公司关于董事长变更的公告	证券时报等	2015-01-12
9	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	证券时报等	2015-01-13
10	金鹰基金管理有限公司关于网上交易银联通系统升级暂停服务的公告	证券时报等	2015-01-13
11	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金参加中国工商银行“2015 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	证券时报等	2015-01-16
12	金鹰基金管理有限公司关于增加中国民族证券有限责任公司为代销机构的公告	证券时报等	2015-01-16
13	金鹰中证 500 指数分级证券投资基金 2014 年第 4 季度报告	证券时报等	2015-01-22
14	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京恒天明泽基金销售有限公司定投及费率优惠活动的公告	证券时报等	2015-01-26
15	金鹰中证 500 指数分级证券投资基金关于增聘基金经理的公告	证券时报等	2015-03-06
16	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金在代销机构天源证券开通转换业务的公告	证券时报等	2015-03-06
17	金鹰基金管理有限公司关于在工商银行开通旗下部分基金转换业务的公告	证券时报等	2015-03-06
18	金鹰基金管理有限公司关于增加东北证券股	证券时报等	2015-03-09

	份有限公司为代销机构的公告		
19	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与齐鲁证券定投及费率优惠活动的公告	证券时报等	2015-03-18
20	金鹰中证 500 指数分级证券投资基金基金经理变更公告	证券时报等	2015-03-30
21	【年报】金鹰中证 500 指数分级证券投资基金 2014 年年度报告（摘要）	证券时报等	2015-03-31
22	金鹰基金管理有限公司关于增加联讯证券股份有限公司为代销机构的公告	证券时报等	2015-04-01
23	金鹰基金管理有限公司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的公告	证券时报等	2015-04-01
24	金鹰中证 500 指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的提示公告	证券时报等	2015-04-14
25	金鹰基金管理有限公司关于增加德邦证券股份有限公司为代销机构的公告	证券时报等	2015-04-15
26	金鹰基金管理有限公司关于增加宏信证券为代销机构的公告	证券时报等	2015-04-15
27	金鹰中证 500 指数分级证券投资基金 2015 年第 1 季度报告	证券时报等	2015-04-21
28	金鹰基金管理有限公司关于增加华鑫证券有限责任公司为代销机构的公告	证券时报等	2015-04-24
29	金鹰基金管理有限公司关于网上交易系统升级暂停服务的公告	证券时报等	2015-05-08
30	金鹰中证 500 指数分级证券投资基金不定期份额折算公告	证券时报等	2015-05-13
31	关于金鹰中证 500 指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务期间金鹰 500A 份额、金鹰 500B 份额停复牌公告	证券时报等	2015-05-14
32	关于金鹰中证 500 指数分级证券投资基金不定期份额折算后次日收盘前收盘价调整的公告	证券时报等	2015-05-15
33	金鹰中证 500 指数分级证券投资基金不定期份额折算结果及恢复交易的公告	证券时报等	2015-05-15
34	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华鑫证券定投及费率优惠活动的公告	证券时报等	2015-05-27
35	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金参加深圳众禄基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证券时报等	2015-06-01
36	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华安证券定投及费率优惠活动的公告	证券时报等	2015-06-03
37	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增稠州银行为代销机构的公告	证券时报等	2015-06-11
38	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海汇付金融服务有限公司为代销机构并	证券时报等	2015-06-11

	开通定投、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告		
39	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海联泰资产管理有限公司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	证券时报等	2015-06-25
40	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	证券时报等	2015-06-29
41	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	证券时报等	2015-07-01
42	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金参加杭州数米基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证券时报等	2015-07-08
43	金鹰中证 500 指数分级证券投资基金 2015 年第 2 季度报告	证券时报等	2015-07-20
44	金鹰中证 500 指数分级基金更新招募说明书摘要 2015 年第 1 号	证券时报等	2015-07-20
45	金鹰中证 500 指数分级证券投资基金关于增聘基金经理的公告	证券时报等	2015-07-22
46	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金在代销机构申万宏源证券开通转换业务的公告	证券时报等	2015-07-23
47	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金参加上海天天基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证券时报等	2015-07-31
48	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海浦东发展银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	证券时报等	2015-07-31
49	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金参加基金第三方销售机构费率优惠活动的公告	证券时报等	2015-08-03
50	金鹰基金管理有限公司关于基金纸质对账单服务调整的公告	证券时报等	2015-08-05
51	金鹰基金管理有限公司关于增加五矿证券为金鹰中证 500 指数分级证券投资基金代销机构的公告	证券时报等	2015-08-07
52	金鹰基金管理有限公司关于增加中信期货有限公司为代销机构的公告	证券时报等	2015-08-17
53	金鹰基金管理有限公司关于增加大同证券有限责任公司为代销机构的公告	证券时报等	2015-08-20
54	金鹰基金管理有限公司关于增加太平洋证券股份有限公司为代销机构的公告	证券时报等	2015-08-20
55	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中金公司费率优惠活动的公告	证券时报等	2015-08-20
56	金鹰中证 500 指数分级证券投资基金金鹰中证 500B 份额交易价格波动提示公告	证券时报等	2015-08-27

57	金鹰中证 500 指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	证券时报等	2015-08-27
58	【半年报】金鹰中证 500 指数分级证券投资基金 2015 年半年度报告（摘要）	证券时报等	2015-08-31
59	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海证券有限责任公司为代销机构并开通定投、转换业务的公告	证券时报等	2015-08-31
60	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增西部证券股份有限公司为代销机构并开通定投、转换业务的公告	证券时报等	2015-08-31
61	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海证券有限责任公司为代销机构并开通定投、转换业务的公告	证券时报等	2015-08-31
62	金鹰中证 500 指数分级证券投资基金金鹰中证 500B 份额交易价格波动提示公告	证券时报等	2015-09-02
63	金鹰中证 500 指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	证券时报等	2015-09-02
64	金鹰中证 500 指数分级证券投资基金金鹰中证 500B 份额交易价格波动提示公告	证券时报等	2015-09-07
65	金鹰中证 500 指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	证券时报等	2015-09-07
66	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增深圳富济财富管理有限公司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	证券时报等	2015-09-07
67	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国泰君安证券股份有限公司为代销机构的公告	证券时报等	2015-09-08
68	金鹰中证 500 指数分级证券投资基金金鹰中证 500B 份额交易价格波动提示公告	证券时报等	2015-09-08
69	金鹰中证 500 指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	证券时报等	2015-09-08
70	金鹰中证 500 指数分级证券投资基金金鹰中证 500B 份额交易价格波动提示公告	证券时报等	2015-09-09
71	金鹰中证 500 指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	证券时报等	2015-09-09
72	金鹰中证 500 指数分级证券投资基金金鹰中证 500B 份额交易价格波动提示公告	证券时报等	2015-09-15
73	金鹰中证 500 指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	证券时报等	2015-09-15
74	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增兴业银行股份有限公司为代销机构并开通定投、转换业务及参加申购费率优惠活动的公告	证券时报等	2015-09-15

75	关于调整金鹰 500B(证券编码: 150089)折算基准日证券简称的公告	证券时报等	2015-09-16
76	金鹰中证 500 指数分级证券投资基金 B 类份额不定期份额折算的风险提示公告	证券时报等	2015-09-16
77	金鹰中证 500 指数分级证券投资基金不定期份额折算公告	证券时报等	2015-09-16
78	关于金鹰中证 500 指数分级证券投资基金之金鹰 500B 份额停复牌的公告	证券时报等	2015-09-16
79	关于恢复金鹰中证 500 指数分级证券投资基金 B 类份额证券简称的公告	证券时报等	2015-09-17
80	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增诺亚正行基金销售为代销机构并开通定投业务的公告	证券时报等	2015-09-17
81	关于金鹰中证 500 指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务期间金鹰 500A 份额、金鹰 500B 份额停复牌公告	证券时报等	2015-09-17
82	关于金鹰中证 500 指数分级证券投资基金不定期份额折算后次日前收盘价调整的公告	证券时报等	2015-09-18
83	金鹰中证 500 指数分级证券投资基金不定期份额折算结果及恢复交易的公告	证券时报等	2015-09-18
84	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海陆金所资产管理有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	证券时报等	2015-09-21
85	金鹰基金管理有限公司关于增加北京君德汇富投资咨询有限公司为代销机构及参与其费率优惠活动的公告	证券时报等	2015-09-22
86	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增兴业银行股份有限公司为代销机构并开通定投、转换业务及参加申购费率优惠活动的公告	证券时报等	2015-09-23
87	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增深圳市新兰德证券投资咨询有限公司为代销机构的公告	证券时报等	2015-09-23
88	金鹰基金管理有限公司关于增加嘉实财富管理有限公司为代销机构并开通转换、费率优惠活动的公告	证券时报等	2015-09-25
89	金鹰基金管理有限公司关于网上交易系统升级暂停服务的公告	证券时报等	2015-09-30
90	金鹰基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金交易下限的公告	证券时报等	2015-10-16
91	金鹰基金管理有限公司关于网上交易系统升级暂停服务的公告	证券时报等	2015-10-16
92	金鹰基金管理有限公司关于增加汇付金融为旗下部分基金代销机构的公告	证券时报等	2015-10-19

93	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增大泰金石投资管理有限公司为代销机构并开通转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	证券时报等	2015-10-19
94	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国都证券费率优惠并开通转换业务的公告	证券时报等	2015-10-20
95	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京乐融多源投资咨询有限公司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	证券时报等	2015-10-21
96	金鹰基金管理有限公司关于增加陆金所资管为旗下部分基金代销机构的公告	证券时报等	2015-10-21
97	金鹰中证 500 指数分级证券投资基金 2015 年第 3 季度报告	证券时报等	2015-10-27
98	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国都证券费率优惠并开通转换业务的公告	证券时报等	2015-10-29
99	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国金证券开通转换业务的公告	证券时报等	2015-11-02
100	金鹰基金管理有限公司关于增加深圳富济财富管理有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	证券时报等	2015-11-13
101	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠的公告	证券时报等	2015-11-13
102	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金参与陆金所资管认购费率优惠的公告	证券时报等	2015-11-16
103	金鹰基金管理有限公司关于增加上海长量基金销售投资顾问有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	证券时报等	2015-11-23
104	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海凯石财富基金销售有限公司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	证券时报等	2015-11-23
105	金鹰基金管理有限公司关于增加南充市商业银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	证券时报等	2015-11-25
106	关于金鹰基金管理公司新增增财基金销售公司为代销机构并开通基金定投、转换及参与费率优惠活动的公告	证券时报等	2015-11-26
107	关于金鹰基金管理公司新增浙商证券为旗下部分基金的代销机构并开通基金定投、转换及参与费率优惠活动的公告	证券时报等	2015-11-26
108	关于金鹰基金新增一路财富为代销机构并开通基金定投、转换及参与费率优惠活动的公告	证券时报等	2015-11-26

109	金鹰基金管理有限公司关于增加上海陆金所资产管理有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	证券时报等	2015-11-28
110	金鹰基金管理有限公司关于新增天津滨海农商行为代销机构并开通基金定投及转换业务的公告	证券时报等	2015-11-28
111	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加国信证券股份有限公司费率优惠活动并开通定投、转换业务的公告	证券时报等	2015-12-08
112	金鹰基金管理有限公司关于增加招商银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	证券时报等	2015-12-15
113	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东方证券股份有限公司为代销机构的公告	证券时报等	2015-12-16
114	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增海通证券股份有限公司为代销机构公告	证券时报等	2015-12-18
115	金鹰基金管理有限公司关于网上交易系统升级暂停服务的公告	证券时报等	2015-12-18
116	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与海通证券股份有限公司费率优惠并开通定投、转换业务的公告	证券时报等	2015-12-22
117	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	证券时报等	2015-12-29
118	金鹰基金管理有限公司关于增加北京乐融多源投资咨询有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	证券时报等	2015-12-29
119	金鹰中证 500 指数分级证券投资基金定期份额折算公告	证券时报等	2015-12-29
120	金鹰基金管理有限公司关于指数熔断机制实施后调整旗下基金开放时间的公告	证券时报等	2015-12-31
121	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	证券时报等	2015-12-31
122	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所公告	证券时报等	2015-12-31
123	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国光大银行股份有限公司费率优惠活动的公告	证券时报等	2015-12-31
124	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国邮政储蓄银行股份有限公司费率优惠活动的公告	证券时报等	2015-12-31
125	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加平安银行股份有限公司费率优惠活动的公告	证券时报等	2015-12-31
126	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加平安银行股份有限公司费率优惠活动的公	证券时报等	2015-12-31

告		
---	--	--

注：相关信息披露文件请登录本基金管理人网站查询。

§12 影响投资者决策的其他重要信息

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

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准金鹰中证 500 指数分级证券投资基金发行及募集的文件。
- 2、《金鹰中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》。
- 3、《金鹰中证 500 指数分级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。

13.2 存放地点

广州市天河区珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

13.3 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

二〇一六年三月三十日