金鹰成份股优选证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011年6月30日

基金管理人:金鹰基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2011年8月25日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

本基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同的规定,于2011年8月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、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。

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

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

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

本报告期为2011年1月1日起至2011年6月30日止,本报告财务资料未经审计。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	金鹰成份优选混合
基金主代码	210001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年6月16日
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,977,586,746.94份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过资产配置和对投资组合的动态调整,在控制投资组合风险的前提下,实现基金的中长期资本增值和获取适当、稳定的现金收益。
投资策略	本基金通过综合分析宏观经济、政策及证券市场的现状和发展趋势的基础上,合理预期各类别资产收益率和风险水平,并据此构建一个包括主要投资于上证180指数成份股和深证100指数成份股、国债等债券及现金等资产的投资组合,适时调整组合中各类别资产的比例,在控制投资组合风险的前提下,实现基金资产的中长期增值和获取适当、稳定的当前收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为75%的成份股加权指数的收益率加上25%的中信标普国债指数的收益率。@成份股加权指数为上证180指数和深证100指数按其各自成份股流通市值加权平均值。
风险收益特征	本基金为风险水平中等偏下、预期收益水平适中的证券投资基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		金鹰基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	苏文锋	唐州徽
	联系电话	020-83282627	010-66594855
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		4006-135-888、020-83936180	95566
传真		020-83282856	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gefund.com.cn
基金半年度报告备置地点	广州市天河区体育西路189号城建大厦22-23层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2011年1月1日至2011年6月30日)
本期已实现收益	26,198,397.45
本期利润	-59,508,440.92
加权平均基金份额本期利润	-0.0293
本期基金份额净值增长率(%)	-4.07
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0130
期末基金资产净值	1,436,145,009.52
期末基金份额净值	0.7262

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;

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

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

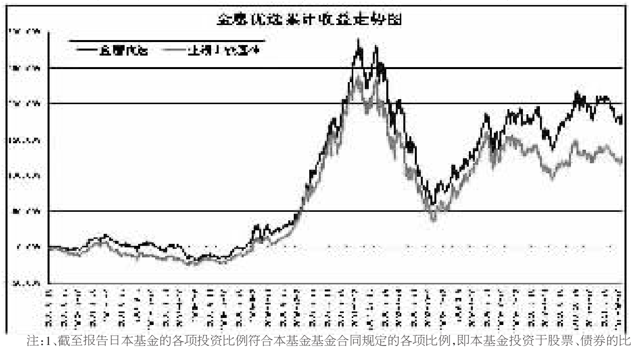
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①(%)	份额净值增长率标准差②(%)	业绩比较基准收益率③(%)	业绩比较基准收益率标准差④(%)	①-③(%)	②-④(%)
过去一个月	2.83	1.06	0.69	0.89	2.14	0.17
过去三个月	-5.21	0.91	-4.02	0.83	-1.19	0.08
过去六个月	-4.07	1.04	-1.04	0.92	-3.03	0.12
过去一年	18.27	1.23	13.89	1.04	4.38	0.19
过去三年	21.54	1.56	12.76	1.51	8.78	0.05
自基金合同生效起至今	185.19	1.45	124.55	1.41	60.64	0.04

注:本基金的业绩比较基准为75%的成份股加权指数的收益率加上25%的中信国债指数的收益率。成份股加权指数为上证180指数和深证100指数按其各自成份股流通市值加权平均值。所采用的指数均是市场公开披露的指数。

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



注:1、截至报告日本基金的各项投资比例符合本基金基金合同规定的各项比例,即本基金投资于股票、债券的比例不得低于基金资产总值的80%,投资于国家债券的比例不得低于基金资产净值的20%;@2、本基金的业绩比较基准为:75%的成份股加权指数的收益率加上25%的中信标普国债指数的收益率。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

金鹰基金管理有限公司经中国证监会证监基字[2002]97号文批准,于2002年12月25日成立,是自律制度下中国证监会批准设立的首批基金管理公司之一。公司注册资本2.5亿元人民币,股东包括广州证券有限责任公司、广州药业股份有限公司、广东美的电器股份有限公司和东亚联丰投资管理有限公司,分别持有49%、20%、20%和11%的股份。

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

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

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

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
林华显	基金经理	2011年3月1日	-	9年	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、基金经理助理等职。2009年10月12日开始担任金鹰成份股优选证券投资基金基金经理助理,协助基金经理管理金鹰成份股优选证券投资基金。现任本基金基金经理。
杨绍基	投资管理部总监,基金经理	2009年9月8日	2011年3月12日	6年	杨绍基先生,经济学博士,证券从业经历六年。曾任职于广东发展银行资产管理部,2007年8月加入金鹰基金管理有限公司,先后担任行业研究员、基金经理助理、基金经理、研究发展部副总监等职,现任公司投资管理部总监、投资决策委员会委员,兼任金鹰中小盘精选证券投资基金、金鹰稳健成长股票型证券投资基金及本基金基金经理。

注:1、任职日期和离任日期指公司公告聘任或解聘日期;

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定;

3、杨绍基先生自2011年3月12日起不再担任金鹰成份股优选证券投资基金基金经理职务,但继续担任本基金管理人旗下金鹰中小盘精选证券投资基金和金鹰稳健成长股票型证券投资基金基金经理;

4、目前,本基金由林华显先生单独管理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》和其他有关法律法规及其各项实施准则、《金鹰成份股优选证券投资基金基金合同》的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作合法合规,无出现重大违法违规或违反基金合同的行为,无损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程来确保公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等,并重视交易执行环节的公平交易措施,以"时间优先、价格优先"作为执行指令的基本原则,对在同一个交易系统中交易的组合,启用投资交易系统中的公平交易模块,以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内,公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金本报告期无与其他投资风格相似的投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011年上半年,宏观面上,经济高增长逐步减速与通胀逐步走高并存,对投资与房地产依赖度增强,货币政策"三率"(汇率、利率和准备金率)齐动对抗通胀,引发市场利率急速上升和地方融资平台收支紧张,"滞胀"与货币政策超调担忧加强。相应A股市场表现上,上证综指上冲3000点未果后单边下跌,下探2600点后反弹,半年下跌1.64%,中小板综指跌幅相对较大,风格表现上大盘股相对占优并符合本基金风格取向。板块表现上,房地产、家电、建材、化工与钢铁股表现相对较强,周期性行业成为主要热点。

上半年,围绕经济增长以投资为主导,从一季度配置银行、家电、化工与钢铁等,到二季度配置房地产、汽车、家电、科技等为主,谋求从需求源头把握行业复苏。本基金仓位相对稳定,一度根据生猪价格大幅上涨可能导致CPI超预期而降低仓位,但依然低估了系统性风险和银行等大盘股调整幅度,仓位下降幅度略显不足。根据房地产开发信托利率大幅飙升反映资金日趋紧张和库存加速增加背景,判断房价松动日益临近,房地产股反弹条件趋向成熟而加大地产股配置,同时房地产开发资金紧张与保障性住房面临加快融资条件下,第三季度国内固定资产投资增速高位可能面临加快回落,因而大幅减持钢铁、化工等周期板块个股,看好新兴消费、科技热点并增加配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2011年6月30日,基金份额净值为0.7262元,本报告期份额净值增长率为-4.07%,同期业绩比较基准增长率为-1.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2011年下半年,从利率市场急速上升和地方融资平台收支紧张看,货币政策已显超调,宏观调控接近尾声。从轮番涨价的各种工业品(国际大宗商品、国内建材、金属等)、农产品和消费品(食品饮料、服装)需求量加速下滑看,通胀已在赶顶。但考虑到通胀刚性和控制通胀需要牺牲一定经济增长速度,高房价尚未明显松动,预计第三季度货币政策紧缩力度接近尾声,但放松可能性也不大,宏观调控进入观察期。考虑到调控政策对经济增长叠加效应将在第三季度充分体现,预计投资品和消费品将面临需求低于预期风险,需要从汽车、房地产(包括保障性住房)两大需求源头去把握经济增长强度和脉络。

有鉴于此判断,看好调控压力最大的地产股预期改善,看好成本压力最大的航空、汽车、钢铁、元器件等行业在高通胀预期回落下毛利改善带来的反弹,看好订单锁定未来增长并进一步受益保障性住房推广的建筑等基建板块、新兴的海洋工程、物连网等板块。但密切关注房地产去库存进度及可能引发地方融资平台违约风险,在风险加大时降低仓位。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守2006年2月15日颁布的《企业会计准则》、2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》(证监会计字[2007]15号)与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的的指导意见》(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负责估值工作的高管、合规人员、基金经理、负责估值工作的部门负责人、基金会计组成。在特殊情况下,公司估值召集估值委员会会议,讨论和决策特殊估值事项,估值委员会问题决策,需到会的三分之二估值委员会成员表决通过 。

本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

本报告期内,本基金未签约与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截至报告期末,本基金可分配利润为25,698,740.34元。

本报告期期初,本基金管理人决定以2010年12月31日的可分配收益为基准,对2010年利润进行如下分配安排:向本基金份额持有人按每10份基金份额派发现金红利0.100元,分红权益登记日为2011年1月11日,除息日为2011年1月11日。本次利润分配总金额为20,792,103.76元,其中现金形式发放总额为8,535,601.88元,再投资形式发放总额为12,256,501.88元。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在金鹰成份股优选证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,尽职尽责地履行了义务。

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

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 半年度财务报表(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:金鹰成份股优选证券投资基金

报告截止日:2011年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末(2011年6月30日)	上年度末(2010年12月31日)
资 产:		
银行存款	71,765,710.09	33,824,680.60
结算备付金	5,801,474.41	2,918,271.86
存出保证金	1,448,783.26	1,404,544.52
交易性金融资产	1,412,259,891.66	1,563,562,687.31
其中:股票投资	1,067,356,087.86	1,219,960,709.71
基金投资	-	-
债券投资	344,903,803.80	343,601,977.60
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	210,000,635.00	290,000,995.00
应收证券清算款	3,905,292.59	-
应收利息	6,977,277.04	2,873,203.95
应收股利	2,202,252.44	-
应收申购款	37,100.00	114,599.04
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,714,398,416.49	1,894,698,982.28

负债和所有者权益	本期末(2011年6月30日)	上年度末(2010年12月31日)
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	260,000,000.00	290,000,000.00
应付证券清算款	12,832,845.87	96,573.60
应付赎回款	775,715.47	358,121.17
应付管理人报酬	1,731,226.85	2,079,872.72
应付托管费	288,537.84	346,645.44
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	909,015.47	1,488,350.18
应交税费	-	-
应付利息	269,493.12	5,853.26
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,446,572.35	1,422,508.33
负债合计	278,253,406.97	295,797,924.70
所有者权益:		
实收基金	1,295,617,149.29	1,365,588,083.36
未分配利润	140,527,860.23	233,312,974.22
所有者权益合计	1,436,145,009.52	1,598,901,057.58
负债和所有者权益总计	1,714,398,416.49	1,894,698,982.28

注:截至报告期末2011年6月30日,本基金份额净值为0.7262元,基金份额总额为1,977,586,746.94份。

6.2 利润表

会计主体:金鹰成份股优选证券投资基金

本报告期:(2011年1月1日至2011年6月30日)

单位:人民币元

项 目	本期(2011年1月1日至2011年6月30日)	上年度可比期间(2010年1月1日至2010年6月30日)
一、收入	-38,886,333.78	-238,585,207.39
1.利息收入	8,005,943.60	5,380,036.77
其中:存款利息收入	233,856.72	306,389.43
债券利息收入	5,353,186.86	5,073,647.34
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	2,418,900.02	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	38,666,752.13	-18,876,541.27
其中:股票投资收益	30,810,017.89	-17,228,535.25
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-1,319,031.71	-4,554,425.26
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	9,175,765.95	2,906,419.24
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-85,706,838.37	-225,215,802.00
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	147,808.86	127,099.11
减:二、费用	20,622,107.14	20,934,113.03
1.管理人报酬	11,345,726.58	12,307,029.30
2.托管费	1,890,954.46	2,051,171.50
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	5,056,703.00	6,390,124.31
5.利息支出	2,130,727.62	-
其中:卖出回购金融资产支出	2,130,727.62	-
6.其他费用	197,995.48	185,787.92
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-59,508,440.92	-259,519,320.42
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-59,508,440.92	-259,519,320.42

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:金鹰成份股优选证券投资基金

本报告期:(2011年1月1日至2011年6月30日)

单位:人民币元

项目	本期(2011年1月1日至2011年6月30日)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,365,588,083.36	233,312,974.22	1,598,901,057.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-59,508,440.92	-59,508,440.92
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)	-69,970,934.07	-12,484,569.31	-82,455,503.38
其中:1.基金申购款	31,204,442.44	4,579,418.35	35,783,860.79
2.基金赎回款	-101,175,376.51	-17,063,987.66	-118,239,364.17
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)	-	-20,792,103.76	-20,792,103.76
五、期末所有者权益(基金净值)	1,295,617,149.29	140,527,860.23	1,436,145,009.52
项目	上年度可比期间(2010年1月1日至2010年6月30日)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,477,511,980.02	346,312,777.75	1,823,824,757.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-259,519,320.42	-259,519,320.42
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)	25,131,563.22	5,296,674.59	30,428,237.81
其中:1.基金申购款	109,793,769.44	15,584,901.35	125,378,670.79
2.基金赎回款	-84,662,206.22	-10,288,226.76	-94,950,432.98
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)	-	-167,671,877.86	-167,671,877.86
五、期末所有者权益(基金净值)	1,502,643,543.24	-75,581,745.94	1,427,061,797.30

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4的财务报表由下列负责人签署:

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

6.4 报表附注

6.4.1 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本半年度财务报表所采用的会计政策、会计估计与上年度财务报表相一致。

6.4.1.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年1月1日至12月31日。

6.4.1.2 记账本位币

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

6.4.1.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1)金融资产分类

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

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

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

(2)金融负债分类

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

6.4.1.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

处置该金融资产或金融负债时,其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益,其中包括同时结转的公允价值变动收益。

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

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,终止确认该金融负债或其一部分。

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

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下:

(1)股票投资

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

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

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

(2)债券投资

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

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

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

卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券投资收益。

卖出未上市债券和银行间同业市场交易的债券于成交日确认债券投资收益。

卖出债券的成本按移动加权平均法结转。

(3)权证投资

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

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

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

(4)分离交易可转债

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

上市后,上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算。

(5)回购协议

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

6.4.1.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金目前金融资产和金融负债的估值原则和方法如下:

1、股票估值原则和方法

(1)上市流通股票的估值

上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,以最近交易日的收盘价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格。

(2)未上市股票的估值

送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票,按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,以最近交易日的收盘价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格。

首次发行未上市的股票,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按成本估值。

(3)长期停牌股票的估值

已停牌股票且潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的,则相应股票采用指数收益法确定其公允价值。指数收益法是指对于需要进行估值的股票,在估值日以公开发布的相应交易市场和相应行业指数的日收益率作为该股票的收益率,然后根据此收益率计算该股票当日的公允价值。

(4)有明确锁定期股票的估值

首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按交易所上市的同一股票的收盘价估值;非公开发行且处于明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

2、固定收益证券的估值原则和方法

(1)证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘净价估值,估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日的收盘净价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格。

(2)证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息(自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息)得到的净价进行估值,估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日债券收盘价减去债券应收利息后的净价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格。

(3)未上市债券采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按成本估值。

(4)在银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种,采用估值技术确定公允价值。

(5)交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本进行后续计量。

(6)同一债券同时在两个或两个以上市场交易的,按债券所处的市场分别估值。

3、权证估值原则和方法

(1)配股权证的估值:

因持有股票而享有的配股权,类同权证处理方式的,采用估值技术进行估值。

(2)认沽/认购权证的估值:

从持有确认日起到卖出日或行权日止,上市交易的认沽/认购权证按估值日的最近交易日的收盘价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格。未上市交易的认沽/认购权证采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按成本估值;停止交易、但未行权的权证,采用估值技术确定公允价值。

4、其他资产的估值原则和方法

其他资产按照国家有关规定或行业约定进行估值。

5、在任何情况下,基金管理人采用上述1-4项规定的方法对基金财产进行估值,均应被认为采用了适当的估值方法。但是,如果基金管理人有充足的理由认为按上述方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素的基础上与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

6、国家有最新规定的,按其规定进行估值。

6.4.1.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.1.7 实收基金

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

6.4.1.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在"损益平准金"科目中核算,并于期末全额转入"未分配利润/(累计亏损)"。

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

6.4.1.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

6.4.1.10 费用的确认和计量

1、基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率逐日计提;

2、基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率逐日计提;

3、卖出回购证券支出,按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在回购期内逐日计提;

4、其他费用系根据有关法规及相应协议规定,按实际支出金额,列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第五位的,则采用待摊或预提的方法。

6.4.1.11 基金的收益分配政策

1、基金当年收益分配比例不得低于当年基金净收益的90%;

2、基金收益分配每年至少分配一次,但若本基金成立至基金会计年度结束不足三个月可不进行收益分配,年度分配在基金会计年度结束后的四个月内完成;

3、基金当年收益应先弥补上一年度亏损后,才可进行当年收益分配;

4、基金投资亏损,或者基金当年虽有收益但基金份额净值低于面值,则不进行收益分配;

5、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;

6、基金份额持有人可以选择取得现金或将所获红利再投资于本基金;选择采取红利再投资形式的,分红现金按红利发放日的基金份额净值转成相应的基金份额;本基金分红的默认方式为现金红利方式;

7、红利分配时所发生的银行转帐或其他注册登记费用由投资者自行承担,若基金管理人收取该项费用,具体提取标准和方法应予以公告;

8、每份基金份额享有同等分配权;

9、法律、法规或中国证监会另有规定的,从其规定。

6.4.1.12 外币交易

本基金本报告期内无外币交易。

6.4.1.13 分部报告

本基金本报告期内无分部报告。

6.4.1.14 其他重要的会计政策和会计估计

无其他重要的会计政策和会计估计。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无会计估计变更。

6.4.2.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无差错更正。

6.4.3 关联方关系

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

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期(2011年1月1日至2011年6月30日)		上年度可比期间(2010年1月1日至2010年6月30日)	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
广州证券	252,861,521.31	7.77	106,638,025.23	2.60

6.4.4.1.2 权证交易

本基金本报告期内没有通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.4.1.3 债券交易

本基金本报告期内没有通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.4.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内没有通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期(2011年1月1日至2011年6月30日)			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
广州证券	205,452.11	7.52	42,522.59	4.70
关联方名称	上年度可比期间(2010年1月1日至2010年6月30日)			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
广州证券	86,644.36	2.51	86,644.36	5.31

注:1、上述佣金按市场佣金率计算,并以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取,并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2、向关联方支付的交易佣金采用公允的交易佣金比率计算。关联方席位租用合同还规定佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期(2011年1月1日至2011年6月30日)	上年度可比期间(2010年1月1日至2010年6月30日)
当期发生的基金应支付的管理费	11,345,726.58	12,307,029.30
其中:应支付给销售机构的客户维护费	201,458.84	182,675.68

注:1、基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提,计算方法如下:@H=E×1.5%/当年天数@H为每日应支付的基金管理费@E为前一日的基金资产净值@2、基金管理费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付;由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期(2011年1月1日至2011年6月30日)	上年度可比期间(2010年1月1日至2010年6月30日)
当期发生的基金应支付的托管费	1,890,954.46	2,051,171.50

注:1、基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:@H=E×0.25%/当年天数@H为每日应支付的基金托管费@E为前一日的基金资产净值@2、基金托管费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付;由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

6.4.4.2.3 销售服务费

本基金本报告期内没有应支付关联方的销售服务费。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内没有与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

截至报告期末,本基金没有除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期(2011年1月1日至2011年6月30日)		上年度可比期间(2010年1月1日至2010年6月30日)	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	71,765,710.09	170,219.98	148,528,841.90	280,296.28

注:1、本基金清算备付金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算公司等结算账户;@2、2011年6月30日清算备付金期末余额5,801,474.41元,清算备付金利息收入62,600.44元,2010年6月30日清算备付金期末余额3,501,364.64元,清算备付金利息收入25,198.94元。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.5 期末(2011年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金报告期内没有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金无期末持有的暂时停牌等流通受限股票。@

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至报告期末2011年6月30日,本基金没有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。1.1.1.1.1交易所市场债券正回购

截至报告期末2011年6月30日,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额260,000,000.00元,于2011年7月1日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,067,356,087.86	62.26
	其中:股票	1,067,356,087.86	62.26
2	固定收益投资	344,903,803.80	20.12
	其中:债券	344,903,803.80	20.12
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	210,000,635.00	12.25
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	77,567,184.50	4.52
6	其他各项资产	14,570,705.33	0.85
7	合计	1,714,398,416.49	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	58,568,935.80	4.08
C	制造业	513,556,518.60	35.76
C0	食品、饮料	31,080,000.00	2.16
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	208,713,405.42	14.53
C6	金属、非金属	58,450,000.00	4.07
C7	机械、设备、仪表	199,908,113.18	13.92
C8	医药、生物制品	15,405,000.00	1.07
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	72,559,800.35	5.05
F	交通运输、仓储业	98,394,409.85	6.85
G	信息技术业	52,300,000.00	3.64
H	批发和零售贸易	19,115,000.00	1.33
I	金融、保险业	55,010,000.00	3.83
J	房地产业	197,851,423.26	13.78
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	1,067,356,087.86	74.32

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002129	中环股份	6,524,850	131,084,236.50	9.13
2	600150	中国船舶	800,000	59,192,000.00	4.12
3	600010	包钢股份	7,000,000	58,450,000.00	4.07
4	600100	同方股份	5,000,000	52,300,000.00	3.64
5	600823	世茂股份	3,513,150	51,397,384.50	3.58
6	000002	万??科A	5,999,941	50,699,501.45	3.53
7	601668	中国建筑	12,000,000	48,360,000.00	3.37
8	600583	海油工程	7,199,990	46,223,935.80	3.22
9	000402	金 融 街	6,099,980	45,566,850.60	3.17
10	600839	四川长虹	12,499,821	41,749,402.14	2.91

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600583	海油工程	82,300,173.46	5.15
2	600019	宝钢股份	81,888,590.27	5.12
3	601688	华泰证券	56,570,773.42	3.54
4	600150	中国船舶	56,207,105.79	3.52
5	600875	东方电气	53,404,899.61	3.34
6	002122	天马股份	49,397,485.05	3.09
7	000002	万科A	49,289,408.47	3.08
8	601727	上海电气	47,741,063.86	2.99
9	600000	浦发银行	46,952,485.59	2.94
10	601390	中国中铁	46,306,212.54	2.90
11	601668	中国建筑	44,152,500.00	2.76
12	601006	大秦铁路	44,125,765.89	2.76
13	000402	金 融 街	43,576,725.52	2.73
14	601857	中国石油	42,922,785.47	2.68
15	601288	农业银行	41,384,066.07	2.59
16	600015	华夏银行	41,058,066.21	2.57
17	600839	四川长虹	40,962,848.54	2.56
18	000825	太钢不锈	39,926,309.23	2.50
19	002097	山河智能	39,115,855.66	2.45
20	600010	包钢股份	38,717,595.76	2.42
21	600104	上海汽车	35,625,968.11	2.23
22	600887	伊利股份	35,227,492.72	2.20
23	600029	南方航空	35,038,982.49	2.19
24	601899	紫金矿业	33,829,512.10	2.12
25	601186	中国铁建	32,710,333.33	2.05
26	600660	福耀玻璃	32,170,538.00	2.01
27	600064	南京高科	32,065,812.12	2.01

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000009	中国宝安	97,149,745.41	6.08
2	600019	宝钢股份	74,761,931.55	4.68
3	600812	华北制药	63,976,175.89	4.00
4	600376	首开股份	58,980,322.41	3.69
5	600015	华夏银行	58,168,830.94	3.64
6	600631	百联股份	56,527,638.69	3.54
7	601688	华泰证券	55,088,781.71	3.45
8	000869	张??裕A	50,805,072.22	3.18
9	600875	东方电气	45,570,154.39	2.85
10	600000	浦发银行	44,654,255.96	2.79
11	601857	中国石油	43,815,210.22	2.74
12	601390	中国中铁	43,216,618.58	2.70
13	601727	上海电气	43,086,633.31	2.69
14	600739	辽宁成大	42,656,745.29	2.67
15	600428	中远航运	41,108,088.06	2.57
16	601628	中国人寿	40,083,763.04	2.51
17	000063	中兴通讯	38,681,455.20	2.42
18	600056	中国医药	36,557,730.73	2.29
19	601888	中国国旅	36,551,856.97	2.29
20	600309	烟台万华	36,510,567.63	2.28
21	600887	伊利股份	33,995,252.88	2.13
22	600268	国电南自	33,882,101.58	2.12
23	000729	燕京啤酒	33,805,300.12	2.11
24	600550	天威保变	33,368,533.00	2.09
25	000425	徐工机械	32,792,271.69	2.05
26	000825	太钢不锈	32,763,730.81	2.05
27	601899	紫金矿业	32,358,000.00	2.02

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票的成本(成交)总额	1,581,927,069.83
卖出股票的收入(成交)总额	1,681,505,925.19

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	295,473,803.80	20.57
2	央行票据	-	-
3	金融债券	49,430,000.00	3.44
	其中:政策性金融债	49,430,000.00	3.44
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	344,903,803.80	24.02

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	010110	21国债⑽	1,501,090.00	149,838,803.80	10.43
2	010112	21国债⑿	1,460,000.00	145,635,000.00	10.14
3	110212	11国开12	500,000.00	49,430,000.00	3.44

注:本报告期末本基金投资债券共3只。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

7.9 投资组合报告附注

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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.9.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

报告期内本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,448,783.26
2	应收证券清算款	3,905,292.59
3	应收股利	2,202,252.44
4	应收利息	6,977,277.04
5	应收申购款	37,100.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,570,705.33

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
71,547	27,640.39	9,475,614.99	0.48	1,968,111,131.95	99.52

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

本期末基金管理人的从业人员无持有本开放式基金的情况。

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2003年6月16日)基金份额总额	1,517,181,953.95
本报告期期初基金份额总额	2,084,389,402.91
本报告期基金总申购份额	47,628,586.97
减:本报告期基金总赎回份额	154,431,242.94
本报告期期末基金份额总额	1,977,586,746.94

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会,无会议决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期基金管理人的无重大人事变动;

2、本报告期基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动:

本报告期内,根据证监会《关于核准中国银行股份有限公司李爱华基金行业高级管理人员任职资格的批复》,李爱华先生担任本基金托管人--中国银行托管及投资者服务部总经理;因工作调动,董杰先生不再担任中国银行托管及投资者服务部总经理。该人事变动已按相关规定备案并公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金报告期内没有改变基金投资策略。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金报告期内没有改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
中金公司	1	429,682,800.57	13.21	12,876,911.50	12.76	-	-	365,229.93	13.37	
国泰君安	1	372,179,765.91	11.44	7,002,996.00	6.94	550,000,000.00	11.83	316,349.74	11.58	
光大证券	1	353,487,810.65	10.87	25,050,480.00	24.83	190,000,000.00	4.09	300,464.58	11.00	
申银万国	1	307,167,327.94	9.44	-	-	200,000,000.00	4.30	261,086.47	9.56	
财达证券	1	289,259,724.74	8.89	4,989,596.00	4.95	730,000,000.00	15.70	245,867.66	9.00	
联合证券	1	262,382,761.26	8.07	-	-	-		213,188.08	7.81	
广州证券	1	252,861,521.31	7.77	-	-	-		205,452.11	7.52	
国信证券	1	215,096,376.94	6.61	10,024,494.00	9.94	810,400,000.00	17.43	182,830.60	6.69	
安信证券	1	200,371,297.43	6.16	-	-	440,000,000.00	9.46	170,315.74	6.24	
东海证券	1	136,448,367.22	4.19	-	-	1,050,000,000.00	22.58	115,979.90	4.25	
中投证券	1	114,184,090.73	3.51	12,957,509.60	12.84	470,000,000.00	10.11	89,694.03	3.28	
招商证券	1	81,334,795.33	2.50	-	-	-	-	66,084.92	2.42	
国金证券	1	57,968,223.21	1.78	-	-	-	-	47,100.21	1.72	
英大证券	1	51,926,950.75	1.60	27,991,604.00	27.74	210,000,000.00	4.52	44,137.57	1.62	
平安证券	1	51,582,571.77	1.59	-	-	-	-	43,843.00	1.61	
万联证券	1	49,647,882.49	1.53	-	-	-	-	40,339.17	1.48	
海通证券	1	23,498,215.07	0.72	-	-	-	-	19,974.04	0.73	
世纪证券	1	3,910,039.26	0.12	-	-	-	-	3,073.55	0.11	

注:1、本基金本报告期内无新增租用证券公司交易单元,无减少租用证券公司交易单元。@2、债券交易不支付佣金。

§11 影响投资者决策的其他重要信息

1、公司增加注册资本

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

本公司增加注册资本及修改公司章程的工商变更手续已于2011年5月16日在广东省工商行政管理局办理完毕,并于2011年5月17日对外公开披露。

2、上海分公司成立

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

3、广州分公司(主要办公场所)变更

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

金鹰基金管理有限公司
2011年8月25日