金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金更新的招募说明书摘要

201112

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

二〇一一年十二月

【重要提示】

金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金（以下简称"本基金"）根据2011年4月6日中国证券监督管理委员会《关于核准金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金募集的批复》（证监许可【2011】694号）和2011年4月21日《关于金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函【2011】246号）进行募集。本基金的基金合同经中国证监会基金监管部于2011年6月1日备案确认（基金部函【2011】342号）后正式生效。

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读招募说明书及其摘要。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

基金管理人保证本招募说明书及其摘要的内容真实、准确、完整，本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券持有的非系统性风险、由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等等。

投资有风险，投资者投资本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同，基金管理人建议投资人根据自身的风险收益偏好，选择适合自己的基金产品，并且中长期持有。

本招募说明书中基金投资组合报告和基金业绩中的数据已经本基金托管人复核，除非另有说明，本招募说明书摘要所载内容截止日为2011年12月1日，有关财务数据截止日为2011年9月30日，净值表现截止日为2011年9月30日，本报告中财务数据未经审计。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：金鹰基金管理有限公司
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16单元
办公地址：广东省广州市天河区体育西路189号22-23层
设立日期：2002年12月25日
法定代表人：刘东
联系电话：020-83282855
联系人：祝红
注册资本：人民币2.5亿元
股权结构：

发起人名称	出资额（万元）	出资比例
广州证券有限责任公司	12250	49%
广州药业股份有限公司	5000	20%
广东美的电器股份有限公司	5000	20%
东亚联丰投资管理有限公司	2750	11%
总计	25000	100%

（二）主要人员情况

1、公司董事和监事

刘东先生，董事长，经济学硕士，高级经济师，曾在中国现代国际关系研究所、中国信达信托投资公司驻武汉证券交易中心任职，历任中国信达信托投资公司北京营业部总经理、证券业务总部副总经理、新疆证券股份有限公司总经理助理兼证券业务总部总经理、发源证券股份有限公司党委委员、副总经理、发源期货有限公司董事长，现任广州证券有限责任公司总经理，经公司第三届董事会第十六次会议选举通过，并报经中国证监会核准，2010年4月起担任公司董事长。

郑德祥先生，董事，硕士，经济学高级工程师，教授，高级经济师，历任广州中山大学管理学院讲师、副教授，美国乔治华盛顿大学助教，美国华盛顿投资咨询公司顾问研究员，美国世界银行政策研究局特约经济处经济顾问，现任广州证券有限责任公司副总裁、首席经济学家、兼任广州风险投资促进会会长，广州市政协委员，上市公司独立董事等。

要建伟先生，董事，工商管理硕士，历任中国长城铝业公司供销处干部，广东美的电器股份有限公司董事局秘书，现任广东美的集团董事副总裁。

温绚容女士，董事，商科毕业，历任德盛安联资产管理香港有限公司市场及传媒经理、恒顺投资管理亚洲有限公司副总裁、德意志资产管理（香港）有限公司区域销售总监、Societe Generale Asset Management Asia Ltd.高级副总裁、德盛安联资产管理香港有限公司行政总裁、香港财务策划师学会行政总裁等职。2011年7月加入东亚联丰投资管理有限公司，现任东亚联丰投资管理有限公司行政总裁。

陈剑华先生，董事，硕士，会计师，曾任广州药业股份有限公司财务部部长，现任广州证券股份有限公司财务总监。

吴晓球先生，独立董事，国际经济管理学博士，历任江西省社会科学院经济研究所主任、中国人民大学财政金融学院副院长、中国人民大学研究生院副院长，现任中国人民大学校长助理、财政金融学院常务副院长、金融与证券研究所所长、教授、博导。

杜金岷先生，独立董事，博士、教授、博士生导师，历任高校讲师、副教授、现任暨南大学教授、经济学院党委书记、副院长，广东中青年经济工作者学会副秘书长、广东经济学会理事、中国外国经济学说研究会理事、广州留学人员协会理事等。

黄元生先生，独立董事，经济学硕士、副教授、高级会计师，历任中山大学会计教研室主任及会计系副主任，广州市康乐会计师事务所副所长及所长，现任广州万隆康正会计师事务所主任会计师。

颜俊先生，独立董事，法学博士，资深律师，资深合伙人，曾是广东华邦世纪律师事务所的创始合伙人，中国工商银行深圳市分行法律顾问，现任北林大学法学教授职副教授，金杜律师事务所资深合伙人，中华全国律师协会会员，广东省法学会民商法研究会常务理事。

刘晓东先生，监事，工商管理硕士，曾任深圳市审计局主任科员，招商银行总行稽核部高级审计师，鹏华基金管理有限公司监察稽核部副总监，现任金鹰基金管理有限公司监察稽核部总监。

曾巧女士，监事，管理学学士，历任赫山会计师事务所审计助理、美的集团审计部审计经理、美的集团审计监察部副部长，现任美的集团审计监察部总监。

姚万义先生，监事，大学本科，历任中共北京市纪律检查委员会北京市监察局办公厅主任、副局长、常委，中国证监会北京证管办副主任、巡视员，北京证券业协会理事长等职，现任北京证券业协会顾问。

2、公司高级管理人员

殷克胜先生，总经理，经济学博士，曾在综合开发研究院（中国深圳）、深圳市体改办任职，历任深圳证监局法规处副处长、上市公司处处长，鹏华基金管理有限公司董事、常务副总经理，方正证券有限责任公司基金公司筹备组组长等职，经公司第三届董事会第十六次会议选举通过，并报经中国证监会核准，2010年4月起担任公司总经理。

刘俊宏先生，副总经理，经济学博士、副教授，历任深圳国资经营公司（物管控股）房产经营部总经理助理，上海复旦大学博士后流动站（金融研究方向）博士后研究员，深圳华强集团资本经营部副部长，广州越秀集团资本经营部副经理，广州证券有限责任公司总裁助理兼资产管理总部总经理，金鹰基金管理有限公司总经理助理等职，经公司第二届董事会第二十一次会议审议通过，并报经中国证监会核准，2008年12月起担任公司副总经理。

郭容辰女士，副总经理，法律硕士，历任交通银行深圳分行公司业务部科长、交通银行深圳福田支行行长助理、交通银行深圳福田支行行长、交通银行深圳分行个人金融部总经理、零售信贷管理部总经理、华夏银行深圳分行个人业务部总经理等职，经公司第三届董事会第十九次会议审议通过，并报经中国证监会核准，2010年10月起担任公司副总经理。

苏文锋先生，督察长，经济学硕士，历任广州市经济管理干部学院外贸经济系党支部书记、南方证券广州分公司研究发展部总经理、南方证券广州分公司大德路营业部总经理、南方证券广州分公司投资银行部总经理、华鼎担保投资有限公司副总经理等职，金鹰基金管理有限公司市场拓展部副总监等职，经公司第二届董事会第二十一次会议审议通过，并报经中国证监会核准，2008年9月起担任公司督察长。

3、本基金经理

朱丹女士，金融学硕士，证券从业经历五年，曾任职于深圳晨星咨询公司，2007年5月加入金鹰基金管理有限公司，先后担任行业研究员、研究组长等职，现任本基金基金经理、金鹰红利价值灵活配置混合型证券基金基金经理以及金鹰中小盘精选证券投资基金基金经理。朱丹在以往工作期间从未受到监管机构行政处罚或采取行政监管措施，不存在《公司法》、《证券投资基金法》等法律、法规规定的不得担任基金管理公司基金经理的情形。

4、投资决策委员会成员

本基金采取集体投资决策制度，投资决策委员会成员有：

股克胜先生，投资决策委员会主席，总经理；

杨绍基先生，投资决策委员会委员，投资管理部总监，基金经理；

杨刚先生，投资决策委员会委员，研究发展部总监；

彭培祥先生，投资决策委员会委员，投资管理部副总监，基金经理；

徐海焱女士，投资决策委员会委员，集中交易部总监。

5、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

名称：中国银行股份有限公司（简称"中国银行"）
住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期：1983年10月31日
变更注册登记日期：2004年8月26日
注册资本：人民币或币荣佰玖拾壹亿肆仟荣佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整
法定代表人：肖钢
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号
托管及投资者服务部总经理：李爱华
托管部门信息披露联系人：唐州徽
电话：010-66594855
传真：010-66594942

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

名称：金鹰基金管理有限公司
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16单元
办公地址：广东省广州市天河区体育西路189号城建大厦22-23层
法定代表人：刘东
总经理：殷克胜
成立时间：2002年12月25日
批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字【2002】77号
组织形式：有限责任公司
注册资本：2.5亿元人民币
存续期间：持续经营
联系人：潘晓毅
联系电话：020-83282950
传真电话：020-83283445
客户服务及投诉电话：4006-135-888
电子邮箱：csmail@gefund.com.cn
网址：www.gefund.com.cn

2、代销机构（排名不分先后）

①名称：中国银行股份有限公司
注册 住所 地址：北京市复兴门内大街1号
法定代表人：肖钢
联系人：宁毓
电话：010-66594977
客服电话：95566（国）
网址：www.boc.com

②名称：中国工商银行股份有限公司
注册 住所 地址：北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人：姜建清
联系人：王佳
电话：010-66107900
客服电话：95588（国）
网址：www.icbc.com.cn

③名称：中国建设银行股份有限公司
注册 住所 地址：北京市西城区金融大街25号
法定代表人：张建国
联系人：张静
电话：010-67596219
客服电话：95533
网址：www.ccb.com

④名称：平安银行股份有限公司
注册 住所 地址：深圳市深南中路1099号平安银行大厦
法定代表人：孙建一
联系人：蔡宇洲
电话：0755-22197874
客服电话：4006699999
网址：bank.pingan.com

⑤名称：交通银行股份有限公司
注册 住所 地址：上海市银城中路188号
法定代表人：胡怀邦
联系人：曹阳
电话：021-58781234
客服电话：95559（国）
网址：www.bankcomm.com

⑥名称：中国民生银行股份有限公司
注册 住所 地址：北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人：董文标
联系人：董云巍
电话：010-58351666
客服电话：95568（国）
网址：www.cmbc.com.cn

⑦名称：上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区浦东南路500号
办公地址：上海市北京东路689号东银大厦17F
法定代表人：吉晓辉
联系人：虞合云
电话：021-61618888
客服电话：95528（国）
网址：www.spdb.com.cn

⑧名称：宁波银行股份有限公司
注册地址：宁波市江东区中山东路294 号
办公地址：宁波市鄞州区宁南南路700号
法定代表人：陆华裕
联系人：胡技勤
电话：0574-87608340
客服电话：96528（上海、北京地区962528）
网址：www.nbcb.com.cn

⑨名称：东莞农村商业银行
注册 住所 地址：东莞市南城路2号
法定代表人：何沛良
联系人：黄 飞燕
电话：0769-23394102
客服电话：0769-961122
网址：www.dgrcc.com

⑩名称：深圳发展银行股份有限公司
办公地址：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
法定代表人：肖遥宁
联系人：梁鹏
电话：0755-2216631
深圳发展银行客服电话：95501
深圳发展银行网址：www.sdb.com.cn

⑪名称：中信银行股份有限公司
注册 办公 地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
法定代表人：田国立
联系人：张哲
电话：010-65557048
客服电话：95558（国）
网址：www.bank.ecitic.com

⑫名称：华夏银行股份有限公司
注册 办公 地址：北京市东城区建国门内大街22号
法定代表人：吴建
联系人：郑鹏
电话：010-85238667
客服电话：95577
网址：www.hxb.com.cn

⑬名称：广州证券有限责任公司
注册 办公 地址：广东省广州市先烈中路69号东山广场主楼5楼、17楼
法定代表人：刘东
联系人：林洁茹
电话：020-87323735
客服电话：020-961303
网址：www.gzs.com.cn

⑭名称：海通证券股份有限公司
注册 办公 地址：上海市淮海中路98号
法定代表人：王开国
联系人：王立群
电话：021-23219286
客服电话：95533（国）、4008888001
网址：www.haitongzq.com

⑮名称：中银万国证券股份有限公司
注册 办公 地址：上海市常熟路171号
法定代表人：丁国荣
联系人：曹晖
电话：021-54047892
客服电话：021-962505
网址：www.aywg.com

⑯名称：光大证券股份有限公司
注册地址：上海市静安区新闸路1508号
办公地址：上海市浦东新区浦东南路528号上海证券大厦南塔16楼
法定代表人：徐浩明
联系人：李芳芳
电话：021-22169089
客服电话：95525（国）、4008888788
网址：www.ebscn.com

⑰名称：国联证券股份有限公司
注册 办公 地址：无锡市县前东街168号
法定代表人：雷建辉
联系人：施俊
电话：0510-82831662
客服电话：4008885288、0510-82588168
网址：www.glsc.com.cn

⑱名称：华安证券有限责任公司
注册地址：合肥市长江中路357号
办公地址：合肥市阜南路166号
法定代表人：李工
联系人：甘霖
电话：0551-5161821
客服电话：96518、4008-096-518
网址：www.hazq.com

⑲名称：东海证券有限责任公司
注册地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18、19号楼
办公地址：上海浦东新区东方路989号中达广场
法定代表人：朱科敏
联系人：俞晓飞
电话：021-50586660-8644
客服电话：4008888588、0519-88166222（常州地区）、021-52574550（上海地区）、0379-64902266（洛阳地区）
网址：www.longone.com.cn

⑳名称：中航证券有限公司
注册 办公 地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷大道1619号国际金融大厦A座41楼
法定代表人：杜航
联系人：余雅娜
电话：0791-6768763
客服电话：400-8866-567
网址：www.avicsec.com

㉑名称：长江证券股份有限公司
注册 办公 地址：湖北省武汉市江汉区新华路特8号
法定代表人：胡运钊
联系人：李良
电话：021-63219781
客服电话：4008888999
网址：www.cjsc.com.cn

㉒名称：财通证券有限责任公司
注册 办公 地址：浙江省杭州市解放路111号金钱大厦
法定代表人：沈龙宁
联系人：乔莹
电话：0571-87925129
客服电话：0571-96336（上海地区962336）
网址：www.ctsec.com

㉓名称：中国银证证券有限责任公司
注册 办公 地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦2-6层
法定代表人：顾伟国
联系人：田薇
电话：010-66568430
客服电话：4008888888
网址：www.chinastock.com.cn

㉔名称：长城证券有限责任公司
注册 办公 地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人：黄耀华
联系人：匡婷
电话：0755-83516289
客服电话：400-6666-888
网址：www.cgws.com
客服电话：400-6666-888
网址：www.cgws.com

㉕名称：国都证券有限责任公司
注册 办公 地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层
法定代表人：常娟
联系人：黄静
电话：010-84183389
客服电话：400-818-8118
网址：www.guodu.com

㉖名称：国信证券股份有限公司
注册 办公 地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人：何如
联系人：齐晓燕
电话：0755-82130833
客服电话：95536（国）
网址：www.guosen.com.cn

㉗名称：华龙证券有限责任公司
注册 办公 地址：上海市南京西路758号23楼
法定代表人：邹冰
联系人：陈毅
电话：021-32229888

㉘名称：宏源证券股份有限公司
注册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路233 号
办公地址：新疆乌鲁木齐市文艺路233 号宏源大厦
北京市西城区太平桥大街19 号
法定代表人：冯戎
联系人：李巍
电话：010-88085338
客服电话：4008000562
网址：www.hysec.com

㉙名称：信信证券有限责任公司
注册 办公 地址：内蒙古自治区内蒙古呼和浩特市锡林南路18号
法定代表人：孔佑杰
联系人：陈韦杉
联系电话：010-88086830
客服电话：010-88086830
网址：www.rxzq.com.cn

㉚名称：浙商证券有限责任公司
注册 办公 地址：浙江杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A-67楼
法定代表人：吴承根
联系人：刘虹
联系电话：0571-87901908
客服电话：0571-96777
网址：www.stocke.com.cn

㉛名称：山西证券股份有限公司
注册 办公 地址：太原市山西府西街69号国际贸易中心东塔楼
法定代表人：侯魏
联系人：郭娜
电话：0351-8686659
客服电话：4006661618
网址：www.i618.com.cn

㉜名称：湘财证券有限责任公司
注册地址：湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
办公地址：上海市东新区陆家嘴958号华能联合大厦5楼
法定代表人：林俊波
联系人：詹雁光
电话：021-68865020
客服电话：4008881551、021-38784525
网址：www.xcsc.com

㉝名称：世纪证券有限责任公司
注册 办公 地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦41楼
法定代表人：沙长才
联系人：王佳佳
电话：0755-83199599
客服电话：0755-83199599
网址：www.csco.com.cn

㉞名称：华福证券有限责任公司
注册 办公 地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层
法定代表人：黄金琳
联系人：张腾
电话：0591-87383623
客服电话：0591-96326
网址：www.gfhfzq.com.cn

㉟名称：万联证券有限责任公司
注册 办公 地址：广州市越秀区中山二路18号广东电信广场36、37层
法定代表人：张建军
联系人：罗剑敏
电话：020-37865070
客服电话：4008888133
网址：www.wlzq.com.cn

㊱名称：东莞证券有限责任公司
注册 办公 地址：广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼
法定代表人：廖musmi辉
联系人：张巧玲
电话：0769-22116557
客服电话：0769-961130
网址：www.dgzq.com.cn

㊲名称：平安证券有限责任公司
注册 办公 地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
法定代表人：杨宇翔
联系人：郑舒丽
电话：4008816168
客服电话：4008816168
网址：www.stock.pingan.com

㊳名称：广发证券股份有限公司
注册 办公 地址：广州市天河区天河北路183号大都会广场43楼
法定代表人：林治海
联系人：黄岚
电话：020-87555888
客服电话：95575（国）
网址：www.gf.com.cn

㊴名称：中国建银投资证券有限责任公司
注册 办公 地址：深圳福田区益田路6003号荣超商务中心A座18-21层
法定代表人：龙增来
联系人：范雪玲
电话：0755-82024331
客服电话：4006008008
网址：www.cjis.cn

㊵名称：中国国际金融有限公司
注册 办公 地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
法定代表人：李剑阁
联系人：黄晓威
电话：0755-83196491
客服电话：010-65051166
网址：www.cicc.com.cn

㊶名称：信达证券股份有限公司
注册 办公 地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人：张志刚
联系人：唐静
电话：010-63081000
客服电话：400-800-8899
网址：www.cindasc.com

㊷名称：民生证券有限责任公司
注册 办公 地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层
法定代表人：岳献春
联系人：赵阴
电话：010-85127622
客服电话：400-619-8888
网址：www.msqz.com

㊸名称：齐鲁证券有限公司
注册 办公 地址：山东省济南市经十路20518号
法定代表人：李玮
联系人：王珠
电话：0531-87107718
客服电话：95538（国）
网址：www.qlzq.com.cn

㊹名称：中信建投证券有限公司
注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址：北京市朝阳门内大街188号
法定代表人：张佑君
联系人：魏明
电话：010-85130579
客服电话：4008888108
网址：www.csc108.com

㊺名称：天相投资顾问有限公司
注册 办公 地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
邮政编码：100140
法定代表人：林义相
联系人：林爽
电话：010-66045608
客服电话：010-66045678
网址：www.txsec.com
天相基金网网址：www.txjijin.com

㊻名称：东吴证券有限责任公司
注册 办公 地址：苏州工业园区星阳路181号商旅大厦
法定代表人：吴永敏
联系人：万晓玲
电话：0512-65581136
客服电话：0512-96288
网址：www.dwzq.com.cn

㊼名称：方正证券有限责任公司
注册 办公 地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
法定代表人：雷杰
联系人：邵艳霞
电话：0731-85832507
客服电话：95571（国）
网址：www.foundersc.com

㊽名称：国元证券股份有限公司
注册 办公 地址：合肥市寿春路179号国元大厦
法定代表人：凤良志
联系人：李慕
电话：0551-2272101
客服电话：95578（国）
网址：www.gyzq.com.cn

㊾名称：华泰证券股份有限公司
注册 办公 地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人：吴万善
联系人：程高峰
电话：025-83290834
客服电话：95597
网址：www.htsc.com.cn

㊿名称：中信证券股份有限公司
注册 办公 地址：广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层
法定代表人：王东明
联系人：陈忠
电话：010-60833799
客服电话：0755-83478806
网址：www.cs.ecitic.com

51名称：金元证券股份有限公司
注册 办公 地址：海口市南宝路36号证券大厦4楼
办公地址：深圳市深南大道4001号时代金融中心大厦17楼
法定代表人：陆涛
联系人：马贤清
电话：0755-83025022
客服电话：4008-888-228
网址：www.jyzq.cn

52名称：财富证券有限责任公司
注册 办公 地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26层
法定代表人：扬晖
联系人：郭磊
电话：0731-84403319
客服电话：0731-84403350
网址：www.cfzq.com

53名称：天风证券有限责任公司
注册 办公 地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼
法定代表人：余磊
联系人：崔瑶
电话：027-87618882
客服电话：027-86711410
网址：www.tfzq.com

54名称：安信证券股份有限公司
注册 办公 地址：深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元
法定代表人：牛冠兴
联系人：陈剑虹
电话：0755-82558305
客服电话：4008-001-001
网址：www.essence.com.cn

55名称：华宝证券有限责任公司
注册 办公 地址：上海市陆家嘴环路未来资产大厦27层
法定代表人：陈林
联系人：陈捷菲
电话：021-50122485
客服电话：021-38929908、400-820-9898
网址：www.cnhbstock.com

56名称：五矿证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公楼47层01单元
办公地址：深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心49层
法定代表人：高竹
联系人：冯敏棋
电话：021-38676666-6161
客服电话：95521（国）
网址：www.gtja.com

58名称：江海证券有限公司
注册 办公 地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人：孙名扬
联系人：高悦铭
电话：0451-82337802
客服电话：400-666-2288
网址：www.jhzq.com.cn

59名称：中信万通证券有限责任公司
注册地址：青岛市崂山区香港路29号澳柯玛大厦15层（507-1510室）
办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层
法定代表人：张智河
联系人：吴忠超
电话：0532-85022326
客服电话：0532-96577
网址：www.zxwt.com.cn

基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

（二）注册登记机构

名称：金鹰基金管理有限公司
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16单元
办公地址：广东省广州市天河区体育西路189号城建大厦22-23层
法定代表人：刘东
电话：020-83282950
传真：020-83282856
联系人：傅军

（三）律师事务所和经办律师

名称：广东岭南律师事务所
办公地址：广州市新港西路135号中山大学西门科技园601-605室
法定代表人：黄添潮
电话：020-84035897
传真：020-84113152
经办律师：江亚芳、陈进学、王欢

（四）会计师事务所和经办注册会计师

名称：立信羊城会计师事务所有限公司
住所：广州市天河区林和西路3-15号耀中广场11楼1106-1118单元
法定代表人：陈雄溢
电话：020-83487300
传真：020-83486116
经办注册会计师：张宁、黎晓霞

四、基金的名称

本基金名称：金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金
本基金简称：金鹰中证技术领先指数增强
本基金代码：210007

五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金为股票型指数增强基金，跟踪指数为本基金的首要目标，力求将日均跟踪偏离度控制在0.5%以下、年跟踪误差控制在7.75%以下；对于指数增强部分，采取适当的增强策略，力争取得超越标的指数的投资收益。

七、投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、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（但需符合中国证监会的相关规定）。股票资产占基金资产净值的比例为85%-95%，其中，不低于80%的基金净资产将投资于中证技术领先指数的成分股和备选成分股；债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产净值的5%-15%，其中，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，权证投资的比例范围占基金资产净值的0%-3%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

八、投资策略

1、大类资产配置策略

本基金将在基金合同规定的投资范围内，采用"自上而下"的分析视角，综合考量中国宏观经济所处投资时钟的象限、国内股票市场的估值、国内债券市场收益率的期限结构、CPI与PPI变动趋势、外围主要经济体宏观经济与资本市场的运行状况等因素，分析研判股票市场、债券市场、货币市场的预期收益与风险，合理确定并适时动态地调整本基金在股票、债券、现金等金融工具上的投资比例，力争取得超越标的指数的投资收益。

2、股票投资策略

①、指数跟踪

1、指数概况

中证技术领先指数为定制类指数，由中证指数有限公司与金鹰基金管理有限公司联合开发。指数成分股是由沪深市场中规模适度、流动性高的200家高新技术类上市公司发行的A股所组成，以综合反映沪深市场中具有技术领先优势的上市公司股价的整体表现。样本空间的行业构成参照国家统计局《高技术产业统计分类目录》，按照证监会行业分类标准筛选相关行业。指数成分股每半年调整一次，每次调整的成分股比例一般不超过20%，以维持被动投资组合的相对稳定性。指数的加权方式为期初等权重，成分股的权重较为分散，以期降低被动投资组合的非系统性风险。

公司专门设立量化投资小组，负责本基金的量化投资工作，跟踪指数投资的偏离度，控制跟踪误差，并进行有限度的主动性增强投资。

2）一般情形下的指数跟踪

本基金投资不低于80%的基金净资产跟踪中证技术领先指数的全部成分股和备选成分股。

3）特殊情形的处理

A、基金建仓期内的指数跟踪

在建仓期内，本基金采取"自上而下"的分析视角，综合考量中国宏观经济所处投资时钟的象限、政府财政政策与货币政策的运行趋势、国内股票市场的估值、中证技术领先指数成分股的估值、国内债券市场收益率的期限结构、CPI与PPI变动趋势、外围主要经济体宏观经济与资本市场的运行状况等因素，分析研判货币市场、债券市场与股票市场的预期收益与风险，并提此灵活动态地把握指数跟踪的节奏。

B、成分股替代与权重调整

对于成分股停牌或员工罢交易但成交量极低等流动性缺失的情形，本基金将根据流动性缺失的严重程度审慎采取不完全跟踪、成分股替代等措施。不完全跟踪是指对于成分股的跟踪比例低于其在指数当中的权重；成分股替代，则优先考虑与被替代的成分股属于同一行业、主营业务相近的成分股。

C、对于备选成分股的预先买入

为避免在成分股调整日集中抛售被剔除的成分股、集中买入新入选的成分股而带来的冲击成本，本基金将根据中证技术领先指数成分股的选择方法，择机逐步减持预期将被剔除的成分股，逐步买入预期将入选的备选成分股。

D、零散股的处理

所谓零散股，是指根据标的指数的权重计算而得的、应该买入而又无法买入的不足100股的股票数量。零散股是影响跟踪误差、跟踪偏离度、相对收益的重要原因。为此，本基金将计算全部成分股的零散股市值之和，将零散股市值之和按照标的指数所属各行业的权重配比，分摊于这些行业当中。

②、指数增强

除了被动跟踪标的指数外，本基金将在严格控制跟踪误差、跟踪偏离度的前提下，辅以有限度的主动性增强投资，其目的有二：在跟踪标的指数的基础上适度获取增强收益；抵消基金运作中不可避免的负向成本，如管理费、托管费、交易费用等。

本基金的指数增强策略主要包括：

1、成分股权重优化增强策略

本基金在严格控制跟踪误差、跟踪偏离度的前提下，将持续追踪成分股的基本面状况、估值水平、流动性等、对其投资价值进行审慎研判；在综合考虑交易成本、冲击成本、流动性、投资比例限制等因素后，本基金将有限度地对标的指数成分股的权重进行优化，以期获取增强收益。

2、个股精选增强策略

对于非成分股，本基金将在个股层面上对其基本面状况、估值水平、流动性等因素进行深入研究，通过综合研判，精选出具有综合性比较优势（估值优势、基本面优势等）的个股进当进行主动配置，力争获得增强收益。

3、其他增强策略

在对相关发行主体的基本面因素进行认真研究的基础上，结合二级市场的平均估值水平、类似券种上市之后的平均溢价率等指标，本基金将有选择性地参与一级市场上新股、新债的发行或已上市券种的增发。

3、跟踪误差、相对收益、跟踪偏离度的监测与控制

本基金采用跟踪误差、相对收益（低金份额净值的增长率与业绩比较基准增长率之差）、跟踪偏离度（即相对收益的绝对值）作为评价指数跟踪与指数增强效果的指标；其中，日均跟踪误差、日均跟踪偏离度为核心测评指标，而相对收益为辅助测评指标。在实际投资运作过程中，本基金将密切监测比较基准与本基金净值的日均跟踪误差、过去30个交易日相对收益、过去30个交易日跟踪偏离度，并根据上述三个指标的监测值，采取合理的措施以控制误差、跟踪偏离度的进一步扩大，或相对收益的进一步向负偏离。

本基金控制跟踪误差、跟踪偏离度的主要措施包括：调整被动投资与主动投资的比例；被动投资部分，优先考虑完全复制的方法；辅用成分股替代增强策略；减小个股的实际投资比例与其在指数当中的权重之偏差等等；

本基金控制相对收益进一步向负偏离的措施主要包括：加强对于宏观经济与资本市场运行状况的研究，以期提升增强策略的有效性；加强对于个股基本面的研究与追踪，以期提升个股选择的有效性。

4、债券投资策略

在资本市场日益国际化的背景下，通过对国际经济环境与国内宏观经济运行状况的综合考量，审慎研判债券市场风险收益特征的变化趋势，采取自上而下的策略构造组合。

债券类品种的投资，遵循在严格控制风险的基础上获取稳健回报的原则。

①本基金采用目标久期管理法作为本基金债券类资产投资的核心策略。通过宏观经济分析平台把握市场利率水平的运行态势，作为组合久期选择的主要依据。

②结合收益率曲线变化的预测，采取期限结构配置策略，通过模拟计算和情景测试，确定长、中、短期债券的投资比例。

③以盈利考核差策略是本基金进行类属间配置的主要策略。本基金在充分考虑不同类型债券流动性、税收以及信用风险等的基础上，进行类属的配置，优化组合收益。

④对运用上述策略方法的基础上，通过分析个券的剩余期限与收益率的配比状况、信用等级、流动性指标等，选择风险收益配比最合理的个券作为投资对象，并形成组合。本基金还将采取积极主动的策略，针对市场定价错误和回购套利机会等，在预期存在超额收益的情况下，积极把握市场机会。

⑤根据基金申购、赎回等情况，对投资组合进行流动性管理，提升基金资产的变现能力。

5、权证投资策略

本基金将因为上市公司进行增发、配售以及投资分离交易的可转换公司债券等原因而被动获得权证，或者在进行套利交易、避险交易以及权证价值严重低估等情形下将投资权证。

本基金进行权证投资时，将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上，结合股价波动率等参数，运用数量化期权定价模型，确定其合理内在价值，从而构建套利交易、避险交易组合以及合同许可投资时间范围内的价值显著低估的权证品种。

6、其它创新或者衍生产品的投资策略

本基金将根据公募基金的特点和要求，结合创新或者衍生产品的特征，在进行充分风险控制和充分遵守法律法规的前提下，制定合适的投资策略进行这类产品的投资。

九、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：本基金业绩比较基准为中证技术领先指数增长率×90%+活期存款利率（税后）×10%

随着市场环境的变化，如果上述业绩比较基准不适用本基金时，本基金管理人可以从维护基金份额持有人合法权益的原则出发，根据实际情况对业绩比较基准进行调整，调整业绩比较基准应经基金托管人同意，报中国证监会备案，基金管理人应在调整前3个工作日在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。

十、风险收益特征

本基金为以跟踪指数为主、主动投资为辅的股票型证券投资基金，属于证券投资基金当中收益、风险较高的品种。一般情形下，其风险和预期收益高于混合型、债券型、货币市场基金。

十一、基金投资组合报告（未经审计）

本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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，自于2011年12月9日复核了本报告中的内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告有关数据的期间为2011年6月1日至2011年9月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

（一）报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益类投资	54,695,883.05	47.01
	其中：股票	54,695,883.05	47.01
2	固定收益类投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	44,000,000.00	37.82
	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	11,989,892.20	10.31
6	其他各项资产	5,658,217.53	4.86
7	合计	116,343,992.78	100.00

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

1、按投资按行业分类的股票投资组合情况

序号	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	302,763.00	0.28
C	制造业	6,836,264.06	6.26
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	271,800.00	0.25
C5	电子	843,899.00	0.77
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	3,528,207.99	3.23
C8	医药、生物制品	2,192,357.07	2.01