金鹰中证500指数分级证券投资基金之金鹰500A、金鹰500B上市交易公告书

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
注册登记人:中国证券登记结算有限责任公司
上市地点:深圳证券交易所
上市时间:2012年7月3日
公告日期:2012年6月28日

一、重要声明与提示

金鹰中证500指数分级证券投资基金(以下简称"本基金")之金鹰500A、金鹰500B上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号《上市交易公告书的内容与格式》》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,本基金管理人的董事会及董事保证本上市交易公告书(以下简称"本公告书")所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

本基金托管人保证本公告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、深圳证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。

本公告书第七节"基金财务状况"未经审计。

凡本公告书未涉及的有关内容,请投资者详细查阅本基金管理人2012年4月18日刊登在《证券时报》、4月23日刊登在《中国证券报》以及5月21日刊登在《上海证券报》和本基金管理人网站(www.gefund.com.cn)的《金鹰中证500指数分级证券投资基金招募说明书》和《金鹰中证500指数分级证券投资基金基金合同》等相关法律文件。

二、基金概览

1.基金名称:金鹰中证500指数分级证券投资基金

2.基金类型:股票型

3.基金运作方式:契约型开放式

4.本基金的基金份额包括金鹰中证500指数分级证券投资基金之基础份额(简称"金鹰中证500指数分级",场内简称"金鹰500",基金代码:162107)、金鹰中证500指数分级证券投资基金之金鹰中证500A份额(简称"金鹰中证500A",场内简称"金鹰500A",基金代码:150088)与金鹰中证500指数分级证券投资基金之金鹰中证500B份额(简称"金鹰中证500B",场内简称"金鹰500B",基金代码:150089)。其中,金鹰500?A份额、金鹰500?B份额的基金份额配比始终保持1:1的比例不变。

5.基金存续期限:不定期

6.金鹰500的申购与赎回:

本基金合同生效后,投资人可通过场外或场内两种方式对金鹰500进行申购与赎回。金鹰500A、金鹰500B只上市交易,不接受投资者对于金鹰500A或金鹰500B单独进行申购与赎回,但可以将金鹰500A与金鹰500B按照1:1的比例,申请配对转换为场内金鹰500,然后申请场内赎回。

7.份额配对转换:指金鹰500与金鹰500?A、金鹰500B之间的配对转换,配对转换的方式包括以下两种:

(1)分拆,指基金份额持有人将其持有的每2份金鹰500的场内份额申请转换成1份金鹰500A与1份金鹰500B的行为。

(2)合并,指基金份额持有人将其持有的每1份金鹰500A与1份金鹰500B申请配对再转换成2份金鹰500场内份额的行为。

金鹰500A、金鹰500B配比始终保持1:1比例不变。

8.基金份额折算:本基金(《基金合同》生效后,本基金管理人按照《基金合同》规定在基金份额折算日对基金份额进行折算。折算后基金运作方式及金鹰500A?份额与金鹰500B?份额配比不变。

9.基金份额总额:本基金的基金份额总额为393,471,186.50份,其中,金鹰500为342,151,566.50份(场外金鹰500为341,001,948.50份;场内金鹰500为1,149,618.00份),金鹰500A为25,659,810.00份,金鹰500B为25,659,810.00份(截至2012年6月26日)

10.基金份额参考净值:本基金基金份额净值为0.9996元,金鹰500A的基金份额参考净值为1.0042元,金鹰500B的基金份额参考净值为0.9950元(截至2012年6月26日)

11.本上市交易的基金份额简称:金鹰500A、金鹰500B

12.本次上市交易的基金份额总额:金鹰500A为25,659,810.00份;金鹰500B为25,659,810.00份(截至2012年6月26日)

13.交易代码:金鹰500A:150088;金鹰500B:150089

14.上市交易的证券交易所:深圳证券交易所

15.上市交易日期:2012年7月3日

16.基金管理人:金鹰基金管理有限公司

17.基金托管人:交通银行股份有限公司

18.本次上市交易的基金份额注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司

三、基金的募集与上市交易

(一)上市前基金募集情况

1.基金募集申请的核准机构和核准文号:中国证券监督管理委员会证监许可【2012】247号

2.基金运作方式:契约型开放式

3.基金合同期限:不定期

4.发售日期:2012年4月23日至2012年5月29日。

5.发售价格:1.00元人民币

6.发售方式:场内和场外。

7.发售机构:

(1)场外销售机构

1)直销机构:金鹰基金管理有限公司

2)代销银行:交通银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、东莞农村商业银行、深圳发展银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司。

3)代销券商:广州证券有限责任公司、华福证券有限责任公司、方正证券股份有限公司、东海证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、国都证券有限责任公司、东莞证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、国海证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、华安证券有限责任公司、中航证券有限公司、五矿证券有限公司、招商证券股份有限公司、日信证券有限责任公司、中信建投证券有限公司、中国银河证券股份有限公司、天相投资顾问有限公司、长城证券有限责任公司、财通证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、国信证券股份有限公司、世纪证券有限责任公司、中国中投证券有限责任公司、万联证券有限责任公司、广发证券股份有限公司、中国国际金融有限公司、平安证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、中银万国证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司。

(2)场内销售机构

场内销售机构为具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位,具体名单可在深交所网站查询。

8.验资机构名称:立信会计师事务所(特殊普通合伙)

9.募集资金总额及入账情况:本次募集的有效净认购金额为393,335,357.21元人民币,有效认购资金在基金验资确认日之前产生的银行利息共计135,829.29元人民币。上述资金已于2012年6月4日全额划入基金在基金托管人交通银行股份有限公司开立的金鹰中证500指数分级证券投资基金交行托管专户。

10.本基金募集备案情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等相关法律、法规的规定以及《金鹰中证500指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称"基金合同")的有关约定,本基金募集结果符合备案条件,本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续,并于2012年6月5日获中国证监会书面确认,本基金合同自该日起正式生效。基金合同生效之日起,本基金管理人正式开始管理本基金。募集资金已于2012年6月4日全额划入本基金在基金托管人交通银行开立的基金托管专户。

11.基金合同生效日:2012年6月5日

12.基金合同生效日的基金份额总额:393,471,186.50份,其中:场外金鹰500为341,051,468.50份;场内金鹰500为52,419,718.00份,分拆为金鹰500?A为26,209,859.00份,金鹰500B为26,209,859.00份。

(二)金鹰500A、金鹰500B上市交易的主要内容

1.基金上市交易的核准机构和核准文号:深圳证券交易所深证上【2012】202号

2.上市交易日期:2012年7月3日

3.上市交易的证券交易所:深圳证券交易所。投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。

4.基金名称:金鹰中证500指数分级证券投资基金之金鹰中证500A份额、
金鹰中证500B份额
场内简称:金鹰500A、金鹰500B

5.交易代码:150088、150089

6.本次上市交易份额:金鹰500A:25,659,810.00份、金鹰500B:25,659,810.00份

7.基金资产净值及份额参考净值的披露:开放式基金每个工作日交易结束后对基金资产净值进行的估值。基金管理人每日对基金资产估值。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算,基金托管人复核。基金管理人于每个工作日交易结束后将经过基金托管人复核的金鹰500A、金鹰500B的基金份额参考净值传给深交所,深交所于次日通过行情系统揭示。

8.未上市交易份额的流通规定:未上市交易的份额托管在场外,基金份额持有人将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内,按1:1的比例确认为金鹰500A份额与金鹰500B份额后,即可上市流通。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

截至2012年6月26日,场外金鹰500基金份额持有人户数为1332户,平均每户持有的基金份额为256,007.47份;场内金鹰500基金份额持有人户数为10户,平均每户持有的基金份额为114,961.80份;金鹰500A为140户,平均每户持有的基金份额为183,284.36份;金鹰500B为145户,平均每户持有的基金份额为176,964.21份。

机构投资者持有的本次上市交易的金鹰500A基金份额为12,500,901.00份,占本次金鹰500A上市交易基金份额比例为48.72%;个人投资者持有的本次上市交易的金鹰500A基金份额为13,158,909.00份,占本次金鹰500A上市交易基金份额比例为51.28%。

机构投资者持有的本次上市交易的金鹰500B基金份额为12,500,901.00份,占本次金鹰500B上市交易基金份额比例为48.72%;个人投资者持有的本次上市交易的金鹰500B基金份额为13,158,909.00份,占本次金鹰500B上市交易基金份额比例为51.28%。

金鹰500场内前十名持有人情况:

序号	持有人名称(全称)	持有基金份额	占场内基金份额的比例(%)
1	候慧华	350,028.00	30.45
2	蒋琰	300,024.00	26.10
3	符国雄	100,022.00	8.70
4	朱卫东	100,006.00	8.70
5	吴增祥	50,008.00	4.35
6	周汉娣	50,004.00	4.35
7	廖秀芬	50,002.00	4.35
8	王晶华	50,002.00	4.35
9	曾玉铮	50,002.00	4.35
10	华祈春	49,520.00	4.31
	合计	1,149,618.00	100.00

金鹰500A前十名持有人情况:

序号	持有人名称(全称)	金鹰500A份额(份)	占金鹰500A份额比例(%)
1	卢丙杰	5,000,347.00	19.49
2	红塔证券股份有限公司	5,000,347.00	19.49
3	国元证券股份有限公司	2,500,208.00	9.74
4	国联证券股份有限公司	2,500,173.00	9.74
5	东北证券股份有限公司	2,500,173.00	9.74
6	范志强	500,076.00	1.95
7	朱秀珍	500,035.00	1.95
8	刘杰	500,035.00	1.95
9	胡润银	450,047.00	1.75
10	胡爱东	250,017.00	0.97
	合计	19,701,458.00	76.77

金鹰500B前十名持有人情况:

序号	持有人名称(全称)	金鹰500B份额(份)	占金鹰500B份额比例(%)
1	卢丙杰	5,000,347.00	19.49
2	红塔证券股份有限公司	5,000,347.00	19.49
3	国元证券股份有限公司	2,500,208.00	9.74
4	东北证券股份有限公司	2,500,174.00	9.74
5	国联证券股份有限公司	2,500,172.00	9.74
6	范志强	500,076.00	1.95
7	朱秀珍	500,034.00	1.95
8	刘杰	500,034.00	1.95
9	胡润银	450,048.00	1.75
10	胡爱东	250,017.00	0.97
	合计	19,701,457.00	76.77

注:由于四舍五入的原因,占场内总份额比例分项之和与合计可能有尾差。

以上信息依据中国证券登记结算有限公司深圳分公司提供的持有人信息编制。

五、基金主要当事人简介

(一)基金管理人

1.名称:金鹰基金管理有限公司

2.法定代表人:刘东

3.总经理:殷克胜

4.注册资本:2.5亿元人民币

5.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

6.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

7.设立批准文号:中国证监会证监基字【2002】97号

8.工商登记注册的法人营业执照文号:4400000000056278

9.经营范围:基金募集、基金销售、资产管理、特定客户资产管理和中国证监会许可的其他业务。

10.存续期间:持续经营

11.股东及其出资比例:公司股东由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、东亚联丰投资管理有限公司组成,四家股东的出资比例分别为49%、20%、20%、11%。

12.内部组织结构及职能:

基金管理部:

负责公司公募基金的投资管理工作。

研究发展部

在公司既定的投资理念和研究理念的基础上,以系统性的研究方法和高质量的研究成果为公司投资部门提供持续有效的支持。

集中交易部

负责执行各基金的投资指令并及时反馈市场信息。

固定收益投资部

负责公司固定收益证券的研究、投资工作。

专户投资部

负责特定客户资产管理业务。

金融工程部

负责公司量化投资管理工作,包括投资管理的绩效评估、风险的计量和控制等。

产品研发部

跟踪证券市场,研发合适的基金品种以及专户理财产品等。

市场拓展部/机构客户部

负责公司销售渠道管理及服务工作。

运作保障部

负责公司计算机设备的维护及基金后台运作支持工作;基金的注册登记、清算和会计工作等。

监察稽核部

负责对公司管理和基金运作合法合规性进行全方位的严格监控,及时防范风险事件的发生以及对外信息披露。

综合管理部

负责公司财务管理、人事劳资管理、日常行政事务管理。

北京分公司、上海分公司、广州分公司

负责所在辖区的业务拓展工作。

13.人员情况

截至2012年3月31日,公司员工总数120人。

员工学历分布为:博士11人,占员工总数9.17%;硕士43人,占员工总数35.83%;本科53人,占员工总数44.17%;大专及以下学历13人,占员工总数10.83%。

14.信息披露负责人及咨询电话

苏文锋 020-83282627

15.基金管理业务情况

截至2012年6月本基金管理人旗下共管理12只基金,分别是金鹰成份股优选证券投资基金、金鹰中小盘精选证券投资基金、金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金、金鹰行业优势股票型证券投资基金、金鹰稳健成长股票型证券投资基金、金鹰主题优势股票型证券投资基金、金鹰保本混合型证券投资基金、金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金、金鹰策略配置股票型证券投资基金、金鹰持久回报分级债券型证券投资基金、金鹰核心资源股票型证券投资基金以及本基金。

16.本基金基金经理

林华显,本科学历,基金从业经历9年。2002年10月加入金鹰基金管理有限公司,先后担任交易员、交易主管、金鹰成份股优选证券投资基金基金经理助理、现任金鹰成份股优选证券投资基金基金经理以及本基金基金经理。林华显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。

张永东,工学博士,FRM(金融风险管理师),中山大学数学与计算科学学院兼职研究生导师,曾任广发证券和中山大学联合博士后工作站研究人员、广发证券发展研究中心金融工程组负责人、华南理工大学副教授、硕士生导师以及广发基金、天治基金、益民基金金融工程负责人等职。2010年7月加入金鹰基金管理有限公司,现任金融工程部总监、金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金以及本基金基金经理。

本基金历任基金经理情况:林华显先生从本基金金同生效之日起至今一直担任本基金基金经理;张永东先生于2012年6月7日增聘为本基金基金经理,相关公告已于当日披露。

(二)基金托管人

1.基金托管人基本情况

(1)基金托管人概况

公司法定中文名称:交通银行股份有限公司(简称:交通银行)

公司法定英文名称:BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD

法定代表人:胡怀邦

住所:上海市浦东新区银城中路188号

办公地址:上海市浦东新区银城中路188号

邮政编码:200120

注册时间:1987年3月30日

注册资本:618.85亿元

基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字【1998】25号

联系人:张咏东

电话:021-32169999

交通银行始建于1908年,是中国历史最悠久的银行之一,也是近代中国发钞行之一。交通银行先后于2005年6月和2007年5月在香港联交所、上交所挂牌上市,是中国2010年上海世博会唯一的商业银行全球合作伙伴。《财资》杂志(The Asset)2010年全球最佳交易银行评选"中,交通银行荣膺"最佳次托管银行"大奖。英国《银行家》杂志2011年公布的全球1000家银行排名,交通银行以343.21亿美元的一级资本连续第三年跻身全球商业银行50强。截至2011年12月31日,交通银行资产总额达到人民币4.61万亿元,实现净利润人民币502.16亿元。

交通银行总行设资产托管部。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验,具备基金从业资格,以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称,员工的学历层次较高,专业分布合理,职业技能优良,职业道德素质过硬,是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

(2)主要人员情况

牛锡明先生,交通银行行长,哈尔滨工业大学经济学硕士,高级经济师。2009年12月起担任交通银行副董事长、行长。

钱文挥先生,交通银行副行长,上海财经大学工商管理硕士。2004年10月起任交通银行副行长,2007年8月起任交通银行执行董事。

刘树军先生,交通银行资产托管部总经理。管理学硕士,高级经济师。曾任中国农业银行长春分行办公室主任、农行总行办公室正处级秘书,农行总行信贷部工业信贷处处长,农行总行托管部及养老金中心副总经理,交通银行内蒙古分行副行长。2011年10月起任交通银行资产托管部副总经理,2012年5月起任交通银行资产托管部总经理。

(3)基金托管业务经营情况

截止2012年一季度末,交通银行共托管证券投资基金61只,包括博时现金收益货币、博时新兴成长股票、长城久富股票(LOF)、富国汉兴封闭、富国天益价值股票、光大保德信中小盘股票、国泰金鹰增长股票、海富通精选混合、华安安顺封闭、华安宝利配置混合、华安策略优选股票、华安创新股票、华夏蓝筹混合(LOF)、华夏债券、汇丰晋信2016周期混合、汇丰晋信龙腾股票、汇丰晋信动态策略混合、汇丰晋信平稳增利债券、汇丰晋信大盘股票、汇丰晋信低碳先锋股票、汇丰晋信消费红利股票、建信优势封闭、金鹰红利价值混合、金鹰中小盘精选混合、大摩货币、农银恒久增利债券、农银行业成长股票、农银平衡双利混合、鹏华普惠封闭、鹏华普天收益混合、鹏华普天债券、鹏华中国50混合、鹏华信用增利、融通行业景气混合、泰达宏利成长股票、泰达宏利风险预算混合、泰达宏利稳定股票、泰达宏利周期股票、天治创新先锋股票、天治核心成长股票(LOF)、万家公用事业行业股票(LOF)、易方达科汇灵活配置混合、易方达科瑞封闭、易方达上证50指数、易方达科讯股票、银河银富货币、银华货币、中海优质成长混合、兴全磐稳增利债券、华富中证100指数、工银瑞信双利债券、长信量化先锋股票、华夏亚债中国指数、博时深证基本面200ETF、博时深证基本面200ETF联接、建信信用增强债券、富安达优势成长股票、工银主题策略股票、汇丰晋信货币、农银汇理中证500指数、建信深证100指数。此外,还托管了全国社会保障基金、保险资产、企业年金、QFII、QDII、信托计划、证券公司集合资产计划、ABS、产业基金、专户理财等12类产品,托管资产规模超过九千亿元。

(三)基金验资机构

名称:立信会计师事务所(特殊普通合伙)

住所:上海市黄浦区南京东路61号四楼

法定代表人:朱建弟

联系电话:021-63391166

经办注册会计师:张宁、黄毅杰

六、基金合同摘要

基金合同内容摘要见附件。

七、基金财务状况(未经审计)

(一)基金募集期间费用

本基金认购费率如下:

	认购金额(万元)	认购费率
场外认购费	A<50	1.0%
	50≤A<100	0.6%
	100≤A<500	0.2%
	A≥500	每笔1000元
场内认购费	深圳证券交易所会员单位应按照场外认购费率设定投资者的场内认购费率	

注:上表中,A为投资者认购金额。

(二)基金上市前重要财务事项

本基金募集结束后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

(三)基金资产负债表

截至2012年6月26日,本基金资产负债表如下:

单位:人民币元

项目	行次	2012年6月26日
资产:		
银行存款	1	23,656,056.12
结算备付金	2	16,254,712.23
存出保证金	3	0.00
交易性金融资产	4	35,000,000.00
其中:股票投资	5	0.00
基金投资	6	0.00
债券投资	7	35,000,000.00
资产支持证券投资	8	0.00
衍生金融资产	9	0.00
买入返售金融资产	10	290,000,000.00
应收证券清算款	11	28,681,637.14
应收利息	12	188,496.42
应收股利	13	0.00
应收申购款	14	0.00
递延所得税资产	15	0.00
其他资产	16	0.00
资产总计	17	393,780,901.91
负债和所有者权益		
负债:		
短期借款	18	0.00
交易性金融负债	19	0.00
衍生金融负债	20	0.00
卖出回购金融资产款	21	0.00
应付证券清算款	22	0.00
应付赎回款	23	0.00
应付管理人报酬	24	225,828.34
应付托管费	25	49,682.24
应付销售服务费	26	0.00
应付交易费用	27	0.00
应交税费	28	0.00
应付利息	29	0.00
应付利润	30	0.00
递延所得税负债	31	0.00
其他负债	32	200,005.60
负债合计	33	475,516.18
所有者权益:		
实收基金	34	393,471,186.50
未分配利润	35	-165,800.77
所有者权益合计	36	393,305,385.73
负债和所有者权益总计	37	393,780,901.91

注:报告截至日2012年6月26日,金鹰中证500指数分级证券投资基金份额净值0.9996元,基金基础份额总额342,151,566.50份;金鹰500A份额净值1.0042元,基金份额总额25,659,810.00份;金鹰500B份额净值0.9950元,基金份额总额25,659,810.00份。

八、基金投资组合

截至2012年6月26日,金鹰中证500指数分级证券投资基金的投资组合如下:

(一)基金资产组合情况

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	0.00	0.00
	其中:股票	0.00	0.00
2	固定收益投资	35,000,000.00	8.89
	其中:债券	35,000,000.00	8.89
	资产支持证券	0.00	0.00
3	金融衍生品投资	0.00	0.00
4	买入返售金融资产	290,000,000.00	73.65
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	0.00	0.00
5	银行存款和结算备付金合计	39,910,768.35	10.13
6	其他各项资产	28,870,133.56	7.33
7	合计	393,780,901.91	100.00

(二)按行业分类的股票投资组合

本基金截至2012年6月26日止未持有股票。

(三)按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

本基金截至2012年6月26日止未持有股票。

(四)按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	0.00	0.00
2	央行票据	0.00	0.00
3	金融债券	0.00	0.00
	其中:政策性金融债	0.00	0.00
4	企业债券	35,000,000.00	8.89
5	企业短期融资券	0.00	0.00
6	中期票据	0.00	0.00
7	可转债	0.00	0.00
8	其他	0.00	0.00
9	合计	35,000,000.00	8.89

(五)截至2012年6月26日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

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	112086	12圣农01	350000	35,000,000.00	8.89

注:本基金截至2012年6月26日止只持有一只债券。

(六)股票投资组合报告附注

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

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。

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

本基金截至2012年6月26日止未持有股票。

3.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	0.00
2	应收证券清算款	28,681,637.14
3	应收股利	0.00
4	应收利息	188,496.42
5	应收申购款	0.00
6	其他应收款	0.00
7	待摊费用	0.00
8	其他	0.00
9	合计	28,870,133.56

4.本基金持有的处于转股期的可转换债券明细及资产支持债券、分离交易可转债

截至2012年6月26日,本基金未持有处于转股期的可转换债券明细及资产支持债券、分离交易可转债。

5.报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金截至2012年6月26日止未持有股票。

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。

九、重大事件揭示

1.本基金于2012年6月21日开通份额配对转换业务,相关公告已于当日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》以及《证券时报》。

2.本基金于2012年6月21日开通跨系统转托管业务,相关公告已于当日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》以及《证券时报》。

3.本基金自合同生效至上市交易期间未发生其他对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺:

(一)严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

(二)真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件,披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息,并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。

(三)在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后,将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺:

(一)严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,设立专门的基金托管部,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。

(二)根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

(三)基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,并在限期内,随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。

(四)基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,将立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。

十二、备查文件目录

本基金备查文件包括下列文件:

(一)中国证监会核准金鹰中证500指数分级证券投资基金募集的文件;

(二)《金鹰中证500指数分级证券投资基金基金合同》;

(三)《金鹰中证500指数分级证券投资基金托管协议》;

(四)《金鹰中证500指数分级证券投资基金招募说明书》;

(五)法律意见书;

(六)基金管理人业务资格批件、营业执照;

(七)基金托管人业务资格批件和营业执照;

(八)中国证监会要求的其他文件。

存放地点:基金管理人和基金托管人的住所

查阅方式:基金投资者可在营业时间免费查阅,或通过指定的信息披露媒体、本基金管理人网站(www.gefund.com.com)查阅。

金鹰基金管理有限公司
2012年6月28日

附件:基金合同摘要

(一)基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

1.基金份额持有人的权利、义务

(1)基金投资者持有本基金基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,基金投资者自依据招募说明书、基金合同取得本基金的的基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同当事人,直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。金鹰中证500、金鹰中证500A、金鹰中证500B的每份基金份额在其各自的份额级别内具有同等的合法权益。

(2)基金份额持有人的权利

1)分享基金财产收益;

2)参与分配清算后的剩余基金财产;

3)依法转让或者申请赎回其持有的基金份额;

4)按照规定要求召开基金份额持有人大会;

5)出席或者委派代表出席基金份额持有人大会,对基金份额持有人大会审议事项行使表决权;

6)查阅或者复制公开披露的基金信息资料;

7)监督基金管理人的投资运作;

8)对基金管理人、基金托管人、注册登记人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼;

9)法律法规、基金合同规定的其它权利。

(3)基金份额持有人的义务

1)遵守基金合同;

2)交纳基金认购、申购款项及基金合同规定的费用;

3)在持有的基金份额范围内,承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任;

4)不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法利益的活动;

5)执行生效的基金份额持有人大会决议;

6)返还在基金交易过程中因任何原因,自基金管理人、基金托管人及代销机构处获得的不当得利;

7)法律法规及基金合同规定的其他义务。

2.基金管理人的的权利、义务

(1)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号城建大厦22-23楼

邮政编码:510620

法定代表人:刘东

成立时间:2002年12月25日

批准设立机关:中国证券监督管理委员会

批准设立文号:证监基金字【2002】97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

(2)基金管理人的权利

1)依法募集基金,办理基金备案手续;

2)自基金合同生效之日起,依照法律法规和基金合同独立管理基金财产;

3)根据法律法规和基金合同的规定,制订、修改并公布有关基金募集、认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则;

4)根据法律法规和基金合同的规定获得基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用;

5)在符合有关法律法规和基金合同的前提下,决定本基金的相关费率结构和收费方式;

6)根据法律法规和基金合同之规定销售基金份额;

7)依据法律法规和基金合同的规定监督基金托管人,如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定,应呈报中国证监会和其他监管部门,并采取必要措施保护基金投资者的利益;

8)根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议对基金代销机构行为进行必要的监督和检查;

9)自行担任基金注册登记人或选择、更换基金注册登记代理机构,办理基金注册登记业务,并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查;

10)在基金合同约定的范围内,拒绝或暂停受理申购和赎回的申请;

11)在法律法规允许的前提下,为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资融券;

12)依据法律法规和基金合同的规定,制订基金收益的分配方案;

13)按照法律法规,代表基金对被投资企业行使股东权利,代表基金行使因投资于其它证券所产生的权利;

14)在基金托管人职责终止时,提名新的基金托管人;

15)依据法律法规和基金合同的规定,召集基金份额持有人大会;

16)以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;

17)选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率;

18)法律法规、基金合同以及依据基金合同制订的其它法律文件所规定的其它权利。

(3)基金管理人的义务

1)依法募集基金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;如认为基金代销机构违反《基金合同》、基金销售与服务代理协议及国家有关法律规定,应呈报中国证监会和其他监管部门,并采取必要措施保护基金投资者的利益;

2)办理基金备案手续;

3)自基金合同生效之日起,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产;

4)配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;

5)配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购和赎回业务;

6)配备足够的专业人员和相应的技术设施进行基金的注册登记或委托其他机构代理该项业务;

7)建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的资产相互独立,对所管理的不同基金和受托资产分别管理、分别记账,进行证券投资;

8)除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外,不得以基金财产为自己及任何第三人谋取非法利益,不得委托第三人运作基金财产;

9)接受基金托管人依法进行的监督;

10)采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回价格的方法符合基金合同等法律文件的规定,按照有关规定计算并公告基金份额净值,确定基金份额申购、赎回的价格;

11)严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

12)保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前,应予以保密,不得向他人泄露;

13)按基金合同确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;

14)按照法律法规和本基金合同的规定受理申购和赎回等申请,及时、足额支付赎回和分红款项;

15)不谋求对上市公司的控股和直接管理;

16)依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会,或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;

17)按规定保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料15年以上;

18)进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告;

19)编制基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告;

20)确保需要向基金份额持有人提供的各项文件或资料,能在规定时间内发出;保证投资者能够按照基金合同约定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件;

21)组织并参加基金财产清算组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

22)面临解散、依法被撤销、被依法宣告破产或者由接管人接管其资产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;

23)因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人的合法权益,应承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

24)监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时,应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

25)不从事任何有损基金财产及本基金其他当事人利益的活动;

26)公平对待所管理的不同基金和受托资产,防止在不同基金和受托资产间进行有损本基金基金份额持有人的利益的资源分配;

27)依据《基金法》、基