金鹰中小盘精选证券投资基金

【2012】第二季度报告

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：二〇一二年七月十八日

§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金鹰中小盘精选混合
基金主代码	162102
交易代码	162102
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年5月27日
报告期末基金份额总额	2,211,831,517.15份
投资目标	本基金投资具有较高成长性和良好基本面的中小盘股票，通过积极的投资组合管理，在控制风险的前提下谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采取主动的股票投资策略，在专业化研究的基础上，将系统的选股方法与积极的投资操作相结合，选择具有较高成长性、基本面良好的股票构建股票投资组合，把握投资机会，实现收益。债券投资策略：本基金采取稳健的混合管理投资策略，根据对利率、收益率走势的预测，考虑债券信用等级、期限、品种、流动性等因素，依据修正久期、凸性等指标，构建债券组合。
业绩比较基准	中证700指数收益率＊75%+中信标普国债指数收益率＊25%
风险收益特征	本基金属于风险水平适中、预期收益较高的证券投资基金品种。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2012年4月1日-2012年6月30日)
1.本期已实现收益	17,227,344.42
2.本期利润	37,813,905.78
3.加权平均基金份额本期利润	0.0172
4.期末基金资产净值	1,635,450,351.50
5.期末基金份额净值	0.7394

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。

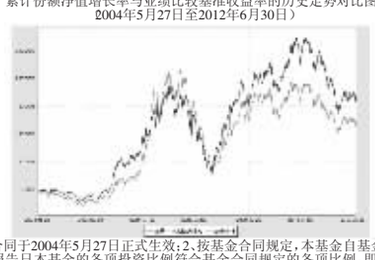
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	2.21%	0.97%	1.02%	0.92%	1.19%	0.05%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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

金鹰中小盘精选证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
（2004年5月27日至2012年6月30日）



注：1、本基金合同于2004年5月27日正式生效；2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效起三个月内为建仓期，截止报告日本基金的各项投资比例符合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%。3、本基金业绩比较基准为：中证700指数收益率＊75%+中信标普国债指数收益率＊25%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
朱丹	基金经理	2010-7-30	-	6	朱丹女士，金融学硕士，曾任职于深圳晨星咨询公司，2007年6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、基金经理助理等职，现任金鹰中小盘精选证券投资基金、金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金和金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
杨绍基	公司首席投资官，投资决策委员会委员，基金经理	2009-9-8	-	8	杨绍基先生，经济学博士，证券从业经历八年。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、基金管理部总监等职，现任公司首席投资官、投资决策委员会委员，兼任本基金基金经理、金鹰稳健成长股票型证券投资基金基金经理、金鹰策略配置股票型证券投资基金基金经理。

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颁布的《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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、《金鹰中小盘精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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本基金管理人事前规定了严格的股票备选库管理制度、投资权限管理制度、债券库管理制度和集中交易制度等；事中重视交易执行环节的公平交易措施，以"时间优先、价格优先"作为执行指令的基本原则，必要时启用投资交易系统中的公平交易模块；事后加强对不同投资组合的交易价差、收益率的分析，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易的情况；与本公司管理的被动型投资组合发生的同日反向交易，未发生过成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度A股市场未能延续一季度的反弹态势，外围市场不稳和国内宏观经济的快速下滑进一步强化投资者的悲观预期，市场在4月份短暂反弹受阻后持续下跌，二季度上证指数下跌1.65%，深证成指上涨0.96%，中小板综指上涨2.3%，创业板指数上涨7.10%。由于市场普遍担心经济增速放慢引致整个经济体系"日持久的去产能问题，使得大部分周期类股票在二季度继续遭到抛售，而业绩增速良好的食品饮料、品牌服饰、建筑装修则继续受到资金的青睐，下半年盈利预期有望改善的医药板块以及销量回升的地产板块也表现强于大盘。

本基金在一季度对二季度的投资策略展望中出现偏差，由于一季度支撑市场做多的政策、经济等预期因素在二季度相继被证伪，市场没有出现我们在前期所预判的持续反弹行情，我们基于行情做多所配置的色金属、券商、汽车等弹性资产在二季度表现不佳，拖累基金净值表现。当我们在发现市场运行与原先预判不同后，果断减持券商、汽车等弹性资产，增加医药板块的配置比例，提高组合资产的防守能力，而二季度继续稳仓持有的稀土永磁板块也表现强于大盘，一定程度上稳定了基金净值。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2012年6月30日，基金份额净值为0.7394元，本报告期份额净值增长率为2.21%，同期业绩比较基准增长率为1.02%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度，预计美国经济将继续温和复苏，欧洲受债务危机影响经济仍将艰难跋涉，国内后宏观经济有望环比略微改善，而随着时间推移，央行降息和降准的政策将逐步在实体经济和虚拟经济中发挥积极效应。但由于A股市场目前仍处于相对弱势，上市公司整体业绩的改善仍是一个相对较长的过程，投资策略应着眼于如何在宽幅震荡的市场中寻找结构性投资机会。本基金将重点在能源、新材料、TMT、消费、商业连锁、医药、节能环保等领域中，致力于寻找未来季度盈利状况环比较快改善，年度盈利增长良好以及长期盈利成长空间更大的股票，尽量回避行业空间萎缩、盈利倒退的行业和股票。

§5 投资组合报告

5.1 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	权益投资	1,234,318,658.91	74.63
	其中：股票	1,234,318,658.91	74.63
2	固定收益投资	336,169,000.00	20.33
	其中：债券	336,169,000.00	20.33
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	27,586,756.66	1.67
6	其他各项资产	55,780,342.42	3.37
7	合计	1,653,854,757.99	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。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	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	79,104,330.39	4.84
C	制造业	816,203,417.73	49.91
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	51,000,000.00	3.12
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	44,793,861.65	2.74
C5	电子	206,581,932.11	12.63
C6	金属、非金属	108,183,536.00	6.61
C7	机械、设备、仪表	271,956,708.01	16.63
C8	医药、生物制品	133,687,379.96	8.17
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	75,418,595.72	4.61
E	建筑业	14,366,745.12	0.88
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	41,359,045.56	2.53
H	批发和零售贸易	44,082,782.92	2.70
I	金融、保险业	86,398,164.53	5.28
J	房地产业	41,289,937.56	2.52
K	社会服务业	27,794,000.00	1.70
L	传播与文化产业	8,301,639.38	0.51
M	综合类	-	-
	合计	1,234,318,658.91	75.47

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002129	中环股份	10,806,775	138,867,058.75	8.49
2	600111	包钢稀土	2,741,600	108,183,536.00	6.61
3	600259	广晟有色	1,199,823	79,104,330.39	4.84
4	600468	百利电气	5,009,346	62,666,918.46	3.83
5	600995	文山电力	9,000,000	62,280,000.00	3.81
6	600268	国电南自	6,493,010	57,982,579.30	3.55
7	000850	华茂股份	7,500,000	51,000,000.00	3.12
8	300267	尔康制药	2,400,000	50,856,000.00	3.11
9	601318	中国平安	1,019,633	46,638,013.42	2.85
10	600378	天科股份	4,987,721	43,143,786.65	2.64

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	19,998,000.00	1.22
2	央行票据	157,576,000.00	9.64
3	金融债券	158,595,000.00	9.70
	其中：政策性金融债	158,595,000.00	9.70
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	336,169,000.00	20.56

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	080214	08国开14	1,000,000	108,190,000.00	6.62
2	1001074	10央行票据74	800,000	79,992,000.00	4.89
3	1101096	11央行票据96	800,000	77,584,000.00	4.74
4	110206	11国开06	500,000	50,405,000.00	3.08
5	090015	09附息国债15	200,000	19,998,000.00	1.22

5.6 报告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。

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,250,000.00
2	应收证券清算款	13,966,808.40
3	应收股利	-
4	应收利息	8,758,929.87
5	应收申购款	30,804,604.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	55,780,342.42

5.8.4 报告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。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
报告期末前十名股票中无流通受限情况。

5.8.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	2,227,091,639.07
本报告期基金总申购份额	150,459,092.95
减：本报告期基金总赎回份额	165,719,214.87
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,211,831,517.15

§7 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1、中国证监会批准金鹰中小盘精选证券投资基金发行及募集的文件。
2、《金鹰中小盘精选证券投资基金基金合同》。
3、《金鹰中小盘精选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。

8.2 存放地点
广州市天河区体育西路189号城建大厦22-23层

8.3 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
二〇一二年七月十八日

金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金

【2012】第二季度报告

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：二〇一二年七月十八日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金鹰技术指数增强
基金主代码	210007
交易代码	210007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年6月1日
报告期末基金份额总额	106,907,557.08份
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，力求实现对中证技术领先指数的有效跟踪；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。
投资策略	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。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为中证技术领先指数×90%+活期存款利率（税后）×10%。
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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2012年4月1日-2012年6月30日)
1.本期已实现收益	-1,072,871.72
2.本期利润	1,006,769.82
3.加权平均基金份额本期利润	0.0090
4.期末基金资产净值	80,356,935.62
5.期末基金份额净值	0.7516

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）。

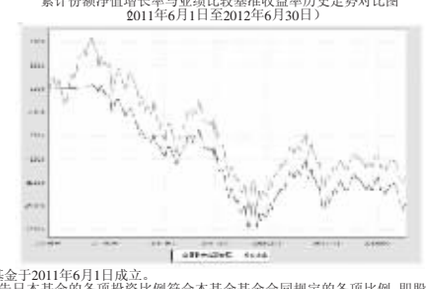
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	0.72%	1.12%	2.02%	1.06%	-1.30%	0.06%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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

金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2011年6月1日至2012年6月30日）



注：1、本基金于2011年6月1日成立。
2、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%；
3、本基金业绩比较基准为中证技术领先指数×90%+活期存款利率（税后）×10%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张永东	金融工程部总监，基金经理	2012-2-16	-	9	张永东先生，工学博士，FRM（金融风险管理师），证券从业经历9年。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及金鹰中证500指数分级证券投资基金及本基金基金经理。
朱丹	基金经理	2011-6-1	-	6	朱丹女士，金融学硕士，证券从业经历6年，具备基金从业资格，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、基金经理助理等职，现任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。

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、《金鹰中证技术领先指数增强型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，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，曾发生一起小额赎回头寸预清算不足的情况，公司已及时处理并按时完成了资金交收，未影响本基金资产和基金份额持有人的利益，未出现其他重大违法违规或违反基金合同的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本基金管理人事前规定了严格的股票备选库管理制度、投资权限管理制度、债券库管理制度和集中交易制度等；事中重视交易执行环节的公平交易措施，以"时间优先、价格优先"作为执行指令的基本原则，必要时启用投资交易系统中的公平交易模块；事后加强对不同投资组合的交易价差、收益率的分析，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易的情况；与本公司管理的被动型投资组合发生的同日反向交易，未发生过成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2012年第二季度，由于同时受到海外欧债问题、美国经济复苏乏力、国内经济持续下行等因素对市场的抑制作用以及稳增长的政策基调对市场的支撑作用，国内市场走出了震荡形态，其中，在行业表现上，医药生物、食品饮料、房地产、公用事业等行业季度涨幅居前，轻工制造、信息服务、采掘、黑色金属等行业表现较差；在风格特征上，高市净率组合、高价股组合大幅跑赢中低市净率组合、中低价股组合。

在报告期内，本基金净值波动水平略高于业绩比较基准、年化跟踪误差2.44%控制在限定范围内。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2012年6月30日，本基金份额净值为0.7516元，本报告期份额净值增长率0.72%，同期业绩比较基准增长率为2.02%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为，在经济潜在增速持续放缓、总供应收缩和总需求不足的宏观背景下，市场的机会更多是结构性的而非趋势性的，同时在稳增长的政策基调下，继续出台结构化政策的概率较大，因此我们判断三季度市场可能继续维持震荡格局。

本基金将继续坚持采用量化策略进行指数增强和风险管理，适时对投资组合进行再平衡调整，在控制跟踪误差在限定范围内的同时，力争获取适度的增强收益。

§5 投资组合报告

5.1 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	权益投资	75,400,088.78	93.17
	其中：股票	75,400,088.78	93.17
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	5,483,682.96	6.78
6	其他各项资产	39,536.59	0.05
7	合计	80,923,308.33	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	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	-	-
C	制造业	1,257,615.02	1.57
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	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	709,424.22	0.88
C8	医药、生物制品	548,190.80	0.68
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	1,140,932.00	1.42
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	2,398,547.02	2.98

5.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	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	-	-
C	制造业	58,822,277.99	73.20
C0	食品、饮料	706,490.00	0.88
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	2,239,711.20	2.79
C5	电子	7,860,427.28	9.78
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	33,973,037.97	42.28
C8	医药、生物制品	13,033,671.54	16.22
C99	其他制造业	1,008,940.00	1.26
D	电力、煤气及水的生产和供应业	397,602.00	0.49
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	12,326,478.77	15.34
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	1,455,183.00	1.81
	合计	73,001,541.76	90.85

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1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前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002106	莱宝高科	43,600	875,052.00	1.09
2	002007	华兰生物	34,000	835,720.00	1.04
3	000423	东阿阿胶	20,089	803,760.89	1.00
4	300050	世纪鼎利	72,000	803,520.00	1.00
5	002153	石基信息	31,200	800,280.00	1.00
6	002252	上海莱士	58,456	789,740.56	0.98
7	600066	宇通客车	34,630	777,789.80	0.97
8	600468	百利电气	61,400	768,114.00	0.96
9	002121	科陆电子	86,500	766,390.00	0.95
10	600118	中国卫星	60,396	760,385.64	0.95

5.3.2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前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002603	以岭药业	12,788	352,309.40	0.44
2	600498	烽火通信	11,900	315,469.00	0.39
3	300105	龙源技术	11,124	303,573.96	0.38
4	002308	威创股份	27,300	268,905.00	0.33
5	601126	四方股份	15,822	231,475.86	0.29

5.4 报告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投资。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券投资。

5.6 报告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。

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	4,577.68
4	应收利息	1,045.60
5	应收申购款	33,913.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	39,536.59

5.8.4 报告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。

5.8.5.1期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.8.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

5.8.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	117,356,878.63
本报告期基金总申购份额	2,077,329.03
减：本报告期基金总赎回份额	12,526,650.58
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	106,907,557.08

§7 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1、中国证监会批准金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金发行及募集的文件。
2、《金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金基金合同》。
3、《金鹰中证技术领先指数增强型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、更新的招募说明书及其他临时公告。

8.2 存放地点
广州市天河区体育西路189号城建大厦22-23层

8.3 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
二〇一二年七月十八日

金鹰主题优势股票型证券投资基金

【2012】第二季度报告

基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一二年七月十八日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金鹰主题优势股票
基金主代码	210005
交易代码	210005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年12月20日
报告期末基金份额总额	1,094,208,923.53份
投资目标	以追求资本可持续增值为目的，以深入的基本面分析为基础，把握主题投资的脉络，在充分控制风险的前提下，分享中国经济快速发展的成果以及企业经营绩效提升所带来的股权溢价，力争实现基金资产的长期可持续稳健增值。
投资策略	本基金坚持"自上而下"为主、"自下而上"为辅的投资视角，在实际投资过程中充分体现"主题优势"这个核心理念，以主题情景分析法把握经济发展不同阶段的主题投资节奏，优选并深挖不同阶段热点主题投资机会，优化资产配置，降低市场波动的冲击，扩大投资收益。