

# 金鹰稳健成长股票型证券投资基金

## 2010 年年度报告摘要

2010 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2011 年 3 月 28 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 3 月 25 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招募说明书及其更新。

本报告财务资料已经审计，立信羊城会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2010 年 4 月 14 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	金鹰稳健成长股票
基金主代码	210004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 4 月 14 日
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
报告期末基金份额总额	402,410,295.28 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	以追求长期资本可持续增值为目的，以深入的基本面分析为基础，通过投资于稳健性、成长性或两者兼备的股票，在充分控制风险的前提下，分享中国经济快速发展的成果，进而实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金投资策略充分体现“稳健”与“成长”这两个核心理念。在实际投资过程中采用“自上而下”的投资方法，定性与定量分析相结

	合，重点考察宏观经济、资本市场、名义利率所处的不同周期阶段，分析判断市场时机，合理确定基金在股票、债券、现金等资产类别上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时动态地调整股票、债券和货币市场工具的投资比例。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×75%+中信标普国债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金为主动操作的股票型证券投资基金，属于证券投资基金中的高收益、高风险品种。

### 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	苏文锋	赵会军
	联系电话	4006-135-888、 020-83282627	010-66105799
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		020-83936180	95588
传真		020-83282856	010-66105798

### 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.gefund.com.cn">http://www.gefund.com.cn</a>
基金年度报告备置地点	广州市沿江中路 298 号江湾商业中心 22 层

## § 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

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2010 年
本期已实现收益	52,284,953.24
本期利润	59,730,243.77
加权平均基金份额本期利润	0.1484
本期基金份额净值增长率(%)	25.44
3.1.2 期末数据和指标	2010 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0224
期末基金资产净值	431,083,922.06
期末基金份额净值	1.071

注：1、本基金基金合同于 2010 年 4 月 14 日正式成立，截至 2010 年 12 月 31 日，基金成立不足一年；

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；

- 3、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；
- 4、期末可供分配利润，采用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

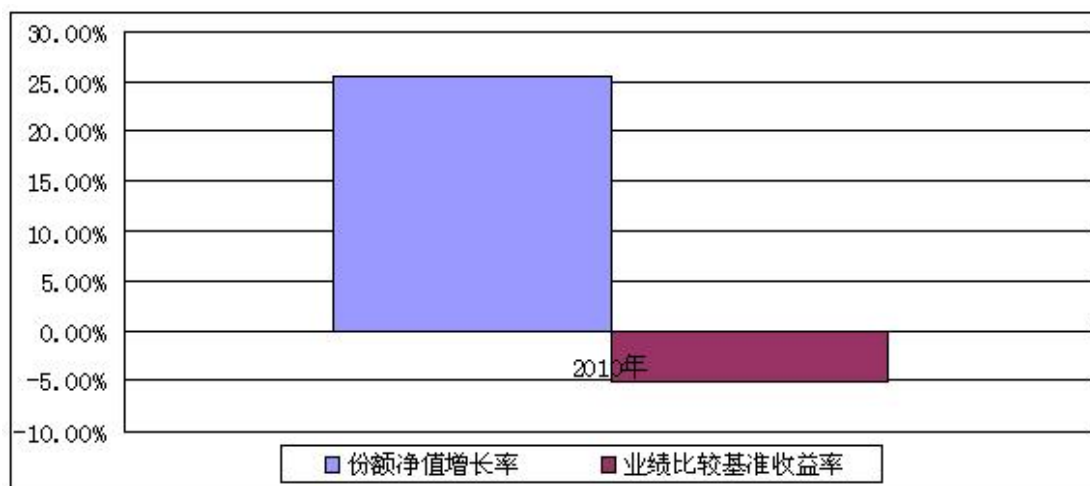
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	16.43	1.82	4.86	1.32	11.57	0.50
过去六个月	33.16	1.50	16.45	1.16	16.71	0.34
自基金合同生效起至今	25.44	1.31	-5.16	1.26	30.60	0.05

#### 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



#### 3.2.3 过去五年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



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2010	1.800	30,626,089.11	23,779,591.59	54,405,680.70	
合计	1.800	30,626,089.11	23,779,591.59	54,405,680.70	

注：本基金成立于 2010 年 4 月 14 日，截至 2010 年 12 月 31 日成立不足一年，在此期间，本基金共分红三次，其分别是 2010 年 8 月 23 日，每 10 份分红 0.30 元；2010 年 11 月 12 日，每 10 份分红 1.00 元；2010 年 12 月 10 日，每 10 份分红 0.50 元。

## § 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金字[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 1 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运作、确定基本投资策略和投资组合原则。风险控制委员会负责全面评估公司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；金融工程部负责建立和完善公司量化投资支持体系以及量化产品的投资管理工作，为基金投资管理与决策、基金投资风险管理及绩效分析、数量化投资产品开发与管理等提供定量研究支持；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；专户投资部负责特定客户资产的投资和管理；运作；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；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 2010 年 12 月 31 日，公司旗下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六只开放式基金。

#### 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	证券从业年限	说明
----	----	----------------	--------	----

		限			
		任职日期	离任日期		
杨绍基	投资管理部总监，投资决策委员会委员，基金经理	2010年5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，兼任本基金基金经理、金鹰中小盘精选证券投资基金基金经理及金鹰成份股优选证券投资基金基金经理。
蔡飞鸣	投资决策委员会委员，基金经理	2010年4月14日	-	5年	蔡飞鸣先生，国际金融（优秀）硕士、管理学硕士，证券从业经历五年。曾任职于广州越秀集团有限公司、香港越秀财务公司资本经营部，香港越秀证券有限公司。2008年5月加入金鹰基金管理有限公司，先后担任研究员、交易主管、金鹰中小盘精选证券投资基金基金经理助理等职，现任投资决策委员会委员、本基金基金经理，并兼任金鹰红利价值灵活配置

					混合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《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、《金鹰稳健成长股票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，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 公平交易制度的执行情况

报告期内本基金管理人认真贯彻执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的有关规定，加强投资管理制度、研究制度、交易制度、监察稽核制度的执行和后台 IT 系统支持，确保公司旗下基金在交易上均能得到公平对待。

本基金管理人主要通过建立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，基金经理只能在既定的权限范围内、根据投资决策委员会的决议或指导意见进行投资操作，超出其权限范围的投资须经相关流程审批并授权。各投资组合只能选取股票备选库中的股票进行投资，股票备选库的建立维护主要由研究部负责，股票入库需要经过充分研究和集体讨论，并经相应的决策程序决定是否入库，从而对投资形成相对的制约。另外，公司还通过完善和加强 IT 系统功能，从系统运作上保证公平交易制度的执行。在交易环节，所有的投资指令必须通过集中交易室下达，集中交易室与投资部门相隔离，交易员对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，审核认为无效的可以拒绝执行。在交易过程中，按照“时间优先、价格优先”的原则，公平对待各投资组合，如发现任何异常交易及时反馈报告，由此形成对投资的又一重制约。监察稽核部负责通过对



投资组合各项合规性指标的的日常检查提示,以及对投资、研究、交易等全流程的独立的监察稽核和实时监控,督促落实上述制度措施,促进投资运作的规范性。金融工程部负责建立和完善公平交易量化分析体系,分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗内同向交易的交易价差进行统计分析,并给出公平交易分析报告。

本基金管理人旗下六只基金投资风格迥异,投资范围严格受基金合同限制,金鹰成份股优选证券投资基金投资标的以上证 180 和深圳 100 大市值股票为主,金鹰中小盘精选证券投资基金投资标的以市场平均流通市值以下的股票为主,金鹰红利价值灵活配置证券投资基金投资标的以注重分红的公司为主,金鹰行业优势股票型证券投资基金投资于优势行业中的优势个股,金鹰稳健成长股票型证券投资基金投资于稳健性、成长性或两者兼备的股票,金鹰主题基金是主动型股票投资基金,以对上市公司盈利产生正向收益的驱动力为主题,结合基本面、政策面、流动性及估值因素,进行主动性投资。通过对本报告期本基金管理人旗下的六只基金在 1 日内、5 日内和 10 日内发生的同向交易和价差进行分析,所有成对基金同向交易价格占优的交易样本占比均低于 50%,不存在违反公平交易的行为,不存在利益输送行为。

#### 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

2010 年 A 股市场剧烈震荡,分化明显。上证指数全年下跌 14.3%,在全球主要股票市场中基本垫底,而中小板综指全年上涨 28.3%,相当数量的个股涨幅翻番。报告期内 A 股市场的运行泾渭分明,上半年震荡向下,上证指数最大跌幅达 29.5%,下半年震荡向上,上证指数最高涨幅达 37.3%,中小板综指更创出历史新高,最高涨幅高达 63%。报告期内 A 股市场的大幅震荡和个股严重分化时刻考验着我们的投资策略和交易的心理强度,本基金自 4 月中旬成立后,在上半年的

单边震荡下跌中，坚守投资纪律，以测试性仓位运作为主，一定程度上回避了市场系统性风险，并在7月中下旬2400-2500点的市场右侧位较快推高股票仓位。在资产配置上，本基金同样执行“弃大扬小，舍旧求新”的八字投资策略。在流动性趋紧、经济结构转型方向逐步明朗、地产调控力度空前的背景下，中小盘股的投资机会好于大盘股，与新经济增长模式相关行业的股票投资机会好于旧的投资出口拉动经济增长模式下的传统行业股票。沿着这一投资逻辑，本基金全年重点配置电子元器件、信息技术、机械、医药、商业零售等与新能源、节能环保、智能电网、物联网、三网融合、大消费等主题相关的股票，并在周期类股票与大消费类股票之间进行策略性轮动配置。报告期内，本基金最大的失误在于低估了四季度国庆后的行情强度，导致在2900点位置过早抛出煤炭、有色、航空等强周期股票仓位，在周期类股票的飙升过程中，“我们没坐在轿子上”。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2010年12月31日，基金份额净值为1.071元，本报告期份额净值增长率为25.44%，同期业绩比较基准收益率为-5.16%。

#### 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，中国经济将保持平稳较快增长，以美国为代表的发达经济体继续复苏也将是主线，尽管过程仍不免曲折。2011年是十二五开局之年，是我国产业结构调整 and 战略新兴产业领域投资的起始之年，转变投资、出口拉动的传统经济增长模式，扩大内需，注重节能减排，提高消费和服务业在GDP增长中的占比是未来经济增长新的方向，相关上市公司将持续受益，盈利有望保持稳定增长。对于证券市场而言，政策仍是影响投资人预期的最关键变量，“积极、稳健、审慎、灵活”的相机抉择政策凸显政府对经济调控兼顾宏观和微观的协调性，对证券市场的影响将是双向的，市场的运行预计仍呈区间宽幅震荡特征。基于政府推动经济转型的决心，我们长期看好战略新兴产业，七大战略新兴产业领域的投资将给A股市场带来新的投资机会。总体而言，我们高度关注来自这些行业和主题的投资机会，包括：清洁能源，高效节能电子器件，以高铁产业链、大飞机产业链、核电、海工、环保节能机械、矿用机械等为代表的高端装备制造，医保、

农林牧渔、食品饮料为代表的消费经济，先导产业中的新一代信息技术。此外，央企重组将可能是全年 A 股市场的投资盛宴。

#### 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、基金会计和相关人员组成。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。

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

本基金于 2010 年 4 月 14 日基金合同正式成立，截至 2010 年 12 月 31 日，基金成立不足一年。在此期间，本基金共进行利润分配 3 次，每 10 份分红 1.80 元，利润分配总额为 54,405,680.70 元，具体为 2010 年 8 月 23 日，每 10 份分红 0.30 元，利润分配金额 8,204,357.51 元；2010 年 11 月 12 日，每 10 份分红 1.00 元，利润分配金额 29,168,580.28 元；2010 年 12 月 10 日，每 10 份分红 0.50 元，利润分配金额 17,032,742.91 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

2010 年，本基金托管人在对金鹰稳健成长股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

## 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

2010 年，金鹰稳健成长股票型证券投资基金的管理人—金鹰基金管理有限公司在金鹰稳健成长股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，金鹰稳健成长股票型证券投资基金对基金份额持有人进行了三次利润分配，分配金额为 54,405,680.70 元。

## 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

本托管人依法对金鹰基金管理有限公司编制和披露的金鹰稳健成长股票型证券投资基金 2010 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

会计师对当期财务会计报告出具了无保留意见的审计报告，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：金鹰稳健成长股票型证券投资基金

报告截止日：2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 (2010 年 12 月 31 日)	上年度末 ( )
<b>资 产:</b>		
银行存款	45,071,439.99	-
结算备付金	2,692,796.98	-
存出保证金	1,250,000.00	-

交易性金融资产	381,284,299.64	-
其中：股票投资	381,284,299.64	-
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	575,863.97	-
应收利息	11,802.55	-
应收股利	-	-
应收申购款	7,947,754.00	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	438,833,957.13	-
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>(2010年12月31日)</b>	<b>( )</b>
<b>负 债：</b>		
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	4,138,668.81	-
应付赎回款	207,666.55	-
应付管理人报酬	504,647.21	-
应付托管费	84,107.87	-
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,054,161.97	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,760,782.66	-
负债合计	7,750,035.07	-
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	402,410,295.28	-
未分配利润	28,673,626.78	-
所有者权益合计	431,083,922.06	-
负债和所有者权益总计	438,833,957.13	-

注：本基金2010年4月14日基金合同正式生效，截至2010年12月31日，本基金成立不足1年。

## 7.2 利润表

会计主体：金鹰稳健成长股票型证券投资基金

本报告期：（2010年4月14日至2010年12月31日）

单位：人民币元

项 目	本期 (2010 年 4 月 14 日至 2010 年 12 月 31 日)		上年度可比期间 (至)
<b>一、收入</b>	70,926,848.35		-
1. 利息收入	1,046,859.15		-
其中：存款利息收入	1,046,859.15		-
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）	61,601,967.49		-
其中：股票投资收益	60,921,683.96		-
基金投资收益	-		-
债券投资收益	-		-
资产支持证券投资收益	-		-
衍生工具收益	-		-
股利收益	680,283.53		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7,445,290.53		-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	832,731.18		-
<b>减：二、费用</b>	11,196,604.58		-
1. 管理人报酬	4,368,922.99		-
2. 托管费	728,153.80		-
3. 销售服务费	-		-
4. 交易费用	5,827,001.33		-
5. 利息支出	-		-
其中：卖出回购金融资产支出	-		-
6. 其他费用	272,526.46		-
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	59,730,243.77		-
减：所得税费用	-		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	59,730,243.77		-

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金鹰稳健成长股票型证券投资基金

本报告期：（2010 年 4 月 14 日至 2010 年 12 月 31 日）

单位：人民币元

项目	本期 (2010 年 4 月 14 日至 2010 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）	649,268,728.62	0	649,268,728.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0	59,730,243.77	59,730,243.77
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”	-246,858,433.34	23,349,063.71	-223,509,369.63

号填列)			
其中：1. 基金申购款	392,208,639.29	50,459,041.45	442,667,680.74
2. 基金赎回款	-639,067,072.63	-27,109,977.74	-666,177,050.37
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）	0	-54,405,680.70	-54,405,680.70
五、期末所有者权益（基金净值）	402,410,295.28	28,673,626.78	431,083,922.06
项目	上年度可比期间 (至)		
	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）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-	-
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	-	-	-

注：本基金基金合同于 2010 年 4 月 14 日正式生效，基金成立不足一年。为此，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 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：殷克胜      主管会计工作负责人：殷克胜      会计机构负责人：傅军

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 关联方关系

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
广州药业股份有限公司	基金管理人股东
四川南方希望实业有限公司	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
广东美的电器股份有限公司	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
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

注：经金鹰基金管理有限公司（简称“公司”）股东会会议审议通过，并经中国证券监督管理委员会证监许可[2010]1584 号文审核批准，公司原股东四川南方希

望实业有限公司将其持有的公司 20% 股权中的 9% 和 11% 分别转让给广州证券有限责任公司和东亚联丰投资管理有限公司。本次股权变更事项已于 2010 年 12 月 13 日在证监会规定的报纸予以披露。

#### 7.4.2 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.2.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.2.1.1 股票交易

本基金报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 7.4.2.1.2 权证交易

本基金报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.2.1.3 债券交易

本基金报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 7.4.2.1.4 债券回购交易

本基金报告期内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 7.4.2.1.5 应支付关联方的佣金

本基金报告期内没有应支付关联方的佣金。

##### 7.4.2.2 关联方报酬

###### 7.4.2.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2010 年 4 月 14 日至 2010 年 12 月 31 日）
当期发生的基金应支付的管理费	4,368,922.99
其中：应支付给销售机构的客户维护费	943,110.82

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托



管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

#### 7.4.2.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期(2010年4月14日至 2010年12月31日)	上年度可比期间 (至)
当期发生的基金应支付的托管费	728,153.80	-

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

#### 7.4.2.2.3 销售服务费

本基金报告期内没有应支付关联方的销售服务费。

#### 7.4.2.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金报告期内未通过关联方交易单元进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.2.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.2.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

##### 7.4.2.4.2 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

报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 7.4.2.5 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(2010年4月14日至2010年12月31日)
-------	----------------------------

	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	45,071,439.99	1,026,431.62

注：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，2010 年度期末余额 2,692,796.98 元，清算备付金利息收入 20,427.53 元。

#### 7.4.2.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在承销期内未参与关联方承销证券。

#### 7.4.2.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内本基金无其他关联交易事项。

#### 7.4.3 期末（2010 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.3.1 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。

##### 7.4.3.2 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	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000903	云内动力	2010 年 12 月 8 日	涉及股权转让的重大事项	17.60	2011 年 1 月 7 日	18.80	250,000.00	3,692,110.78	4,400,000.00	-

注：政府与中国兵器装备集团公司就云南内燃机厂与中国兵器装备集团公司产权合作的可行性进行初期的接触和探讨，处于前期商谈阶段，双方尚未就上述合作事宜达成任何合作意向或协议，云内动力申请自 2010 年 12 月 8 日停牌，于 2011 年 1 月 7 日复牌。

##### 7.4.3.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.3.3.1 银行间市场债券正回购

本基金报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.3.3.2 交易所市场债券正回购

本基金报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### § 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	381,284,299.64	86.89
	其中：股票	381,284,299.64	86.89
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	47,764,236.97	10.88
6	其他各项资产	9,785,420.52	2.23
7	合计	438,833,957.13	100.00

#### 8.2 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	5,753,541.63	1.33
B	采掘业	33,030,478.00	7.66
C	制造业	223,625,276.98	51.88
C0	食品、饮料	13,997,351.53	3.25
C1	纺织、服装、皮毛	19,279,448.09	4.47
C2	木材、家具	0.00	0.00
C3	造纸、印刷	0.00	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	41,070,214.80	9.53
C5	电子	32,217,049.19	7.47
C6	金属、非金属	17,953,571.45	4.16
C7	机械、设备、仪表	86,186,141.92	19.99
C8	医药、生物制品	12,921,500.00	3.00
C99	其他制造业	0.00	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	19,159,298.84	4.44
E	建筑业	0.00	0.00
F	交通运输、仓储业	10,449,000.00	2.42
G	信息技术业	38,060,383.96	8.83
H	批发和零售贸易	23,768,262.23	5.51

I	金融、保险业	6,761,664.00	1.57
J	房地产业	8,456,694.00	1.96
K	社会服务业	0.00	0.00
L	传播与文化产业	0.00	0.00
M	综合类	12,219,700.00	2.83
	合计	381,284,299.64	88.45

### 8.3 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	889,549	24,845,103.57	5.76
2	600468	百利电气	598,367	21,517,277.32	4.99
3	600694	大商股份	339,957	16,110,562.23	3.74
4	600378	天科股份	800,000	13,760,000.00	3.19
5	600123	兰花科创	270,100	12,716,308.00	2.95
6	002148	北纬通信	276,561	12,381,635.97	2.87
7	000540	中天城投	890,000	12,219,700.00	2.83
8	600439	瑞贝卡	923,501	12,088,628.09	2.80
9	002452	长高集团	367,300	10,919,829.00	2.53
10	600038	哈飞股份	379,975	10,821,688.00	2.51

### 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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600000	浦发银行	84,593,458.27	19.62
2	601166	兴业银行	77,927,723.18	18.08
3	601288	农业银行	52,410,000.00	12.16
4	600468	百利电气	39,961,395.23	9.27
5	600068	葛洲坝	39,466,946.89	9.16
6	002129	中环股份	39,134,314.33	9.08
7	600378	天科股份	39,064,664.55	9.06
8	600036	招商银行	35,818,445.10	8.31
9	600268	国电南自	34,197,087.22	7.93
10	600038	哈飞股份	29,342,375.99	6.81
11	000969	安泰科技	28,403,416.63	6.59
12	600056	中国医药	27,116,007.96	6.29
13	600694	大商股份	25,993,762.85	6.03
14	600226	升华拜克	24,396,748.78	5.66
15	600221	海南航空	23,901,095.24	5.54
16	002094	青岛金王	22,143,318.48	5.14
17	600710	常林股份	22,030,897.76	5.11
18	600995	文山电力	21,537,847.69	5.00

19	000937	冀中能源	21,071,690.05	4.89
20	601111	中国国航	20,361,762.41	4.72
21	600739	辽宁成大	20,186,022.34	4.68
22	601318	中国平安	20,064,856.00	4.65
23	000002	万科A	19,302,821.83	4.48
24	600594	益佰制药	19,140,437.08	4.44
25	601299	中国北车	18,580,419.10	4.31
26	601628	中国人寿	18,550,687.72	4.30
27	600879	航天电子	18,208,619.40	4.22
28	002320	海峡股份	17,491,773.47	4.06
29	002036	宜科科技	17,286,403.17	4.01
30	600312	平高电气	17,065,614.61	3.96
31	600812	华北制药	16,713,972.85	3.88
32	002220	天宝股份	16,207,474.47	3.76
33	000903	云内动力	16,094,376.62	3.73
34	600107	美尔雅	15,003,288.42	3.48
35	600439	瑞贝卡	14,440,949.02	3.35
36	002148	北纬通信	14,291,437.49	3.32
37	000778	新兴铸管	14,225,583.25	3.30
38	000933	神火股份	13,964,088.61	3.24
39	600517	置信电气	13,823,039.90	3.21
40	002498	汉缆股份	13,586,969.80	3.15
41	600967	北方创业	13,446,825.14	3.12
42	601328	交通银行	13,436,990.00	3.12
43	600422	昆明制药	13,203,975.94	3.06
44	600894	广钢股份	13,041,424.43	3.03
45	002053	云南盐化	12,807,854.94	2.97
46	000540	中天城投	12,664,848.88	2.94
47	601939	建设银行	12,617,120.00	2.93
48	000039	中集集团	12,433,586.23	2.88
49	601158	重庆水务	12,395,263.79	2.88
50	002109	兴化股份	12,261,828.91	2.84
51	600123	兰花科创	12,141,872.50	2.82
52	601998	中信银行	12,130,860.24	2.81
53	600089	特变电工	12,120,113.15	2.81
54	000602	金马集团	11,710,149.80	2.72
55	600713	南京医药	11,659,410.76	2.70
56	600062	双鹤药业	11,406,227.92	2.65
57	600362	江西铜业	11,185,288.11	2.59
58	600380	健康元	11,092,867.75	2.57
59	601666	平煤股份	11,086,518.05	2.57
60	000157	中联重科	11,086,490.00	2.57
61	000635	英力特	11,021,507.01	2.56
62	000060	中金岭南	10,741,869.96	2.49
63	000565	渝三峡A	10,690,089.34	2.48
64	600361	华联综超	10,605,459.86	2.46
65	002452	长高集团	10,602,316.26	2.46
66	000063	中兴通讯	10,577,802.24	2.45

67	600208	新湖中宝	10,510,052.42	2.44
68	600216	浙江医药	10,407,514.00	2.41
69	000001	深发展A	10,158,451.53	2.36
70	000426	富龙热电	10,027,676.70	2.33
71	002007	华兰生物	10,002,748.35	2.32
72	000858	五粮液	9,917,909.87	2.30
73	000050	深天马A	9,894,110.00	2.30
74	002233	塔牌集团	9,733,104.66	2.26
75	002001	新和成	9,707,273.36	2.25
76	601179	中国西电	9,674,456.18	2.24
77	000928	中钢吉炭	9,603,169.78	2.23
78	002392	北京利尔	9,551,665.56	2.22
79	000551	创元科技	9,503,094.04	2.20
80	600888	新疆众和	9,479,104.24	2.20
81	002315	焦点科技	9,270,181.64	2.15
82	600176	中国玻纤	9,258,880.53	2.15
83	002168	深圳惠程	9,227,520.82	2.14
84	000503	海虹控股	8,997,283.59	2.09
85	600267	海正药业	8,982,970.20	2.08
86	600395	盘江股份	8,953,599.56	2.08
87	002179	中航光电	8,836,278.13	2.05
88	600580	卧龙电气	8,816,621.13	2.05
89	000917	电广传媒	8,655,046.73	2.01

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600000	浦发银行	83,064,663.24	19.27
2	601166	兴业银行	77,298,807.67	17.93
3	601288	农业银行	52,090,000.00	12.08
4	600068	葛洲坝	39,842,704.56	9.24
5	600036	招商银行	34,649,084.53	8.04
6	600378	天科股份	32,154,786.82	7.46
7	600268	国电南自	29,284,765.33	6.79
8	000969	安泰科技	28,576,612.56	6.63
9	002129	中环股份	27,185,097.08	6.31
10	600468	百利电气	25,451,184.15	5.90
11	002094	青岛金王	24,988,795.88	5.80
12	600056	中国医药	24,282,101.44	5.63
13	600710	常林股份	23,749,925.23	5.51
14	600594	益佰制药	22,974,328.56	5.33
15	601111	中国国航	21,484,758.76	4.98
16	600879	航天电子	20,633,141.15	4.79
17	600739	辽宁成大	20,358,447.26	4.72
18	000002	万科A	20,114,322.51	4.67
19	601628	中国人寿	19,654,874.57	4.56

20	600812	华北制药	18,424,921.20	4.27
21	600312	平高电气	18,398,833.27	4.27
22	601299	中国北车	18,304,180.00	4.25
23	600038	哈飞股份	18,118,136.99	4.20
24	600221	海南航空	17,456,292.02	4.05
25	002220	天宝股份	17,147,540.32	3.98
26	002036	宜科科技	17,110,837.46	3.97
27	002320	海峡股份	17,010,242.53	3.95
28	600226	升华拜克	15,866,364.06	3.68
29	002498	汉缆股份	14,830,317.12	3.44
30	600517	置信电气	14,822,880.34	3.44
31	600967	北方创业	14,341,626.84	3.33
32	000039	中集集团	13,902,712.58	3.23
33	002168	深圳惠程	13,887,578.44	3.22
34	601328	交通银行	13,722,298.80	3.18
35	000937	冀中能源	13,509,970.81	3.13
36	000778	新兴铸管	13,357,396.58	3.10
37	600422	昆明制药	13,303,715.26	3.09
38	600362	江西铜业	13,244,872.42	3.07
39	601318	中国平安	13,244,771.68	3.07
40	000903	云内动力	13,062,083.30	3.03
41	601158	重庆水务	13,051,980.02	3.03
42	600089	特变电工	12,766,321.44	2.96
43	600995	文山电力	12,741,859.02	2.96
44	000933	神火股份	12,491,122.58	2.90
45	000602	金马集团	12,461,923.26	2.89
46	601939	建设银行	12,368,191.00	2.87
47	600713	南京医药	11,850,692.11	2.75
48	000050	深天马A	11,725,989.00	2.72
49	000426	富龙热电	11,616,077.07	2.69
50	000063	中兴通讯	11,562,442.35	2.68
51	601998	中信银行	11,462,164.80	2.66
52	600216	浙江医药	11,442,089.93	2.65
53	600380	健康元	10,980,186.69	2.55
54	601666	平煤股份	10,979,735.36	2.55
55	000001	深发展A	10,603,734.34	2.46
56	000858	五粮液	10,462,217.44	2.43
57	000565	渝三峡A	10,395,964.93	2.41
58	000060	中金岭南	10,370,312.84	2.41
59	002233	塔牌集团	10,314,917.56	2.39
60	002007	华兰生物	10,314,881.60	2.39
61	000917	电广传媒	10,210,835.39	2.37
62	600303	曙光股份	10,142,879.08	2.35
63	600267	海正药业	9,891,843.55	2.29
64	600894	广钢股份	9,727,857.78	2.26
65	601179	中国西电	9,707,495.29	2.25
66	600815	厦工股份	9,659,586.22	2.24
67	002008	大族激光	9,631,293.20	2.23

68	000928	中钢吉炭	9,430,761.15	2.19
69	600176	中国玻纤	9,429,976.91	2.19
70	000503	海虹控股	9,341,749.61	2.17
71	002298	鑫龙电器	9,276,195.20	2.15
72	600169	太原重工	8,909,084.63	2.07
73	002337	赛象科技	8,857,644.29	2.05
74	000713	丰乐种业	8,811,931.72	2.04

注：累计卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列。

#### 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	2,206,834,272.10
卖出股票的收入（成交）总额	1,893,916,946.95

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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投资。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 8.7 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。

#### 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

本基金本报告期末未持有权证投资。

#### 8.9 投资组合报告附注

##### 8.9.1 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

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。

##### 8.9.2 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。



**8.9.3 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	1,250,000.00
2	应收证券清算款	575,863.97
3	应收股利	-
4	应收利息	11,802.55
5	应收申购款	7,947,754.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,785,420.52

**8.9.4 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。

**8.9.5 期末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	000540	中天城投	12,219,700.00	2.83	召开临时股东大会，停牌一天。
2	600226	升华拜克	8,648,000.00	2.01	召开临时股东大会，停牌一天。
3	000903	云内动力	4,400,000.00	1.02	涉及股权转让的重大事项，于2010年12月8日起连续停牌，于2011年1月7日复牌。

**§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

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(%)
8,293	48,524.09	77,878,456.74	19.35	324,531,838.54	80.65

**9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况**

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	1,348,226.99	0.34

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年4月14日）基金份额总额	649,268,728.62
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	392,208,639.29
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	639,067,072.63
本报告期期末基金份额总额	402,410,295.28

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 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

#### 11.2.1 基金管理人重大人事变动

金鹰基金管理有限公司（以下称公司）公司原董事长梁伟文先生、原总经理詹松茂先生因工作调动原因，经公司第三届董事会第十六次会议审议通过，免去其分别担任的董事长职务及总经理职务。经同次董事会审议通过，刘东先生当选为公司董事长，并聘任殷克胜先生担任公司总经理。刘东先生、殷克胜先生基金行业高级管理人员任职资格已经中国证券监督管理委员会证监许可【2010】420号文核准。本次高管变更已按规定向相关监管机关备案并于2010年4月19日在证监会规定的报纸予以披露。

经公司2010年第三届董事会第十九次会议审议通过，并经中国证券监督管理委员会证监许可【2010】1336号文核准，决定聘任郭容辰女士担任公司副总经理。本次变更事宜已按规定向相关监管机关备案，并于2010年10月20日在证监会规定的报纸予以披露。

#### 11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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、基金托管业务的诉讼。

### 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

为本基金进行审计的会计师事务所为立信羊城会计师事务所，从 2005 年到本报告期末已连续 5 年为本基金从事审计业务，本报告期内支付该会计师事务所审计费 40,000.00 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。

### 11.7 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		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 (%)	
五矿证券	2	1,140,006,586.91	27.81	964,843.49	30.64	
齐鲁证券	1	628,042,792.85	15.32	510,288.46	16.20	
长城证券	2	615,593,365.56	15.01	392,840.81	12.48	
东莞证券	1	404,155,007.14	9.86	247,546.21	7.86	
西南证券	1	374,944,493.86	9.14	243,713.08	7.74	
方正证券	1	306,776,668.64	7.48	260,759.30	8.28	
民生证券	2	256,064,618.80	6.25	216,910.24	6.89	
安信证券	1	215,899,129.01	5.27	183,514.12	5.83	
东方证券	1	158,191,776.28	3.86	128,533.77	4.08	
东兴证券	1	0.00	0	0.00	0	
长江证券	1	0.00	0	0.00	0	
国信证券	1	0.00	0	0.00	0	
合计	15	4,099,674,439.05	100.00	3,148,949.48	100.00	

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、个股分析报告及丰富全面的信息服务；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。

### § 12 影响投资者决策的其他重要信息

经金鹰基金管理有限公司（简称“公司”）股东会会议审议通过，并经中国证券监督管理委员会证监许可[2010]1584号文审核批准，公司原股东四川南方希望实业有限公司将其持有的公司20%股权中的9%和11%分别转让给广州证券有限责任公司和东亚联丰投资管理有限公司。本次股权转让后，公司股权结构变更为：广州证券有限责任公司49%，广州药业股份有限公司20%，广东美的电器股份有限公司20%，东亚联丰投资管理有限公司11%。中国商务部已向公司颁发了《中华人民共和国台港澳侨投资企业批准证书》（商外资资审A字【2010】0016号），目前本次股权转让事项的相关变更登记手续已办理完毕。本次股权变更事项已于2010年12月13日在证监会规定的报纸予以披露。

金鹰基金管理有限公司

2011年3月28日