

金鹰红利价值灵活配置混合型

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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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。

本报告期为 2010 年 1 月 1 日起至 2010 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	金鹰红利价值混合
基金主代码	210002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 12 月 4 日
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
报告期末基金份额总额	128,960,277.40 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对分红能力良好且长期投资价值突出的优质股票投资，为基金资产获取稳定的当期收益和长期增值。
投资策略	本基金采取积极主动式投资管理，通过积极的资产配置策略，深入研究、调研基础上的主动性证券选择和市场时机选择，在合理控制投资风险的前提下，最大限度地获取投资收益。本基金主要投资于分红能力良好且长期价值突出的优质企业，股票资产占基金资产净值比例为 30%—80%；现金、债券资产、其他资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产净值的比例为 20%—70%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；权证投资占基金资产净值的比例不超过 3%。
业绩比较基	富时中国 A 股红利 150 指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。

准	
风险收益特征	本基金风险收益特征从长期来看,其风险与预期收益高于债券型基金,低于股票型基金。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	苏文锋	张咏东
	联系电话	020-83282627	021-32169999
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	zhangyd@bankcomm.com
客户服务电话		020-83936180 4006135888	95559
传真		020-83282856	021-62701216

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	http://www.gefund.com.cn
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 楼

§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	2009 年	2008 年
本期已实现收益	25,705,430.38	93,233,278.77	-168,854.73
本期利润	14,267,699.79	110,006,717.80	-168,854.73
加权平均基金份额本期利润	0.0922	0.3665	-0.0005
本期基金份额净值增长率 (%)	8.93	48.77	-0.05
3.1.2 期末数据和指标	2010 年末	2009 年末	2008 年末
期末可供分配基金份额利润	0.1991	0.1717	-0.0005
期末基金资产净值	154,630,205.44	224,263,804.03	366,849,692.66
期末基金份额净值	1.1991	1.2002	0.9995

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、所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

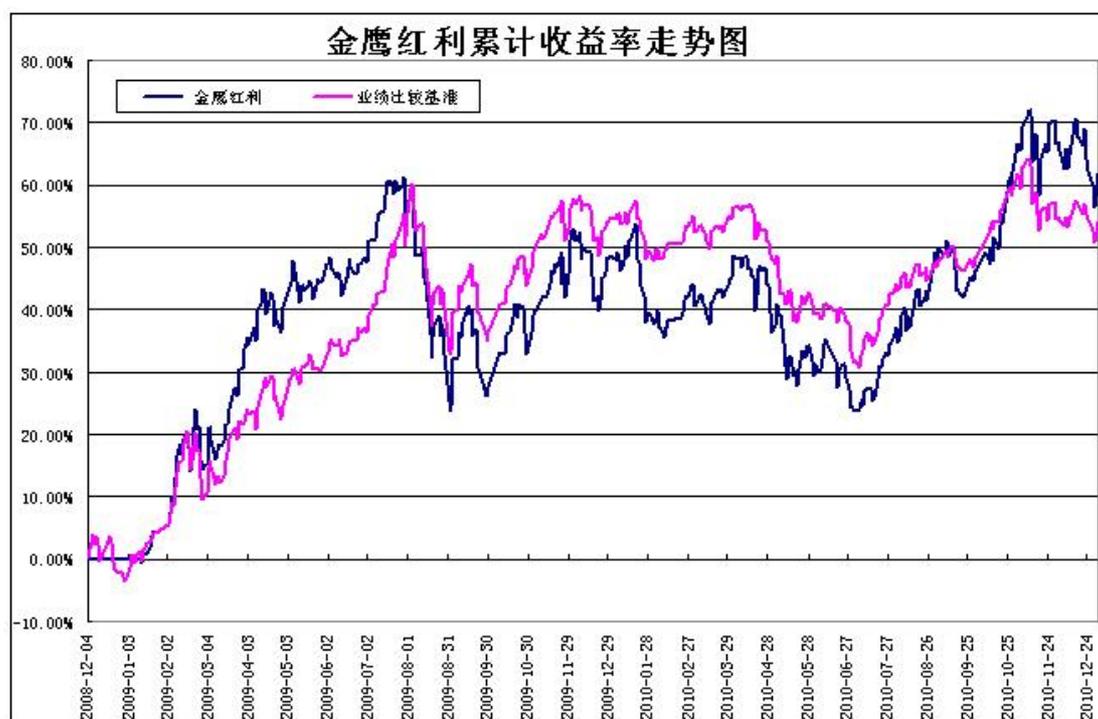
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	10.71	1.68	3.73	1.02	6.98	0.66

月						
过去六个月	30.34	1.44	16.43	0.91	13.91	0.53
过去一年	8.93	1.42	-0.53	0.93	9.46	0.49
自基金合同生效起至今	61.97	1.52	54.05	1.19	7.92	0.33

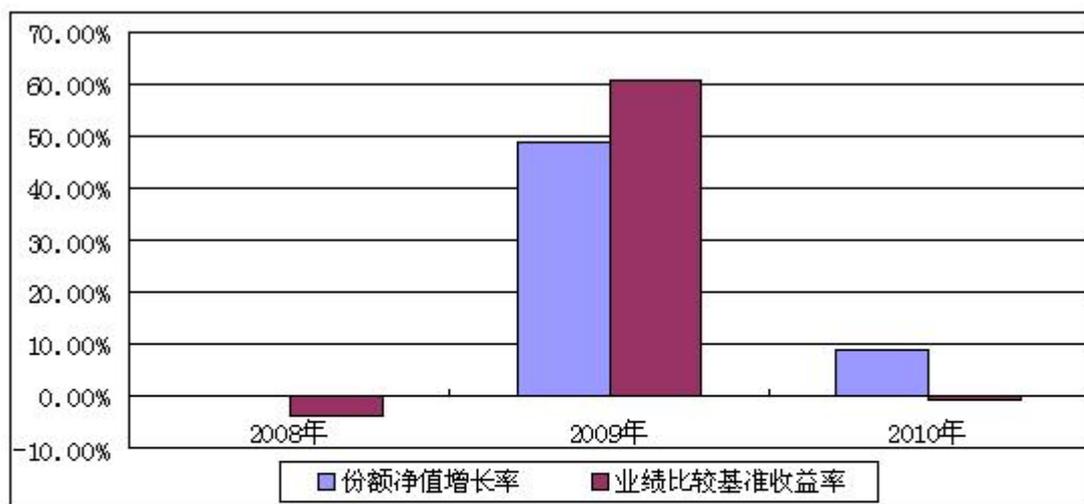
注：本基金成立不足三年。本基金的业绩比较基准为：“富时中国 A 股红利 150 指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%”。

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、本基金合同于 2008 年 12 月 4 日正式生效；2、截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同规定的各项比例，股票资产占基金资产比例为 30%—80%；现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 20%—70%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；权证投资占基金资产净值的比例不超过 3%。3、本基金的业绩比较基准为：“富时中国 A 股红利 150 指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%”。

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



注：本基金成立不足三年。本基金的业绩比较基准为：“富时中国 A 股红利 150 指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%”。

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	1.000	8,959,560.71	5,951,225.30	14,910,786.01	
2009	2.880	41,226,589.06	23,599,386.83	64,825,975.89	
合计	3.880	50,186,149.77	29,550,612.13	79,736,761.90	

§ 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、集中交易部、研究发展部、金融工程部、产品研发部、固定收益投资部、专户投资部、市场拓展部、机构客户部、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；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）期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
蔡飞鸣	投资决策委员会委员、基金	2009 年 7 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

	经理				任金鹰稳健成长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、《金鹰红利价值灵活配置混合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施监控，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混合型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，金鹰主题优势股票型证券投资基金是主动型股票投资基金，以各种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

今年上半年本基金运作积极，主要参与了中小市值成长股的投资。进入四月份，在国家出台系列房地产调控政策、以及欧洲主权债务危机的影响下，市场破位下行，系统性风险释放。本基金逐步降低仓位、调整持仓结构以规避风险。在市场探明 2319 点的底部之后，中小市值成长股继续活跃，医药、消费、新兴产业、周期类品种亦此起彼伏，市场机会再次浮现。本基金抓住市场逐步好转的时机，积极配置相关热点板块，动态调整持仓结构，至年终获得了一定的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2010 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.1991，报告期内份额净值增长率为 8.93%，同期业绩比较基准增长率为-0.53%。

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，国内外的经济、政策局势更加扑朔迷离，不确定性更为明显。A 股市场两大结构性阵营面临着不同的窘况：有安全边际的强周期板块（如金融、地产、有色、煤炭、钢铁等）缺乏资金的认同；有人气的非周期板块（如医药、消费、新兴产业等）缺乏持续上涨的空间。市场中确定的持续性投资机会并不明显。除了继续加强对具备穿越性的真正高成长公司的发掘外，本基金将在严格控制风险的前提下，继续坚持灵活应对的策略，密切关注市场中可能出现的阶段性的交易机会，争取获得较好的投资回报。

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,本公司成立了资产估值委员会。资产估值委员会由公司总经理、分管副总经理或总经理助理、研究发展部总监、运作保障部总监、投资管理部总监、基金经理、基金会计和相关人员组成。基金经理可以发表相关意见和建议,如估值委员会表决时,其仅有一票表决权,遵从少数服从多数的原则。

报告期内,本公司对长期停牌的股票依据相关规定采用行业内通用的公允价值估值方法进行估值。

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

报告期内,本基金派发红利一次,登记日 2010 年 9 月 15 日,共派发红利 14,910,786.01 元,其中现金红利 8,959,560.71 元,红利再投资 5,951,225.30 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 年度,基金托管人在金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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 年度，金鹰基金管理有限公司在金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金进行了 1 次收益分配，分配金额为 14,910,786.01 元，符合基金合同的规定。

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

2010 年度，由金鹰基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金

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 (2009 年 12 月 31 日)
资 产：		
银行存款	10,408,745.21	1,921,507.41
结算备付金	22,489,723.86	45,783,470.41
存出保证金	1,250,000.00	1,627,335.99
交易性金融资产	122,317,680.98	177,227,777.45
其中：股票投资	122,317,680.98	177,227,777.45
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	3,964,494.19	2,653,317.29
应收利息	13,301.15	19,749.56
应收股利	-	-
应收申购款	240,650.51	107,694.73
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	0.00
资产总计	160,684,595.90	229,340,852.84
负债和所有者权益	本期末 (2010 年 12 月 31 日)	上年度末 (2009 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	-	-
应付证券清算款	3,651,929.15	1,779,806.31
应付赎回款	460,110.93	1,104,345.33
应付管理人报酬	200,836.67	300,683.81
应付托管费	33,472.77	50,113.97
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	830,581.05	1,214,711.59
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	877,459.89	627,387.80
负债合计	6,054,390.46	5,077,048.81
所有者权益:		
实收基金	128,960,277.40	186,849,702.61
未分配利润	25,669,928.04	37,414,101.42
所有者权益合计	154,630,205.44	224,263,804.03
负债和所有者权益总计	160,684,595.90	229,340,852.84

注：报告截止日 2010 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1991 元，基金份额总额 128,960,277.40 份。

7.2 利润表

会计主体：金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：（2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日）

单位：人民币元

项 目	本期 (2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日)	上年度可比期间 (2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日)
一、收入	23,359,315.86	132,504,843.84
1. 利息收入	583,162.98	1,281,670.20
其中：存款利息收入	583,162.98	1,281,670.20
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）	34,053,704.45	112,042,374.74
其中：股票投资收益	33,716,719.99	110,043,788.03
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	336,984.46	1,998,586.71

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-11,437,730.59	16,773,439.03
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	160,179.02	2,407,359.87
减：二、费用	9,091,616.07	22,498,126.04
1. 管理人报酬	2,644,948.45	5,626,635.66
2. 托管费	440,824.80	937,772.63
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	5,627,701.22	15,550,351.57
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	378,141.60	383,366.18
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	14,267,699.79	110,006,717.80
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	14,267,699.79	110,006,717.80

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：（2010年1月1日至2010年12月31日）

单位：人民币元

项目	本期 (2010年1月1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）	186,849,702.61	37,414,101.42	224,263,804.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,267,699.79	14,267,699.79
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）	-57,889,425.21	-11,101,087.16	-68,990,512.37
其中：1. 基金申购款	50,408,575.95	8,736,258.58	59,144,834.53
2. 基金赎回款	-108,298,001.16	-19,837,345.74	-128,135,346.90
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）	-	-14,910,786.01	-14,910,786.01
五、期末所有者权益（基金净值）	128,960,277.40	25,669,928.04	154,630,205.44
项目	上年度可比期间 (2009年1月1日至2009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）	367,018,547.39	-168,854.73	366,849,692.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	110,006,717.80	110,006,717.80
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）	-180,168,844.78	-7,597,785.76	-187,766,630.54

少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	1,338,767,764.73	399,322,273.68	1,738,090,038.41
2. 基金赎回款	-1,518,936,609.51	-406,920,059.44	-1,925,856,668.95
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)	-	-64,825,975.89	-64,825,975.89
五、期末所有者权益(基金净值)	186,849,702.61	37,414,101.42	224,263,804.03

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：

基金管理公司负责人：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(2010年12月13日之前)
东亚联丰投资管理有限公司	基金管理人股东(2010年12月13日之后)
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
交通银行股份有限公司	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

本基金本报告期及上年度可比期间均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

本基金本报告期及上年度可比期间均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

本基金本报告期及上年度可比期间均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

本基金本报告期及上年度可比期间均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

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付给关联方的佣金。

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1月1日至2010年12月31日)	上年度可比期间(2009年1月1日至2009年12月31日)
当期发生的基金应支付的管理费	2,644,948.45	5,626,635.66
其中:应支付给销售机构的客户维护费	606,985.15	1,181,354.84

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：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

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；由基金管理人向基金托管人发送基金管理人报酬划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇节假日、休息日等，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1月1日至2010年12月31日)	上年度可比期间(2009年1月1日至2009年12月31日)
当期发生的基金应支付的托管费	440,824.80	937,772.63

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：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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；由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内，从基金资产中一次性支付，若遇节假日、休息日等，支付日期顺延。

7.4.2.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付给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

本基金本报告期及上年度可比期间均无与关联方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**

本基金报告期内及上年度可比期间均没有基金管理人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

份额单位：份

关联方名称	本期末 (2010年12月31日)		上年度末 (2009年12月31日)	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例(%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例(%)
广州证券	0.00	0.00	4,332,270.24	2.32

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1月1日至2010年12月31日)		上年度可比期间(2009年1月1日至2009年12月31日)	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	10,408,745.21	37,503.11	1,921,507.41	1,281,670.20

注：本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，在资产负债表中“结算备付金”科目中单独列示，按银行同业利率计息。结算备付金2010年末余额 22,489,723.86 元，当期结算备付金利息收入 545,651.56 元；结算备付金2009年末余额为 45,783,470.41 元，当期结算备付金利息收入为 1,033,197.53 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

本基金报告期及上年度可比期间内均没有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

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**

本基金报告期末未持有因认购新发/增发证券而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
002131	利欧股份	2010 年 10 月 18 日	筹划 资产 重组 重大 事项	17.33	2011 年 2 月 16 日	17.93	344,000	4,799,872.12	5,961,520.00	-

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

本基金报告期期末无银行间市场债券正回购。

7.4.3.3.2 交易所市场债券正回购

本基金报告期期末无交易所市场债券正回购。

§ 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	122,317,680.98	76.12
	其中：股票	122,317,680.98	76.12
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	32,898,469.07	20.47
6	其他各项资产	5,468,445.85	3.40
7	合计	160,684,595.90	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。

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	-	-
B	采掘业	9,063,882.00	5.86
C	制造业	87,217,810.99	56.40
C0	食品、饮料	5,406,380.00	3.50
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	5,293,107.00	3.42
C5	电子	3,895,592.61	2.52
C6	金属、非金属	20,213,302.00	13.07
C7	机械、设备、仪表	52,409,429.38	33.89
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,989,433.60	4.52
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	6,878,139.00	4.45
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	8,385,213.10	5.42
K	社会服务业	3,783,202.29	2.45
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	122,317,680.98	79.10

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	600362	江西铜业	240,800	10,876,936.00	7.03
2	002480	新筑股份	146,100	10,080,900.00	6.52
3	000528	柳 工	257,848	9,540,376.00	6.17
4	600031	三一重工	436,500	9,441,495.00	6.11
5	000157	中联重科	656,900	9,288,566.00	6.01
6	600048	保利地产	660,253	8,385,213.10	5.42
7	002131	利欧股份	344,000	5,961,520.00	3.86
8	000972	新 中 基	370,300	5,406,380.00	3.50
9	300048	合康变频	87,646	5,305,212.38	3.43
10	600585	海螺水泥	162,700	4,828,936.00	3.12

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	600048	保利地产	52,576,500.57	23.44
2	600000	浦发银行	51,994,459.77	23.18
3	601888	中国国旅	48,849,568.98	21.78
4	600068	葛洲坝	42,807,934.77	19.09
5	600036	招商银行	42,246,373.56	18.84
6	000671	阳光城	40,901,740.56	18.24
7	002008	大族激光	34,137,817.22	15.22
8	000157	中联重科	32,570,892.25	14.52
9	002326	永太科技	26,775,745.43	11.94
10	000983	西山煤电	26,016,263.03	11.60
11	600581	八一钢铁	25,234,600.63	11.25
12	600720	祁连山	23,075,279.13	10.29
13	600884	杉杉股份	22,296,073.53	9.94
14	600423	柳化股份	21,719,199.80	9.68
15	601601	中国太保	20,198,638.17	9.01
16	000060	中金岭南	20,092,443.62	8.96
17	600031	三一重工	19,523,082.34	8.71
18	600809	山西汾酒	18,657,749.84	8.32
19	002129	中环股份	18,544,874.74	8.27
20	002273	水晶光电	18,112,605.60	8.08
21	000903	云内动力	18,033,320.27	8.04
22	600015	华夏银行	17,932,185.93	8.00
23	002351	漫步者	17,452,556.25	7.78
24	002163	中航三鑫	17,025,126.15	7.59
25	600812	华北制药	16,966,561.83	7.57
26	002104	恒宝股份	16,705,867.20	7.45
27	600468	百利电气	16,351,647.85	7.29
28	002375	亚厦股份	16,113,546.21	7.19
29	000501	鄂武商A	16,075,317.67	7.17
30	002139	拓邦股份	15,434,464.84	6.88
31	002142	宁波银行	15,393,808.28	6.86
32	601998	中信银行	15,144,863.23	6.75
33	600739	辽宁成大	15,096,275.47	6.73
34	600378	天科股份	14,977,504.22	6.68
35	600622	嘉宝集团	14,827,670.28	6.61
36	002261	拓维信息	14,752,079.50	6.58
37	000528	柳工	14,505,152.36	6.47
38	600388	龙净环保	14,112,298.33	6.29
39	600362	江西铜业	14,101,513.38	6.29
40	600491	龙元建设	13,651,109.38	6.09
41	000962	东方钨业	13,464,141.63	6.00
42	600115	东方航空	13,350,440.81	5.95
43	002157	正邦科技	12,948,907.23	5.77
44	601169	北京银行	12,927,197.10	5.76

45	600176	中国玻纤	12,461,744.85	5.56
46	000829	天音控股	12,051,831.26	5.37
47	000861	海印股份	11,714,030.25	5.22
48	000055	方大集团	11,519,541.88	5.14
49	002421	达实智能	11,396,010.33	5.08
50	000713	丰乐种业	11,299,422.39	5.04
51	000636	风华高科	11,237,964.96	5.01
52	002093	国脉科技	10,851,634.34	4.84
53	000969	安泰科技	10,610,070.41	4.73
54	000898	鞍钢股份	10,437,547.93	4.65
55	600583	海油工程	10,403,057.49	4.64
56	002413	常发股份	10,056,072.46	4.48
57	601699	潞安环能	9,994,222.20	4.46
58	600037	歌华有线	9,839,574.76	4.39
59	600354	敦煌种业	9,833,775.99	4.38
60	000917	电广传媒	9,641,099.42	4.30
61	002297	博云新材	9,601,139.68	4.28
62	002080	中材科技	9,585,567.77	4.27
63	600875	东方电气	9,196,519.50	4.10
64	000061	农产品	9,137,533.80	4.07
65	002480	新筑股份	9,098,693.68	4.06
66	600549	厦门钨业	8,994,018.30	4.01
67	002131	利欧股份	8,959,875.98	4.00
68	600268	国电南自	8,891,198.85	3.96
69	600428	中远航运	8,753,420.84	3.90
70	600595	中孚实业	8,536,204.78	3.81
71	601318	中国平安	8,509,086.52	3.79
72	600271	航天信息	8,318,870.20	3.71
73	002038	双鹭药业	8,097,953.78	3.61
74	600879	航天电子	8,000,453.56	3.57
75	600718	东软集团	7,963,578.40	3.55
76	002161	远望谷	7,955,598.80	3.55
77	000024	招商地产	7,737,414.21	3.45
78	000837	秦川发展	7,735,691.54	3.45
79	601288	农业银行	7,519,020.00	3.35
80	600439	瑞贝卡	7,516,311.98	3.35
81	600226	升华拜克	7,435,208.50	3.32
82	600830	香溢融通	7,413,159.31	3.31
83	600050	中国联通	7,400,287.56	3.30
84	600285	羚锐制药	7,356,284.66	3.28
85	002067	景兴纸业	7,319,366.23	3.26
86	601666	平煤股份	7,240,648.60	3.23
87	601939	建设银行	7,214,045.37	3.22
88	600760	东安黑豹	7,188,090.86	3.21
89	601268	二重重装	7,124,459.99	3.18
90	600361	华联综超	6,986,492.86	3.12
91	002168	深圳惠程	6,871,604.16	3.06
92	600380	健康元	6,832,219.50	3.05

93	002482	广田股份	6,729,847.11	3.00
94	000800	一汽轿车	6,654,423.00	2.97
95	600508	上海能源	6,512,659.94	2.90
96	002488	金固股份	6,140,757.62	2.74
97	600481	双良节能	5,913,624.91	2.64
98	600331	宏达股份	5,909,501.99	2.64
99	000862	银星能源	5,889,307.32	2.63
100	002469	三维工程	5,691,293.97	2.54
101	601857	中国石油	5,653,824.11	2.52
102	600330	天通股份	5,640,247.22	2.52
103	002214	大立科技	5,562,702.00	2.48
104	000905	厦门港务	5,539,276.26	2.47
105	600211	西藏药业	5,512,661.73	2.46
106	002019	鑫富药业	5,499,158.57	2.45
107	601600	中国铝业	5,461,696.01	2.44
108	600019	宝钢股份	5,453,112.00	2.43
109	002414	高德红外	5,351,768.74	2.39
110	600216	浙江医药	5,305,496.20	2.37
111	000012	南玻A	5,287,421.10	2.36
112	002251	步步高	5,284,374.92	2.36
113	002449	国星光电	5,269,315.10	2.35
114	600432	吉恩镍业	5,245,353.17	2.34
115	600239	云南城投	5,203,242.76	2.32
116	600664	哈药股份	5,163,821.08	2.30
117	600970	中材国际	5,091,545.19	2.27
118	000100	TCL 集团	5,071,436.00	2.26
119	600540	新赛股份	5,012,214.76	2.23
120	600277	亿利能源	4,981,997.20	2.22
121	300048	合康变频	4,971,049.20	2.22
122	600887	伊利股份	4,956,949.02	2.21
123	002422	科伦药业	4,937,705.31	2.20
124	002431	棕榈园林	4,920,803.26	2.19
125	002303	美盈森	4,868,464.03	2.17
126	600316	洪都航空	4,859,789.27	2.17
127	002007	华兰生物	4,850,262.24	2.16
128	300137	先河环保	4,839,729.16	2.16
129	600122	宏图高科	4,833,250.00	2.16
130	000602	金马集团	4,809,020.40	2.14
131	000972	新中基	4,796,960.07	2.14
132	600348	国阳新能	4,783,444.00	2.13
133	002269	美邦服饰	4,748,359.77	2.12
134	600537	海通集团	4,741,413.11	2.11
135	000401	冀东水泥	4,739,992.95	2.11
136	600498	烽火通信	4,716,735.91	2.10
137	002011	盾安环境	4,704,147.83	2.10
138	600143	金发科技	4,680,865.90	2.09
139	600107	美尔雅	4,655,687.62	2.08
140	600585	海螺水泥	4,646,003.62	2.07

141	000002	万 科A	4,619,068.00	2.06
142	600867	通化东宝	4,600,441.01	2.05
143	600276	恒瑞医药	4,541,422.34	2.03

注：该表的累计买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。

8.4.2 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	601888	中国国旅	59,172,752.06	26.39
2	600000	浦发银行	51,924,053.08	23.15
3	600048	保利地产	43,417,288.84	19.36
4	600036	招商银行	41,173,878.96	18.36
5	000671	阳光城	39,723,837.09	17.71
6	600068	葛洲坝	38,230,474.90	17.05
7	002008	大族激光	34,170,812.01	15.24
8	600423	柳化股份	33,057,837.24	14.74
9	000157	中联重科	28,672,149.80	12.79
10	002326	永太科技	28,362,201.13	12.65
11	002273	水晶光电	27,186,799.61	12.12
12	002104	恒宝股份	27,180,485.41	12.12
13	600581	八一钢铁	25,582,775.42	11.41
14	600720	祁连山	24,634,983.98	10.98
15	002142	宁波银行	23,595,983.95	10.52
16	000829	天音控股	21,731,622.05	9.69
17	002129	中环股份	21,585,150.36	9.62
18	000983	西山煤电	20,939,489.59	9.34
19	601169	北京银行	20,937,409.53	9.34
20	600884	杉杉股份	20,445,754.97	9.12
21	000060	中金岭南	19,825,627.99	8.84
22	601601	中国太保	19,787,624.87	8.82
23	600739	辽宁成大	19,245,477.86	8.58
24	600809	山西汾酒	18,908,575.02	8.43
25	002163	中航三鑫	18,861,824.77	8.41
26	000962	东方钨业	18,635,533.80	8.31
27	002375	亚厦股份	18,221,152.13	8.12
28	601998	中信银行	18,088,178.78	8.07
29	000861	海印股份	17,598,048.60	7.85
30	000903	云内动力	17,287,218.15	7.71
31	600015	华夏银行	17,110,928.73	7.63
32	000501	鄂武商A	17,104,664.97	7.63
33	002139	拓邦股份	17,090,471.59	7.62
34	600468	百利电气	16,991,888.29	7.58
35	002351	漫步者	16,266,765.36	7.25
36	600812	华北制药	15,501,298.85	6.91
37	600622	嘉宝集团	14,503,103.22	6.47

38	600388	龙净环保	14,130,209.07	6.30
39	600031	三一重工	13,297,974.60	5.93
40	002157	正邦科技	13,123,360.38	5.85
41	600837	海通证券	13,087,094.53	5.84
42	600115	东方航空	13,051,638.31	5.82
43	600378	天科股份	12,787,055.37	5.70
44	600481	双良节能	12,158,403.11	5.42
45	600176	中国玻纤	11,656,318.55	5.20
46	600268	国电南自	11,627,886.61	5.18
47	000636	风华高科	11,626,241.14	5.18
48	000100	TCL 集团	11,477,068.03	5.12
49	002297	博云新材	11,467,592.11	5.11
50	600028	中国石化	11,460,462.71	5.11
51	600354	敦煌种业	11,027,008.48	4.92
52	000862	银星能源	10,876,500.88	4.85
53	002421	达实智能	10,726,166.48	4.78
54	002024	苏宁电器	10,586,953.30	4.72
55	000713	丰乐种业	10,541,202.61	4.70
56	600491	龙元建设	10,477,098.85	4.67
57	002168	深圳惠程	10,383,974.47	4.63
58	600875	东方电气	10,278,289.80	4.58
59	000898	鞍钢股份	10,173,380.73	4.54
60	600549	厦门钨业	10,163,263.70	4.53
61	002413	常发股份	10,080,267.05	4.49
62	600583	海油工程	9,967,696.28	4.44
63	000055	方大集团	9,882,798.36	4.41
64	000969	安泰科技	9,850,308.34	4.39
65	002080	中材科技	9,808,538.55	4.37
66	002161	远望谷	9,726,323.44	4.34
67	600037	歌华有线	9,725,185.25	4.34
68	600316	洪都航空	9,353,597.24	4.17
69	002261	拓维信息	9,310,410.83	4.15
70	000917	电广传媒	9,171,340.24	4.09
71	601699	潞安环能	9,124,953.10	4.07
72	600961	株冶集团	9,068,861.07	4.04
73	600428	中远航运	8,972,482.25	4.00
74	002093	国脉科技	8,829,118.22	3.94
75	002301	齐心文具	8,691,220.48	3.88
76	600271	航天信息	8,645,805.79	3.86
77	000061	农产品	8,593,226.20	3.83
78	601318	中国平安	8,510,157.86	3.79
79	600595	中孚实业	8,133,928.91	3.63
80	600285	羚锐制药	8,011,831.19	3.57
81	600226	升华拜克	7,939,931.17	3.54
82	000024	招商地产	7,919,168.55	3.53
83	002038	双鹭药业	7,886,414.72	3.52
84	600830	香溢融通	7,719,948.74	3.44
85	600879	航天电子	7,692,630.07	3.43

86	601288	农业银行	7,520,112.58	3.35
87	002431	棕榈园林	7,394,749.15	3.30
88	601939	建设银行	7,325,732.12	3.27
89	600361	华联综超	7,107,785.08	3.17
90	600508	上海能源	7,097,053.49	3.16
91	600439	瑞贝卡	7,077,597.68	3.16
92	600050	中国联通	7,054,317.82	3.15
93	600521	华海药业	6,926,695.31	3.09
94	601268	二重重装	6,884,503.21	3.07
95	002067	景兴纸业	6,868,844.23	3.06
96	002482	广田股份	6,855,619.02	3.06
97	601666	平煤股份	6,836,659.62	3.05
98	600380	健康元	6,827,273.25	3.04
99	000837	秦川发展	6,677,264.75	2.98
100	600760	东安黑豹	6,564,109.00	2.93
101	600718	东软集团	6,557,170.14	2.92
102	000800	一汽轿车	6,493,283.05	2.90
103	002488	金固股份	6,122,703.22	2.73
104	000528	柳 工	6,053,093.60	2.70
105	600432	吉恩镍业	5,875,715.39	2.62
106	002414	高德红外	5,694,337.05	2.54
107	600970	中材国际	5,680,496.44	2.53
108	600330	天通股份	5,678,876.86	2.53
109	600540	新赛股份	5,625,191.67	2.51
110	002422	科伦药业	5,576,466.54	2.49
111	002469	三维工程	5,576,408.43	2.49
112	601857	中国石油	5,567,041.99	2.48
113	000905	厦门港务	5,430,472.24	2.42
114	600019	宝钢股份	5,400,487.17	2.41
115	002019	鑫富药业	5,398,298.21	2.41
116	600277	亿利能源	5,383,146.54	2.40
117	002251	步步高	5,301,869.42	2.36
118	600362	江西铜业	5,242,998.99	2.34
119	002214	大立科技	5,154,179.10	2.30
120	000987	广州友谊	5,148,649.12	2.30
121	601600	中国铝业	5,125,720.58	2.29
122	600211	西藏药业	5,120,918.20	2.28
123	600216	浙江医药	5,084,352.95	2.27
124	002303	美盈森	5,082,960.90	2.27
125	600498	烽火通信	5,077,165.87	2.26
126	600143	金发科技	5,006,139.27	2.23
127	002449	国星光电	4,993,834.67	2.23
128	000012	南 玻 A	4,968,280.00	2.22
129	002007	华兰生物	4,898,328.73	2.18
130	600887	伊利股份	4,889,807.88	2.18
131	600867	通化东宝	4,831,106.15	2.15
132	600664	哈药股份	4,827,381.55	2.15
133	002269	美邦服饰	4,825,241.24	2.15

134	600239	云南城投	4,790,324.42	2.14
135	600122	宏图高科	4,765,310.44	2.12
136	300137	先河环保	4,749,557.47	2.12
137	002011	盾安环境	4,740,786.18	2.11
138	600331	宏达股份	4,685,433.78	2.09
139	000401	冀东水泥	4,615,960.00	2.06
140	600992	贵绳股份	4,548,018.42	2.03

注：该表的累计卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。

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	1,801,295,786.18
卖出股票的收入（成交）总额	1,878,484,872.05

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金报告期期末未持有债券。

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

本基金报告期期末未持有债券。

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

本基金报告期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

本基金报告期期末未持有权证。

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

本基金报告期内投资的前十名证券的发行主体本期末未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

本基金报告期投资的前十名股票未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	3,964,494.19
3	应收股利	-
4	应收利息	13,301.15

5	应收申购款	240,650.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,468,445.85

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期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	002131	利欧股份	5,961,520.00	3.86	该股因筹划资产重组重大事项,2010年10月18日起连续停牌

注：002131 利欧股份已于 2011 年 2 月 16 日复牌。

8.9.6 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。

§ 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(%)
8,666	14,881.18	2,072,791.88	1.61	126,887,485.52	98.39

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

本期末基金管理人的从业人员未持有本开放式基金。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2008年12月4日)基金份额总额	367,018,547.39
本报告期期初基金份额总额	186,849,702.61
本报告期基金总申购份额	50,408,575.95
减：本报告期基金总赎回份额	108,298,001.16
本报告期期末基金份额总额	128,960,277.40

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期未召开基金份额持有人大会。

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

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

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，自2009年开始为本基金进行审计业务，本报告期内支付该会计师事务所审计费56,000.00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

本报告期内基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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	佣金	占当期佣金总量的比例（%）	

			额的比例 (%)			
江南证券	1	497,490,751.98	13.52	422,864.10	13.79	
华创证券	2	507,749,405.42	13.80	412,805.65	13.46	
银河证券	1	76,621,965.14	2.08	65,128.11	2.12	
湘财证券	1	147,522,185.17	4.01	125,394.81	4.09	
中信建投证券	1	161,312,684.93	4.38	131,068.77	4.27	
山西证券(天相投资)	1	537,786,170.73	14.61	436,955.57	14.25	
中金公司	1	419,781,186.85	11.41	356,809.68	11.64	
国信证券	1	775,417,707.31	21.07	659,101.84	21.50	
安信证券	1	129,112,403.49	3.51	104,904.79	3.42	
中信证券	2	426,986,197.21	11.60	351,085.10	11.45	
合计	12	3,679,780,658.23	100	3,066,118.42	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、个股分析的报告及丰富全面的信息；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