金鹰成份股优选证券投资基金

更新的招募说明书摘要

2008年第2号

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

二〇〇九年一月

金鹰成份股优选证券投资基金经中国证监会2003年3月24日证监基金字[2003]41号文件"关于同意金鹰成份股优选证券投资基金设立的批复"批准发起设立。基金合同于2003年6月16日正式生效。

重要提示

投资有风险,投资人申购基金时应认真阅读招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据本基金的基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务;基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅本基金的基金合同。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、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作出实质性判断或保证,不表明投资于本基金没有风险。

本基金管理人依照恪尽职守、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。当投资人赎回时,所得或会高于或低于投资人先前所支付的金额。如对本招募说明书有任何疑问,应寻求独立及专业的财务意见。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2008年12月16日,有关人员变动和代销机构信息截止日为2008年12月31日,有关财务数据和净值表现截止日为2008年9月30日。本报告财务数据未经审计。

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:　广东省广州市沿江中路298号江湾商业中心22层
设 立 日期:　2002年12月25日
法定代表人:　梁伟文
联 系 电 话:　020-83936180
联　系　人:　潘晓毅
注 册 资 本:　人民币1亿元
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	4000	40%
四川南方希望实业有限公司	2000	20%
广州药业股份有限公司	2000	20%
广东美的电器股份有限公司	2000	20%
总计	10000	100%

(二)主要人员情况

本主要人员信息截止日为2008年12月31日。

1、董事、监事、经理及其他高级管理人员

梁伟文先生,董事长,工商管理硕士,高级会计师、中国注册会计师。曾在广州国际信托投资公司、越秀企业集团有限公司任职,历任越信隆投资有限公司副总经理,华凌集团有限公司财务董事兼副总经理,广州证券有限责任公司总裁助理、副总裁等职。经公司第二届董事会第二十三次会议选举通过,并报经中国证监会核准,2008年12月起担任公司董事长。

詹松茂先生,董事,总经理,管理学硕士。历任中国投资银行广东省分行(现为国家开发银行广州分行)国际业务部经理,美国洛杉矶美华国际企业公司董事、副总裁、财务总监,招商银行广州分行大德支行行长,广州证券有限责任公司增城营业部、广州环市中营业部、经纪业务管理总部总经理,金鹰基金管理有限公司代理总经理等。经公司首届董事会第十五次会议审议通过,并报经中国证监会核准,2005年8月起担任公司总经理。

栗建伟先生,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、战略发展部总监。

高燕女士,董事,法学学士。历任北京金泉投资顾问有限公司客户部总经理,新希望集团金融事业部、四川南方希望有限公司投资经理等。

陈炳华先生,董事,硕士,会计师。曾任广州药业股份有限公司财务部部长,对企业财务管理有较丰富的经验,现任广州药业股份有限公司财务总监。

郭平先生,独立董事,经济学博士,教授、硕士生导师。历任湖南财经学院财政系讲师、教研室主任,湖南财经学院财政会计系副教授、系副主任,现任湖南大学会计学院教授、副院长。

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,广东经济学会常务理事,中华外国经济学说研究会理事,广东金融学会理事、广州留学归国人员协会理事等。

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,现任吉林大学法学院兼职副教授,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。

曹萍女士,监事会召集人,经济学硕士,律师。曾任原华夏证券有限责任公司广州分公司研究发展部、投资银行部总经理助理,2003年进入金鹰基金管理有限公司,现任金鹰基金管理有限公司监察稽核部负责人。

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

姚万义先生,独立监事,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、常委等职,中国证监会北京证管办副主任、巡视员等职,北京证券业协会理事长。

龙苏云先生,副总经理,投资研究总监,大学本科。历任南方诚信证券评估有限公司投资银行部经理,原南方证券广州分公司营业部交易主管,广东强世投资管理有限公司资产管理部经理,深圳兰光集团有限公司投资部经理、金鹰基金管理有限公司投资副总监、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12月起担任公司副总经理。

刘葆先生,副总经理,经济学博士,副教授。历任深圳国资经营公司(简贸控股)资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。

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办公室主任,南方证券广州分公司投资银行部总经理,华期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。

2、本基金现任基金经理

杨绍基先生,经济学博士,证券从业经历四年。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,曾任行业研究员、基金经理助理等职,协助基金经理进行投资管理工作。经金鹰基金管理有限公司第三届董事会第二次会议审议通过,自2008年12月24日起担任本基金基金经理。杨绍基先生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。

此外,金鹰成份股优选证券投资基金管理小组还配备了若干名证券投资分析人员,协助基金经理从事金鹰成份股优选证券投资基金的投资管理工作。

3、本基金历任基金经理

龙苏云先生,2008年2月19日至2008年12月24日管理本基金;
李鹏先生,2006年9月28日至2008年8月7日管理本基金;
欧庆龄先生,2005年9月28日至2006年9月12日管理本基金;
谢国满先生,2003年6月16日至2005年9月28日管理本基金。

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:
詹松茂先生,投资决策委员会主席,董事、总经理;
龙苏云先生,投资决策委员会成员,副总经理,投资研究总监,基金经理;
刘保民先生,投资决策委员会成员;
彭培祥先生,投资决策委员会成员,研究发展部副总监;
杨绍基先生,投资决策委员会成员,基金经理。

5、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

本基金之基金托管人为中国银行股份有限公司(简称"中国银行"),基本情况如下:
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:人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元
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:董杰
托管部门联系人:宁敏
电话:010-66594977
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:广东省广州市沿江中路298号江湾商业中心22层
法定代表人:梁伟文
电话:020-83936180
传真:020-83282856
联系人:潘晓毅

2、代销机构

本代销机构信息截止日为2008年12月31日。

名称:中国银行股份有限公司
住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人:肖钢
客户服务电话:95566
网址:www.boc.cn

名称:交通银行股份有限公司
注册及办公地址:上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人:胡怀邦
客户服务电话:95559
网址:www.bankcomm.com

名称:深圳发展银行股份有限公司
住所:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
法定代表人:法兰克纽曼
客户服务电话:95501
网址:www.sdb.com.cn

名称:中国邮政储蓄银行有限责任公司
住所:北京市西城区宣武门西大街131号
法定代表人:刘安东
客户服务电话:11185
网址:www.psbc.com

名称:中信银行股份有限公司
住所: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:孔丹
客户服务电话:95558
网址:bank.ecitic.com

名称:中国民生银行股份有限公司
住所:北京市西城区复兴门内大街2号@法定代表人:董文标
客户服务热线:95568
网址:www.cmbc.com.cn

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:上海市中山东一路12号
法定代表人:吉晓辉
客户服务电话:95528
网址:www.spdb.com.cn

名称:宁波银行股份有限公司
注册地址:浙江省宁波市中山东路294号
法定代表人:陆华裕
客户服务电话:96528
网址:www.nbcb.com.cn

名称:深圳平安银行股份有限公司
注册地址:深圳市福田区红荔西路301栋
办公地址:深圳市深南中路1099号平安银行大厦
法定代表人:孙建一
客户服务电话:40066-99999
网址:www.18ebank.com

名称:海通证券股份有限公司
住所:上海市淮海中路98号
法定代表人:王开国
电话:021-23219000
传真:021-23219100
客户服务电话:021-962503
网址:www.htsec.com

名称:国泰君安证券股份有限公司
住所:上海市浦东新区商城路618号
法定代表人:祝幼一
电话:021-62580818-416
传真:021-62569400
客户服务电话:400-8888-666,021-962588
网址:www.gtja.com

名称:中信建投证券有限公司
注册地址:北京朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京朝内大街188号
法定代表人:张佑君
客户服务电话:4008888108
网址:www.csc108.com

名称:广发证券股份有限公司
住所:广州市天河北路183号大都会广场36、38、41楼
法定代表人:王志伟
电话:020-87555888
传真:020-87557985
网址:www.gf.com.cn

名称:中国银河证券有限责任公司
住所:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人:肖时庆
电话:010-66568888
传真:010-66568536
客户服务电话:010-68016655
网址:www.chinastock.com.cn

名称:国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦
法定代表人:何如
电话:0755-82130833
传真:0755-82133302
客户服务电话:800-810-8868
网址:www.guosen.com.cn

名称:联合证券有限责任公司
住所:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
法定代表人:马昭明
传真:0755-82492187
客户服务热线:4008888555
网址:www.lhzq.com

名称:湘财证券有限责任公司
注册地址:长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12层
法定代表人:陈学荣
电话:021-68634518-8635
传真:021-68865938
客户服务电话:021-68865020
网址:www.xcsc.com

名称:广州证券有限责任公司
住所:广州市先烈中路69号东山广场主楼五楼
法定代表人:吴志明
电话:020-87320991
传真:020-87325036
客户服务电话:020-87320991、020-87320595
网址:www.gzs.com.cn

名称:西南证券有限责任公司
住所:重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦A幢22-25层
法定代表人:范剑
电话:023-63786397??
传真:023-63786312 ?
客户服务电话:023-63786241
网址:www.swsc.com.cn

名称:万联证券有限责任公司
住所:广州市中山二路18号广东电信广场36-37层
法定代表人:李舫金
电话:020-37865026
传真:020-37865030
客户服务电话:400-8888-133
网址:www.wlzq.com.cn

名称:东莞证券有限责任公司
住所:东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼
法定代表人:游锦辉
电话:0769-22119351
网址:www.dgzq.com.cn

名称:东吴证券有限责任公司
注册地址:苏州市十梓街298号
法定代表人:吴永敏
电话:0512-65158588
传真:0512-65158028
客户服务电话:0512-96288
网址:www.dwzq.com.cn

名称:平安证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦三层
法定代表人:陈敬达
客户服务电话:40088666338
网址:www.PA18.com

名称:江南证券有限责任公司
住所:江西省南昌市抚河北路291号
法定代表人:姚江涛
客户服务电话:0791-6770351
网址:www.scstock.com

名称:安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路2222号安联大厦34F、28A
法定代表人:牛冠兴
客户服务电话:0755-82825555
网址:www.axzq.com.cn

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:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:徐浩明
客户服务电话:10108998
网址:www.ebscn.com

名称:国盛证券有限责任公司
注册地址:江西省南昌市永叔路15号
办公地址:江西省南昌市永叔路15号信达大厦10-13楼
法定代表人:管荣升
客户服务电话:0791-6285337、0791-6288690
网址:www.gsstock.com

名称:财通证券经纪有限责任公司
注册地址:浙江省杭州市解放路111号金钱大厦
法定代表人:沈继宁
客户服务电话:0571-96336(上海地区962336)
网址:www.ctsec.com

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59号投资广场18楼
办公地址:上海市浦东新区东方路989号中达广场17楼
法定代表人:朱科敏
客户服务电话:400-888-8588
网址:www.longone.com.cn

名称:申银万国证券股份有限公司
注册地址:上海市常熟路171号
法定代表人:丁国荣
客户服务电话:021-962505
网站:www.sw2000.com.cn

名称:山西证券有限责任公司
注册地址:山西省太原市府西街69号国贸大厦A座30层
法定代表人:吴晋安
客户服务电话:400-666-1618
网址:www.i618.com.cn

名称:兴业证券股份有限公司
住所:福建省福州市湖东路99号标力大厦
法定代表人:兰荣
电话:021-68419974
传真:021-68419867
客户服务电话:021-68419125
网址:www.xyzq.com.cn

名称:宏源证券股份有限公司
注册地址:新疆维吾尔自治区乌鲁木齐市建设路2号
办公地址:北京市海淀区西直门北大街甲43号金运大厦B座6层
联系人:魏海
客户服务电话:010-62267799
网址:www.hysec.com

名称:国元证券股份有限公司
注册地址:安徽省合肥市寿春路179号
法定代表人:凤良志
客户服务电话:0551-2634400
网址:www.gyzq.com.cn

名称:招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人:宫少林
客户服务电话:95565、4008888111
网址:www.newone.com.cn

名称:中国建银投资证券有限责任公司
注册地址:深圳福田区福华三路国际商会中心48-50楼
法定代表人:杨小阳
客户服务电话:4006-008-008
网址:www.cjis.cn

名称:长江证券股份有限公司
注册地址:中国湖北省武汉市江汉区新华路特8号
法定代表人:胡运钊
客户服务电话:4008-888-999
网址:www.95579.com

名称:齐鲁证券有限公司
注册地址:山东省济南市经十路128号
法定代表人:李玮
客户服务电话:95538
网址:www.qlzq.com.cn

(二)注册登记机构

名称:金鹰基金管理有限公司
住所:广州市沿江中路298号江湾商业中心22层
法定代表人:梁伟文
电话:020-83282872
传真:020-83282856
联系人:左朝阳

(三)律师事务所和经办律师

名称:广东岭南律师事务所
住所:广州市新港西路135号中山大学西门内
法定代表人:江亚芳
电话:020-84035397
传真:020-84113152
经办律师:江亚芳

(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:金鹰成份股优选证券投资基金

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

通过资产配置和对投资组合的动态调整,在控制投资组合风险的前提下,实现基金资产的中长期增值和获取适当、稳定的现金收益。

七、基金的投资方向

本基金的投资方向为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、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

八、基金的投资策略

(一)决策依据

本基金的投资决策依据包括:
1、宏观经济形势及前景、有关政策趋向;
2、行业发展现状及前景;
3、上市公司基本面及发展前景;
4、证券市场走势及预期;
5、股票、债券等类别资产的预期收益率及风险水平。

(二)决策程序

1、本基金管理人的研究部门基于对宏观经济、政策及证券市场的现状和发展趋势的深入分析研究,和对各类别资产收益率和风险水平的合理预期,向投资决策委员会提交投资建议,投资建议包括总体资产配置建议、类别资产配置建议、个股/券种投资建议等;
2、投资决策委员会根据本基金的投资目标,结合对本基金投资相关因素的全局考虑,确定本基金的投资策略,制定总体资产配置计划;
3、本基金投资管理部门根据投资决策委员会制定的基金的总体资产配置计划,考虑研究部门的相关建议,拟定投资计划,报投资决策委员会批准;
4、本基金经理根据投资决策委员会批准的投资计划,考虑研究部门的相关建议,制定具体投资方案。

(三)组合原则

本基金的投资组合必须符合以下比例规定:
1、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%;
2、本基金投资于国家债券的比例,不得低于基金资产净值的20%;
3、本基金持有一家上市公司的股票,其市值不得超过基金资产净值的10%;
4、本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和,不得超过该证券的10%;
5、运用本基金资产参与股票发行申购,所申报的金额不得超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司该次的股票发售总量;
6、本基金的股票投资占基金投资组合的比例不超过80%,其中投资于成份股的比例不低于本基金股票投资总额的70%;
7、本基金的债券投资占基金投资组合的比例不低于20%;
8、本基金应当保持不低于基金资产净值百分之五的现金或者到期日在一年以内的政府债券;
9、有关法律法规、中国证监会及本基金契约所规定的其他比例限制。

法律法规或监管部门对上述比例另有规定时从其规定。

本基金已在基金合同生效后三个月内达到符合上述规定的比例限制。

(四)本基金股票投资原则

本基金的股票投资主要从上证180指数成份股和深证100指数成份股中选择两大类股票,一类是公司价值被市场低估的股票,另一类是收益稳定、分红派息率高的股票。两大类股票在股票投资的分配比例范围为50%±20%,根据两大类股票前期、当期和预计的风险调整后的收益率水平(夏普比率)确定其在股票投资中的具体比例。成份股以外的股票投资主要是参与有较高投资价值的新股申购、股票增发申购和有可能入选成份股的股票及根据市场情况的短期股票投资。

(五)本基金债券投资原则

本基金债券投资以国债为主,采取稳健的混合管理的投资策略,大部份(80%以上)的债券投资采取稳健投资策略,以确保投资收益的稳定性,小部分的债券投资采取积极的投资策略,即根据对到期收益率、市场利率等因素的预期,选择具有升值潜力的债券品种进行投资。此外,本基金还可进行国债回购和逆回购,以提高基金资产的利用效率。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为75%的成份股加权指数的收益率加上25%的中信国债指数的收益率。

成份股加权指数为上证180指数和深证100指数按其各自成份股流通市值加权平均值。

十、基金的风险收益特征

本基金为风险水平中等偏下、收益水平适中的证券投资基金,基金的收益目标设为α值大于零,风险目标为β值的目标区间为[0.75,1.1]。

十一、基金的投资组合报告(未经审计)

本投资组合报告所载数据截止日为2008年9月30日,本报告中所列财务数据未经审计。

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。

本基金的托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同的规定,于2009年1月20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。

(一)报告期末基金资产组合情况

项目	金额	占基金资产总值比例
股票	1,105,436,900.05	68.17%
债券	304,094,668.30	18.75%
权证	0.00	0.00%
资产支持证券	0.00	0.00%
银行存款和清算备付金	162,760,407.19	10.04%
其他资产	49,233,151.23	3.04%
合计	1,621,525,126.77	100.00%

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	市值	占基金资产净值比例%
A 农、林、牧、渔业	0.00	0.00%
B 采掘业	177,552,220.80	11.80%
C 制造业	289,680,941.51	19.25%
C0 食品、饮料	0.00	0.00%
C1 纺织、服装、皮毛	0.00	0.00%
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	38,919,177.88	2.59%
C5 电子	0.00	0.00%
C6 金属、非金属	177,835,401.71	11.81%
C7 机械、设备、仪表	9,629,079.40	0.64%
C8 医药、生物制品	63,297,282.52	4.21%
	0.00	0.00%
C99 其他制造业	0.00	0.00%
	0.00	0.00%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	31,399,434.80	2.09%
E 建筑业	0.00	0.00%
F 交通运输、仓储业	43,396,643.43	2.88%
G 信息技术业	142,340,578.16	9.46%
H 批发和零售贸易	12,261,923.92	0.81%
I 金融、保险业	292,871,988.00	19.46%
J 房地产业	115,933,169.43	7.70%
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	0.00	0.00%
合计	1,105,436,900.05	73.46%

(三)报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	市值(元)	市值占基金资产净值比
1	600030	中信证券	6,000,000.00	148,560,000.00	9.87%
2	600231	凌钢股份	19,845,681.00	128,798,469.69	8.56%
3	000002	万 科A	17,753,931.00	115,933,169.43	7.70%
4	601857	中国石油	8,856,281.00	113,714,648.04	7.56%
5	600050	中国联通	20,000,000.00	109,400,000.00	7.27%
6	601398	工商银行	20,857,000.00	90,727,950.00	6.03%
7	601628	中国人寿	2,121,300.00	53,584,038.00	3.56%
8	601919	中国远洋	2,910,573.00	43,396,643.43	2.88%
9	000566	海南海药	6,319,366.00	42,466,139.52	2.82%
10	002128	露天煤业	3,150,000.00	39,595,500.00	2.63%

(四)报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	国债	304,094,668.30	20.21%
2	金融债	0.00	0.00%
3	央行票据	0.00	0.00%
4	企业债	0.00	0.00%
5	可转债	0.00	0.00%
6	其他	0.00	0.00%
	合计	304,094,668.30	20.21%

(五)报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券代码	债券名称	市值(元)	市值占基金资产净值比
1	010115	21国债(5)	100,579,264.50	6.68%
2	009908	99国债(8)	70,615,178.20	4.69%
3	010004	20国债(4)	50,765,000.00	3.37%
4	010110	21国债(0)	24,333,404.40	1.62%
5	010215	02国债(5)	23,880,000.00	1.59%

注:本报告期末本基金投资债券8只。

(六)投资组合报告附注

1、报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

2、本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、本基金其他资产的构成

序号	项目	金额(元)
1	交易保证金	1,302,988.27
2	应收证券清算款	42,152,521.93
3	应收利息	4,669,043.29
4	应收股利	813,497.74
5	应收申购款	295,100.00
6	其他应收款	0.00
7	待摊费用	0.00
8	其他	0.00
合计		49,233,151.23

4、报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5、权证投资情况

报告期内本基金因投资分离交易可转换债券而获得的权证:

序号	权证代码	权证名称	获得数量	成本(元)	期末持有数量
1	580024	宝钢CWB1	1,993,600	2,956,524.42	0

注:580024权证于本报告期内卖出,到本报告期末580024权证持有数量为0。

6、投资分离交易可转债情况

报告期内本基金因原股东优先配售获得的分离交易可转债情况:

序号	债券代码	债券名称	数量	成本(元)	期末持有数量
1	126016	08宝钢债	124,600	9,503,475.58	0

注:126016分离交易可转债于2008年7月4日卖出,到本报告期末126016分离交易可转债持有数量为0。

7、投资资产支持证券情况

报告期内本基金未投资资产支持证券。

8、本报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效日为2003年6月16日,基金合同生效以来的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示:

金鹰成份股优选证券投资基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

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
2003.6.16-2003.12.31	4.79%	0.58%	-4.35%	0.74%	9.14%	-0.16%
2004.1.1-2004.12.31	-5.46%	0.96%	-11.55%	1.00%	6.09%	-0.04%
2005.1.1-2005.12.31	-9.40%	1.02%	-2.31%	1.04%	-7.09%	-0.02%
2006.1.1-2006.12.31	73.17%	1.29%	85.11%	1.06%	-11.94%	0.23%
2007.1.1-2007.12.31	132.39%	1.73%	107.39%	1.72%	25.00%	0.01%
2008.1.1-2008.6.30	-35.11%	2.32%	-37.13%	2.32%	2.02%	0.00%
2008.1.1-2008.9.30	-46.65%	2.22%	-46.02%	2.29%	-0.63%	-0.07%
2003.6.16-2008.9.30	92.90%	1.42%	70.18%	1.41%	22.72%	0.01%

金鹰优选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

(2003年6月16日至2008年9月30日)

注:1、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已达到基金合同第十三条(二)投资范围、(三)投资策略(6)组合原则中规定的各项比例,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%。

2、原基金经理李鹏先生因个人原因提出辞去基金经理职务的请求。经公司第二届董事会第二十三次会议审议通过,同意其辞职请求,免去其所担任的本基金基金经理职务。上述调整事项已报中国证监会广东监管局备案,并于2008年8月7日公开披露。

3、因工作需要,经公司第三届董事会第二次会议审议通过,决定聘请杨绍基先生担任本基金基金经理,龙苏云先生不再担任本基金基金经理职务。上述调整事项已报中国证监会广东监管局备案,并于2008年12月24日公开披露。

十三、费用概览

(一)与基金运作有关的费用

1、基金费用的种类

(1)基金管理人的管理费;
(2)基金托管人的托管费;
(3)基金信息披露费用;
(4)基金份额持有人大会费用;
(5)与基金相关的会计师费和律师费;
(6)证券交易费;
(7)按照国家有关规定可以列入的其他费用;

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1)基金管理人的报酬

基金管理人的报酬按基金资产净值的1.5%年费率计提。

在通常情况下,基金管理人报酬按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法为:

H=E×1.5%÷当年天数
H为每日应支付的基金管理人报酬
E为前一日基金资产净值

基金管理人报酬每日计提,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2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。

(2)基金托管人的托管费

基金托管人的托管费按基金资产净值的2.5‰的年费率计提。

在通常情况下,基金托管人的托管费按前一日的基金资产净值的2.5‰的年费率计提。计算方法为:

H=E×2.5‰÷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

基金托管人的托管费每日计提,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2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。

(3)上述"1、基金费用的种类"中第3-7项费用由基金托管人根据有关规定进行核算,发生的费用如果影响基金份额净值小数点后第五位的,即发生的其他费用大于基金净值十万分之一,应采用待摊或预提的方法,待摊或预提计入基金损益。发生的其他费用如果不影响基金份额净值小数点后第五位的,即发生的其他费用小于基金净值十万分之一,应于发生时直接计入基金损益。

3、不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

4、基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费,此项调整不需要召开基金持有人大会。

(二)与基金销售有关的费用

1、申购费用

本基金申购费用采取按照申购规模和持有期限递减的后端收费模式,即投资者在申购时不支付手续费,而在赎回时收取,并随着持有期间的长短而变动。基金份额持有年限越长,规模越大,后端收申购费率越低,直至为零。

申购规模(N)	持有时间	后端申购费率(%)
N<1000万	1年以内(不含1年)	1.5
	1-2年(不含2年)	1.2
	2-3年(不含3年)	1.0
	3-4年(不含4年)	0.8
	4年以上(含4年)	0
1000万≤N<5000万	1年以内(不含1年)	1.35
	1-2年(不含2年)	1.08
	2-3年(不含3年)	0.90
	3-4年(不含4年)	0.72
	4年以上(含4年)	0
5000万≤N<1亿	1年以内(不含1年)	1.2
	1-2年(不含2年)	0.96
	2-3年(不含3年)	0.8
	3-4年(不含4年)	0.64
	4年以上(含4年)	0
N≥1亿	1年以内(不含1年)	0.75
	1-2年(不含2年)	0.6
	2年以上(含2年)	0

本基金的申购费用由申购人承担,用于市场推广、销售、注册登记等各项费用,不列入基金资产。

2、赎回费用

本基金的赎回费用由基金持有人承担,赎回费按照赎回金额的0.5%收取,其中归入基金资产部分的比例为赎回费总额的25%,其余部分作为注册登记费和其他手续费支出。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人根据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对《金鹰成份股优选证券投资基金更新的招募说明书》(2008年第1号)进行了再次更新,主要更新的内容如下:

(一)在"三、基金管理人"部分,更新了主要人员情况:

1、公司原董事长谭思马先生因工作调动原因向公司董事会提出辞去董事长职务的请求。经公司第二届董事会第二十二次会议审议通过,同意其辞职请求,免去其所担任的董事长职务。上述调整事项已报中国证监会基金部、广东证监局备案,并于2008年8月7日公告。

经公司第二届董事会第二十三次会议选举通过,梁伟文先生当选为公司董事长。经中国证券监督管理委员会证监许可[2008]1334号文批复,已核准梁伟文先生基金行业高级管理人员任职资格,并对梁伟文先生担任我公司董事长无异议。上述调整事项于2008年12月12日公告。

2、因公司第二届董事会任期届满,经公司股东会2008年第三次临时会议选举通过,梁伟文先生、詹松茂先生、栗建伟先生、高燕女士、陈炳华先生、郭平先生、杜金岷先生、黄元生先生、颜俊先生担任公司第三届董事会董事,其中郭平先生、杜金岷先生、黄元生先生、颜俊先生为独立董事。经公司第三届董事会第一次会议选举通过,梁伟文先生当选为公司第三届董事会董事长。第二届董事会独立董事魏明海先生、苏祖耀先生、高宝明先生因累计任职时间已达公司章程规定的上限,不再继续担任公司独立董事职务。上述调整事项已报中国证监会基金部、广东证监局备案,并于2008年10月11日公告。

3、因公司第二届监事会任期届满,经公司股东会2008年第三次临时会议选举通过,曹萍女士、曾巧女士、姚万义先生担任公司第三