2008年年度报告摘要

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:2009年3月27日

§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。本年度报告已经全体独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2009年3月26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。

本报告期自2008年1月1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	金鹰优选
交易代码	210001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年6月16日
报告期末基金份额总额	2,702,347,061.50份

2.2 基金产品说明

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,实现基金的中长期资本增值和获取适当、稳定的现金收益。
投资策略	1)、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。 2)、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、个股或券种投资建议等。 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。 3)、组合原则 ①)本基金的股票债券的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%; ②)本基金的债券投资占基金投资组合的比例不低于20%。
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。
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]。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	苏文锋	宁敏
	联系电话	020-83282855	010-66594977
	电子邮箱	investor@gefund.com.cn	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		020-83936180	95566
传真		020-83282856	010-66594942

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:元

3.1.1 期间数据和指标	2008年	2007年	2006年
本期已实现收益	-1,197,551,244.49	719,617,048.95	90,384,728.87
本期利润	-1,537,030,746.98	850,917,144.83	93,656,470.28
加权平均基金份额本期利润	-0.5498	0.8032	0.6293
本期基金份额净值增长率 (%)	-51.43	132.39	73.17
3.1.2 期末数据和指标	**2008年**	**2007年**	**2006年**
期末可供分配基金份额利润	-0.1566	0.3859	0.4290
期末基金资产净值	1,347,319,514.68	2,203,062,712.95	65,273,096.28
期末基金份额净值	0.4986	1.1040	1.4290

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 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

[illegible]	[illegible]①(%)	[illegible]②(%)	[illegible]③(%)	[illegible]④(%)	①-③ (%)	②-④ (%)
[illegible]	-8.95	2.15	-12.99	2.29	4.04	-0.14
[illegible]	-25.15	2.09	-25.29	2.26	0.14	-0.17
[illegible]	-51.43	2.20	-53.03	2.28	1.60	-0.08
[illegible]	95.47	1.80	80.12	1.78	15.35	0.02
[illegible]	67.60	1.53	55.29	1.52	12.31	0.01
[illegible]	75.64	1.46	48.07	1.46	27.57	0

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

[illegible]

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)股资范围、(三)股资策略(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。

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

[illegible]

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位: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
2008年	0.800	55,322,659.50	112,735,891.28	168,058,550.78	
2007年	10.300	50,480,151.33	94,022,843.02	144,502,994.35	
2006年	-	-	-	-	
合计	11.100	105,802,810.83	206,758,734.30	312,561,545.13	

§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字[2002]97号批准,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、四川南方希望实业有限公司、广州药业股份有限公司、广东美的电器股份有限公司,分别持有40%、20%、20%和20%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。

公司目前下设八个部门,分别是:投资管理部、研究发展部、金融工程部、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原则进行基金投资;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。金融工程部负责金融工程研究、数量分析和新产品设计工作。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。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及其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。

公司目前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和金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金三只开放式基金。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨绍基	基金经理	2008年12月17日	-	5年	经济学博士,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,任职行业研究员、基金经理助理等职。
龙苏云	副总经理,投资研究总监,基金经理	2008年1月23日	2008年12月17日	16年	大学本科,证券从业经历十六年。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,深圳三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、总经理助理等职。
李 鹏	基金经理	2006年9月12日	2008年7月31日	10年	大学本科。,历任广州证券有限责任公司机构管理部证券分析师,投资自营部投资经理,投资管理总部经理、从事证券研究及投资管理工作。2005年加入金鹰基金管理有限公司,先后担任行业研究员和金鹰成份股优选证券投资基金基金经理助理。
杨绍基	基金经理助理	2008年9月18日	2008年12月17日	同前述	同前述

注:1.任职日期和离任日期均指公司董事会决议通过之日;

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、《金鹰成份股优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,本基金的投资决策、投资交易程序、投资权限等各方面均符合有关法规及基金合同规定的要求;基金的投资范围、投资比例及投资组合也均符合有关法规及基金合同的规定;交易行为合法合规,未出现异常交易、操纵市场的现象;未发生内幕交易的情况;相关的信息披露真实、完整、准确,及时;基金各种账户类、申购赎回及其他交易类业务、注册登记业务均按规定的程序、规则进行,未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

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制约。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。

本报告期内,上述公平交易制度和流程执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内不存在异常交易行为。

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

截至2008年12月31日,本基金份额净值为0.4986,报告期内份额净值增长率为-51.43%,同期业绩比较基准增长率为-53.03%。2008年A股全年基本呈单边下行态势,上证指数全年下跌65.4%,上证180指数和深证100指数分别下跌66.3%和63.2%,本基金主要的投资标的股票上证180和深证100成份股全年出现较大跌幅。由于2008年全年A股市场存在较大的系统性风险,本基金总体上采取防守策略,在控制好仓位的前提下,适度参与阶段性反弹行情。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2009年世界宏观经济仍趋下行,但中国政府的强力反经济周期政策将有助于保持经济稳定增长,经济增长速度有望呈逐季环比上升态势。

A股市场2009年将进入修复期,从投资角度看,流动性充裕将提高市场估值水平,市场对宏观经济、行业以及上市公司盈利预期的变化以及事件驱动型投资和主题投资,也将带来层出不穷的结构性投资机会。在操作上,与2008年着重研判市场系统性风险和控制仓位不同,我们在2009年将更多关注个股投资机会和优化资产配置,及时跟踪和洞察产业链中各行业景气度的变化和行业轮动的最新情况,按照"首先受益、直接受益、确定性受益"的原则对实施积极财政政策的受益行业、确定性增长行业和景气复苏行业进行布局。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在合规运作、稳健经营的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1 估值的一般程序

①)基金会计根据当天有价证券投资的实际余额,作出基金资产的初步估值;

②)运作保障部根据基金会计的初步估值进行核对;运作保障部根据估值结果与基金托管人核对;

③)基金托管人反馈;

④)若基金管理人与托管人能达成一致意见,则按照达成的估值结果;若无法达成一致,则按照《托管协议》中的约定进行处理;

⑤)公司总经理签发;

⑥)公司公布。

4.6.2 特殊情况下的估值程序

本条所述的特殊情况是指基金所持有的有价证券出现停牌或暂停交易(属于公布信息而暂停交易的除外)的情况。

对特殊情况下的有价证券估值,其估值程序如下:

①)基金会计和基金经理对基金持仓的证券交易情况、信息披露情况,应保持应有的职业敏感,适时确定需要采用特别定价程序的有价证券;

②)由基金经理根据对该等有价证券的价值趋势作出判断,并根据判断出具对该有价证券的估值报告,报运作保障部;

③)运作保障部根据基金经理的估值报告与基金托管人协商估值标准后,报送公司估值委员会;

④)估值委员会根据基金经理的估值报告和基金托管人的意见,作出估值的决定;

⑤)基金会计根据估值委员会的估值决定对该等有价证券进行初步估值;

⑥)运作保障部根据基金会计的初步估值进行核对;

⑦)运作保障部将估值结果通知基金托管人;

⑧)若基金管理人与托管人能达成一致意见,则按照达成的估值结果;若无法达成一致,则按照《托管协议》中的约定进行处理;

⑨)报公司总经理签发;

⑩)公布。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

2008年1月10日本基金实施分红,实际分配利润168,058,550.78元。

截止本报告期末,本基金可供分配净收益为-423,126,932.17元,本报告期无可分配收益。

§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

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在金鹰成份股优选证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核。

本基金本期利润为-1,537,030,746.98元,本期已实现收益-1,197,551,244.49元。本报告期内,本基金累计收益分配金额为168,058,550.78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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

金鹰成份股优选证券投资基金全体份额持有人:

我们审计了后附的金鹰成份股优选证券投资基金(简称"金鹰成份股优选基金")2008年12月31日的资产负债表和2008年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及年度财务报表附注。

一、管理层对财务报表的责任

按照《企业会计准则》和《金融企业会计制度》的规定,编制财务报表是金鹰成份股优选基金的基金管理人的责任。这种责任包括:①)设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报;②)选择和运用恰当的会计政策;③)作出合理的会计估计。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范,计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,我们考虑与财务报表编制相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。

我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

三、审计意见

我们认为,贵公司财务报表已经按照《企业会计准则》、《金融企业会计制度》及《证券投资基金会计核算办法》的规定编制,在所有重大方面公允反映了金鹰成份股优选基金2007年12月31日的财务状况和2007年度的经营成果及净值变动情况。

立信羊城会计师事务所有限公司　　中国注册会计师:张宁

中国注册会计师:黎晓霞

中国·广州　　2009年3月19日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:金鹰成份股优选证券投资基金

报告截止日:2008年12月31日

单位:元

资 产	本期末 (2008年12月31日)	上年度末 (2007年12月31日)
资 产:		
银行存款	169,449,123.17	138,683,317.20
结算备付金	9,020,025.30	3,234,784.21
存出保证金	1,138,549.12	1,608,961.18
交易性金融资产	1,177,332,039.91	1,983,820,745.28
其中:股票投资	874,564,166.91	1,534,642,325.38
?????? 债券投资	302,767,873.00	449,178,419.90
?????? 资产支持证券投资	302,767,873.00	449,178,419.90
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	0.00	-
应收证券清算款	1,713,961.93	42,798,309.63
应收利息	3,673,165.84	7,759,830.66
应收股利	0.00	-
应收申购款	39,600.00	43,108,604.54
其他资产	-	-
资产总计	1,362,366,465.27	2,221,014,552.70
负债和所有者权益	本期末 (2008年12月31日)	上年度末 (2007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	7,639,340.67	-
应付赎回款	514,335.97	10,430,580.06
应付管理人报酬	1,796,551.47	2,450,910.15
应付托管费	299,425.26	408,485.06
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,153,659.28	2,185,794.65
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
其他负债	1,643,637.94	2,476,069.83
负债合计	15,046,950.59	17,951,839.75
所有者权益:		
实收基金	1,770,446,446.85	1,307,360,328.55
未分配利润	-423,126,932.17	895,702,384.40
所有者权益合计	1,347,319,514.68	2,203,062,712.95
负债和所有者权益总计	1,362,366,465.27	2,221,014,552.70

报告截止日:2008年12月31日,基金份额净值0.4986元,基金份额总额2,702,347,061.50份。

注:所附附注为本财务报表的组成部分

7.2 利润表

会计主体:金鹰成份股优选证券投资基金

本报告期:2008年1月1日至2008年12月31日

单位:元

项 目	本期 (2008年1月1日至2008年12月31日)	上年度可比期间 (2007年1月1日至2007年12月31日)
一、收入	-1,473,197,948.67	920,666,873.49
1.利息收入	16,187,170.94	9,501,679.73
其中:存款利息收入	1,137,239.80	1,812,826.83
债券利息收入	15,049,931.14	7,688,852.90
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)	-1,150,705,935.46	776,167,908.52
其中:股票投资收益	-1,161,255,086.46	760,724,350.60
基金投资收益	-3,886,690.36	-1,471,077.78
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	1,576,740.29	5,996,336.09
股利收益	12,859,101.07	10,918,299.61
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-339,479,502.49	131,300,095.88
4.其他收入(损失以"-"号填列)	800,318.34	3,697,189.36
二、费用(以"-"号填列)	-63,832,798.31	-69,749,728.66
1.管理人报酬	-30,068,149.67	-20,519,675.75
2.托管费	-5,011,358.27	-3,419,946.01
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	28,365,998.93	45,454,169.51
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	-387,291.44	-355,937.39
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-1,537,030,746.98	850,917,144.83
所得税费用(以"-"号填列)	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-1,537,030,746.98	850,917,144.83

注:所附附注为本财务报表的组成部分

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:金鹰成份股优选证券投资基金

本报告期:2008年1月1日至2008年12月31日

单位:元

项目	本期 (2008年1月1日至2008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)	1,307,360,328.55	895,702,384.40	2,203,062,712.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,537,030,746.98	-1,537,030,746.98
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)	463,086,118.30	386,259,981.19	849,346,099.49
其中:1.基金申购款	948,802,213.26	514,276,245.49	1,463,078,458.75
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-485,716,094.96	-128,016,264.30	-613,732,359.26
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)	-	-168,058,550.78	-168,058,550.78
五、期末所有者权益(基金净值)	1,770,446,446.85	-423,126,932.17	1,347,319,514.68
项目	上年度可比期间 (2007年1月1日至2007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)	45,677,086.40	19,596,009.88	65,273,096.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	850,917,144.83	850,917,144.83
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)	1,261,683,242.15	169,692,224.04	1,431,375,466.19
其中:1.基金申购款	3,493,232,930.26	895,794,904.61	4,389,027,834.87
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-2,231,549,688.11	-726,102,680.57	-2,957,652,368.68
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)	-	-144,502,994.35	-144,502,994.35
五、期末所有者权益(基金净值)	1,307,360,328.55	895,702,384.40	2,203,062,712.95

7.4 报表附注

7.4.1 关联方关系

7.4.1.1 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
广州证券有限责任公司(下"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
广东美的电器股份有限公司	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
金鹰基金管理有限公司	基金发起人、管理人
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

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

金额单位:元

关联方名称	本期 (2008年1月1日至2008年12月31日)		上年度可比期间 (2007年1月1日至2007年12月31日)	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
广州证券	2,061,488,031.74	17.35	2,779,648,520.41	20.14

7.4.2.1.2 权证交易

金额单位:元

关联方名称	本期 (2008年1月1日至2008年12月31日)		上年度可比期间 (2007年1月1日至2007年12月31日)	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
广州证券	1,071,271.45	17.19	5,996,336.09	100.00

7.4.2.1.3 债券交易

金额单位:元

关联方名称	本期 (2008年1月1日至2008年12月31日)		上年度可比期间 (2007年1月1日至2007年12月31日)	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)
广州证券	3,346,365.25	0.24	0.00	0

7.4.2.1.4 债券回购交易

本基金报告期内没有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.2.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:元

关联方名称	本期 (2008年1月1日至2008年12月31日)			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
广州证券	1,674,983.83	16.80	495,129.77	15.70
关联方名称	上年度可比期间 (2007年1月1日至2007年12月31日)			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
广州证券	1,674,983.83	16.80	495,129.77	15.70

注:1、上述佣金按市场佣金率计算,并以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取,并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2、向关联方支付的交易佣金采用公允的交易佣金比率计算。关联方席位租用合同还规定佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.2.2 关联方报酬

7.4.2.2.1 基金管理费

单位:元

项目	本期 (2008年1月1日至2008年12月31日)	上年度可比期间 (2007年1月1日至2007年12月31日)
当期应支付的管理费	30,068,149.67	20,519,675.75
其中:当期已支付	28,271,598.20	18,068,765.60
期末未支付	1,796,551.47	2,450,910.15

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×1.5%/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;由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

7.4.2.2.2 基金托管费

单位:元

项目	本期 (2008年1月1日至2008年12月31日)	上年度可比期间 (2007年1月1日至2007年12月31日)
当期应支付的托管费	5,011,358.27	3,419,946.01
其中:当期已支付	4,711,933.01	3,011,460.95
期末未支付	299,425.26	408,485.06

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×0.25%/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;由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

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

本基金报告期内没有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 (2008年12月31日)		上年度末 (2007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(%)
广州证券有限责任公司	0.00	0	0.00	0
广州药业股份有限公司	0.00	0	0.00	0
广东美的电器股份有限公司	0.00	0	0.00	0
四川南方希望实业有限公司	0.00	0	0.00	0

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:元

关联方名称	本期 (2008年1月1日至2008年12月31日)		上年度可比期间 (2007年1月1日至2007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
中国银行	169,449,123.17	1,040,366.34	138,683,317.20	1,127,841.00

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,2008年度期末余额9,020,025.30元,清算备付金利息收入94,359.84元,2007年度期末余额3,234,784.21元,清算备付金利息收入102,276.35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

本基金报告期内没有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.3 期末(2008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股票

金额单位: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
000652	泰达股份	2008年12月30日	注1	5.33	2009年1月20日	5.28	6,979,600	41,304,006.88	37,201,268.00

注:因筹划重大资产重组事项,停牌。

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

本基金报告期末没有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

本基金报告期末没有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:元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	874,564,166.91	64.20
	其中:股票	874,564,166.91	64.20
2	固定收益投资	302,767,873.00	22.22
	其中:债券	302,767,873.00	22.22
	资产支持证券	0.00	0
3	金融衍生品投资	0.00	0
4	买入返售金融资产	0.00	0
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	0.00	0
5	银行存款和结算备付金合计	178,469,148.47	13.10
6	其他资产	6,565,276.89	0.48
7	合计	1,362,366,465.27	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:元

序号	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	0.00	0
B	采掘业	7,050,637.26	0.52
C	制造业	398,368,425.01	29.57
C0	食品、饮料	0.00	0
C1	纺织、服装、皮毛	0.00	0
C2	木材、家具	0.00	0
C3	造纸、印刷	0.00	0
C4	石油、化学、塑胶、塑料	2,581,017.07	0.19
C5	电子	0.00	0
C6	金属、非金属	149,254,009.96	11.08
C7	机械、设备、仪表	174,056,911.18	12.92
C8	医药、生物制品	72,476,486.80	5.38
C99	其他制造业	0.00	0
D	电力、煤气及水的生产和供应业	16,710,000.00	1.24
E	建筑业	59,619,777.78	4.43
F	交通运输、仓储业	37,201,268.00	2.76
G	信息技术业	94,423,524.00	7.01
H	批发和零售贸易	19,249,