金鹰中小盘精选证券投资基金 2009年半年度报告摘要

基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司
送出日期： 2009年08月29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。本半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2009年8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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2009年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	金鹰中小盘精选混合
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	793,123,757.91份

2.2 基金产品说明

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	股票投资策略：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	本基金的业绩比较基准为75%的股票投资比较基准加上25%的债券投资比较基准。 股票投资比较基准采用50%的中信中盘指数收益率加50%的中信小盘指数收益率。债券投资比较基准采用中信国债指数。
风险收益特征	本基金属于风险水平适中、收益较高的证券投资基金品种。

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	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	021-68888917
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	zhangyd@bankcomm.com
客户服务电话		020-83936180	021-68888917
传真		020-83282856	021-58408836

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gefund.com.cn
基金半年度报告备置地点	广州市沿江中路298号江湾商业中心22楼

§3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2009年1月1日-2009年6月30日)
本期已实现收益	114,700,180.99
本期利润	250,000,499.51
加权平均基金份额本期利润	0.3991
本期基金份额净值增长率	56.72%
3.1.2 期末数据和指标	报告期(2009年1月1日-2009年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.4517
期末基金资产净值	1,151,356,800.69
期末基金份额净值	1.4517

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"等。

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

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
过去一个月	0.63%	0.79%	5.70%	0.68%	-5.07%	0.11%
过去三个月	12.35%	1.44%	13.54%	1.17%	-1.19%	0.27%
过去六个月	56.72%	1.64%	52.95%	1.58%	3.77%	0.06%
过去一年	38.88%	1.90%	15.68%	2.06%	23.20%	-0.16%
过去三年	73.01%	1.87%	93.13%	1.98%	-20.12%	-0.11%
自基金合同生效起至今	162.43%	1.59%	126.66%	1.70%	35.77%	-0.11%

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

金鹰中小盘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2009年6月30日）

注：截止报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例，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%。

§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、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。

截止2009年6月30日，公司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。2009年7月1日，金鹰行业优势股票型证券投资基金基金合同生效，公司管理的开放式基金增至4只。

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		
龙苏云	副总经理，投研总监，本基金的基金经理	2008年1月23日	-	16年	龙苏云先生，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，曾于2008年2月19日至2008年12月24日担任金鹰成份股优选证券投资基金基金经理。现担任本基金基金经理以及金鹰红利价值混合基金基金经理。

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、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，符合公平交易原则，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。

报告期本基金管理人旗下金鹰成份股优选证券投资基金的净值增长率为41.36%，金鹰红利价值灵活配置基金净值增长率为47.69%，金鹰中小盘精选证券投资基金净值增长率为56.72%。基金净值增长率最高相差15.36个百分点。

从股票和债券收益率来看，本报告期金鹰红利基金股票收益率为47.69%，债券收益率为0；金鹰优选基金股票收益率为41.2%，债券收益率为0.16%；金鹰中小盘基金股票收益率为56.57%，债券收益率为0.15%。三只基金中，债券收益率最高相差0.16个百分点，股票收益率最高相差15.37个百分点。

在上半年的A股市场行情中，一季度小盘股大幅跑赢大盘股，二季度大市值股票的表现总体上则略强于中小市值股票，金鹰成份股优选基金投资标的主要为大市值股票，金鹰中小盘基金主要投资小市值股票，金鹰红利价值基金则介于两者之间，受此影响，金鹰优选基金和金鹰中小盘基金、金鹰红利基金的净值增长率出现一定程度的差异，这是与三只基金的投资风格和A股市场运行特点相关的。

本基金管理人旗下三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基金投资标的以注重分红的公司为主。通过对本报告期本基金管理人旗下的三只基金在1日内、5日内和10日内发生的同向交易和价差进行分析，不存在违反公平交易的行为。三只基金的对于相同的股票投资标的进行的交易，在交易价格上不存在明显的价格差异，交易价差随市场波动随机发生的，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

无与本投资组合投资风格相似的其它投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内无异常交易行为。

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

09年上半年，A股市场在强力的宏观经济刺激政策和宽裕的流动性共同推动下呈单边上行态势，涨幅高达62.53%。从经济复苏梯度扩散效应与信心持续增强角度透视上半年的行情脉络，在年初宏观经济走势仍不清晰的情况下，市场追捧相对独立于经济周期并有望解决长期经济增长瓶颈的新能源、新材料、新技术行业和公司，随着房地产、汽车需求的快速释放，内需支柱型产业带动经济复苏的迹象日益明显，行情进一步扩散和深化，风格逐步由中小盘股、题材股向大盘股和金融、地产、煤炭等前一轮牛市的传统板块转换。从着眼于中国的长远健康发展以及投资人对本轮经济复苏的预期变化出发，本基金重点配置新能源、有色金属、房地产、汽车、煤炭等板块，这些板块成为基金净值增长的主要贡献者。

截止2009年06月30日，基金份额净值为1.4517元，本报告期份额净值增长率为56.72%，同期业绩比较基准收益率为52.95%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，投资的乘数效应将加快释放，外贸持续低迷的状况也有望在发达经济体经济企稳和补充库存需求的拉动下出现回暖，经济有望保持复苏向上的良好态势，这对证券市场是一个有力支持。但也必须看到，上半年贷款的大量投放与汽车、房地产超常规销售增长将难持续，如果外需难以如期回暖，经济增长的内生动力或将放缓，同时宽松流动性滋生资产泡沫与通胀的压力可能也将随之显现，这将是影响下半年证券市场继续走高的关键因素。

策略上，本基金坚持自身投资特色，继续关注新能源、新技术和新材料等适应中国经济可持续发展和长期科技竞争力趋势的个股，同时顺应经济复苏的行业受益逻辑，重点配置金融、地产、有色、煤炭、钢铁、化工等周期类行业。如果遭遇流动性紧缩或经济复苏可持续性遭遇挑战，则适当降低仓位，应对高位大幅波动风险。

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

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

本基金2009年2月9日实施分红，每份分配红利0.08元，共分配利润17,894,460.61元，其中现金红利8,645,768.81元，红利再投9,248,691.80元。本报告期末，本基金可分配利润358,233,042.78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

2009年上半年度，基金托管人在金鹰中小盘精选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

2009年上半年度，金鹰基金管理有限公司在金鹰中小盘精选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17,894,460.61元 。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2009年上半年度，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中小盘精选证券投资基金的半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：金鹰中小盘精选证券投资基金

报告截止日：2009年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2009年6月30日	上年度末 2008年12月31日
资 产：		-	-
银行存款		1,177,671.47	6,644,583.15
结算备付金		37,911,348.50	11,865,536.99
存出保证金		2,079,915.81	601,282.05
交易性金融资产		1,136,687,038.33	156,756,009.06
其中：股票投资		882,383,720.33	105,412,567.56
债券投资		254,303,318.00	51,343,441.50
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		20,457,559.14	1,986,682.97
应收利息		5,866,563.04	459,866.15
应收股利		-	-
应收申购款		11,374,442.10	587,790.21
其他资产		-	-
资产总计		1,215,554,538.39	178,901,750.58
负债和所有者权益	附注号	本期末 2009年6月30日	上年度末 2008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		-	2,673,840.43
应付赎回款		57,419,059.05	1,639,887.44
应付管理人报酬		1,641,402.95	199,951.05
应付托管费		273,567.16	33,325.19
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		3,399,738.10	838,631.77
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
其他负债		1,463,970.44	929,800.58
负债合计		64,197,737.70	6,315,436.46
所有者权益：		-	-
实收基金		793,123,757.91	173,823,362.59
未分配利润		358,233,042.78	-1,237,048.47
所有者权益合计		1,151,356,800.69	172,586,314.12
负债和所有者权益总计		1,215,554,538.39	178,901,750.58

注：报告截止日2009年6月30日，基金份额净值1.4517元，基金份额总额793,123,757.91份。

6.2 利润表

会计主体：金鹰中小盘精选证券投资基金

本报告期：2009年1月1日至2009年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2009年1月1日至2009年6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日
一、收入		267,702,648.39	-56,799,144.87
1.利息收入		2,946,426.82	635,766.24
其中：存款利息收入		272,132.06	74,555.65
债券利息收入		2,674,294.76	561,210.59
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）		127,488,222.30	-28,000,281.09
其中：股票投资收益		126,680,899.17	-28,261,319.35
债券投资收益		-1,033,941.12	-187,560.91
资产支持证券投资收益		-	
权证投资收益		-	12,424.47
衍生工具收益		-	
股利收益		1,841,264.25	436,174.70
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）		135,300,318.52	-29,582,088.55
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）		-	-
5.其他收入（损失以"-"号填列）		1,967,680.75	147,458.53
二、费用（以"-"号填列）		-17,702,148.88	-4,358,714.24
1.管理人报酬		-6,097,540.92	-1,112,134.58
2.托管费		-1,016,256.90	-185,355.69
3.销售服务费		-	
4.交易费用		-10,403,664.01	-2,851,868.34
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		-184,687.05	-209,355.63
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）		250,000,499.51	-61,157,859.11
所得税费用（以"-"号填列）		-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）		250,000,499.51	-61,157,859.11

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金鹰中小盘精选证券投资基金

本报告期：2009年1月1日至2009年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年6月30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）	173,823,362.59	-1,237,048.47	172,586,314.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	250,000,499.51	250,000,499.51
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）	619,300,395.32	127,364,052.35	746,664,447.67
其中：1.基金申购款	1,791,336,768.22	536,140,487.75	2,327,477,255.97
2.基金赎回款（以"-"号填列）	-1,172,036,372.90	-408,776,435.40	-1,580,812,808.30
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）	-	-17,894,460.61	-17,894,460.61
五、期末所有者权益（基金净值）	793,123,757.91	358,233,042.78	1,151,356,800.69
项目	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30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）	48,149,542.39	28,724,542.01	76,874,084.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-61,157,859.11	-61,157,859.11
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）	92,927,203.90	57,508,852.00	150,436,055.90
其中：1.基金申购款	178,823,142.37	91,540,100.48	270,363,242.85
2.基金赎回款（以"-"号填列）	-85,895,938.47	-34,031,248.48	-119,927,186.95
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）	-	-8,096,643.97	-8,096,643.97
五、期末所有者权益（基金净值）	141,076,746.29	16,978,890.93	158,055,637.22

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

金鹰中小盘精选证券投资基金（简称"本基金"），经中国证券监督管理委员会（简称"中国证监会"）证监基金字［2004］25号文《关于同意金鹰中小盘精选证券投资基金设立的批复》批准，于2004年5月27日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为545,813,283.53份基金份额。本基金募集期间自2004年4月12日起至2004年5月20日止，净销售额为545,813,283.53元，认购资金在认购期间的银行利息234,025.89元折算成基金资产。上述资金已于2004年5月27日全额划入本基金在基金托管人交通银行开立的本基金托管专户。验资机构为安永华明会计师事务所。本基金的基金管理人为金鹰基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

6.4.2 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内关联方无发生变化。

6.4.3.2 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（"广州证券"）	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

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日至2009年6月30日		上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30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	267,869,162.28	3.84%	190,888,831.53	21.69%

6.4.4.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日至2009年6月30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	217,647.20	3.27%	217,647.20	6.40%
关联方名称	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30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	155,098.77	21.07%	56,835.35	15.94%

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

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日至2009年6月30日
当期应支付的管理费	6,097,540.92	1,112,134.58
其中：当期已支付	4,456,137.97	902,481.99
期末未支付	1,641,402.95	209,652.59

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。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日至2009年6月30日
当期应支付的托管费	1,016,256.90	185,355.69
其中：当期已支付	742,689.74	150,413.60
期末未支付	273,567.16	34,942.09

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。

6.4.4.3 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 2009年6月30日		上年度末 2008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	1,901,814.38	0.24%	1,776,674.43	1.02%

6.4.4.4 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 2009年1月1日至2009年6月30日		上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30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	1,177,671.47	103,325.44	4,548,466.37	24,847.33

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，按银行同业利率计息。于2009年6月30日的相关余额37,911,348.50元，在资产负债表中的"情算备付金"科目中单独列示（2008年6月30日：6,374,768.50元）。

6.4.5 期末（2009年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌股票

本报告期末未持有暂时停牌股票。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

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。

§7 投资组合报告

7.1 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	882,383,720.33	72.59%
	其中：股票	882,383,720.33	72.59%
2	固定收益投资	254,303,318.00	20.92%
	其中：债券	254,303,318.00	20.92%
	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	39,089,019.97	3.22%
6	其他资产	39,778,480.09	3.27%
7	合计	1,215,554,538.39	100%

7.2 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	-	-
C	制造业	507,022,980.66	44.04%
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	126,296,954.70	10.97%
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	32,567,559.25	2.83%
C6	金属、非金属	3,697,500.00	0.32%
C7	机械、设备、仪表	236,842,513.71	20.57%
C8	医药、生物制品	107,618,453.00	9.35%
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	31,515,000.00	2.74%
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	41,906,764.61	3.64%
H	批发和零售贸易	5,119,847.88	0.44%
I	金融、保险业	85,060,737.16	7.39%
J	房地产业	85,358,829.12	7.41%
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	19,007,430.00	1.65%
M	综合类	107,392,130.90	9.33%
	合计	882,383,720.33	76.64%

7.3 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	600884	杉杉股份	6,000,000	83,280,000.00	7.23%
2	000990	诚志股份	6,000,000	82,800,000.00	7.19%
3	600872	中炬高新	6,510,000	76,297,200.00	6.63%
4	002005	德豪润达	6,061,497	72,313,659.21	6.28%
5	600416	湘电股份	3,041,020	62,128,038.60	5.40%
6	600162	香江控股	6,646,752	57,228,534.72	4.97%
7	600316	洪都航空	2,356,771	50,434,899.40	4.38%
8	600166	福田汽车	3,370,000	44,652,500.00	3.88%
9	600259	ST有色	2,238,135	43,016,954.70	3.74%
10	600837	海通证券	2,000,000	32,900,000.00	2.86%

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值前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	600030	中信证券	282,957,482.66	163.95%
2	600872	中炬高新	114,634,870.82	66.42%
3	000001	深发展A	112,189,465.93	65.00%
4	600884	杉杉股份	100,977,989.24	58.51%
5	600837	海通证券	96,043,790.77	55.65%
6	600549	厦门钨业	93,071,736.49	53.93%
7	600331	宏达股份	88,926,276.44	51.53%
8	600111	包钢稀土	83,547,393.78	48.41%
9	000960	锡业股份	81,368,505.66	47.15%
10	000990	诚志股份	74,720,941.33	43.29%
11	000728	国元证券	74,231,859.01	43.01%
12	600050	中国联通	70,333,798.00	40.75%
13	600162	香江控股	65,885,961.17	38.18%
14	000839	中信国安	65,873,947.07	38.17%
15	600895	张江高科	65,596,000.51	38.01%
16	000680	山推股份	63,816,372.29	36.98%
17	600478	科力远	61,123,623.31	35.42%
18	600416	湘电股份	56,368,792.56	32.66%
19	000686	东北证券	54,717,652.04	31.70%
20	000903	云内动力	53,206,067.83	30.83%

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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值前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	600030	中信证券	287,808,124.05	166.76%
2	000001	深发展A	96,720,833.73	56.04%
3	600549	厦门钨业	95,103,166.31	55.10%
4	600331	宏达股份	91,346,967.10	52.93%
5	000960	锡业股份	82,878,383.64	48.02%
6	600111	包钢稀土	82,320,875.92	47.70%
7	600478	科力远	77,676,762.83	45.01%
8	600050	中国联通	72,290,085.00	41.89%
9	600895	张江高科	69,665,864.28	40.37%
10	000680	山推股份	68,424,387.59	39.65%
11	600872	中炬高新	68,350,958.85	39.60%
12	600837	海通证券	63,069,746.33	36.54%
13	000839	中信国安	62,907,588.93	36.45%
14	600150	中国船舶	59,822,030.88	34.66%
15	600109	国金证券	56,520,066.72	32.75%
16	000686	东北证券	56,114,668.98	32.51%
17	000903	云内动力	55,144,959.89	31.95%
18	600037	歌华有线	51,113,455.07	29.62%
19	000636	风华高科	49,853,714.96	28.89%
20	600036	招商银行	46,644,504.94	27.03%

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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元