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%。
业绩比较基准	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%。
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。

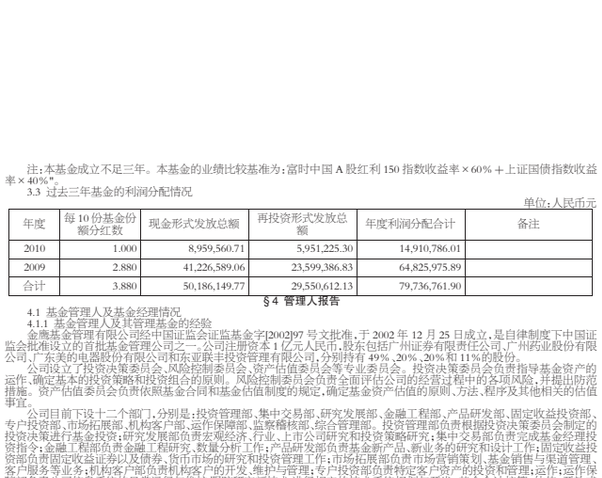
3.2 基金净值表现

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(%)
过去三个月	10.71	1.68	3.73	1.02	6.98	0.66
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: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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
蔡飞鸣	投资决策委员会委员、基金经理	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投诉、以及投资、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和深证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,市场波位下行,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转暖的时机,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
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×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×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