金鹰成份股优选证券投资基金 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:中国银行股份有限公司
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。

基金托管人中国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。

本报告期自2010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	金鹰成份优选混合
基金主代码	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
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
报告期末基金份额总额	2,084,389,402.91份
基金合同存续期	不定期

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	本基金通过综合分析宏观经济、政策及证券市场的现状和发展趋势的基础上,合理预期各类别资产收益率和风险水平,并据此构建一个包括主要投资于上证180指数成份股和深证100指数成份股、国债等债券及现金等资产的投资组合,适时调整组合中各类别资产的比例,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、稳定的当前收益。
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%的中信标普国债指数的收益率。@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、预期收益水平适中的证券投资基金。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	苏文锋	唐州徽
	联系电话	020-83282627	010-66594855
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	tgcxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		4006-135-888,020-83936180	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号江湾商业中心大厦22层

§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	8,970,043.48	496,310,220.89	-1,197,551,244.49
本期利润	68,861,789.78	799,258,254.33	-1,537,030,746.98
加权平均基金份额本期利润	0.0305	0.3186	-0.5498
本期基金份额净值增长率(%)	4.36	62.19	-51.43
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	0.0106	0.0796	-0.1566
期末基金资产净值	1,598,901,057.58	1,823,824,757.77	1,347,319,514.68
期末基金份额净值	0.7671	0.8087	0.4986

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;
2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	6.07	1.60	4.78	1.32	1.29	0.28
过去六个月	23.29	1.39	15.09	1.15	8.20	0.24
过去一年	4.36	1.34	-9.37	1.18	13.73	0.16
过去三年	-17.78	1.77	-28.30	1.75	10.52	0.02
过去五年	230.86	1.68	175.72	1.64	55.14	0.04
自基金合同生效起至今	197.29	1.47	126.91	1.44	70.38	0.03

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、截至报告日本基金的各项投资比例符合本基金基金合同规定的各项比例,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、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%的中信标普国债指数的收益率。
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

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年	0.750	69,555,920.98	98,115,956.88	167,671,877.86	权益登记日、除息日:2010年1月18日
2009年	0.000	0.00	0.00	0.00	-
2008年	0.800	55,322,659.50	112,735,891.28	168,058,550.78	权益登记日、除息日:2008年1月10日
合计	1.550	124,878,580.48	210,851,848.16	335,730,428.64	

§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;金融工程部负责建立和完善公司量化投资支持体系以及量化产品的投资管理工作,为基金投资管理与决策、基金投资风险管理与绩效分析、数量化投资产品开发与管理等提供定量研究支持;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		
杨绍基	投资管理部总监,基金经理	2009年9月8日	-	6年	杨绍基先生,经济学博士,证券从业经历六年。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,先后担任行业研究员、基金经理助理、基金经理、研究发展部副总监等职,现任公司投资管理部总监、投资决策委员会委员,兼任金鹰中小盘精选证券投资基金、金鹰稳健成长股票型证券投资基金及本基金基金经理。

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《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》及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,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

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。六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

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

2010年A股市走出类"V"型走势,两头高,中间低,基本围绕2500-3000点之间震荡。在积极财政政策和极度宽松货币政策扶持下,房地产、农产品等资产价格泡沫和通胀压力加速呈现,政府持续调控房地产和收紧货币信贷政策,市场年中和年末皆出现大幅调整行情,上证综指年末收于2808.08点,全年跌幅达到14.31%。风格表现上,小盘股持续优于大盘股,中小板综指全年上涨28.38%,大市值板块不少仅在九、十月份有较好表现。

本基金全年策略基本围绕"战略新兴产业"、"消费市局",成为战胜基准的关键。战略新兴产业主要围绕新能源与通信软件股布局,但大市值个股涨幅明显滞后并小于同板块小盘股,对于高端装备制造个股配比不高,也错失了相关机会。消费主要围绕医药、商业、食品饮料和旅游布局,但四季度减仓不及时导致收益没有充分兑现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2010年12月31日,基金份额净值为0.7671元,本报告期份额净值增长率为4.36%,同期业绩比较基准收益率为-9.37%。

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年的证券市场,我们认为宏观经济形势趋向复杂化导致A股总体可能仍然只有震荡走势。宏观面上,美欧日二次经济刺激政策和定量宽松货币政策可能改善经济增长预期,国内宏观调控政策密集出台后尚需观察成效,国内房地产调控与通胀预期管理能否达到效果仍将是改变投资人预期的主要因素。如果以美国为首发达国家经济持续复苏,则累计涨幅较大的不少大宗商品的金融属性将遭遇货币转向预期而可能回调。而如果国内通胀上升势头得到抑制并且经济增速趋向下滑,则宏观调控风险降低,以金融地产为代表的传统产业估值修复行情值得期待,此外,新一年的投资和消费热点也是布局全年的投资线索。

不确定的是,货币政策收紧与房地产调控是否超调而加大经济系统性风险,如果预见到则降低仓位。

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,本公司还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、运作保障部部门负责人、投资管理部总监、基金经理、基金会计和相关人员组成。在特殊情况下,公司估值召集估值委员会会议,讨论和决策特殊估值事项,估值委员会问题决策,需到会的三分之二估值委员会成员表决通过。

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。

本报告期内,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

截至报告期末,本基金可分配利润为22,148,785.20元。本基金管理人决定2010年12月31日的可分配收益为基准,对2010年利润进行如下分配安排:向本基金份额持有人按每10份基金份额派发现金红利0.100元,分红权益登记日为2011年1月11日,除息日为2011年1月11日。本次利润分配总金额为20,792,103.76元,其中现金形式发放总额为8,535,601.88元,再投资形式发放总额为12,256,501.88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

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,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§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:金鹰成份股优选证券投资基金

报告截止日:2010年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	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	7.4.7.1	33,824,680.60	47,849,210.33
结算备付金		2,918,271.86	7,603,630.36
存出保证金		1,404,544.52	2,667,893.08
交易性金融资产	7.4.7.2	1,563,562,687.31	1,777,087,202.61
其中:股票投资		1,219,960,709.71	1,397,311,073.21
?????? 基金投资		-	-
?????? 债券投资		343,601,977.60	379,776,129.40
?????? 资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产	7.4.7.3	290,000,995.00	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.4	2,873,203.95	5,367,917.20
应收股利		-	-
应收申购款		114,599.04	135,300.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		1,894,698,982.28	1,840,711,153.58
负债和所有者权益	附注号	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		290,000,000.00	-
应付证券清算款		96,573.60	6,861,991.68
应付赎回款		358,121.17	3,137,420.90
应付管理人报酬		2,079,872.72	2,317,518.23
应付托管费		346,645.44	386,253.04
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.6	1,488,350.18	2,631,027.28
应交税费		-	-
应付利息		5,853.26	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.7	1,422,508.33	1,552,184.68
负债合计		295,797,924.70	16,886,395.81
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.8	1,365,588,083.36	1,477,511,980.02
未分配利润	7.4.7.9	233,312,974.22	346,312,777.75
所有者权益合计		1,598,901,057.58	1,823,824,757.77
负债和所有者权益总计		1,894,698,982.28	1,840,711,153.58

注:报告截止日2010年12月31日,基金份额净值0.7671元,基金份额总额2,084,389,402.91份。

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:2010年1月1日至2010年12月31日)

单位:人民币元

项 目	附注号	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		111,230,910.04	859,211,537.07
1.利息收入		11,644,637.33	11,434,362.61
其中:存款利息收入	7.4.7.10	587,710.51	673,790.06
债券利息收入		10,182,275.28	10,760,572.55
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		874,651.54	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		39,344,982.05	544,298,437.71
其中:股票投资收益	7.4.7.11	37,613,236.73	538,300,777.25
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	-5,035,707.46	-47,305.24
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-	-
股利收益	7.4.7.14	6,767,452.78	6,044,965.70
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.15	59,891,746.30	302,948,033.44
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.16	349,544.36	530,703.31
减:二、费用		42,369,120.26	59,953,282.74
1.管理人报酬		24,368,920.88	25,394,247.00
2.托管费		4,061,486.78	4,232,374.50
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.17	12,571,788.74	29,957,156.46
5.利息支出		979,454.57	-
其中:卖出回购金融资产支出		979,454.57	-
6.其他费用	7.4.7.18	387,469.29	369,504.78
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		68,861,789.78	799,258,254.33
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		68,861,789.78	799,258,254.33

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: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)	1,477,511,980.02	346,312,777.75	1,823,824,757.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	68,861,789.78	68,861,789.78
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)	-111,923,896.66	-14,189,715.45	-126,113,612.11
其中:1.基金申购款	128,289,845.09	18,493,122.28	146,782,967.37
2.基金赎回款	-240,213,741.75	-32,682,837.73	-272,896,579.48
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)	-	-167,671,877.86	-167,671,877.86
五、期末所有者权益(基金净值)	1,365,588,083.36	233,312,974.22	1,598,901,057.58
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)	1,770,446,446.85	-423,126,932.17	1,347,319,514.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	799,258,254.33	799,258,254.33
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)	-292,934,466.83	-29,818,544.41	-322,753,011.24
其中:1.基金申购款	86,562,933.98	5,783,635.49	92,346,569.47
2.基金赎回款	-379,497,400.81	-35,602,179.90	-415,099,580.71
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,477,511,980.02	346,312,777.75	1,823,824,757.77

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
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
东亚联丰投资管理有限公司	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

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。

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: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)	
	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	776,078,614.04	9.56	2,788,628,222.23	14.30

7.4.2.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内均没有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.2.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内均无通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.2.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内均无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:人民币元

关联方名称	本期(2010年1月1日至2010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	630,571.76	9.24	188,174.61	12.64
关联方名称	上年度可比期间(2009年1月1日至2009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	2,265,788.31	13.90	0.00	0.00

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: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	24,368,920.88	25,394,247.00
其中:应支付给销售机构的客户维护费	374,885.40	325,641.93

注:1、基金管理费按前一日基金资产净值的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。本基金本年应支付基金管理人管理费共人民币24,368,920.88元(2009年:人民币25,394,247.00元),其中已支付人民币22,289,048.16元,尚余人民币2,079,872.72元未支付。

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	4,061,486.78	4,232,374.50

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

本基金本报告期内及上年度可比区间内均无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

本基金本报告期内及上年度可比期间内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

本基金本报告期内及上年度可比期间内均无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

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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
中国银行	33,824,680.60	540,193.81	47,849,210.33	565,048.23

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,2010年度期末余额2,918,271.86元,清算备付金利息收入45,720.74元,2009年度期末余额7,603,630.36元,清算备付金利息收入106,930.16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

本基金本报告期内及上年度可比期间内均无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等流通受限股票

本基金无期末持有的暂时停牌等流通受限股票。

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

截至本报告期末2010年12月31日止,本基金无银行间市场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

截至本报告期末2010年12月31日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额290,000,000.00元,于2011年1月4日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

§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	1,219,960,709.71	64.39
	其中:股票	1,219,960,709.71	64.39
2	固定收益投资	343,601,977.60	18.13
	其中:债券	343,601,977.60	18.13
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	290,000,995.00	15.31
	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	36,742,952.46	1.94
6	其他各项资产	4,392,347.51	0.23
7	合计	1,894,698,982.28	100.00

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	19,530,000.00	1.22
C	制造业	494,944,230.76	30.96
C0	食品、饮料	97,664,948.60	6.11
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	24,862,531.20	1.55
C5	电子	144,815,653.50	9.06
C6	金属、非金属	17,950,739.28	1.12
C7	机械、设备、仪表	149,952,358.18	9.38
C8	医药、生物制品	59,698,000.00	3.73
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	30,720,356.64	1.92
G	信息技术业	138,363,000.00	8.65
H	批发和零售贸易	178,483,000.00	11.16
I	金融、保险业	105,011,414.20	6.57
J	房地产业	94,541,868.00	5.91
K	社会服务业	66,131,840.11	4.14
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	92,235,000.00	5.77
	合计	1,219,960,709.71	76.30

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	002129	中环股份	5,184,950	144,815,653.50	9.06
2	000009	中国宝安	5,500,000	92,235,000.00	5.77
3	600100	同方股份	3,000,000	79,530,000.00	4.97
4	600812	华北制药	3,800,000	59,698,000.00	3.73
5	600631	百联股份	3,800,000	57,950,000.00	3.62
6	600376	首开股份	3,200,000