

金鹰稳健成长股票型证券投资基金 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:中国工商银行股份有限公司
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
基金管理人承诺,遵循诚实信用原则,勤勉尽责,恪守职业道德,诚实守信,并保证其内容的真实性、准确性和完整性,并承担相应的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事审核同意,并由董事长签发。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年3月28日复核了本报告中的财务指标、净值、基金份额变动、净值增长率、投资组合比例等内容,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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。投资有风险,投资者在作出投资决策前请咨询专业人士的意见,并自行承担相应的投资风险。
本报告材料未经审计,立信羊城会计师事务所有限公司为基金资产托管事宜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,应当阅读年度报告正文。
本报告自2010年4月14日起于12月31日止。

§2 基金概况

2.1 基金基本情况	
基金名称	金鹰稳健成长股票型证券投资基金
代码	210001
基金运作方式	契约型开放式
基金存续日期	2010年4月14日
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金注册登记机构	400.400.293.010
基金的销售机构	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以追求长期资本增值为目标,在追求基金资产稳健增值的基础上,力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采取“自上而下”的资产配置策略,在资产配置的基础上,采取“自下而上”的个股投资策略,重点投资于具有良好成长性、业绩优良、估值合理的上市公司。本基金采取“分散投资、动态调整”的投资策略,通过分散投资降低个股风险,通过动态调整把握市场机会。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×95%+中证全指指数收益率×5%
风险收益特征	本基金为主动管理的股票型证券投资基金,属于证券投资基金中的高风险、高收益品种。

2.3 基金管理人及基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	金鹰基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
住所	苏州	北京
法定代表人	赵廷斌	姜建清
总经理	赵廷斌	姜建清
基金托管部负责人	张军	张军
联系电话	400-135-888 020-4328227	010-66107799
传真	020-4328226	010-66107799
客户服务电话	020-4328226	95588
网址	020-4328226	020-66107799
基金管理人网址	http://www.gefund.com.cn	
基金年度报告备置地点	http://www.gefund.com.cn	

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要财务指标和财务指标	
单位:人民币元	
3.1.1 期间数据	2010年
本期利润总额	52,284,953.24
净利润	99,730,243.77
期末可供分配利润	4,146
期末未分配利润	25.41
3.1.2 年度数据	2010年
期末可供分配利润	0.0224
期末未分配利润	431,083,922.06
期末可供分配基金份额	1,071

注:1、本基金基金合同于2010年4月14日正式成立,截至2010年12月31日,基金成立不足一年。
2、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。
3、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
4、期末可供分配利润,采用期末资产负债表未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰孰数(仍为期末,不是当期发生数)。

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	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	基金份额净值增长率-业绩比较基准收益率	①-②	③-④
最近三个月	16.43	1.82	14.61	1.32	0.50
最近六个月	31.60	1.80	29.80	16.71	0.44
基金成立以来	25.41	1.31	-5.16	1.28	20.60

3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩比较基准变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

年度	业绩比较基准
2010	2006.02.09.11 - 23.779.291.29 - 24.405.680.70
2011	2006.02.09.11 - 23.779.291.29 - 24.405.680.70

注:本基金成立于2010年4月14日,截至2010年12月31日,基金成立不足一年,其实际业绩与业绩比较基准进行比较,其实际业绩与业绩比较基准的偏差,其实际业绩与业绩比较基准的偏差,其实际业绩与业绩比较基准的偏差。

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

年度	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	基金份额净值增长率-业绩比较基准收益率
2010	25.41%	1.31%	-5.16%
2009	16.43%	1.82%	14.61%
2008	31.60%	1.80%	29.80%
2007	25.41%	1.31%	-5.16%
2006	25.41%	1.31%	-5.16%

注:本基金基金合同于2010年4月14日正式生效,截至2010年12月31日,本基金成立不足一年。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及其基金投资情况
4.1.1 基金管理人及其管理基金的情况
金鹰基金管理有限公司(以下简称“公司”)经中国证监会核准,于2002年12月25日正式成立,是自律性中国证券投资基金业协会会员。公司注册资本1亿元人民币,股东包括广州证券股份有限公司、广州证券股份有限公司、广东证券股份有限公司和亚非资产管理(香港)有限公司,分别为49%、20%、20%和11%的股权。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运作,确定基金投资策略和资产配置;风险控制委员会负责全面评估公司运营中的各项风险,并提出防范措施;资产估值委员会负责基金估值和基金估值制度的制定,确定基金估值的原则、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、研究发展部、集中交易部、产品管理部、固定收益管理部、市场部、风险控制部、运营管理部、监察稽核部、综合管理部、投资管理部的下设投资决策委员会、风险控制委员会、资产估值委员会;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的投资指令;产品管理部负责建立和完善公司量化投资体系及衍生品(产品)的投资管理工作,为基金投资管理提供决策、基金投资风险管理与绩效分析;数量化投资产品开发和策略研究;产品管理部负责基金新产品、新业务的研究和设计与工作;固定收益管理部负责固定收益证券、货币市场产品的投资管理;市场部负责基金市场营销策略、基金销售与渠道管理、客户服务等业务;风险控制部负责客户资产的风险评估、专户投资风险特定客户资产的管理和监督;运营管理部负责基金信息系统的日常运行与维护、跟踪研究技术,进行相关的技术规划与开发、基金会计核算、估值、开放式基金申购、赎回和清算等业务;监察稽核部负责对基金和公司业务及员工遵守国家法律法规、基金合同和行业自律规则等情况进行监督检查;综合管理部负责公司企业文化建设、文档管理、公司财务、后勤保障、人力资源、薪酬福利、人事培训、绩效考核等综合事务。
截至2010年12月31日,公司共有管理金鹰稳健成长股票型证券投资基金、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 基金管理人及其基金投资情况

注:1、任职日期和离任日期指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各项基金合同、基金托管协议、基金合同等基金合同的有关规定,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,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作合法合规,没有出现重大违法违规行为,无损害基金份额持有人合法权益的行为。
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,研究、制定、完善和严格执行公平交易制度,确保公平交易制度的有效执行。报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度,确保公平交易制度的有效执行。报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度,确保公平交易制度的有效执行。
4.3.2 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,全球市场跌宕起伏,分化明显。上证指数全年下跌14.3%,在全部主要股票市场中排名垫底,而中小板指数全年上涨28.9%,相当数量的个股涨幅超50%。报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度,确保公平交易制度的有效执行。报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度,确保公平交易制度的有效执行。
4.4.2 报告期内基金业绩表现
截至2010年12月31日,本基金净值增长率为25.41%,同期业绩比较基准收益率为1.31%,基金份额净值增长率为25.41%,同期业绩比较基准收益率为1.31%。

注:本基金基金合同于2010年4月14日正式生效,截至2010年12月31日,基金成立不足一年,其实际业绩与业绩比较基准进行比较,其实际业绩与业绩比较基准的偏差,其实际业绩与业绩比较基准的偏差,其实际业绩与业绩比较基准的偏差。

4.5 基金管理人及其基金投资情况

注:1、任职日期和离任日期指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各项基金合同、基金托管协议、基金合同等基金合同的有关规定,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,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作合法合规,没有出现重大违法违规行为,无损害基金份额持有人合法权益的行为。
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,研究、制定、完善和严格执行公平交易制度,确保公平交易制度的有效执行。报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度,确保公平交易制度的有效执行。报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度,确保公平交易制度的有效执行。
4.3.2 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,全球市场跌宕起伏,分化明显。上证指数全年下跌14.3%,在全部主要股票市场中排名垫底,而中小板指数全年上涨28.9%,相当数量的个股涨幅超50%。报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度,确保公平交易制度的有效执行。报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度,确保公平交易制度的有效执行。
4.4.2 报告期内基金业绩表现
截至2010年12月31日,本基金净值增长率为25.41%,同期业绩比较基准收益率为1.31%,基金份额净值增长率为25.41%,同期业绩比较基准收益率为1.31%。

大资管业务进行实质性结构调整。报告期内,本基金最大的失误在于低估了美国四国后行情的发展,导致在2000点位置过早抛出重仓股,有色、煤炭等蓝筹股表现,在后期反弹的过程中,表现欠佳于大盘。

4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现
截至2010年12月31日,基金份额净值为1.071元,本报告期份额净值增长率为25.41%,同期业绩比较基准收益率为-5.16%。
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,中国经济将保持平稳较快增长,以美国为代表的发达经济体复苏将是主线,旱涝过程仍不断,2011年是十二五开局之年,是我国产业结构调整和新产业领域投资的起步之年,转变投资、出口拉动的传统经济模式,扩大内需,提高自主创新能力,提高服务业在GDP增长中的比重,是未来经济调整的方向,相关上市公司将持续受益,盈利能力和成长性。对于证券市场而言,政策仍是影响投资者预期的关键变量,和顺、健康、渐进”的有机衔接和良性互动对宏观经济调整和优化结构的协调,正成为市场影响将是双向的,市场的运行预计仍呈现区间震荡特征。基于对推动经济转型的决心,我们长期看好战略性新兴产业,七大战略性新兴产业领域的投资机会将给市场带来新的投资机会。总体而言,我们高度关注未来这些行业和主题的投资机会,包括:清洁能源,高效节能电子器件,以高技术产业,“大”新兴产业,核电、风电、环保节能机械,节能环保机械等为代表的高端装备制造业,医药、农林牧渔、食品饮料为代表的消费类,新兴产业的新一代信息技术。此外,央企重组将是未来A股市场的重要看点。
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《证券投资基金估值业务指导意见》(证监会公告[2009]22号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外公布。本年内,本中期末估值复核与基金会计账目的核对均顺利完成。
4.7 报告期内基金管理人参与股指期货交易情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金股指期货交易指引》(证监会公告[2010]123号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外公布。本年内,本中期末估值复核与基金会计账目的核对均顺利完成。

4.8 基金管理人参与股指期货交易情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金股指期货交易指引》(证监会公告[2010]123号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外公布。本年内,本中期末估值复核与基金会计账目的核对均顺利完成。

4.9 基金管理人参与股指期货交易情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金股指期货交易指引》(证监会公告[2010]123号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外公布。本年内,本中期末估值复核与基金会计账目的核对均顺利完成。

4.10 基金管理人参与股指期货交易情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金股指期货交易指引》(证监会公告[2010]123号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外公布。本年内,本中期末估值复核与基金会计账目的核对均顺利完成。

4.11 基金管理人参与股指期货交易情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金股指期货交易指引》(证监会公告[2010]123号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外公布。本年内,本中期末估值复核与基金会计账目的核对均顺利完成。

4.12 基金管理人参与股指期货交易情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金股指期货交易指引》(证监会公告[2010]123号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外公布。本年内,本中期末估值复核与基金会计账目的核对均顺利完成。

4.13 基金管理人参与股指期货交易情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金股指期货交易指引》(证监会公告[2010]123号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外公布。本年内,本中期末估值复核与基金会计账目的核对均顺利完成。

4.14 基金管理人参与股指期货交易情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金股指期货交易指引》(证监会公告[2010]123号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外公布。本年内,本中期末估值复核与基金会计账目的核对均顺利完成。

4.15 基金管理人参与股指期货交易情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金股指期货交易指引》(证监会公告[2010]123号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外公布。本年内,本中期末估值复核与基金会计账目的核对均顺利完成。

4.16 基金管理人参与股指期货交易情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金股指期货交易指引》(证监会公告[2010]123号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外公布。本年内,本中期末估值复核与基金会计账目的核对均顺利完成。

4.17 基金管理人参与股指期货交易情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金股指期货交易指引》(证监会公告[2010]123号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外公布。本年内,本中期末估值复核与基金会计账目的核对均顺利完成。

4.18 基金管理人参与股指期货交易情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金股指期货交易指引》(证监会公告[2010]123号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外公布。本年内,本中期末估值复核与基金会计账目的核对均顺利完成。

4.19 基金管理人参与股指期货交易情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金股指期货交易指引》(证监会公告[2010]123号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外公布。本年内,本中期末估值复核与基金会计账目的核对均顺利完成。

4.20 基金管理人参与股指期货交易情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金股指期货交易指引》(证监会公告[2010]123号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外公布。本年内,本中期末估值复核与基金会计账目的核对均顺利完成。

4.21 基金管理人参与股指期货交易情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金股指期货交易指引》(证监会公告[2010]123号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外公布。本年内,本中期末估值复核与基金会计账目的核对均顺利完成。

4.22 基金管理人参与股指期货交易情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金股指期货交易指引》(证监会公告[2010]123号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外公布。本年内,本中期末估值复核与基金会计账目的核对均顺利完成。

4.23 基金管理人参与股指期货交易情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金股指期货交易指引》(证监会公告[2010]123号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外公布。本年内,本中期末估值复核与基金会计账目的核对均顺利完成。

4.24 基金管理人参与股指期货交易情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金股指期货交易指引》(证监会公告[2010]123号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外公布。本年内,本中期末估值复核与基金会计账目的核对均顺利完成。

4.25 基金管理人参与股指期货交易情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金股指期货交易指引》(证监会公告[2010]123号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外公布。本年内,本中期末估值复核与基金会计账目的核对均顺利完成。

4.26 基金管理人参与股指期货交易情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金股指期货交易指引》(证监会公告[2010]123号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外公布。本年内,本中期末估值复核与基金会计账目的核对均顺利完成。

4.27 基金管理人参与股指期货交易情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金股指期货交易指引》(证监会公告[2010]123号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外公布。本年内,本中期末估值复核与基金会计账目的核对均顺利完成。

4.28 基金管理人参与股指期货交易情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金股指期货交易指引》(证监会公告[2010]123号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外公布。本年内,本中期末估值复核与基金会计账目的核对均顺利完成。

4.29 基金管理人参与股指期货交易情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金股指期货交易指引》(证监会公告[2010]123号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外公布。本年内,本中期末估值复核与基金会计账目的核对均顺利完成。

4.30 基金管理人参与股指期货交易情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金股指期货交易指引》(证监会公告[2010]123号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外公布。本年内,本中期末估值复核与基金会计账目的核对均顺利完成。

4.31 基金管理人参与股指期货交易情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金股指期货交易指引》(证监会公告[2010]123号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外公布。本年内,本中期末估值复核与基金会计账目的核对均顺利完成。

4.32 基金管理人参与股指期货交易情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金股指期货交易指引》(证监会公告[2010]123号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外公布。本年内,本中期末估值复核与基金会计账目的核对均顺利完成。

4.33 基金管理人参与股指期货交易情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金股指期货交易指引》(证监会公告[2010]123号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外公布。本年内,本中期末估值复核与基金会计账目的核对均顺利完成。

4.34 基金管理人参与股指期货交易情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金股指期货交易指引》(证监会公告[2010]123号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外公布。本年内,本中期末估值复核与基金会计账目的核对均顺利完成。

4.35 基金管理人参与股指期货交易情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金股指期货交易指引》(证监会公告[2010]123号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外公布。本年内,本中期末估值复核与基金会计账目的核对均顺利完成。

4.36 基金管理人参与股指期货交易情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金股指期货交易指引》(证监会公告[2010]123号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外公布。本年内,本中期末估值复核与基金会计账目的核对均顺利完成。

4.37 基金管理人参与股指期货交易情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金股指期货交易指引》(证监会公告[2010]123号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外公布。本年内,本中期末估值复核与基金会计账目的核对均顺利完成。

4.38 基金管理人参与股指期货交易情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金股指期货交易指引》(证监会公告[2010]123号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外公布。本年内,本中期末估值复核与基金会计账目的核对均顺利完成。

4.39 基金管理人参与股指期货交易情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金股指期货交易指引》(证监会公告[2010]123号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外公布。本年内,本中期末估值复核与基金会计账目的核对均顺利完成。

4.40 基金管理人参与股指期货交易情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金股指期货交易指引》(证监会公告[2010]123号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外公布。本年内,本中期末估值复核与基金会计账目的核对均顺利完成。

4.41 基金管理人参与股指期货交易情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金股指期货交易指引》(证监会公告[2010]123号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外公布。本年内,本中期末估值复核与基金会计账目的核对均顺利完成。

4.42 基金管理人参与股指期货交易情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金股指期货交易指引》(证监会公告[2010]123号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外公布。本年内,本中期末估值复核与基金会计账目的核对均顺利完成。

4.43 基金管理人参与股指期货交易情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金股指期货交易指引》(证监会公告[2010]123号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外公布。本年内,本中期末估值复核与基金会计账目的核对均顺利完成。

4.44 基金管理人参与股指期货交易情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金股指期货交易指引》(证监会公告[2010]123号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外公布。本年内,本中期末估值复核与基金会计账目的核对均顺利完成。

4.45 基金管理人参与股指期货交易情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金股指期货交易指引》(证监会公告[2010]123号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外公布。本年内,本中期末估值复核与基金会计账目的核对均顺利完成。

4.46 基金管理人参与股指期货交易情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金股指期货交易指引》(证监会公告[2010]123号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外公布。本年内,本中期末估值复核与基金会计账目的核对均顺利完成。

4.47 基金管理人参与股指期货交易情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金股指期货交易指引》(证监会公告[2010]123号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外公布。本年内,本中期末估值复核与基金会计账目的核对均顺利完成。

4.48 基金管理人参与股指期货交易情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金股指期货交易指引》(证监会公告[2010]123号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外公布。本年内,本中期末估值复核与基金会计账目的核对均顺利完成。

4.49 基金管理人参与股指期货交易情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金股指期货交易指引》(证监会公告[2010]123号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外公布。本年内,本中期末估值复核与基金会计账目的核对均顺利完成。

4.50 基金管理人参与股指期货交易情况
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金股指期货交易指引》(证监会公告[2010]123号)和《证券投资基金会计核算业务指引》(证监会公告[2009]15号)等有关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同基金托管人一起执行,基金估值由本基金管理人完成估值,且本基金管理人复核无误后由基金管理人对外