

金鹰中小盘精选证券投资基金

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：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

本基金管理人的董事会及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。

本基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同的规定，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、财务会计报告相关内容、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。

本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	金鹰中小盘精选混合
基金主代码	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
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	1,174,304,834.16 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	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	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

较基准	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	021-32169999
	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 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	207,412,303.32	279,676,478.80	-69,167,673.43
本期利润	252,406,176.45	362,829,670.69	-81,146,150.88
加权平均基金份额本期利润	0.2272	0.5994	-0.6735
本期基金份额净值增长率 (%)	18.47	80.48	-35.03
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	0.2616	0.5013	-0.0071
期末基金资产净值	1,481,467,449.17	1,101,938,898.61	172,586,314.12
期末基金份额净值	1.2616	1.5013	0.9929

注：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。

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

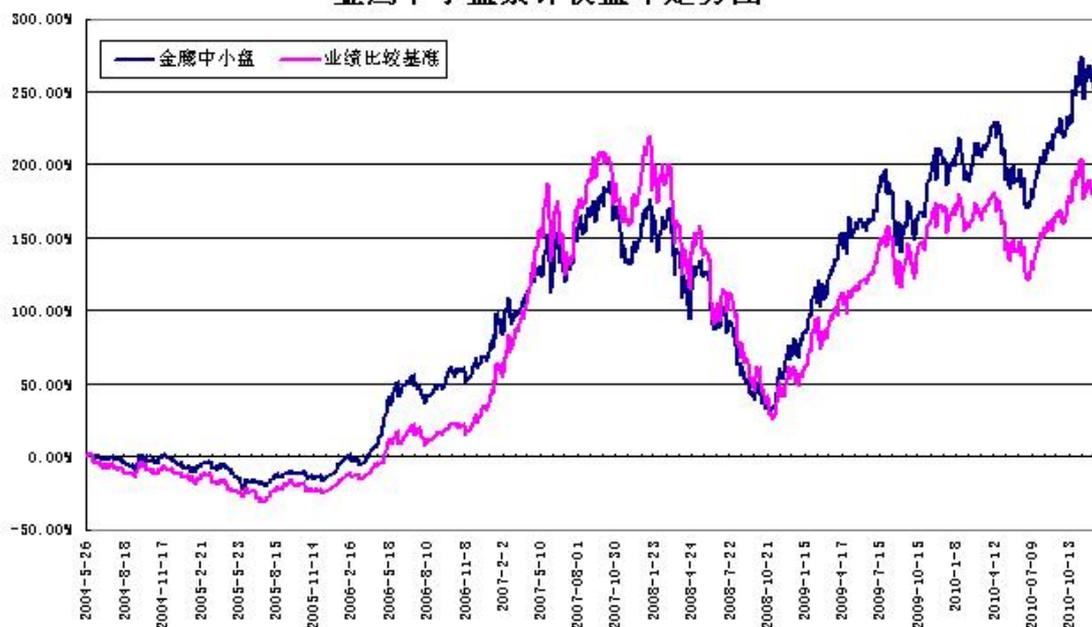
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益	①—③ (%)	②—④ (%)
----	----------	----------	----------	----------	---------	---------

	(%)	准差② (%)	率③ (%)	率标准差 ④ (%)		
过去三个月	10.70	1.54	5.16	1.43	5.54	0.11
过去六个月	31.61	1.31	23.73	1.27	7.88	0.04
过去一年	18.47	1.31	3.83	1.29	14.64	0.02
过去三年	38.92	1.80	-6.16	1.88	45.08	-0.08
过去五年	300.17	1.70	250.61	1.77	49.56	-0.07
自基金合同生效起至今	258.05	1.56	178.31	1.64	79.74	-0.08

注：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。所采用的指数均是市场公开披露的指数。

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

金鹰中小盘累计收益率走势图

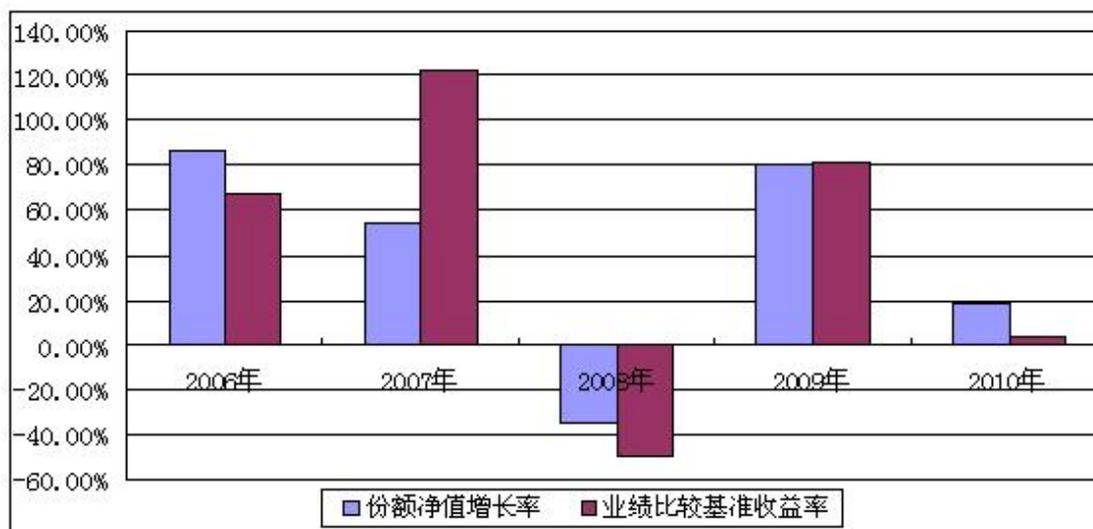


注：1、截至报告日本基金的各项投资比例符合基金合同规定的各项比例，即本基金的股票投资占基金资产总值的比例为 50%到 80%，债券投资占基金资产总值的比例为 20%到 40%，现金占基金资产总值的比例不超过 10%。2、本基金的业绩比较基准为：75%的股票投资比较基准加上 25%的债券投资比较基准。股

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。

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	4.500	194,463,902.81	133,655,395.68	328,119,298.49	
2009年	2.300	45,700,764.63	40,369,706.71	86,070,471.34	
2008年	0.600	4,121,829.29	3,974,814.68	8,096,643.97	
合计	7.400	244,286,496.73	177,999,917.07	422,286,413.80	

§ 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		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, 兼任本基金基金经理及金鹰成份股优选证券投资基金基金经理、金鹰稳健成长股票型证券投资基金基金经理。
朱丹	金鹰中小盘精选证券投资基金基金经理	2010年7月30日	-	4年	朱丹女士, 金融学硕士, 曾任职于深圳晨星咨询公司, 2007年5月加入金鹰基金管理有限公司, 先后担任行业研究员、研究组长、基金经理助理等职, 现任本基金基金经理。

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颁布的《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定; 3、经金鹰基金管理有限公司第三届董事会审议通过, 增聘朱丹女士担任金鹰中小盘精选证券投资基金基金经理, 与现任基金经理杨绍基先生共同管理该基金, 上述变更事项于2010年7月30日公开披露。

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、《金鹰中小盘精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, 为基金份额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, 无损害基金份额持有人利益的行为。

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，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 股市场剧烈震荡，分化明显。上证指数全年下跌 14.3%，在全球主要股票市场中基本垫底，而中小板综指全年上涨 28.3%，相当数量的个股涨幅翻番。报告期内 A 股市场的运行泾渭分明，上半年震荡向下，上证指数最大跌幅达 29.5%，下半年震荡向上，上证指数最高涨幅达 37.3%，中小板综指更创出历史新高，最高涨幅高达 63%。报告期内 A 股市场的大幅震荡和个股严重分化时刻考验着我们的投资策略和交易的心理强度，我们全年做得最为正确的一件事就是坚持年初制定的“弃大扬小，舍旧求新”的八字投资策略。在流动性趋紧、经济结

构转型方向逐步明朗、地产调控力度空前的背景下，中小盘股的投资机会好于大盘股，与新经济增长模式相关行业的股票投资机会好于旧的投资出口拉动经济增长模式下的传统行业股票。沿着这一投资逻辑，我们全年重点配置电子元器件、信息技术、机械、医药、商业零售，以及新能源、节能环保、智能电网、物联网、三网融合、大消费等主题相关的股票。虽然全年交易过众多平庸的股票，但通过不懈的努力和持续的跟踪，我们仍幸运地在以上的行业和投资主题中找到一些前景光明、市场空间巨大、受政策鼓励、盈利增速持续向好的优质股票。报告期内，我们最大的失误在于对市场运行趋势未有明确判别的情况下，经常为寻找低估值股票的“估值修复行情”而最终掉进低估值陷阱中，代表性失误是二季度对银行股的交易，再次验证了低估值是股价下跌的结果而非股价上涨的原因这句话。对于一只长期专注于投资中小盘成长股的基金来说，坚持自己的投资风格远比时刻准备买入低估值股票赚取“估值修复”的股价波动收益更为重要。

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 1.2616 元，本报告期份额净值增长率为 18.47%，同期业绩比较基准收益率为 3.83%。

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继续复苏也将是主线，尽管过程仍不免曲折。2011 年是十二五开局之年，是我国产业结构调整 and 战略新兴产业领域投资的起始之年，转变投资、出口拉动的传统经济增长模式，扩大内需，注重节能减排，提高消费和服务业在 GDP 增长中的占比是未来经济增长新的方向，相关上市公司将持续受益，盈利有望保持稳定增长。对于证券市场而言，政策仍是影响投资人预期的最关键变量，“积极、稳健、审慎、灵活”的相机抉择政策凸显政府对经济调控兼顾宏观和微观的协调性，对证券市场的影响将是双向的，市场的运行预计仍呈区间宽幅震荡特征。基于政府推动经济转型的决心，我们长期看好战略新兴产业，七大战略新兴产业领域的投资将给 A 股市场相关公司带来持续的业绩增长。总体而言，我们高度关注来自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，以高铁产业链、大飞机产业链、核电、海工、环保节能机械、矿用机械等为代表的高端装备制造业，医保、农林牧渔、食品饮料为代表的消费经济，先导产业中的新一代信息技术等。此外，央企重组将可能是全年 A 股市场的投资盛宴。

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。

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

本基金报告期内派发红利一次,登记除权日 2010 年 1 月 18 日,每 10 份基金份额派发 4.50 元,分红总金额 328,119,298.49 元,其中红利再投资 133,655,395.68 元,现金红利 194,463,902.81 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

2010 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 328,119,298.49 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中小盘精选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：金鹰中小盘精选证券投资基金

报告截止日：2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	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	19,954,861.71	5,572,020.43
结算备付金	9,340,083.67	6,342,368.48
存出保证金	1,537,705.07	1,646,138.14
交易性金融资产	1,446,430,494.48	1,074,087,098.26
其中：股票投资	1,133,018,316.88	840,208,002.36
基金投资	-	-
债券投资	313,412,177.60	233,879,095.90
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	12,717,153.49	25,366,144.63
应收利息	2,104,210.41	3,714,901.20
应收股利	-	-
应收申购款	6,295,223.30	1,376,034.59
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,498,379,732.13	1,118,104,705.73
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	6,878,408.07	-
应付赎回款	3,711,280.40	10,872,599.50
应付管理人报酬	1,863,470.19	1,407,331.28
应付托管费	310,578.37	234,555.21
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,708,651.35	2,086,879.55
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,439,894.58	1,564,441.58
负债合计	16,912,282.96	16,165,807.12
所有者权益：		
实收基金	1,174,304,834.16	733,989,990.59
未分配利润	307,162,615.01	367,948,908.02
所有者权益合计	1,481,467,449.17	1,101,938,898.61
负债和所有者权益总计	1,498,379,732.13	1,118,104,705.73

注：报告截止日 2010 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2616 元，基金份额总额

1,174,304,834.16 份

7.2 利润表

会计主体：金鹰中小盘精选证券投资基金

本报告期：（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	288,476,303.88	396,876,827.18
1. 利息收入	8,286,523.30	6,012,971.91
其中：存款利息收入	705,168.25	480,895.53
债券利息收入	7,505,679.84	5,532,076.38
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	75,675.21	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	233,194,848.76	304,311,706.97
其中：股票投资收益	234,253,770.95	305,628,633.12
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-4,355,511.53	-3,591,398.57
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	3,296,589.34	2,274,472.42
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	44,993,873.13	83,153,191.89
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	2,001,058.69	3,398,956.41
减：二、费用	36,070,127.43	34,047,156.49

1. 管理人报酬	18,852,349.82	12,611,965.98
2. 托管费	3,142,058.29	2,101,994.45
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	13,549,258.46	18,960,829.82
5. 利息支出	150,508.69	-
其中：卖出回购金融资产支出	150,508.69	-
6. 其他费用	375,952.17	372,366.24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	252,406,176.45	362,829,670.69
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	252,406,176.45	362,829,670.69

7.3 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：（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）	733,989,990.59	367,948,908.02	1,101,938,898.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	252,406,176.45	252,406,176.45
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）	440,314,843.57	14,926,829.03	455,241,672.60
其中：1. 基金申购款	1,812,641,673.05	263,060,746.12	2,075,702,419.17
2. 基金赎回款	-1,372,326,829.48	-248,133,917.09	-1,620,460,746.57
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）	-	-328,119,298.49	-328,119,298.49
五、期末所有者权益（基金净值）	1,174,304,834.16	307,162,615.01	1,481,467,449.17
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）	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）	-	362,829,670.69	362,829,670.69
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）	560,166,628.00	92,426,757.14	652,593,385.14
其中：1. 基金申购款	2,503,055,936.09	883,123,355.54	3,386,179,291.63
2. 基金赎回款	-1,942,889,308.09	-790,696,598.40	-2,733,585,906.49
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变	-	-86,070,471.34	-86,070,471.34

动(净值减少以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	733,989,990.59	367,948,908.02	1,101,938,898.61

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(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)
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

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	2,103,959,205.32	23.74	1,092,001,982.51	8.72

7.4.2.1.2 权证交易

本基金本年度及上年度可比期间未通过关联方进行权证交易。

7.4.2.1.3 债券交易

本基金本年度及上年度可比期间未通过关联方进行债券交易。

7.4.2.1.4 债券回购交易

本基金本年度及上年度可比期间未通过关联方进行债券回购交易。

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	1,709,484.27	23.08	606,356.45	22.39
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	887,261.70	8.47	666,127.64	31.92

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除中国证券登记结算公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括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等。

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	18,852,349.82	12,611,965.98
其中：应支付给销售机构的客户维护费	3,853,349.56	1,937,353.97

注：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：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

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	3,142,058.29	2,101,994.45

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：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

本基金报告期内及上年度可比期间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

本基金本年度及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（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

本基金本报告期及上年度可比期间内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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	2,111,034.89	0.28

注：本报告期末未有关联方投资本基金情况。

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

交通银行	19,954,861.71	204,142.87	5,572,020.43	143,621.32
------	---------------	------------	--------------	------------

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，在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示。2010 年年末结算备付金余额 9,340,083.67 元，当期结算备付金存款利息收入 491,717.51 元；可比期间 2009 年年末结算备付金余额 6,342,368.48 元，当期结算备付金存款利息收入 329,847.10 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

本基金期末未因认购新发/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
000903	云内动力	2010 年 12 月 8 日	重大不确定事项（与中国兵器装备集团公司进行产权合作的可行性协商）	17.60	2011 年 1 月 7 日	18.80	2,200,000	31,904,002.58	38,720,000.00	-

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	1,133,018,316.88	75.62
	其中：股票	1,133,018,316.88	75.62
2	固定收益投资	313,412,177.60	20.92
	其中：债券	313,412,177.60	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	29,294,945.38	1.96
6	其他各项资产	22,654,292.27	1.51
7	合计	1,498,379,732.13	100.00

注：其他各项资产包括：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、买入返售证券。

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	19,721,360.23	1.33
B	采掘业	75,480,124.05	5.09
C	制造业	599,860,791.84	40.49
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	39,101,311.76	2.64
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	136,758,230.24	9.23
C5	电子	149,844,744.80	10.11
C6	金属、非金属	20,399,986.40	1.38
C7	机械、设备、仪表	232,159,242.53	15.67
C8	医药、生物制品	21,597,276.11	1.46
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	75,784,777.56	5.12
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	27,028,574.43	1.82
G	信息技术业	94,968,537.73	6.41
H	批发和零售贸易	65,515,956.41	4.42
I	金融、保险业	66,755,144.48	4.51
J	房地产业	39,154,391.76	2.64
K	社会服务业	27,204,946.13	1.84
L	传播与文化产业	-	-

M	综合类	41,543,712.26	2.80
	合计	1,133,018,316.88	76.48

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	4,892,114	136,636,744.02	9.22
2	600468	百利电气	1,998,166	71,854,049.36	4.85
3	600378	天科股份	4,060,839	69,846,430.80	4.71
4	601318	中国平安	896,103	50,325,144.48	3.40
5	600268	国电南自	1,788,599	48,435,260.92	3.27
6	000540	中天城投	3,025,762	41,543,712.26	2.80
7	600289	亿阳信通	3,170,642	39,918,382.78	2.69
8	000002	万科A	4,763,308	39,154,391.76	2.64
9	000903	云内动力	2,200,000	38,720,000.00	2.61
10	600056	中国医药	2,300,000	37,536,000.00	2.53

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	600378	天科股份	124,950,109.45	11.34
2	002129	中环股份	116,889,819.82	10.61
3	601318	中国平安	115,479,959.16	10.48
4	002142	宁波银行	101,482,324.09	9.21
5	600468	百利电气	90,181,445.40	8.18
6	600056	中国医药	83,832,685.58	7.61
7	000969	安泰科技	71,281,053.11	6.47
8	600289	亿阳信通	68,787,207.80	6.24
9	601009	南京银行	67,549,158.30	6.13
10	600050	中国联通	64,220,866.07	5.83
11	600176	中国玻纤	61,816,596.45	5.61
12	600226	升华拜克	60,094,187.59	5.45
13	000002	万科A	59,996,932.00	5.44
14	600585	海螺水泥	53,399,791.16	4.85
15	601666	平煤股份	52,594,138.52	4.77
16	600380	健康元	52,515,774.09	4.77
17	000042	深长城	52,302,254.94	4.75
18	601288	农业银行	50,775,676.00	4.61
19	000903	云内动力	49,557,669.38	4.50
20	600894	广钢股份	47,152,408.60	4.28
21	601299	中国北车	47,105,056.30	4.27
22	600268	国电南自	46,703,819.45	4.24

23	600107	美尔雅	44,395,377.62	4.03
24	601998	中信银行	44,373,867.38	4.03
25	600995	文山电力	43,743,269.52	3.97
26	002220	天宝股份	43,598,589.79	3.96
27	000540	中天城投	43,164,846.54	3.92
28	002019	鑫富药业	43,151,544.33	3.92
29	600710	常林股份	42,154,256.22	3.83
30	600193	创兴置业	41,542,103.68	3.77
31	002297	博云新材	41,465,411.72	3.76
32	600439	瑞贝卡	39,972,855.91	3.63
33	600096	云天化	39,692,724.45	3.60
34	600694	大商股份	39,399,970.43	3.58
35	000565	渝三峡A	39,207,040.52	3.56
36	000503	海虹控股	38,937,173.70	3.53
37	000608	阳光股份	37,948,919.57	3.44
38	601106	中国一重	36,379,831.25	3.30
39	000917	电广传媒	35,639,571.43	3.23
40	600067	冠城大通	35,570,167.82	3.23
41	600029	南方航空	35,231,540.28	3.20
42	000928	中钢吉炭	33,616,871.40	3.05
43	601158	重庆水务	32,900,765.45	2.99
44	600227	赤天化	32,491,810.69	2.95
45	601958	金钼股份	32,244,169.66	2.93
46	600000	浦发银行	31,338,621.52	2.84
47	600265	景谷林业	30,972,286.33	2.81
48	002094	青岛金王	29,728,296.14	2.70
49	600221	海南航空	29,578,082.83	2.68
50	600115	东方航空	29,535,378.68	2.68
51	600008	首创股份	29,132,998.79	2.64
52	601398	工商银行	28,049,128.90	2.55
53	000768	西飞国际	27,932,020.64	2.53
54	002155	辰州矿业	27,538,332.47	2.50
55	002315	焦点科技	27,138,591.81	2.46
56	000937	冀中能源	27,119,419.76	2.46
57	600804	鹏博士	27,008,931.89	2.45
58	002036	宜科科技	26,763,786.51	2.43
59	000602	金马集团	26,469,665.61	2.40
60	002234	民和股份	26,391,131.03	2.39
61	600312	平高电气	26,337,775.34	2.39
62	600068	葛洲坝	26,238,905.53	2.38
63	601179	中国西电	26,234,379.65	2.38
64	000400	许继电气	25,611,830.67	2.32
65	002134	天津普林	25,481,952.43	2.31
66	002067	景兴纸业	25,149,003.25	2.28
67	000861	海印股份	24,779,082.45	2.25
68	002109	兴化股份	24,718,182.36	2.24
69	600999	招商证券	24,326,375.93	2.21
70	600803	威远生化	24,108,355.64	2.19

71	601939	建设银行	23,965,191.18	2.17
72	600580	卧龙电气	23,684,898.80	2.15
73	600518	康美药业	23,410,935.14	2.12
74	601727	上海电气	23,373,303.13	2.12
75	600622	嘉宝集团	23,069,999.46	2.09
76	600388	龙净环保	23,048,960.61	2.09
77	002227	奥特迅	22,415,943.69	2.03
78	600825	新华传媒	22,110,788.25	2.01

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。

8.4.2 累计卖出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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600056	中国医药	118,715,585.46	10.77
2	600050	中国联通	104,273,232.55	9.46
3	600380	健康元	99,752,836.14	9.05
4	002129	中环股份	96,849,499.85	8.79
5	002142	宁波银行	96,478,446.74	8.76
6	600378	天科股份	86,069,301.64	7.81
7	000969	安泰科技	72,753,443.20	6.60
8	601318	中国平安	66,059,844.54	5.99
9	601009	南京银行	65,543,092.54	5.95
10	600585	海螺水泥	62,408,351.01	5.66
11	600176	中国玻纤	60,910,088.33	5.53
12	601666	平煤股份	60,721,488.45	5.51
13	601888	中国国旅	58,421,443.16	5.30
14	600226	升华拜克	57,050,510.27	5.18
15	600468	百利电气	56,584,154.98	5.13
16	600388	龙净环保	53,057,759.19	4.81
17	002252	上海莱士	52,204,929.20	4.74
18	000778	新兴铸管	52,019,536.93	4.72
19	601288	农业银行	50,421,048.00	4.58
20	601299	中国北车	47,308,099.66	4.29
21	600710	常林股份	47,254,324.60	4.29
22	600068	葛洲坝	46,862,543.50	4.25
23	600193	创兴置业	46,331,710.61	4.20
24	002220	天宝股份	45,766,175.91	4.15
25	000825	太钢不锈	43,996,719.63	3.99
26	600316	洪都航空	43,332,238.65	3.93
27	000917	电广传媒	43,200,833.34	3.92
28	601998	中信银行	42,665,103.36	3.87
29	002019	鑫富药业	42,088,602.58	3.82
30	000042	深长城	41,690,329.82	3.78
31	600029	南方航空	41,349,313.86	3.75
32	600894	广钢股份	40,646,841.16	3.69

33	002094	青岛金王	38,872,403.07	3.53
34	000503	海虹控股	38,497,870.19	3.49
35	600067	冠城大通	38,034,076.52	3.45
36	000565	渝三峡A	37,794,190.36	3.43
37	000608	阳光股份	36,993,489.06	3.36
38	600268	国电南自	36,901,126.66	3.35
39	002155	辰州矿业	36,430,674.13	3.31
40	601106	中国一重	36,046,631.03	3.27
41	002227	奥特迅	35,987,330.88	3.27
42	000861	海印股份	33,713,707.54	3.06
43	600227	赤天化	33,032,098.43	3.00
44	600289	亿阳信通	32,713,709.84	2.97
45	002123	荣信股份	32,330,007.71	2.93
46	000928	中钢吉炭	31,773,915.24	2.88
47	600115	东方航空	30,849,497.56	2.80
48	601601	中国太保	30,412,672.93	2.76
49	600000	浦发银行	29,625,583.71	2.69
50	600008	首创股份	29,581,312.27	2.68
51	601668	中国建筑	29,578,288.00	2.68
52	000768	西飞国际	29,224,276.70	2.65
53	600571	信雅达	29,027,962.51	2.63
54	600804	鹏博士	28,464,053.93	2.58
55	601958	金钼股份	27,749,870.14	2.52
56	600312	平高电气	27,734,859.92	2.52
57	000400	许继电气	27,679,914.43	2.51
58	600521	华海药业	26,578,220.14	2.41
59	002036	宜科科技	26,135,157.02	2.37
60	002134	天津普林	25,738,202.42	2.34
61	002067	景兴纸业	25,025,470.37	2.27
62	600265	景谷林业	23,851,154.42	2.16
63	600518	康美药业	23,848,563.80	2.16
64	601939	建设银行	23,582,866.87	2.14
65	600622	嘉宝集团	23,492,891.22	2.13
66	601727	上海电气	23,425,382.11	2.13
67	002253	川大智胜	23,285,991.04	2.11
68	600999	招商证券	23,049,953.06	2.09
69	002121	科陆电子	22,148,650.99	2.01

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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	4,436,105,454.74
卖出股票的收入（成交）总额	4,424,855,569.77

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	313,412,177.60	21.16
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	313,412,177.60	21.16

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	100030	10 付息国债 30	2,000,000	198,120,000.00	13.37
2	010110	21 国债(0)	1,145,590	115,292,177.60	7.78

注：本基金报告期末仅持有两只债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金报告期末未持有资产支持证券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金报告期内投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,537,705.07
2	应收证券清算款	12,717,153.49

3	应收股利	-
4	应收利息	2,104,210.41
5	应收申购款	6,295,223.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,654,292.27

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000903	云内动力	38,720,000.00	2.61	该股因重大不确定事项（与中国兵器装备集团公司进行产权合作的可行性协商）2010年12月8日起连续停牌。该股已于2011年1月7日复牌。

8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
66,168	17,747.32	147,751,421.29	12.58	1,026,553,412.87	87.42

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	21,972.18	0.00

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2004年5月27日)基金份额总额	545,813,283.53
本报告期期初基金份额总额	733,989,990.59
本报告期基金总申购份额	1,812,641,673.05

减：本报告期基金总赎回份额	1,372,326,829.48
本报告期期末基金份额总额	1,174,304,834.16

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 基金管理人重大人事变动

金鹰基金管理有限公司（以下称公司）公司原董事长梁伟文先生、原总经理詹松茂先生因工作调动原因，经公司第三届董事会第十六次会议审议通过，免去其分别担任的董事长职务及总经理职务。经同次董事会审议通过，刘东先生当选为公司董事长，并聘任殷克胜先生担任公司总经理。刘东先生、殷克胜先生基金行业高级管理人员任职资格已经中国证券监督管理委员会证监许可【2010】420号文核准。本次高管变更已按规定向相关监管机关备案并于2010年4月19日在证监会规定的报纸予以披露。

经公司2010年第三届董事会第十九次会议审议通过，并经中国证券监督管理委员会证监许可【2010】1336号文核准，决定聘任郭容辰女士担任公司副总经理。本次变更事宜已按规定向相关监管机关备案，并于2010年10月20日在证监会规定的报纸予以披露。

11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本基金报告期内没有改变基金投资策略。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所为立信羊城会计师事务所，从2005年到本报告期末已连续6年为本基金从事审计业务，本报告期内支付该会计师事务所审计费56,000.00元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
财通证券	1	76,096,887.76	0.86	-	-	-	-	64,682.01	0.87	-
银河证券	1	55,050,413.64	0.62	-	-	-	-	44,729.04	0.60	-
海通证券	1	1,380,356,396.93	15.58	306,579,738.50	19.64	100,000,000.00	56.98	1,173,296.56	15.84	-
广州证券	1	2,103,959,205.32	23.74	-	-	-	-	1,709,484.27	23.08	-
江南证券	1	565,472,084.73	6.38	557,560,671.80	35.71	-	-	480,649.18	6.49	-
中银国际	1	1,676,267,574.94	18.92	465,326,108.80	29.81	-	-	1,424,816.80	19.24	-
爱建证券	1	508,659,351.75	5.74	14,548,627.00	0.93	5,500,000.00	3.13	432,360.51	5.84	-
齐鲁证券	1	8,291,723.47	0.09	-	-	-	-	7,048.00	0.10	-
国联证券	2	1,703,008,227.38	19.22	217,137,050.00	13.91	70,000,000.00	39.89	1,433,170.92	19.35	-
中投	1	744,133,612.26	8.40	-	-	-	-	604,614.39	8.16	-

证券										
国泰君安	1	39,455,122.09	0.45	-	-	-	-	32,057.54	0.43	-
兴安证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-
合计	13	8,860,750,600.27	100	1,561,152,196.10	100	175,500,000.00	100	7,406,909.22	100.00	-

注：本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单位作为本基金的专用交易单位。本基金专用交易单位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

本基金专用交易单位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单位的证券经营机构。
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单位租用协议。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

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。

金鹰基金管理有限公司
2011 年 3 月 28 日