金鹰中小盘精选证券投资基金更新的招募说明书摘要 200907

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

【重要提示】

金鹰中小盘精选证券投资基金经中国证监会2004年3月9日《关于同意金鹰中小盘精选证券投资基金设立的批复》(证监基金字[2004]25号)批准发起设立。基金合同于2004年5月27日正式生效。

投资有风险,投资人申购基金时应认真阅读招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人保证本招募说明书摘要的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

本摘要根据本基金的基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务;基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅本基金的基金合同。

基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,应全面了解本基金的产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等等。

投资有风险,投资者投资本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。基金管理人建议投资人根据自身的风险收益偏好,选择适合自己的基金产品,并且中长期持有。

本招募说明书摘要已经本基金托管人复核。除非另有说明,本招募说明书摘要所载内容截止日为2009年5月27日,有关财务数据截止日为2009年3月31日,净值表现截止日为2009年3月31日,本报告中财务数据未经审计。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:金鹰基金管理有限公司

注册地址:广东省珠海市吉大九洲大道东段商业银行大厦7楼16单元

办公地址:广东省广州市沿江中路298号江湾商业大厦22楼

设立日期:2002年12月25日

法定代表人:梁伟文

联系电话:020-83936180

联系人:潘晓毅

注册资本:人民币1亿元

股权结构:

发起人名称	出资额(万元)	出资比例
广州证券有限责任公司	4000	40%
四川南方希望实业有限公司	2000	20%
广州药业股份有限公司	2000	20%
广东美的集团股份有限公司	2000	20%
总计	10000	100%

(二)主要人员情况

1、董事、监事、经理及其他高级管理人员

梁伟文先生,董事长,工商管理硕士,高级会计师、中国注册会计师。曾在广州国际信托投资公司、越秀企业集团有限公司任职,历任越信隆投资有限公司副总经理,华凌集团有限公司财务董事兼副总经理,广州证券有限责任公司总裁助理、副总裁等职。经公司第二届董事会第二十三次会议选举通过,并报经中国证监会核准,2008年12月起担任公司董事长。

詹松茂先生,董事、总经理,管理学硕士。历任中国投资银行广东省分行(现为国家开发银行广州分行)国际业务部经理,美国洛杉矶美华国际企业公司董事、副总裁、财务总监,招商银行广州分行大德支行行长,广州证券有限责任公司增城营业部、广州环市中营业部、经纪业务管理总部总经理,金鹰基金管理有限公司代理总经理等。经公司首届董事会第十五次会议审议通过,并报经中国证监会核准,2005年8月起担任公司总经理。

栗建伟先生,董事,工商管理硕士。历任中国长城铝业公司供销处干部,广东美的电器股份有限公司董事局秘书,现任广东美的集团董事副总裁、战略发展部总监。

高燕女士,法学学士,从2005年9月29日起至今担任董事。历任北京金泉投资顾问有限公司客户部总经理,四川南方希望实业有限公司投资经理、新希望集团金融事业部高级经理等,现任新希望集团北京办总经理。

陈炳华先生,董事,硕士,会计师。曾任广州药业股份有限公司财务部部长,现任广州药业股份有限公司财务总监。

郭平先生,独立董事,经济学博士、教授、硕士生导师。历任湖南财经学院财政系讲师、教研室主任,湖南财经学院财政会计系副教授、系副主任,现任湖南大学会计学院教授、副院长。

杜金岷先生,独立董事,博士、教授、博士生导师。历任高校讲师、副教授,现任暨南大学教授、经济学院党委书记、副院长,广东中青年经济工作者学会副秘书长,广东经济学会常务理事,中华外国经济学说研究会理事、广东金融学会理事、广州留学归国人员协会理事等。

黄元生先生,独立董事,经济学硕士、副教授、高级会计师。历任中山大学会计教研室主任及会计系副主任,广州市康乐会计师事务所副所长及所长,现任广州万隆康正会计师事务所主任会计师。

颜俊先生,独立董事,法学博士,资深律师,资深合伙人。曾是广东华邦世纪律师事务所的创始合伙人,中国工商银行深圳市分行法律顾问,现任吉林大学法学院兼职副教授,金杜律师事务所资深合伙人,中华全国律师协会会员,广东省法学会民商法研究会常务理事。

曹萍女士,监事会召集人,经济学硕士,律师。曾任原华夏证券有限责任公司广州分公司研究发展部、投资银行部总经理助理,2003年进入金鹰基金管理有限公司,现任金鹰基金管理有限公司监察稽核部负责人。

曾巧女士,监事,管理学学士。历任佛山会计师事务所审计助理,美的集团审计部审计经理,现任美的集团审计监察部副部长。

姚万义先生,监事,大学本科。历任中共北京市纪律检查委员会北京市监察局办公厅主任、副局长、常委等职,中国证监会北京证管办副主任、巡视员等职,北京证券业协会理事长。

龙苏云先生,副总经理,投资研究总监,大学本科。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、金鹰基金管理有限公司投资副总监、总监等职。经公司第二届董事会第二十一次会议审议通过,并报经中国证监会核准,2008年12月起担任公司副总经理。

苏文锋先生,督察长,经济学硕士。历任广州市经济管理干部学院外贸经济系党支部书记,南方证券广州分公司研究发展部总经理,南方证券广州分公司大德路营业部总经理,南方证券广州分公司办公室主任,南方证券广州分公司投资银行部总经理,华鼎担保投资有限公司副总经理等职,金鹰基金管理有限公司市场拓展部副总监等职。经公司第二届董事会第二十一次会议审议通过,并报经中国证监会核准,2008年9月起担任公司督察长。

2、本基金现任基金经理

龙苏云先生,副总经理,投研总监,大学本科,证券从业经历十六年。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、金鹰基金管理有限公司投资副总监、总监、总经理助理等职,曾于2008年2月19日至2008年12月24日担任金鹰成份优选证券投资基金基金经理。现任公司副总经理、投研总监,并担任本基金基金经理以及金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理。龙苏云先生在以往工作期间从未受到监管机构行政处罚或采取行政监管措施,不存在《公司法》、《基金法》等法律、法规规定的不得担任基金管理公司基金经理的情形。

此外,金鹰中小盘精选证券投资基金管理小组还配备了若干名证券投资分析人员,协助基金经理从事金鹰中小盘精选证券投资基金的投资管理工作。

3、本基金历任基金经理

刘保民先生,2007年11月13日至2008年12月24日管理本基金;

罗荣女士,2007年1月10日至2008年1月23日管理本基金;

崔海鸿先生,2005年9月28日至2007年1月10日管理本基金;

汪旻杰先生,2004年5月27日至2005年9月28日管理本基金。

4、投资决策委员会成员

本基金采取集体投资决策制度,投资决策委员会成员有:

詹松茂先生,投资决策委员会主席,董事、总经理;

龙苏云先生,投资决策委员会委员,副总经理,投研总监,基金经理;

彭培祥先生,投资决策委员会委员,投资管理部副总监,基金经理;

杨绍基先生,投资决策委员会委员,研究发展部副总监,基金经理;

夏和平先生,投资决策委员会委员,研究发展部副总监。

5、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

公司法定中文名称:交通银行股份有限公司(简称:交通银行)

公司法定英文名称:BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD

法定代表人:胡怀邦

住所:上海市浦东新区银城中路188号

邮政编码:200120

注册时间:1987年3月30日

注册资本:489.94亿元

基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]25号

联系人:张咏东

电话:021-68888917

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、直销机构

名称:金鹰基金管理有限公司

注册地址:广东省珠海市吉大九洲大道东段商业银行大厦7楼16单元

办公地址:广东省广州市沿江中路298号江湾商业中心22层

法定代表人:梁伟文

电话:020-83936180

传真:020-83282856

联系人:潘晓毅

2、代销机构(排名不分先后)

(1)名称:交通银行股份有限公司

注册及办公地址:上海市浦东新区银城中路188号

法定代表人:胡怀邦

客户服务电话:95559

网址:www.bankcomm.com

(2)名称:中国工商银行股份有限公司

注册及办公地址:北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人:姜建清

客服电话:95588

网址:www.icbc.com.cn

(3)名称:中国银行股份有限公司

住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人:肖钢

客服电话:95566

网址:www.boc.cn

(4)名称:中信银行股份有限公司

住所:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人:孔丹

客户服务电话:95558

网址:bank.ecitic.com

(5)名称:中国民生银行股份有限公司

住所:北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人:董文标

客户服务电话:95568

网址:www.cmbc.com.cn

(6)名称:招商银行股份有限公司

公司地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人:秦晓

客服电话:95555

网址:www.cmbchina.com

(7)名称:上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区浦东南路500号

办公地址:上海市中山东一路12号

法定代表人:吉晓辉

客户服务电话:95528

网址:www.spdb.com.cn

(8)名称:深圳发展银行股份有限公司

办公地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦

法定代表人:法兰克纽曼

电话:0755-82088888

传真:0755-82080714

客服电话:95501

网址:www.sdb.com.cn

(9)名称:宁波银行股份有限公司

注册地址:浙江省宁波市中山东路294号

法定代表人:陆华裕

客户服务电话:96528

网址:www.nbcb.com.cn

(10)名称:深圳平安银行股份有限公司

注册地址:深圳市福田区红荔西路301栋

办公地址:深圳市深南中路1099号平安银行大厦

法定代表人:孙建一

客户服务电话:40066-99999

网址:www.18ebank.com

(11)名称:海通证券股份有限公司

住所:上海市淮海中路98号

法定代表人:王开国

电话:021-23219000

传真:021-23219100

客户服务电话:021-962503

网址:www.htsec.com

(12)名称:中信建投证券有限公司

注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址:北京朝内大街188号

法定代表人:张佑君

客户服务电话:4008888108

网址:www.csc108.com

(13)名称:国泰君安证券股份有限公司

住所:上海市浦东新区商城路618号

法定代表人:祝幼一

电话:021-62580818-416

传真:021-62569400

客户服务电话:400-8888-666、021-962588

网址:www.gtja.com

(14)名称:中国银河证券有限责任公司

住所:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人:肖时庆

电话:010-66568888

传真:010-66568536

客户服务电话:010-68016655

网址:www.chinastock.com.cn

(15)名称:广发证券股份有限公司

注册地址:广州市天河北路183号大都会广场43楼

办公地址:广东广州天河北路大都会广场18、19、36、38、41和42楼

法定代表人:王志伟

传真:020-87555305

客户服务电话:95575

网址:www.gf.com.cn

(16)名称:湘财证券有限责任公司

注册地址:长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12层

法定代表人:陈学荣

电话:021-68634518-8635

传真:021-68865938

客户服务电话:021-68865020

网址:www.xcsc.com

(17)名称:国信证券股份有限公司

住所:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人:何如

电话:0755-82130833

传真:0755-82133302

客户服务电话:95536

网址:www.guosen.com.cn

(18)名称:招商证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

法定代表人:宫少林

客户服务电话:95565、4008888111

网址:www.newone.com.cn

(19)名称:兴业证券股份有限公司

住所:福建省福州市湖东路99号标力大厦

法定代表人:兰荣

电话:021-68419974

传真:021-68419867

客户服务电话:021-68419125

网址:www.xyzq.com.cn

(20)名称:东吴证券有限责任公司

注册地址:苏州工业园区翠园路181号商旅大厦

法定代表人:吴永敏

电话:0512-65581136

传真:0512-65588021

客户服务电话:0512-33396288

网址:www.dwzq.com.cn

(21)名称:广州证券有限责任公司

注册地址:广州市先烈中路69号东山广场主楼五楼

法定代表人:吴志明

电话:020-87320991

传真:020-87325036

客户服务电话:020-87320991、020-87320595

网址:www.gzs.com.cn

(22)名称:山西证券有限责任公司

注册地址:山西省太原市府西街69号国贸大厦A座30层

法定代表人:吴晋安

客户服务电话:400-666-1618

网址:www.i618.com.cn

(23)名称:西南证券有限责任公司

注册地址:重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦A幢22-25层

法定代表人:范剑

电话: 023-63786397

传真: 023-63786312

客户服务电话:023-63786241

网址:www.swsc.com.cn

(24)名称:东莞证券有限责任公司

住所:东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼

法定代表人:游锦辉

客户服务电话:0769-22119351

网址:www.dgzq.com.cn

(25)名称:财通证券有限责任公司

注册地址:浙江省杭州市解放路111号金钱大厦

法定代表人:沈继宁

客户服务电话:0571-96336(上海地区962336)

网址:www.ctsec.com

(26)名称:平安证券有限责任公司

注册地址:深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦三层

法定代表人:陈敬达

客户服务电话:40088666338

网址:www.PA18.com

(27)名称:江南证券有限责任公司

住所:江西省南昌市抚河北路291号

法定代表人:姚江涛

客户服务电话:0791-6770351

网址:www.scstock.com

(28)名称:安信证券股份有限公司

注册及办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

法定代表人:牛冠兴

传真:0755-82558355

客户服务电话:4008001001

网址:www.essence.com.cn

(29)名称:光大证券股份有限公司

注册地址:上海市静安区新闸路1508号

办公地址:上海市静安区新闸路1508号

法定代表人:徐浩明

客户服务电话:10108998

网址:www.ebscn.com

(30)名称:国盛证券有限责任公司

注册地址:江西省南昌市永叔路15号

办公地址:江西省南昌市永叔路15号信达大厦10-13楼

法定代表人:管荣升

客户服务电话:0791-6285337、0791-6288690

网址:www.gsstock.com

(31)名称:万联证券有限责任公司

住所:广州市中山二路18号广东电信广场36-37层

法定代表人:李舫金

电话:020-37865026

传真:020-37865030

客户服务电话:400-8888-133

网址:www.wlzq.com.cn

(32)名称:东海证券有限责任公司

注册地址:江苏省常州市延陵西路59号投资广场18楼

办公地址:上海市浦东新区东方路989号中达广场17楼

法定代表人:朱科敏

客户服务电话:400-888-8588

网址:www.longone.com.cn

(33)名称:宏源证券股份有限公司

注册地址:新疆维吾尔自治区乌鲁木齐市建设路2号

办公地址:北京市海淀区西直门北大街甲43号金运大厦B座6层

联系人:魏海

客户服务电话:010-62267799

网址:www.hysec.com

(34)名称:申银万国证券股份有限公司

注册地址:上海市常熟路171号

法定代表人:丁国荣

客户服务电话:021-962505

网站:www.sw2000.com.cn

(35)名称:国元证券股份有限公司

注册地址:安徽省合肥市寿春路179号

法定代表人:凤良志

客户服务电话:0551-2634400

网址:www.gyzq.com.cn

(36)名称:中国建银投资证券有限责任公司

注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层至20层

法定代表人:杨小阳

客户服务电话:4006-008-008

网址:www.cjis.cn

(37)名称:长江证券股份有限公司

注册地址:中国湖北省武汉市江汉区新华路特8号

法定代表人:胡运钊

客户服务电话:4008-888-999

网址:www.95579.com

(38)名称:世纪证券有限责任公司

办公地址:深圳市深南大道招商银行大厦40-42层

法定代表人:卢长才

客户服务电话:0755-83199511

网址:www.csco.com.cn

(39)名称:齐鲁证券有限公司

注册地址:山东省济南市经十路128号

法定代表人:李玮

客户服务电话:95538

网址:www.qlzq.com.cn

(40)名称:江海证券经纪有限责任公司

注册地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号

法定代表人:孙名扬

客服电话:4006662288

网址:www.jhzq.com.cn

(41)名称:国联证券股份有限公司

注册地址:无锡市县前东街168号国联大厦

法定代表人:雷建辉

客服电话:400-888-5288

网址:www.glsc.com.cn

(42)名称:爱建证券有限责任公司

注册地址:上海市南京西路758号24楼

邮政编码:200041

法定代表人:张建华

客服电话:021-63340678

网址:www.ajzq.com

(43)名称:联合证券有限责任公司

注册地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层

法定代表人:马昭明

传真:0755-82492187

客户服务热线:4008888555

网址:www.lhzq.com

(44)名称:中国国际金融有限公司

公司地址:北京建国门外大街1号国贸大厦2座28层

法定代表人:李剑阁

客服电话:010-85679238等

网址:www.cicc.com.cn

(二)注册登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司

地址:北京西城区金融大街27号投资广场23层

法定代表人:陈耀先

电话:0755-25938095

传真:0755-25987538

联系人:任瑞新

(三)律师事务所和经办律师

名称:广东岭南律师事务所

住所:广州市新港西路135号中山大学西门内

法定代表人:江亚芳

电话:020-84035397

传真:020-84113152

经办律师:江亚芳

(四)会计师事务所和经办注册会计师

名称:立信羊城会计师事务所有限公司

住所:广州市天河区林和西路3-15号耀中广场11楼1106-1118单元

法定代表人:陈雄溢

电话:020-83487300

传真:020-83486116

经办注册会计师:张宁、黎晓霞

四、基金的名称

本基金名称:金鹰中小盘精选证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型:契约型开放式

六、基金的投资目标

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。

七、基金的投资方向

本基金的投资方向为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金的股票投资主要投资于具有较高成长性和良好基本面的、流通市值在市场平均水平之下的中小盘股票(流通市值排名前20%(含20%)的新上市股票一年内不列入流通市值市场平均值的计算)。本基金的其他股票投资还包括新股申购、股票增发申购等。

本基金的债券投资包括国内依法公开发行、上市的国家债券、金融债、企业(公司)债(包括可转债)等债券。

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%。

八、基金的投资策略

(一)决策依据

本基金的投资决策依据包括:

1、宏观经济形势及前景、有关政策趋向;

2、行业发展现状及前景;

3、上市公司基本面及发展前景;

4、证券市场走势及预期;

5、股票、债券等类别资产的预期收益率及风险水平。

(二)决策程序

1、基金管理人的研究部门基于对宏观经济、政策及证券市场的现状和发展趋势的深入分析研究,和对各类别资产收益率和风险水平的合理预期,向投资决策委员会提交投资建议,投资建议包括总体资产配置建议、类别资产配置建议、个股/券种投资建议等;

2、投资决策委员会根据本基金的投资目标,结合对本基金投资相关因素的全局考虑,确定本基金的投资策略,制定总体资产配置计划;

3、基金基金经理根据投资决策委员会制定的基金的总体资产配置计划,考虑研究部门的相关建议,拟定投资计划,报投资决策委员会批准;

4、本基金基金经理根据投资决策委员会批准的投资计划,制定具体投资方案。

(三)组合原则

本基金的投资组合必须符合以下比例规定:

1、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%;

2、本基金投资于国家债券的比例,不得低于基金资产净值的20%;

3、本基金持有一家上市公司的股票,不得超过基金资产净值的10%;

4、本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和,不得超过该证券的10%;

5、运用基金资产参与股票发行申购,所申报的金额不得超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司该次的股票发售总量;

6、基金投资于中小盘股的比例不低于本基金股票投资总额的80%;

7、本基金应当保持不低于基金资产净值百分之五的现金或者到期日在一年以内的政府债券;

8、有关法律法规、中国证监会及本基金合同所规定的其他比例限制;

9、法律法规或监管部门对上述比例另有规定时从其规定。

(四)本基金股票投资策略

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。

股票投资组合包括中小盘股票组合和其他股票组合。中小盘股票组合通过选择具有较高成长性、基本面良好的中小盘股,依据有效充分分散的原则构建。其他股票投资主要是参与有较高投资价值的新股申购、股票增发申购以及根据市场情况的短期股票投资。

(五)本基金债券投资策略

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。

九、基金的业绩比较基准

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%的中信标普200(中盘)指数收益率加50%的中信标普小盘指数收益率。债券投资比较基准采用中信标普国债指数。

十、基金的风险收益特征

本基金属于风险适中、预期收益较高的证券投资基金品种。

十一、基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据截止日为2009年3月31日,本报告中所列财务数据未经审计。

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责任。

本基金的托管人交通银行根据本基金合同的规定,于2009年6月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

(一)报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	459,595,531.87	54.47%
	其中:股票	459,595,531.87	54.47%
2	固定收益投资	234,347,351.80	27.78%
	其中:债券	234,347,351.80	27.78%
	资产支持证券	0.00	0.00%
3	金融衍生品投资	0.00	0.00%
4	买入返售金融资产	0.00	0.00%
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	0.00	0.00%
5	银行存款和结算备付金合计	79,873,209.49	9.47%
6	其他资产	69,863,853.42	8.28%
7	合计	843,679,946.58	100.00%

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合

行　业	公允价值(元)	占基金资产净值比例%
A农、林、牧、渔业	0.00	0.00%
B采掘业	0.00	0.00%
C制造业	295,655,661.92	39.19%
C0食品、饮料	0.00	0.00%
C1纺织、服装、皮毛	45,352,875.00	6.01%
C2木材、家具	0.00	0.00%
C3造纸、印刷	0.00	0.00%
C4石油、化学、塑胶、塑料	0.00	0.00%
C5电子	7,270,422.48	0.96%
C6金属、非金属	57,531,537.76	7.63%
C7机械、设备、仪表	100,275,500.48	13.29%
C8医药、生物制品	85,225,326.20	11.30%
C99其他制造业	0.00	0.00%
D电力、煤气及水的生产和供应业	34,500,000.00	4.57%
E建筑业	0.00	0.00%
F交通运输、仓储业	0.00	0.00%
G信息技术业	28,160,609.95	3.73%
H批发和零售贸易	3,624,060.00	0.48%
I金融、保险业	39,110,000.00	5.19%
J房地产业	0.00	0.00%
K社会服务业	0.00	0.00%
L传播与文化产业	0.00	0.00%
M综合类	58,545,200.00	7.76%
合　计	459,595,531.87	60.93%

(三)报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	公允价值占资产净值比(%)
1	000990	诚志股份	4,840,127	62,679,644.65	8.31%
2	002005	德豪润达	6,061,497	47,885,826.30	6.35%
3	600895	张江高科	3,000,000	42,870,000.00	5.68%
4	600549	厦门钨业	2,964,044	41,615,177.76	5.52%
5	601318	中国平安	1,000,000	39,110,000.00	5.19%
6	600259	ST有色	2,203,100	35,668,189.00	4.73%
7	000903	云内动力	3,092,349	27,274,518.18	3.62%
8	600283	钱江水利	2,550,000	22,593,000.00	3.00%
9	600594	益佰制药	2,077,943	22,545,681.55	2.99%
10	002052	同洲电子	1,665,016	17,482,668.00	2.32%

(四)报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	公允价值占基金资产净值比例(%)
1	国债	234,347,351.80	31.07%
2	金融债	0.00	0.00%
3	央行票据	0.00	0.00%
4	企业债	0.00	0.00%
5	可转债	0.00	0.00%
6	其他	0.00	0.00%
7	合计	234,347,351.80	31.07%

(五)报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	公允价值占净值比(%)
1	010210	02国债(10)	1,529,000	153,802,110.00	20.39%
2	009908	99国债(8)	795,430	80,545,241.80	10.68%
3					
4					
5					

(六)报告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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(七)报告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

本基金本报告期末未持有权证。

(八)投资组合报告附注

1、报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

2、本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、其他资产构成

序号	其他资产	金额(元)
1	存出保证金	622,940.16
2	应收证券清算款	53,687,897.92
3	应收股利	0.00
4	应收利息	3,664,402.48
5	应收申购款	11,888,612.86
6	其他应收款	0.00
7	待摊费用	0.00
8	其他	0.00
合计		69,863,853.42

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

6、投资组合报告附注的其他文字描述部分

权证投资情况:本报告期内本基金未投资权证。

投资分离交易可转债情况:本报告期内本基金未投资分离交易可转债。

投资资产支持证券情况:报告期内本基金未投资资产支持证券。

本报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况:报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

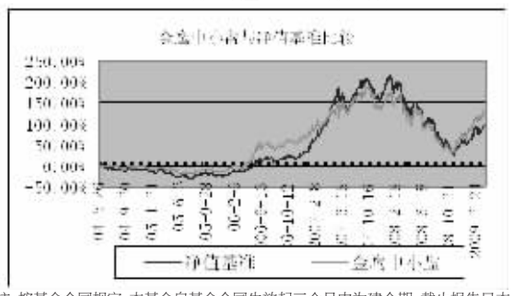
本基金合同生效日为2004年5月27日,基金合同生效以来的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示:

金鹰中小盘精选证券投资基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

阶段	净值增长率①	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
2004.5.27-2004.12.31	-5.71%	0.82%	-13.57%	1.11%	7.86%	-0.29%
2005.1.1-2005.12.31	-5.11%	1.07%	-7.98%	1.19%	2.87%	-0.12%
2006.1.1-2006.12.31	86.49%	1.20%	67.98%	1.15%	18.51%	0.05%
2007.1.1-2007.12.31	54.47%	1.82%	122.43%	1.90%	-67.96%	-0.08%
2008.1.1-2008.12.31	-35.03	2.27	-50.04	2.47	15.01	-0.20
2009.1.1-2009.3.31	39.49%	1.82%	34.71%	1.92%	4.78%	-0.10%
2004.5.27-2009.3.31	133.58%	1.60%	99.63%	1.72%	33.95%	-0.12%

金鹰中小盘基金累计份额净值增长率与同期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3月31日)



注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效起三个月内为建仓期,截止报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十五条(三)投资范围、(三)投资策略(3)组合原则中规定的各项比例,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%。

十三、费用概览

(一)与基金运作有关的费用

1、基金费用的种类

(1)基金管理人的管理费;

(2)基金托管人的托管费;

(3)基金信息披露费用;

(4)基金份额持有人大会费用;

(5)与基金相关的会计师费和律师费;

(6)证券交易费;

(7)按照国家有关规定可以列入的其他费用;

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1)基金管理人的报酬

基金管理人的报酬按基金资产净值的1.5%年费率计提。

在通常情况下,基金管理人报酬按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法为:

H=E×1.5%÷当年天数

H为每日应支付的基金管理人报酬

E为前一日基金资产净值

基金管理人报酬每日计提,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。

(2)基金托管人的托管费

基金托管人的托管费按基金资产净值的2.5‰的年费率计提。

在通常情况下,基金托管人的托管费按前一日的基金资产净值的2.5‰的年费率计提。计算方法为:

H=E×2.5‰÷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

基金托管人的托管费每日计提,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。

(3)上述"1、基金费用的种类"中第3-7项费用根据有关规定进行核算,发生的费用如果影响基金份额净值小数点后第五位的,即发生的其他费用大于基金净值十万分之一,应采用待摊或预提的方法,待摊或预提计入基金损益。发生的其他费用如果不影响基金份额净值小数点后第五位的,即发生的其他费用小于基金净值十万分之一,应于发生时直接计入基金损益。

3、不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

4、基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费,此项调整不需要召开基金持有人大会。

(二)与基金销售有关的费用

1、申购费用

本基金申购费率按照申购金额递减,即申购金额越大,所适用的申购费率越低,申购费用等于申购金额乘以所适用的申购费率。

申购金额在100万元人民币以下的,申购费率为1.5%。

申购金额在100万元人民币以上(含100万元人民币)、1000万元人民币以下的,申购费率为1.2%。

申购金额在1000万元人民币以上(含1000万元人民币)的,申购费每笔1000元人民币。

本基金的申购费用由申购人承担,用于市场推广、销售、注册登记等各项费用,不列入基金资产。

2、赎回费用

赎回费率按照持有时间递减,即持有时间越长,所适用的赎回费率越低,赎回费用等于赎回金额乘以所适用的赎回费率。

持有时间在一年以内的,赎回费率为0.5%。

持有时间在一年以上(含一年)两年以内的,赎回费率为0.4%。

持有时间在两年以上(含两年)三年以内的,赎回费率为0.3%。

持有时间在三年以上(含三年)的,赎回费率为0.2%。

本基金的赎回费用由基金持有人承担,其中归入基金资产部分的比例为赎回费总额的25%,其余部分作为注册登记费和其他手续费支出。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对2009年1月9日披露的《金鹰中小盘精选证券投资基金更新的招募说明书》(2008年第1号)进行了再次更新,主要更新的内容如下:

(一)在"三、基金管理人"部分,更新了主要人员信息和投资决策委员会成员信息。

(二)在"四、基金托管人"部分,更新了有关基金托管人的资料信息。

(三)在"五、相关服务机构"部分,对机构与人员的信息按照最新变动情况进行了更新:

1、基金份额发售机构的基本信息和联络方式;

2、新增了中国银行股份有限公司为代销机构,该变动事项于2009年2月2日公告;

3、新增了江海证券经纪有限责任公司为代销机构,该变动事项于2009年2月10日公告;

4、新增了深圳发展银行股份有限公司为代销机构,该变动事项于2009年2月10日公告;

5、新增了国联证券股份有限公司为代销机构,该变动事项于2009年2月10日公告;

6、新增了