

金鹰保本混合型证券投资基金

2016 年年度报告摘要

2016 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

送出日期：二〇一七年三月二十九日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 28 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。

本报告中财务资料已经审计。中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2016 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	金鹰保本混合	
基金主代码	210006	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011 年 5 月 17 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	
报告期末基金份额总额	765,821,790.06 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	金鹰保本混合 A	金鹰保本混合 C
下属分级基金的交易代码	210006	002425
报告期末下属分级基金的份额总额	41,903,171.32 份	723,918,618.74 份

2.2 基金产品说明

投资目标	采用改进的固定比例组合保险策略（CPPI），引入收益锁定机制，在严格控制投资风险、保证本金安全的基础上，力争在保本期结束时，实现基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金的保本策略为改进的固定比例组合保险策略（CPPI），是本基金投资运作过程中的核心策略；投资策略采用“自上而下”的投资视角，根据宏观经济与资本市场运行状况、固定收益类与权益类资产风险收益特性、基金净资产、价值底线，定性分析与定量分析并用，灵活动态地选取适当的风险乘数，以期对固定收益类与权益类资产之间的配置额进行优化调节，力争在确保本金安全的前提下，获取投资收益。 本基金的股票、权证占基金资产净值的比例为 0%~40%，其中，权证投资的比例范围占基金资产净值的 0%~3%；债券、资产支持证券、货币市场工具、现金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产净值的 60%~100%，其中，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；此外，在基金合同和法律

	法规的允许范围内，本基金将积极参与一级市场新股、新债的申购。
业绩比较基准	3 年期银行定期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为积极配置的保本混合型基金，属于证券投资基金当中的低风险品种，其长期平均风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金，但高于货币市场基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	苏文锋	郭明
	联系电话	020-83282627	010-66105799
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006135888,020-83936180	95588
传真		020-83282856	010-66105798

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	广州市天河区珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据和指 标	2016 年		2015 年		2014 年	
	金鹰保本混 合 A	金鹰保本混 合 C	金鹰保本混 合 A	金鹰保本混 合 C	金鹰保本混 合 A	金鹰保本混 合 C
本期已 实现收 益	769,038.62	7,444,751.72	-413,565.32	-	2,194,249.36	-
本期利 润	-4,774.80	5,539,976.73	469,455.23	-	12,905,619.4 3	-
加权平 均基金 份额本	-0.0001	0.0576	0.0058	-	0.0604	-

期利润						
本期基金 份额 净值增 长率	0.35%	61.37%	12.32%	-	4.99%	-
3.1.2 期末 数据和指 标	2016 年末		2015 年末		2014 年末	
	金鹰保本混合 A	金鹰保本混合 C	金鹰保本混合 A	金鹰保本混合 C	金鹰保本混合 A	金鹰保本混合 C
期末可 供分配 基金份 额利润	0.1725	0.1105	0.1955	-	0.1375	-
期末基 金资产 净值	46,514,725. 17	803,924,835. 64	58,482,120.1 0	-	109,797,650. 54	-
期末基 金份额 净值	1.110	1.111	1.149	-	1.023	-

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、本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；

4、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，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

金鹰保本混合 A

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	0.09%	0.18%	0.71%	0.01%	-0.62%	0.17%
过去六个月	1.41%	0.14%	1.42%	0.01%	-0.01%	0.13%
过去一年	0.35%	0.20%	2.84%	0.01%	-2.49%	0.19%
过去三年	18.34%	0.23%	11.06%	0.01%	7.28%	0.22%
过去五年	27.49%	0.20%	21.50%	0.01%	5.99%	0.19%
自基金合同生 效起至今	30.30%	0.19%	25.38%	0.01%	4.92%	0.18%

金鹰保本混合 C

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	0.42%	0.18%	0.71%	0.01%	-0.29%	0.17%
过去六个月	59.93%	5.15%	1.42%	0.01%	58.51%	5.14%
自基金合同生效起至今	61.37%	4.02%	2.32%	0.01%	59.05%	4.01%

注：注：金鹰保本 C 份额自 2016 年 3 月 7 日起生效。

本基金的业绩比较基准为 3 年期银行定期存款利率（税后）。

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

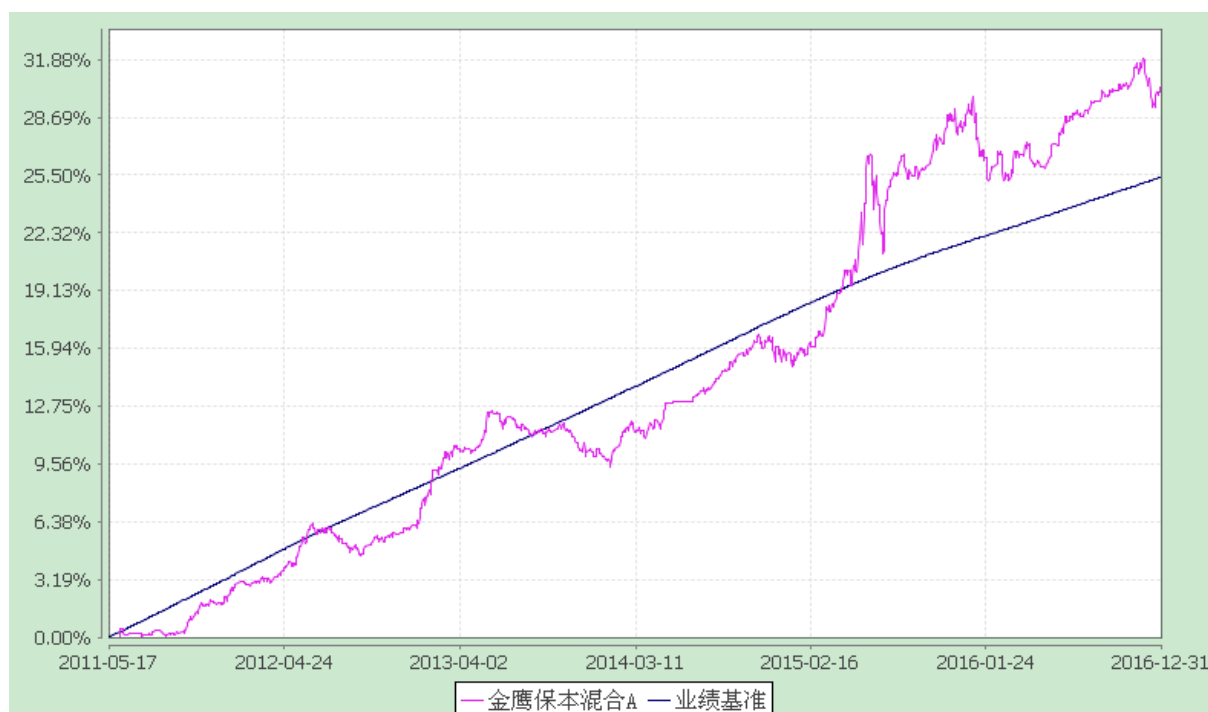
金鹰保本混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2011 年 5 月 17 日至 2016 年 12 月 31 日）

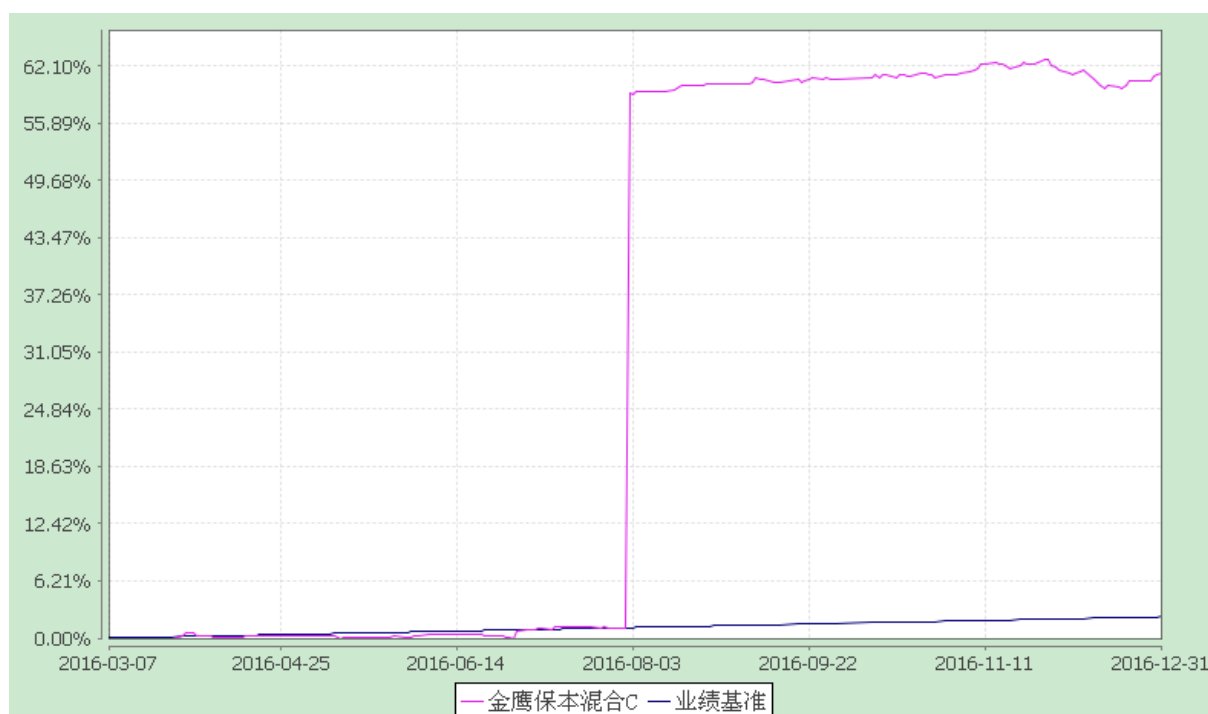
金鹰保本混合 A

（2011 年 5 月 17 日至 2016 年 12 月 31 日）



金鹰保本混合 C

（2011 年 5 月 17 日至 2016 年 12 月 31 日）



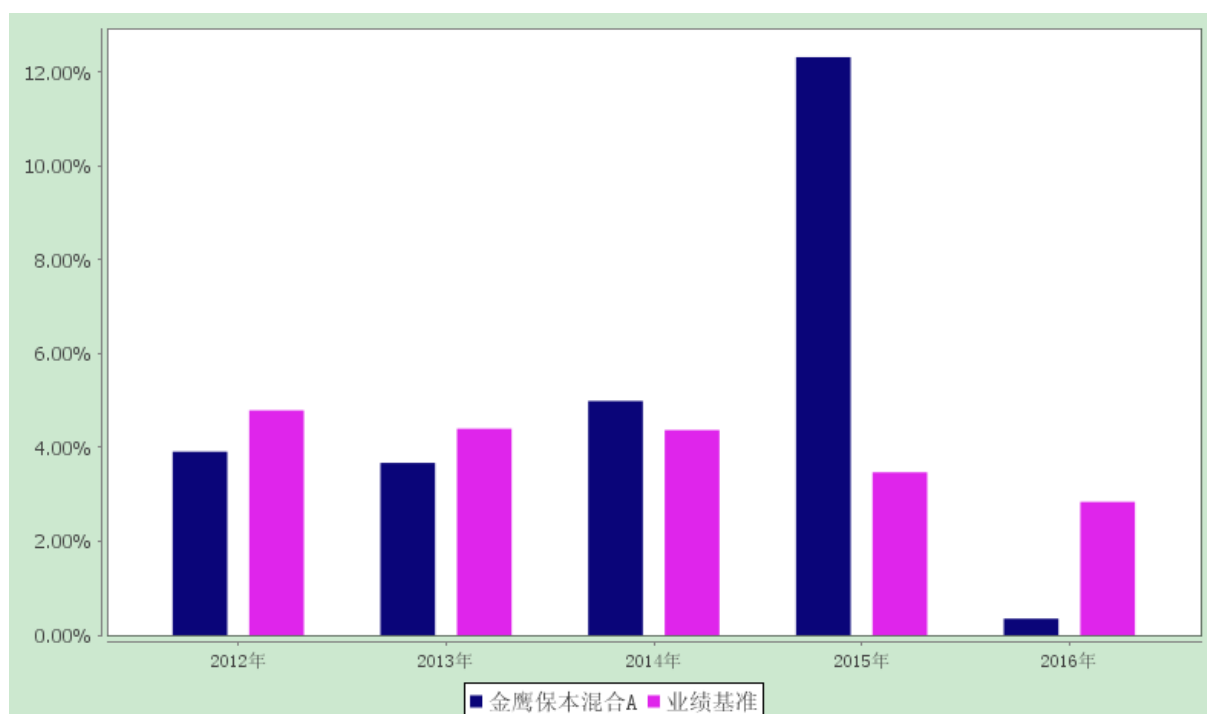
注：1、截至报告日本基金各项投资比例符合基金合同规定的各项比例，即股票、权证占基金资产净值的比例为 0%~40%，其中，权证投资的比例范围占基金资产净值的 0%~3%；债券、资产支持证券、货币市场工具、现金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产净值的 60%~100%，其中，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；此外，在基金合同和法律法规的允许范围内，本基金将积极参与一级市场新股、新债的申购。2、本基金的业绩比较基准为 3 年期银行定期存款利率（税后）。

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

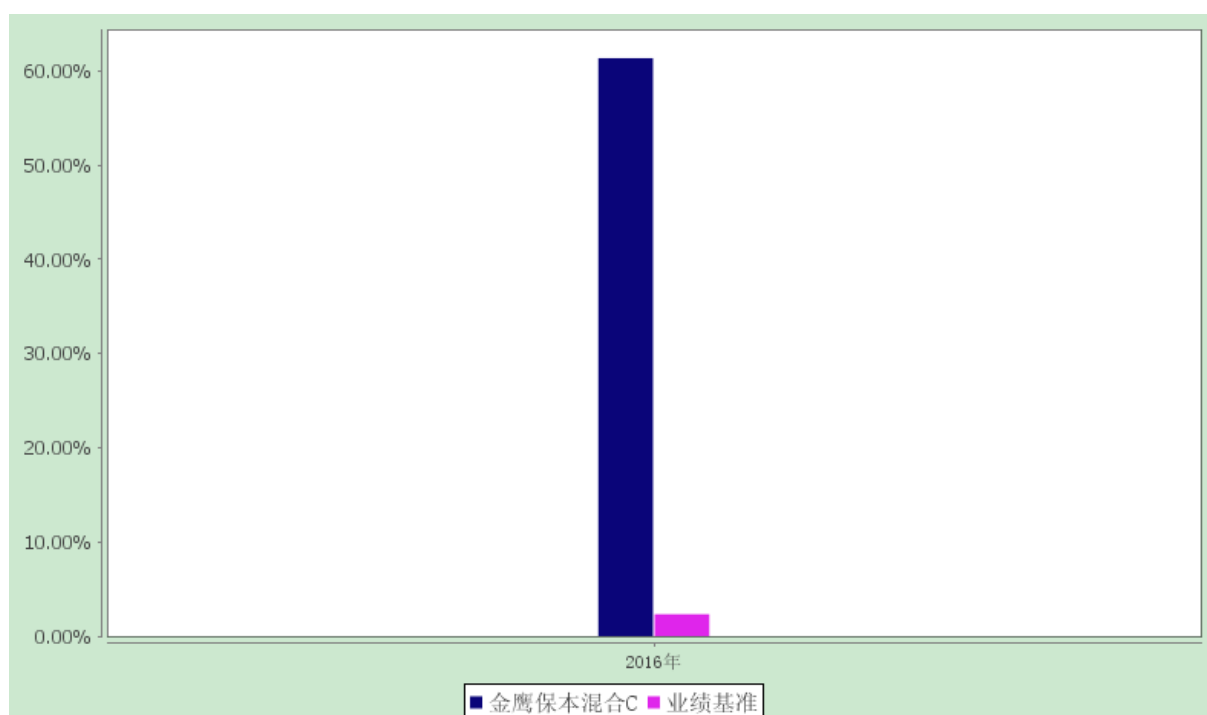
金鹰保本混合型证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图

金鹰保本混合 A



金鹰保本混合 C



3.3 过去三年基金的利润分配情况

1、金鹰保本混合 A

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

2016	0.430	1,801,820.78	-	1,801,820.78	-
合计	0.430	1,801,820.78	-	1,801,820.78	-

2、金鹰保本混合 C

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
-	5.000	562,208,722.13	-	562,208,722.13	-
合计	5.000	562,208,722.13	-	562,208,722.13	-

注：本基金过去三年内仅 2016 年进行了利润分配。

§ 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字[2002]97 号文批准，于 2002 年 12 月 25 日成立，总部设在广州，目前注册资本 2.5 亿元人民币。2011 年 12 月公司获得特定客户资产管理计划业务资格，2013 年 7 月子公司-深圳前海金鹰资产管理有限公司成立。

“以人为本、互信协作；创新谋变、挑战超越”是金鹰人的核心价值观，在新经营团队的带领下，通过全体员工的奋发努力，公司近两年各方面都发生了积极的蜕变，追求以更高的标准为投资者提供贴心专业的财富管理服务，赢得市场认可。

截至 2016 年 12 月末，公司下设权益投资部等 17 个一级职能部门、北京、广州、上海、深圳、成都分公司以及一个子公司—深圳前海金鹰资产管理有限公司。截至 2016 年 12 月末，公司旗下管理公募基金 30 只以及特定客户资产管理计划 101 个、子公司专项资产管理计划 195 个，资产管理总规模约 1800 亿元。

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		
倪	基金经理	2015-	-	8	倪超先生，厦门大学硕士研究生。

超		08-13			2009 年 6 月加盟金鹰基金管理有限公司，先后任行业研究员，消费品研究小组组长、基金经理助理。现任金鹰行业优势混合型证券投资基金、金鹰保本混合型证券投资基金、金鹰元祺保本混合型证券投资基金基金经理。
李涛	固定收益部副总监、基金经理	2015-01-09	2016-10-27	11	李涛先生，北京大学金融学硕士，证券从业经历 11 年。历任光大银行总行资金部货币市场自营投资业务主管、中银国际证券研究部宏观研究员、广州证券资产管理总部投研总监。2014 年 11 月加入金鹰基金管理有限公司，曾任固定收益部副总监职务、金鹰保本混合型证券投资基金、金鹰持久增利债券型（LOF）证券投资基金、金鹰元安保本混合型证券投资基金、金鹰元丰保本混合型证券投资基金、金鹰灵活配置混合型证券投资基金、金鹰元祺保本混合型证券投资基金基金经理。
戴骏	基金经理、基金经理助理	2016-10-22	-	6	戴骏先生，美国密歇根大学金融工程硕士研究生，历任国泰基金管理有限公司基金经理助理、东兴证券股份有限公司债券交易员等职务，2016 年 7 月加入金鹰基金管理有限公司，现任金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）、金鹰保本混合型证券投资基金及金鹰持久增利债券型证券投资基金（LOF）基金经理，金鹰元和保本混合型证券投资基金等基金的基金经理助理。

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合规守信情况的说明

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，严格遵守本基金的基金合同、托管协议、招募说明书等法律文件的规定，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 公平交易制度和控制方法

为了保证本基金管理人管理的不同投资组合得到公平对待，本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，以及公司内控大纲的要求，制定了《金鹰基金管理有限公司公平交易管理规定》并严格执行，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。本基金管理人通过投资交易系统公平交易功能，对不同投资组合进行公平交易事前控制。同时，本基金管理人引入公平交易分析系统，定期或不定期对公司旗下投资组合在一定期间内买卖相同证券的情况进行监控和分析。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现。同时通过投资交易系统内的公平交易功能执行交易，以尽可能确保公平对待各投资组合。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

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

回顾 2016 年，债券市场跌宕起伏。第一季度，债券市场缓慢下跌，委外杠杆传闻是引发收益率上行的主要因素，但伴随着降准，下调公开市场操作利率等一系列手段，市场情绪有所缓解，利率并没有大幅上行。第二季度，4 月份伴随着信用违约事件的连续爆发，大量信用债一级发行被迫取消，营改增增加回购成本，长端国债利率出现了明显的上行，十年国开收益率一度接近 3.5 的阶段高点，但是在 5 月份之后，伴随着央行持续的流动性注入，信用风险缓和，同时，资产荒逻辑推动配置盘持续推高债券价格，多重利好带来了大的修复行情。第三季度，资产荒逻辑依旧推动债

券市场持续的不理智上涨，即使在 8 月下旬，央行重启 14 天逆回购，9 月份央行拉长 MLF 期限，重启 28 天逆回购，也没有缓解市场的狂热情绪。进入四季度，伴随着表外理财纳入 MPA 考核的传言动摇多头市场，同时，同业资金链年底出现问题，货币基金流动性及负偏离问题导致债券市场短端债券相继被抛售，流动性问题导致市场快速调整，一度上行将近 80bp 达到 3.9 左右的年度高点。纵观 2016 年，债券市场伴随着央行去杠杆的监管思路，在年末出现的大幅调整，全年，十年国债收益率上行 20bp 至 3.01%，十年国开债收益率上行 55bp 至 3.68%。

在整个 2016 年，本基金在债券投资方面维持了哑铃状配置，较为均衡，为基金参与打新策略建立了较好的基础。在报告期内，基金积极参与打新操作，为组合提供了较好的收益增厚。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金 A 份额净值 1.110 元，本报告期份额净值增长率为 0.35%，同期业绩比较基准增长率为 2.84%；本基金 C 份额净值 1.111 元，本报告期份额净值增长率为 61.37%，同期业绩比较基准增长率为 2.32%。

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 2017 年，我们认为债券市场仍将大概率保持震荡的态势。从经济基本面来看，虽然 1 月份的金融数据表现较好，社融及新增信贷数据均超出预期，但是，伴随着房地产限制措施的进一步出台，整体地产的投资额将出现明显的回落。同时，基建投资也较难持续保持高速的增长，虽然 PPP 项目发力可以撬动一部分基建投资，但总量也不大，故我们认为 2017 年基建投资对经济整体的贡献也较为疲软。从通胀的角度来看，伴随着春节效应，以及大宗、食品价格的表现，一季度大概率将是通胀的高点，随后，伴随着商品价格的企稳以及基数效应，后半年的通胀水平预计大概率无法超越一季度。故从基本面及通胀的角度来看，并不支撑债券收益率的持续上扬。从货币政策角度来看，今年央行的主要基调是稳健中性，并将持续进行金融去杠杆操作，从这个角度来讲，只要去杠杆的进程没有结束，债券市场时刻面临着调整风险。所以，预期差的体现将引导多空力量不断进行博弈，博弈的最终体现就是市场的震荡。总的来看，2017 年将大概率震荡，一旦金融去杠杆过程进入尾声，实体经济表现疲软，则债券市场将再次迎来上涨的机会。

基于上述判断，本基金将在保本期内维持较为谨慎的投资策略，债券方面，缩短组合久期，获得稳健收益。股票方面以表现稳定的蓝筹股为底仓，尽可能的多参与新股申购，为组合增厚收益。

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、分管总经理助理、权益投资部总监、固定收益部总监、研究发展部总监、基金事务部总监、基金经理、投资经理、基金会计和有关人员组成。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，估值委员会集体决策，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

2016 年 12 月 28 日本基金实行了 2016 年度利润分配，A 类共分配利润 1,801,820.78 元，其中现金分红 1,801,820.78 元，红利再投资 0 元。C 类共分配利润 562,208,722.13 元，其中现金分红 562,208,722.13 元，红利再投资 0 元。

4.8 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

本报告期，会计师事务所未对本基金出具非标准审计报告。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内无应当说明的预警事项。

§ 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，本基金托管人在对金鹰保本混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，金鹰保本混合型证券投资基金的管理人——金鹰基金管理有限公司在金鹰保本混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内本基金进行 1 次收益分配，分配金额为 564,010,542.91 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

本托管人依法对金鹰基金管理有限公司编制和披露的金鹰保本混合型证券投资基金本年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）审计了 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注，并出具了标准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：金鹰保本混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	14,516,479.42	1,848,660.53
结算备付金	278,611.57	130,347.56
存出保证金	20,049.85	59,438.81
交易性金融资产	433,176,292.38	56,180,793.82
其中：股票投资	54,146,809.58	8,869,291.82
基金投资	-	-
债券投资	379,029,482.80	47,311,502.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	619,038,915.74	-

应收证券清算款	-	-
应收利息	6,240,563.53	1,168,904.22
应收股利	-	-
应收申购款	171,715.99	90,425.08
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,073,442,628.48	59,478,570.02
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2016 年 12 月 31 日	2015 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	-	24,203.02
应付赎回款	221,396,893.19	51,657.02
应付管理人报酬	531,748.48	59,027.81
应付托管费	88,624.72	9,837.97
应付销售服务费	40,185.32	-
应付交易费用	49,747.73	55,732.94
应交税费	203,866.10	203,866.10
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	692,002.13	592,125.06
负债合计	223,003,067.67	996,449.92
所有者权益:		
实收基金	761,001,663.07	45,032,336.57
未分配利润	89,437,897.74	13,449,783.53

所有者权益合计	850,439,560.81	58,482,120.10
负债和所有者权益总计	1,073,442,628.48	59,478,570.02

7.2 利润表

会计主体：金鹰保本混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入	9,184,367.90	2,704,852.29
1.利息收入	6,425,570.45	3,605,141.99
其中：存款利息收入	89,862.60	129,527.19
债券利息收入	4,260,881.18	3,376,226.55
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	2,074,826.67	99,388.25
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	3,186,959.11	-2,754,134.75
其中：股票投资收益	2,774,042.44	-3,721,352.03
基金投资收益	-	-
债券投资收益	389,856.67	953,105.28
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	23,060.00	14,112.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-2,678,588.41	883,020.55
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	2,250,426.75	970,824.50
减：二、费用	3,649,165.97	2,235,397.06

1. 管理人报酬	2,358,416.80	1,055,832.22
2. 托管费	393,069.44	175,972.07
3. 销售服务费	143,408.90	-
4. 交易费用	223,684.22	558,030.20
5. 利息支出	249,558.41	112,836.78
其中：卖出回购金融资产支出	249,558.41	112,836.78
6. 其他费用	281,028.20	332,725.79
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	5,535,201.93	469,455.23
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	5,535,201.93	469,455.23

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金鹰保本混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	45,032,336.57	13,449,783.53	58,482,120.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,535,201.93	5,535,201.93
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）	715,969,326.50	634,463,455.19	1,350,432,781.69
其中：1.基金申购款	1,143,562,967.79	682,535,509.79	1,826,098,477.58
2.基金赎回款	-427,593,641.29	-48,072,054.60	-475,665,695.89

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）	-	-564,010,542.91	-564,010,542.91
五、期末所有者权益（基金净值）	761,001,663.07	89,437,897.74	850,439,560.81
项目	上年度可比期间		
	2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	95,019,178.52	14,778,472.02	109,797,650.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	469,455.23	469,455.23
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）	-49,986,841.95	-1,798,143.72	-51,784,985.67
其中：1.基金申购款	216,021,223.22	54,439,766.09	270,460,989.31
2.基金赎回款	-266,008,065.17	-56,237,909.81	-322,245,974.98
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）	45,032,336.57	13,449,783.53	58,482,120.10

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：

基金管理人负责人：刘岩，主管会计工作负责人：曾长兴，会计机构负责人：谢文君

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

金鹰保本混合型证券投资基金(简称"本基金"),经中国证券监督管理委员会(简称"中国证监会")基金部函[2011]315号文《关于金鹰保本混合型证券投资基金备案确认的函》批准,于2011年5月17日募集成立。本基金为契约型开放式,存续期限不定,保本周期为3年,第一个保本周期自2011年5月17日起至2014年5月19日止。保证人为广州越秀金融控股集团有限公司,基金第一个保本周期届满时,在符合保本基金存续条件下,本基金继续存续并进入下一保本周期,该保本周期的具体起讫日期、保本和担保安排以本基金管理人届时公告为准。本基金第一个保本周期到期日为2014年5月19日,第二个保本周期为3年,起始日为2014年6月21日,到期日为2017年6月21日。第二个保本周期由广州越秀金融控股集团有限公司提供不可撤销的连带责任保证。基金首次设立募集规模为933,906,638.28份基金份额。本基金的基金管理人为金鹰基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《金鹰保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金可投资于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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。股票、权证占基金净资产的比例为0%~40%,其中,权证投资的比例范围占基金资产净值的0%~3%;债券、资产支持证券、货币市场工具、现金、以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金净资产的60%~100%,其中,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。此外,在基金合同和法律法规的允许范围内,本基金将积极参与一级市场新股、新债的申购。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布并于2014年7月修改的《企业会计准则—基本准则》和41项具体会计准则及其应用指南、解释及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”),中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》和中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定而编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2016年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2016年12月31日的财务状况以及2016年1月1日至2016年12月31日的经营成果和基金净值变动情况

等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 差错更正的说明

本基金本年度无差错更正。

7.4.6 税项

1、印花税

根据财政部、国家税务总局财税字[2007]84 号文《关于调整证券（股票）交易印花税率的通知》的规定，自 2007 年 5 月 30 日起，调整证券（股票）交易印花税率，由原先的 1‰调整为 3‰；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税；

经国务院批准,根据财政部、国家税务总局《关于调整证券（股票）交易印花税率的通知》的规定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自 2008 年 9 月 19 日起，证券（股票）交易印花税调整为单边征税,由出让方按证券(股票)交易印花税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变。

2、营业税、增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》，自 2016 年 5 月 1 日起，证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征营业税或增值税。对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

3、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字【2002】128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题

的通知》，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字【2005】103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字【2012】85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、证监会财税字[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。（上市公司派发股息红利，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日之后的，股息红利所得按照本通知的规定执行。）

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
广州证券股份有限公司	基金管理人股东、基金代销机构
广州白云山医药集团股份有限公司	基金管理人股东
美的集团股份有限公司	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、销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
深圳前海金鹰资产管理有限公司	基金管理人子公司

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
-------	----	---------

	2016年1月1日至2016年12月31日		2015年1月1日至2015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
广州证券股份有限公司	-	-	-	-

注： 本基金本年度及上年度可比期间均没有通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
广州证券股份有限公司	-	-	-	-

注： 本基金报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广州证券股份有限公司	-	-	-	-

注： 本基金报告期内没有通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期债券	成交金额	占当期债券

		券回购成 交总额的 比例		券回购成 交总额的 比例
广州证券股份有限公司	-	-	-	-

注：本基金报告期内没有通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本年度及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,358,416.80	1,055,832.22
其中：支付销售机构的客户维护费	308,285.00	399,115.67

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.2%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

若保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，基金份额持有人将所持有本基金份额转为变更后的“金鹰持续收益债券型证券投资基金”的基金份额，管理费按前一日基金资产净值的 0.75% 的年费率计提。计算方法同上。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年
----	-----------------------	----------------------------

	12月31日	12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	393,069.44	175,972.07

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

若保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，基金份额持有人将所持有本基金份额转为变更后的“金鹰持续收益债券型证券投资基金”的基金份额，托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。计算方法同上。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各 关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	金鹰保本混合 A	金鹰保本混合 C	合计
金鹰基金管理有限公司	-	136,003.39	136,003.39
合计	-	136,003.39	136,003.39
获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	金鹰保本混合 A	金鹰保本混合 C	合计
合计	-	-	0.00

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年率为 0.1%。在通常情况下，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.1% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付，于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性划出，由基

金管理人代收，基金管理人收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

若保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，基金份额持有人将所持有本基金份额转为变更后的“金鹰持续收益债券型证券投资基金”的基金份额，金鹰持续收益债券 C 类份额的销售服务费仍按前一日基金资产净值的 0.1% 计提。计算方法同上。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金报告期内及上年度可比期间内均没有与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.5 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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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
中国工商银行股份有限公司	14,516,479.42	70,887.01	1,848,660.53	123,126.69

注：本基金清算备付金本年度期末余额 278,611.57 元，清算备付金利息收入 9,310.03 元；上年度可比期间期末余额 130,347.56 元，清算备付金利息收入 5,717.88 元。

7.4.8.6 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。

7.4.9 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603877	太平鸟	2016-12-29	2017-01-09	网下新股	21.30	21.30	3,180.00	67,734.00	67,734.00	网下

				申购						新股待上市
603035	常熟汽饰	2016-12-27	2017-01-05	网下新股申购	10.44	10.44	2,316.00	24,179.04	24,179.04	网下新股待上市
601375	中原证券	2016-12-20	2017-01-03	网下新股申购	4.00	4.00	26,695.00	106,780.00	106,780.00	网下新股待上市

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 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。

7.4.9.3.2 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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值

的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的不含权固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2015 年 3 月 25 日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

§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	54,146,809.58	5.04
	其中：股票	54,146,809.58	5.04
2	固定收益投资	379,029,482.80	35.31
	其中：债券	379,029,482.80	35.31
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	619,038,915.74	57.67
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	80,027,951.74	7.46
6	银行存款和结算备付金合计	14,795,090.99	1.38
7	其他各项资产	6,432,329.37	0.60
8	合计	1,073,442,628.48	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
----	------	---------	---------------

A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	44,394,630.60	5.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	106,780.00	0.01
K	房地产业	9,645,398.98	1.13
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	54,146,809.58	6.37

8.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

8.2.2.1 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

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	600703	三安光电	1,100,000	14,729,000.00	1.73
2	000157	中联重科	3,000,000	13,620,000.00	1.60

3	000725	京东方 A	3,400,000	9,724,000.00	1.14
4	600565	迪马股份	1,299,919	9,645,398.98	1.13
5	600063	皖维高新	1,000,000	4,630,000.00	0.54
6	600667	太极实业	150,000	1,156,500.00	0.14
7	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.01
8	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.01
9	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.01
10	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.01

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	000157	中联重科	21,291,900.22	36.41
2	600703	三安光电	16,054,652.27	27.45
3	000725	京东方 A	11,994,628.00	20.51
4	601258	庞大集团	9,485,000.00	16.22
5	600565	迪马股份	8,883,837.77	15.19
6	600063	皖维高新	4,633,440.00	7.92
7	600667	太极实业	2,891,341.53	4.94
8	002117	东港股份	2,221,964.53	3.80
9	300224	正海磁材	1,655,241.44	2.83
10	601339	百隆东方	1,383,737.80	2.37
11	002092	中泰化学	1,368,136.00	2.34
12	002325	洪涛股份	1,284,686.00	2.20
13	600741	华域汽车	1,234,418.00	2.11
14	600123	兰花科创	1,219,267.00	2.08
15	600517	置信电气	1,214,400.00	2.08
16	000759	中百集团	1,161,649.00	1.99
17	000709	河钢股份	1,083,000.00	1.85
18	002366	台海核电	1,020,000.00	1.74
19	600019	宝钢股份	1,013,400.00	1.73
20	600029	南方航空	990,000.00	1.69

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	601258	庞大集团	9,555,000.00	16.34
2	000157	中联重科	9,310,535.48	15.92
3	000725	京东方 A	4,155,000.00	7.10
4	600667	太极实业	2,597,727.45	4.44
5	600703	三安光电	2,504,269.48	4.28
6	002117	东港股份	2,279,826.60	3.90
7	300224	正海磁材	1,695,686.60	2.90
8	000042	中洲控股	1,657,580.56	2.83
9	002335	科华恒盛	1,581,413.61	2.70
10	000678	襄阳轴承	1,574,805.00	2.69
11	002061	*ST 江化	1,574,026.00	2.69
12	601339	百隆东方	1,329,221.00	2.27
13	002092	中泰化学	1,288,072.00	2.20
14	000759	中百集团	1,240,813.00	2.12
15	600741	华域汽车	1,240,781.00	2.12
16	600517	置信电气	1,235,000.00	2.11
17	000985	大庆华科	1,184,624.88	2.03
18	600123	兰花科创	1,152,464.15	1.97
19	000709	河钢股份	1,044,000.00	1.79
20	600019	宝钢股份	1,028,046.84	1.76

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

买入股票成本（成交）总额	101,910,281.62
卖出股票收入（成交）总额	63,219,462.75

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	21,610,644.20	2.54
2	央行票据	-	-
3	金融债券	38,468,000.00	4.52
	其中：政策性金融债	38,468,000.00	4.52
4	企业债券	78,434,372.60	9.22
5	企业短期融资券	119,628,000.00	14.07

6	中期票据	42,152,000.00	4.96
7	可转债（可交换债）	11,280,756.00	1.33
8	同业存单	-	-
9	其他	67,455,710.00	7.93
10	合计	379,029,482.80	44.57

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	111619223	16 恒丰银行 CD223	400,000.00	39,164,000.00	4.61
2	160210	16 国开 10	400,000.00	38,468,000.00	4.52
3	101460025	14 潍坊滨投 MTN001	300,000.00	31,845,000.00	3.74
4	1280046	12 来宾债	300,000.00	31,671,000.00	3.72
5	011698336	16 江阴公 SCP005	300,000.00	30,000,000.00	3.53

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

无

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

无

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

8.12.2 本基金报告期内基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 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	20,049.85
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,240,563.53
5	应收申购款	171,715.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,432,329.37

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110032	三一转债	4,089,240.00	0.48
2	110035	白云转债	3,363,120.00	0.40
3	113009	广汽转债	1,974,040.00	0.23
4	128009	歌尔转债	1,028,160.00	0.12
5	123001	蓝标转债	826,196.00	0.10

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 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

份额级别	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
金鹰保本混合 A	1,219	34,375.04	19,433.63	0.05%	41,883,737.69	99.95%
金鹰保本混合 C	847	854,685.50	716,308,876.55	98.95%	7,609,742.19	1.05%
合计	2,066	370,678.50	716,328,310.18	93.54%	49,493,479.88	6.46%

9.2 期末上市基金前十名持有人

本基金非上市基金。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	金鹰保本混合 A	0.00	0.00%
	金鹰保本混合 C	141.64	0.00%
	合计	141.64	0.00%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	金鹰保本混合 A	-
	金鹰保本混合 C	-
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	金鹰保本混合 A	-
	金鹰保本混合 C	-
	合计	0

9.5 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金非发起式基金，本公司未持有基金份额。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	金鹰保本混合 A	金鹰保本混合 C
本报告期期初基金份额总额	50,886,869.47	-
本报告期基金总申购份额	5,328,324.42	1,138,847,116.72
减：本报告期基金总赎回份额	14,312,022.57	414,928,497.98
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	41,903,171.32	723,918,618.74

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开基金份额持有人大会。

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

报告期内基金管理人增聘曾长兴先生为公司副总经理，相关事项已于 2016 年 5 月 13 日进行了信息披露。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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事项。

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

为本基金审计的会计师事务所为中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）。

本报告期内实际应支付会计师事务所的审计费为 32000 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

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	----	------	-----------	----

	单元 数量	成交金额	占当期股 票成交总 额的比例	佣金	占当期佣 金总量的 比例	
国信证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	20,804,740.12	12.69%	18,959.41	13.39%	-
华林证券	1	4,321,034.07	2.63%	3,937.73	2.78%	-
西南证券	2	16,273,424.40	9.92%	14,830.17	10.47%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	553,500.00	0.34%	393.69	0.28%	-
财达证券	1	21,495,535.04	13.11%	19,588.92	13.83%	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	21,824,129.37	13.31%	15,523.53	10.96%	-
长城证券	1	16,751,189.84	10.21%	11,915.29	8.41%	-
浙商证券	1	32,102,528.22	19.57%	29,255.14	20.66%	-
长江证券	1	29,882,523.72	18.22%	27,232.09	19.23%	-

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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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	成交金额	占当期权 证成交总 额的比例

				比例		
国信证券	4,971,075.41	4.87%	4,800,000.00	0.16%	-	-
安信证券	53,762,307.72	52.66%	1,600,000.00	0.05%	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	763,800,000.00	25.56%	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	938,340,000.00	31.40%	-	-
方正证券	11,092,217.81	10.87%	215,000,000.00	7.19%	-	-
开源证券	-	-	106,600,000.00	3.57%	-	-
长城证券	2,002,212.21	1.96%	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	30,261,944.53	29.64%	958,500,000.00	32.07%	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

无

金鹰基金管理有限公司

二〇一七年三月二十九日