

金鹰元丰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

报告送出日期：二〇一七年三月二十九日

§1 重要提示

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	金鹰元丰保本混合
基金主代码	210014
交易代码	210014
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 1 月 30 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	892,272,863.74 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金运用投资组合保险策略，在严格控制投资风险、保证本金安全的基础上，力争在保本周期结束时，实现基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金在投资组合管理过程中采取主动投资方法，通过数量化方法严格控制风险，以保障基金资产本金的安全，并通过有效的资产配置策略，获得基金资产的稳健增值。 本基金股票、权证等风险资产占基金资产的比例不超过 30%，债券、货币市场工具等安全资产占基金资产的比例不低于 70%。
业绩比较基准	2 年期银行定期存款利率（税后）。
风险收益特征	本基金为保本混合型基金，属于证券投资基金中的低风险品种。

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	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

登载基金年度报告摘要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
本期已实现收益	30,008,563.48	118,357,851.11	21,161,761.40
本期利润	13,769,741.17	123,424,840.05	43,398,882.49
加权平均基金份额本期利润	0.0167	0.1247	0.0974
本期基金份额净值增长率	0.55%	17.34%	8.14%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	0.2016	0.2311	0.0512
期末基金资产净值	909,810,911.89	315,837,835.86	86,873,308.89
期末基金份额净值	1.020	1.191	1.015

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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2、上述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、期末可供分配利润，指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

阶段	份额净值增	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①—③	②—④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

	长率①	长率标准差 ②	准收益率③	准收益率标 准差④		
过去三个月	0.29%	0.12%	0.54%	0.01%	-0.25%	0.11%
过去六个月	1.09%	0.10%	1.08%	0.01%	0.01%	0.09%
过去一年	0.55%	0.13%	2.16%	0.01%	-1.61%	0.12%
过去三年	27.56%	0.22%	9.03%	0.01%	18.53%	0.21%
自基金合同生 效起至今	24.88%	0.20%	12.91%	0.01%	11.97%	0.19%

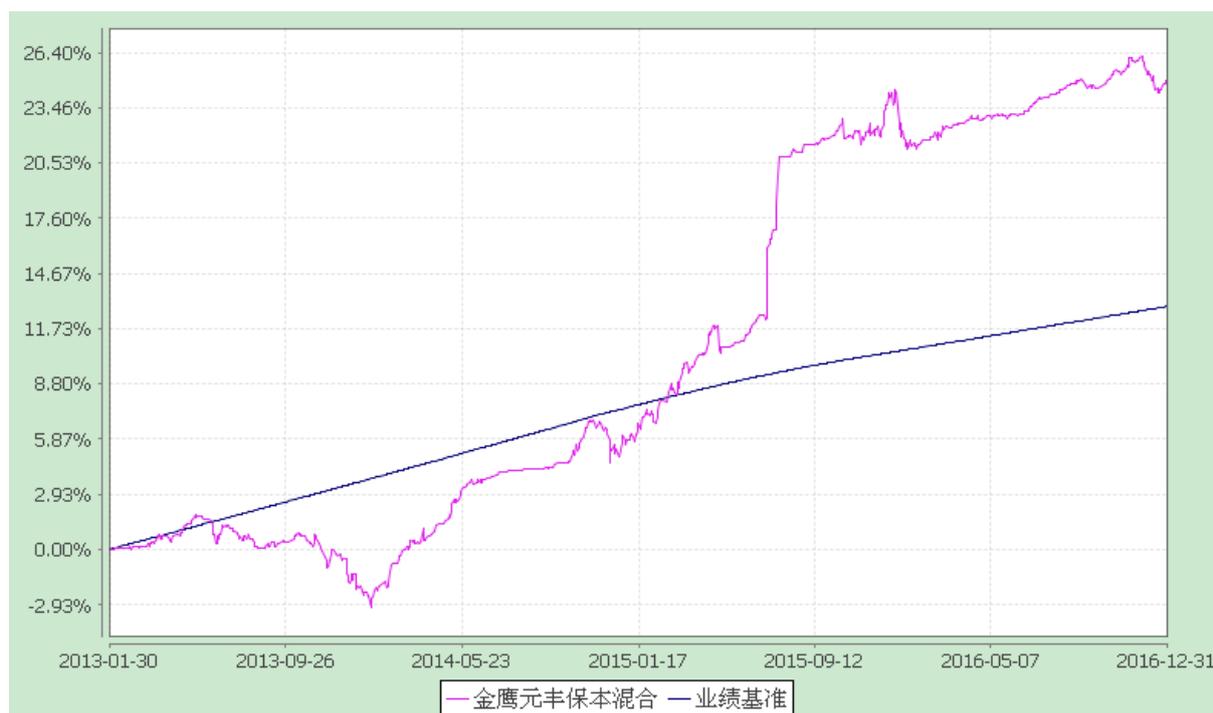
注：本基金的业绩比较基准是：2 年期银行定期存款利率（税后）。

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

金鹰元丰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的历史走势对比图

(2013 年 1 月 30 日至 2016 年 12 月 31 日)



注：1、本基金合同生效日期为 2013 年 1 月 30 日。

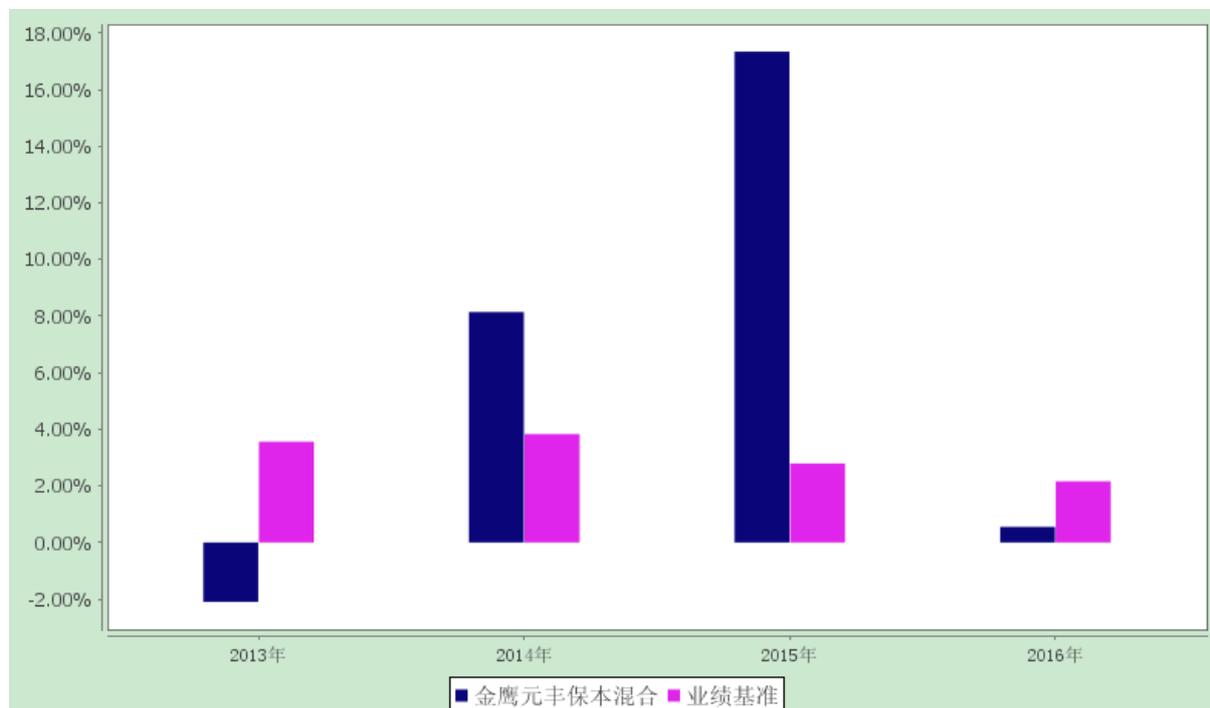
2、本基金建仓期为合同生效后 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例应符合本基金合同有关规定。即股票、权证占基金资产的比例不超过 30%，债券等固定收益类品种占基金资产的比例不低于 70%。

3、本基金的业绩比较基准为：2 年期银行定期存款利率（税后）。

3.2.3 自基金合同生效以来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

金鹰元丰保本混合型证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§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）及基金经理助理的简介

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		
于利强	研究部总监、 基金经理	2015-08- 13	-	8	于利强先生，复旦大学金融学学士。历任安永华明会计师事务所审计师，华禾投资管理有限公司风险投资经理，2009 年加入银华基金管理有限公司，历任旅游、地产、中小盘行业研究员和银华中小盘基金经理助理。2015 年 1 月加入金鹰基金管理有限公司，现任研究部总监、金鹰中小盘精选证券投资基金、金鹰元丰保本混合型证券投资基金、金鹰元安保本混合型证券投资基金、金鹰产业整合灵活配置混合型证券投资基金、金鹰改革红利灵活配置混合型证券投资基金、金鹰元和保本混合型证券投资基金、金鹰多元策略灵活配置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、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。
刘丽娟	固定收益部总 监、基金经 理	2016-10- 19	-	10	刘丽娟女士，中南财经政法大学工商管理硕士。历任恒泰证券股

					份有限公司交易员，投资经理，广州证券股份有限公司债券投资主办。2014 年 12 月加入金鹰基金管理有限公司，现任固定收益部总监、金鹰货币市场证券投资基金、金鹰灵活配置混合型证券投资基金、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、金鹰元祺保本混合型证券投资基金、金鹰元和保本混合型证券投资基金、金鹰添益纯债债券型证券投资基金、金鹰添利纯债债券型证券投资基金、金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）基金经理。
吴德瑄	基金经理、基金经理助理	2016-07-22	-	5	吴德瑄先生，兰州交通大学工学硕士研究生，历任广州证券股份有限公司资产管理部行业研究员，2015 年 1 月加入金鹰基金管理有限公司，历任行业研究员，现任金鹰技术领先灵活配置混合型证券投资基金基金经理，金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金等基金的基金经理助理。
黄倩倩	研究员，基金经理助理	2016-08-19	-	5	黄倩倩女士，硕士研究生，历任广州证券股份有限公司资产管理部债券交易员，2014 年 11 月加入金鹰基金管理有限公司，现任固定收益部债券交易员，金鹰货币市场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、《金鹰元丰保本混合型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中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同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 年债券市场行情，整个债券市场收益率呈现震荡向上的走势。一季度受房价和食品价格持续上升的影响，CPI 超预期，加之房地产投资增速改善，PMI 数据也得到进一步改善，整体经济基本面企稳和通胀抬头给了债券市场一定的上行压力，引致收益率缓慢上行。4 月 MPA 初次考核造成的流动性余悸叠加频频爆出的信用风险事件、营改增的落地，市场悲观情绪蔓延，市场利率

急速上行。直至 5 月受营改增补丁，权威人士讲话的利好影响，市场情绪好转，利率转而下行。6 月英国脱欧引发避险情绪上升，全球债市收益率竞相创出新低，在外围债券市场收益率竞相下行以及市场配置压力集中释放拉动下，国内债券市场收益率也经历了一波下行，随后公布的 7 月份经济金融数据大幅弱于预期，关键期限利率债收益率全线下行，十年期国债收益率一度下行至 2.635%，创 2009 年以来新低。自 8 月中开始，由于前期债券收益率下行速度较快、幅度较大，获利盘获利了结锁定收益，央行相继重启 14 天及 28 天逆回购，通过“缩短放长”控杠杆意图明显，8 月经济金融数据较 7 月份呈现改善的趋势，市场对经济悲观预期有所修正，债券收益率出现了一波回调。10 月初在国庆期间密集出台的楼市限购限贷政策影响下，市场预期房地产投资将下行并带动经济基本面下行压力进一步增大，十年期国债收益率于 10 月 21 日又下行至前期低位，10 月底表外理财将纳入 MPA 考核的消息延续了今年以来监管层防风险、去杠杆的政策思路，11 月初美国大选中川普意外获胜，其大规模财政刺激计划引发市场对美国经济增长和再通胀预期增强，全球风险偏好提升，美元指数表现强劲，海外国债收益率大幅上行，人民币贬值预期强烈，外汇占款持续流出，债券收益率持续缓步上行；随着年末临近，货币市场流动性持续紧张，同业存款、同业存单发行利率大幅上行，市场对监管层去杠杆的决心进一步担忧，叠加国海代持事件的发酵以及市场传闻某基金货币产品巨额亏损的消息，市场恐慌情绪蔓延，债券收益率快速调整，并于 12 月 20 日到达全年收益的最高点，十年期国债相比年初大幅上行近 60BP，十年国开债上行幅度近 80BP，同业存款、同业存单上行幅度近 200BP，调整幅度虽未超过 2013 年钱荒时，但调整速度之快前所未有。随着证监会出面协调国海代持事件和货币市场流动性的好转，市场恐慌情绪缓解，债券收益率在年末最后几个交易日快速下行。整体来看，全年信用债表现强于利率债，中等评级信用债优于高等级信用债。

股票市场在 2016 年呈现震荡分化的行情。全年上证指数下跌了 12.31%，而深成指数下跌了 19.64%，市场整体分化较大，本基金在 2016 年的固定收益投资方面，维持了组合短久期，适度杠杆的策略，获取稳定的利差，避免了四季度债券市场大幅调整而导致的亏损；股票投资方面，较好的进行了波段操作，对个股的结构性行情有较好的把握，积极参与网下新股申购，为组合提供了稳定的超额收益，总体组合在市场大幅调整中获得了正收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.020 元。本报告期份额净值增长 0.55%，同期业绩比较基准增长率为 2.16%。

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 2017 年，经济基本上：经济内生增长动力依旧较弱，中央经济工作会议直指“房子是用来住的,不是用来炒的”，2017 年房地产投资在调控政策下销量放缓将面临下行压力；中央经济工作会议提出“财政政策要更加积极有效”，基建投资可能保持相对较高增长，但受制于财政收入乏力、赤字约束及总体投资体量较高，基建投资增长空间也不大；制造业在企业盈利改善下小幅反弹，但主要由价格驱动，需求相对不足，在供给侧改革约束以及对经济前景预期不乐观的情况下，企业融资和投资需求并未改善。整体经济仍面临下行压力。物价方面：OPEC 和非 OPEC 减产推升油价上涨，供给侧改革推升钢铁、煤炭价格，在非食品价格走高的压力下，明年 CPI 中枢水平预计将小幅提升。政策面上：中央经济工作会议提及货币政策“稳健中性”，适应货币供应方式新变化，调节好货币闸门，货币政策预计将较 2016 年收紧。

基于以上判断，我们认为 2017 年货币市场流动性整体将维持在中性偏紧状态，且银行理财将于一季度正式纳入 MPA 考核,对于银行理财、同业存单的监管政策尚未落地，监管层防风险、去杠杆的监管思路将持续。股票市场在经过了年底的市场调整后，目前整体市场的上涨情绪受到一定的压制。市场在一季度震荡调整的概率较大。同时，进入年报期后，业绩风险逐步凸显，对于成长股压力依旧比较大。整个周期品种随着经济拐点的临近，证伪成为不得不重视的风险。因此，从仓位选择上来说，维持偏低仓位。品种选择上，成长、周期回避，重点关注短期的题材性标的，例如改革。在一季度将继续积极参与网下打新。债券操作上，由于目前短端品种绝对收益较高，而期限利差和信用利差都处于历史相对低位，短端品种性价比较高，我们将继续维持短久期中高评级策略，在中长端方面，将关注市场走势，适当参与波段操作以获得资本利得，并适时调整组合各类资产比例和久期，竭力为持有人服务。

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

本基金报告期内未进行利润分配。

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

本报告期内无应当说明的预警事项。

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

在本报告期内，本基金未出现持有人数或资产净值达到或低于预警线的情形。

§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元丰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，金鹰元丰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元丰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，金鹰元丰保本混合型证券投资基金未进行利润分配。

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元丰保本混合型证券投资基金 2016 年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

本报告期的基金财务会计报告经中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师王兵、赵会娜签字出具了众环审字（2017）050031 号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：金鹰元丰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	707,635.31	10,384,753.43
结算备付金	18,000,373.42	2,083,075.01
存出保证金	91,239.11	277,127.34
交易性金融资产	1,146,510,012.89	272,943,187.06
其中：股票投资	62,848,828.39	47,690,361.66
基金投资	-	-
债券投资	1,083,661,184.50	225,252,825.40
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	240,700,240.00	30,000,165.00
应收证券清算款	898,191.28	-
应收利息	15,380,641.06	2,203,599.61
应收股利	-	-
应收申购款	404.46	11,465.32

递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,422,288,737.53	317,903,372.77
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	509,800,948.20	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	701,278.62	410,256.19
应付管理人报酬	582,682.25	273,098.91
应付托管费	155,381.93	72,826.39
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	186,180.27	665,918.08
应交税费	141,818.87	141,818.87
应付利息	128,161.28	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	781,374.22	501,618.47
负债合计	512,477,825.64	2,065,536.91
所有者权益:	-	-
实收基金	729,920,067.95	254,568,216.31
未分配利润	179,890,843.94	61,269,619.55
所有者权益合计	909,810,911.89	315,837,835.86
负债和所有者权益总计	1,422,288,737.53	317,903,372.77

7.2 利润表

会计主体：金鹰元丰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	25,683,335.96	137,160,287.44
1.利息收入	26,651,236.73	16,311,934.05
其中：存款利息收入	343,288.83	4,060,151.50
债券利息收入	23,159,544.81	8,434,047.26
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	3,148,403.09	3,817,735.29
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	13,848,127.10	86,391,696.76
其中：股票投资收益	14,209,848.28	84,519,596.29
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-743,768.59	1,665,700.47
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	382,047.41	206,400.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-16,238,822.31	5,066,988.94
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	1,422,794.44	29,389,667.69
减：二、费用	11,913,594.79	13,735,447.39
1. 管理人报酬	6,216,567.29	7,881,057.58
2. 托管费	1,657,751.28	2,074,626.78
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	824,187.91	2,786,339.20

5. 利息支出	2,788,090.67	767,751.24
其中：卖出回购金融资产支出	2,788,090.67	767,751.24
6. 其他费用	426,997.64	225,672.59
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	13,769,741.17	123,424,840.05
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	13,769,741.17	123,424,840.05

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金鹰元丰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)	254,568,216.31	61,269,619.55	315,837,835.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	13,769,741.17	13,769,741.17
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)	475,351,851.64	104,851,483.22	580,203,334.86
其中：1.基金申购款	714,956,380.20	159,352,565.22	874,308,945.42
2.基金赎回款	-239,604,528.56	-54,501,082.00	-294,105,610.56
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)	729,920,067.95	179,890,843.94	909,810,911.89
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)	82,072,356.44	4,800,952.45	86,873,308.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	123,424,840.05	123,424,840.05
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)	172,495,859.87	-66,956,172.95	105,539,686.92
其中：1.基金申购款	5,398,682,047.04	646,308,724.63	6,044,990,771.67
2.基金赎回款	-5,226,186,187.17	-713,264,897.58	-5,939,451,084.75
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)	254,568,216.31	61,269,619.55	315,837,835.86

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从 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

金鹰元丰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[2013]58号文《关于金鹰元丰保本混合型证券投资基金备案确认的函》批准,于2013年1月30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18个月,本保本周期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;否则,本基金变更为非保本的债券型基金,基金名称相应变更为“金鹰元丰债券型证券投资基金”。如果本基金不符合法律法规和《基金合同》对基金的存续要求,则本基金将按照《基金合同》的规定终止。本基金首次设立募集规模为781,278,046.90份基金份额。本基金募集期间自2012年12月24日起至2013年1月24日止,净销售额为781,039,673.49元,认购资金在认购期间的银行利息238,373.41元折算成基金资产。上述资金已于2013年1月28日全额划入本基金在基金托管人中国工商银行股份有限公司开立的本基金托管专户。验资机构为立信会计师事务所(特殊普通合伙)。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。

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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外), 鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息, 本基金本报告期内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。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

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 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	0.00	0.00%	-	-

注：本基金本报告期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	0.00	0.00%	-	-

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	0.00	0.00%	-	-

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	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
广州证券股份有限公司	0.00	0.00%	-	-

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

本基金本报告期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	6,216,567.29	7,881,057.58
其中：支付销售机构的客户维护费	2,128,772.16	343,210.92

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.75% 的年费率逐日计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{年费率} \div \text{当年天数}$$

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。在保本周期内，本基金的担保费用从基金管理人的管

理费收入中列支。

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“金鹰元丰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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的托管费	1,657,751.28	2,074,626.78

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% / \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，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“金鹰元丰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。

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
合计	-
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
合计	0.00

注：本基金本报告期及上年度可比期间内均没有应支付关联方的销售服务费。

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

本基金本报告期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。

7.4.8.4.2 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其他关联方未投资本基金。

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		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	
	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	707,635.31	170,201.73	10,384,753.43	4,012,602.34

注：本基金用于证券交易结算的资金通过“工商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，按银行同业利率或约定利率计息，在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示。本基金结算备付金本年度期末余额 18,000,373.42 元，结算备付金利息收入 56,484.69 元；上年度可比期间度结算备付金期末余额 2,083,075.01 元，结算备付金利息收入 44,838.70 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	网下新股申购	21.30	21.30	3,180.00	67,734.00	67,734.00	网下新股待上市
002838	道恩股份	2016-12-28	2017-01-06	网下新股申购	15.28	15.28	681.00	10,405.68	10,405.68	网下新股待上市
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
300586	美联新材	2016-12-26	2017-01-04	网下新股申购	9.30	9.30	1,006.00	9,355.80	9,355.80	网下新股待上市
002840	华统股份	2016-12-29	2017-01-10	网下新股申购	6.55	6.55	1,814.00	11,881.70	11,881.70	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

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	复牌开盘价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300553	广信材	2016-	重大事	48.79	2017-	43.91	1,024.00	9,410.56	49,960.96	重大

7	料	10-12	项停牌		01-13					事项
---	---	-------	-----	--	-------	--	--	--	--	----

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

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值总额
138069	13 长投建债	2017-01-03	82.60	148,000.00	12,224,800.00
1480N3	14 泸纳国资 债	2017-01-03	105.03	500,000.00	52,515,000.00
111698706	16 东莞农村 商业银行 CD081	2017-01-03	98.06	553,000.00	54,227,180.00
111617321	16 光大 CD321	2017-01-03	97.95	1,000,000.00	97,950,000.00
111681866	16 广州农村 商业银行 CD166	2017-01-03	96.00	500,000.00	48,000,000.00
111680834	16 洛阳银行 CD059	2017-01-03	97.90	21,000.00	2,055,900.00
168088	16 唐山金控 债	2017-01-03	97.09	500,000.00	48,545,000.00
合计				3,222,000.00	315,517,880.00

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，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 208,600,000.00 元，于 2016 年 12 月 31 日(先后)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。

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	62,848,828.39	4.42
	其中：股票	62,848,828.39	4.42
2	固定收益投资	1,083,661,184.50	76.19
	其中：债券	1,083,661,184.50	76.19
	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	240,700,240.00	16.92
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	18,708,008.73	1.32
7	其他各项资产	16,370,475.91	1.15
8	合计	1,422,288,737.53	100.00

8.2 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

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	23,845,200.00	2.62
B	采矿业	-	-
C	制造业	30,886,968.07	3.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	103,332.51	0.01
F	批发和零售业	4,156,000.00	0.46
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	3,750,547.81	0.41
J	金融业	106,780.00	0.01
K	房地产业	-	-
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	62,848,828.39	6.91

8.2.2 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	600961	株冶集团	850,000	9,520,000.00	1.05
2	600598	北大荒	550,000	6,710,000.00	0.74
3	000735	罗牛山	650,000	4,654,000.00	0.51
4	600251	冠农股份	550,000	4,460,500.00	0.49
5	002556	辉隆股份	400,000	4,156,000.00	0.46
6	600108	亚盛集团	700,000	4,004,000.00	0.44
7	600299	安迪苏	259,916	3,740,191.24	0.41
8	002174	游族网络	139,966	3,702,100.70	0.41
9	000998	隆平高科	150,000	3,214,500.00	0.35
10	300436	广生堂	55,000	2,972,200.00	0.33

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	601857	中国石油	23,166,463.76	7.33
2	601766	中国中车	20,853,540.71	6.60
3	600028	中国石化	14,964,092.40	4.74
4	600428	中远海特	14,874,084.43	4.71
5	000778	新兴铸管	12,800,979.05	4.05
6	000725	京东方 A	10,206,000.00	3.23
7	600961	株冶集团	9,122,956.39	2.89
8	000063	中兴通讯	7,680,728.01	2.43
9	002572	索菲亚	6,995,907.74	2.22
10	600598	北大荒	5,704,438.00	1.81
11	600079	人福医药	5,497,483.65	1.74
12	002084	海鸥卫浴	4,999,619.28	1.58
13	600048	保利地产	4,999,321.00	1.58
14	000401	冀东水泥	4,998,664.67	1.58
15	000882	华联股份	4,998,431.00	1.58
16	002594	比亚迪	4,997,319.00	1.58
17	600753	东方银星	4,996,688.28	1.58
18	600497	驰宏锌锗	4,981,712.42	1.58

19	002098	浔兴股份	4,931,170.69	1.56
20	600978	宜华生活	4,930,827.00	1.56

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	601857	中国石油	22,650,831.96	7.17
2	601766	中国中车	21,532,772.73	6.82
3	600428	中远海特	16,284,547.26	5.16
4	600028	中国石化	14,910,000.00	4.72
5	000778	新兴铸管	12,974,764.32	4.11
6	000725	京东方 A	11,061,000.00	3.50
7	002572	索菲亚	9,348,788.80	2.96
8	000063	中兴通讯	8,160,670.96	2.58
9	601588	北辰实业	7,261,083.92	2.30
10	600079	人福医药	7,000,221.62	2.22
11	002510	天汽模	6,629,211.00	2.10
12	600048	保利地产	5,508,230.20	1.74
13	002594	比亚迪	5,365,319.00	1.70
14	600978	宜华生活	5,353,481.02	1.70
15	000882	华联股份	5,236,225.00	1.66
16	002098	浔兴股份	5,007,239.89	1.59
17	002084	海鸥卫浴	4,889,014.98	1.55
18	600873	梅花生物	4,877,055.75	1.54
19	000401	冀东水泥	4,798,079.00	1.52
20	600497	驰宏锌锗	4,707,533.00	1.49

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	294,398,134.44
卖出股票的收入（成交）总额	290,596,335.68

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	29,985,000.00	3.30
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,980,000.00	2.20
	其中：政策性金融债	19,980,000.00	2.20
4	企业债券	470,173,148.10	51.68
5	企业短期融资券	70,189,000.00	7.71
6	中期票据	30,402,000.00	3.34
7	可转债	2,220,036.40	0.24
8	同业存单	460,712,000.00	50.64
9	其他	-	-
10	合计	1,083,661,184.50	119.11

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	111698486	16 宁波银行 CD211	1,000,000.00	99,220,000.00	10.91
2	111617321	16 光大 CD321	1,000,000.00	97,950,000.00	10.77
3	111680692	16 贵阳银行 CD068	700,000.00	68,551,000.00	7.53
4	111698706	16 东莞农村商业银行 CD081	600,000.00	58,836,000.00	6.47
5	1480493	14 沪纳国资债	500,000.00	52,515,000.00	5.77

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

本基金报告期内未投资贵金属。

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

本基金报告期内未投资贵金属。

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**

本基金报告期内未进行股指期货投资。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同规定，本基金暂不投资股指期货。

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**

根据本基金基金合同规定，本基金暂不投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同规定，本基金暂不投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金期末持有的前十大重仓股之一北大荒（代码：600598），由于财务会计报告违规、信息披露虚假及严重误导性陈述、未依法履行其他职责，被中国证监会警示、对公司罚款 50 万元。

该事项已于 2016 年 8 月 26 日在指定媒体公开披露。

8.12.2 本基金投资前十名股票未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	91,239.11
2	应收证券清算款	898,191.28
3	应收股利	-

4	应收利息	15,380,641.06
5	应收申购款	404.46
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,370,475.91

8.12.4 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	300537	广信材料	49,960.96	0.01	重大事项停牌

8.12.5 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
5,784	154,265.71	136,250,732.12	15.27%	756,022,131.62	84.73%

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	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	1,095.63	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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	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

本报告期期初基金份额总额	265,143,433.91
本报告期基金总申购份额	747,684,210.69
减：本报告期基金总赎回份额	268,599,390.07
本报告期基金拆分变动份额	148,044,609.21
本报告期期末基金份额总额	892,272,863.74

§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 1、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。

2、本报告期内，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 60000 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	交易单元数量	股票交易		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	佣金	占当期佣金总量的 比例	
国信证券	1	84,538,366.78	14.54%	77,040.10	16.51%	-
安信证券	1	5,702,078.96	0.98%	5,196.00	1.11%	-
中信证券	1	9,962,102.16	1.71%	9,078.28	1.95%	-
银河证券	2	166,124,851.84	28.57%	118,164.74	25.32%	-
爱建证券	1	52,979,128.22	9.11%	48,279.05	10.35%	-
东方证券	1	17,059,744.10	2.93%	15,546.51	3.33%	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	1,999,276.00	0.34%	1,821.97	0.39%	-
国泰君安证券	1	19,670,461.30	3.38%	18,319.21	3.93%	-
开源证券	1	33,045,982.42	5.68%	23,504.66	5.04%	-
齐鲁证券	1	36,901,480.50	6.35%	33,627.72	7.21%	-
首创证券	1	43,020,556.82	7.40%	30,600.37	6.56%	-
长城证券	1	76,245,785.49	13.11%	54,233.96	11.62%	-
浙商证券	1	34,259,039.83	5.89%	31,220.23	6.69%	-
中信建投证券	1	47,577.72	0.01%	33.84	0.01%	-
长江证券	1	-	-	-	-	-

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、个股分析报告及丰富全面的信息服务；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		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	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国信证券	1,662,078.87	1.03%	53,000,000.00	0.48%	-	-
安信证券	-	-	1,500,000.00	0.01%	-	-
银河证券	-	-	162,000,000.00	1.47%	-	-
爱建证券	-	-	6,092,900,000.00	55.25%	-	-
东兴证券	-	-	1,072,880,000.00	9.73%	-	-
方正证券	159,832,738.63	98.84%	68,600,000.00	0.62%	-	-
国金证券	-	-	20,000,000.00	0.18%	-	-
国泰君安证券	-	-	500,000.00	-	-	-
开源证券	-	-	1,036,000,000.00	9.39%	-	-
齐鲁证券	-	-	20,400,000.00	0.18%	-	-
首创证券	-	-	2,366,300,	21.46%	-	-

			000.00			
长城证券	219,366.00	0.14%	-	-	-	-
浙商证券	-	-	90,000,00 0.00	0.82%	-	-
长江证券	-	-	44,100,00 0.00	0.40%	-	-

§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