

金鹰元安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：广发银行股份有限公司

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。

基金托管人广发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	金鹰元安保本混合	
基金主代码	000110	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 5 月 20 日	
基金管理人	金鹰基金管理有限公司	
基金托管人	广发银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	526,683,818.02 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	金鹰元安保本混合 A	金鹰元安保本混合 C
下属分级基金的交易代码	000110	002513
报告期末下属分级基金的份额总额	26,934,672.64 份	499,749,145.38 份

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，严格控制投资风险，在为符合保本条件的投资金额提供保本保障的基础上，力争在保本周期到期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，并通过有效的资产配置策略，动态调整安全资产和风险资产的投资比例，以确保保本周期到期时实现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 40%；债券、货币市场工具等安全资产占基金资产的比例不低于 60%，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%。
业绩比较基准	2 年期银行定期存款利率（税后） 在基金合同生效日，业绩比较基准为中国人民银行公布的、该日适用的 2 年期银行定期存款利率（税后）；并随着 2 年期银行定期存款利率的调整而动态调整。
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，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	广发银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	苏文锋	周小磊
	联系电话	020-83282627	010-65169562
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	lichunlei@cgbchina.com.cn
客户服务电话		4006135888,020-83936180	400-830-8003
传真		020-83282856	020-65169555

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	
	金鹰元安保 本混合 A	金鹰元安保 本混合 C	金鹰元安保 本混合 A	金鹰元安保 本混合 C	金鹰元安保 本混合 A	金鹰元安保 本混合 C
本期已 实现收 益	1,352,326.0 2	3,919,748.86	39,427,161.8 7	-	13,849,216.4 0	-
本期利 润	- 2,422,523.2 4	-4,402,679.77	40,903,353.2 4	-	18,037,306.3 8	-
加权平 均基金 份额本 期利润	-0.0189	-0.0121	0.0918	-	0.1271	-
本期基 金份额 净值增	-0.21%	-0.81%	15.82%	-	12.94%	-

长率						
3.1.2 期末 数据和指 标	2016 年末		2015 年末		2014 年末	
	金鹰元安保本 混合 A	金鹰元安保本 混合 C	金鹰元安保本 混合 A	金鹰元安保本 混合 C	金鹰元安保本 混合 A	金鹰元安保本 混合 C
期末可供分配 基金份额利润	0.2260	-0.0081	0.2069	-	0.1299	-
期末基金资产 净值	28,081,311. 13	495,691,882. 29	204,602,213. 52	-	112,770,528. 04	-
期末基金份 额净值	1.0426	0.9919	1.0448	-	1.1337	-

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）；

4、依据基金合同，经与本基金托管人协商一致，金鹰元安保本混合型证券投资基金自 2016 年 3 月 10 日起增设 C 类份额，故 C 类份额无上年度及上上年度可比数据（下同）。

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

金鹰元安保本混合 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	-0.34%	0.12%	0.53%	0.01%	-0.87%	0.11%
过去六个月	-0.04%	0.09%	1.06%	0.01%	-1.10%	0.08%
过去一年	-0.21%	0.15%	2.13%	0.01%	-2.34%	0.14%
过去三年	30.53%	0.25%	9.00%	0.01%	21.53%	0.24%
自基金合同生 效起至今	31.02%	0.24%	11.59%	0.01%	19.43%	0.23%

金鹰元安保本混合 C

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	-1.06%	0.10%	0.53%	0.01%	-1.59%	0.09%
过去六个月	-0.86%	0.08%	1.06%	0.01%	-1.92%	0.07%
自基金合同生 效起至今	-0.81%	0.07%	1.73%	0.01%	-2.54%	0.06%

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

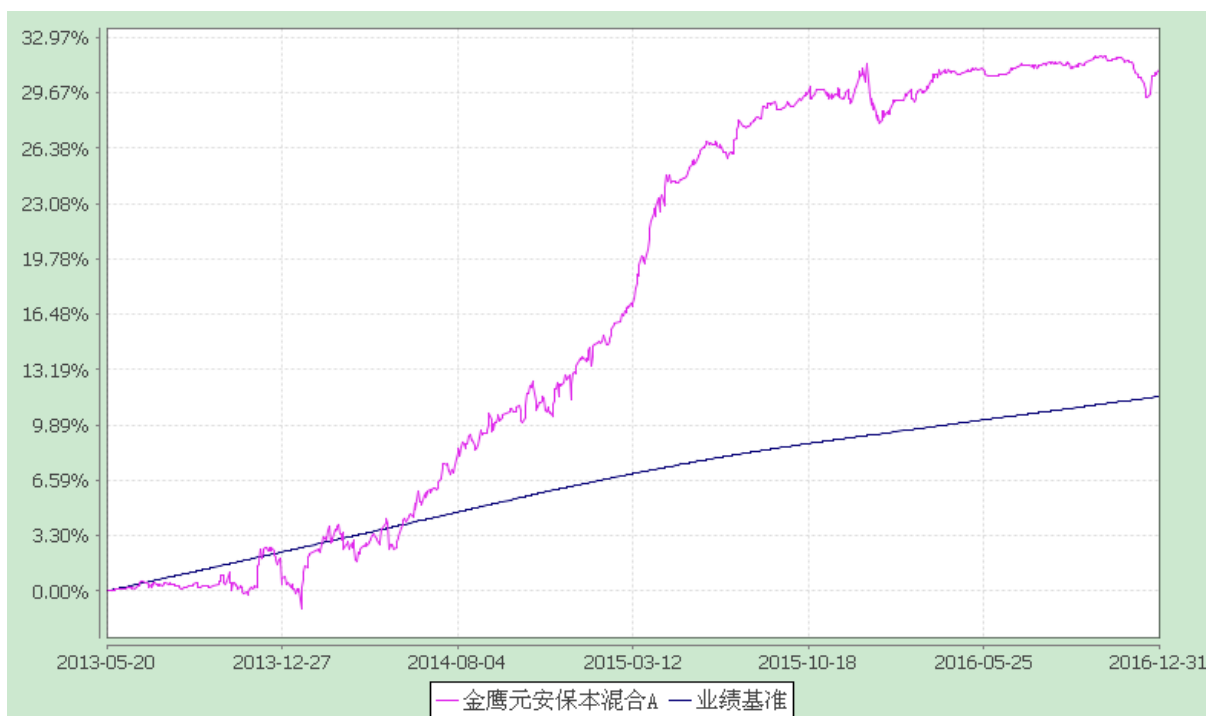
金鹰元安保本混合型证券投资基金

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

(2013 年 5 月 20 日至 2016 年 12 月 31 日)

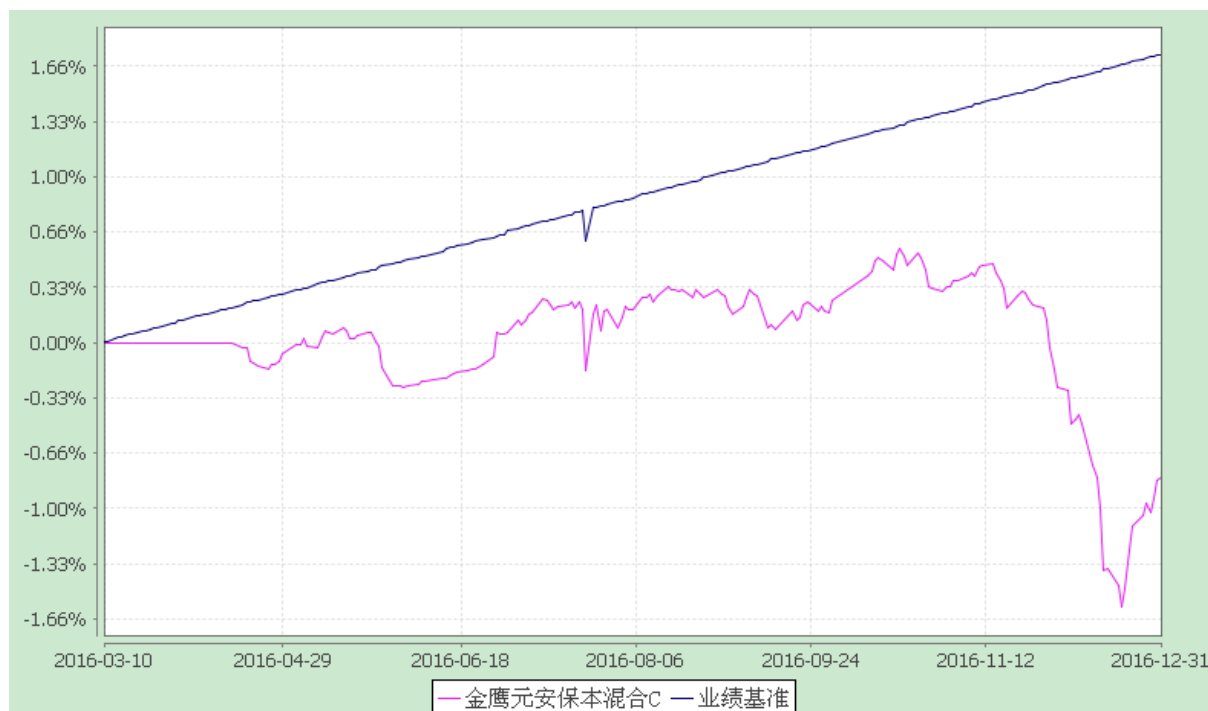
金鹰元安保本混合 A

(2013 年 5 月 20 日至 2016 年 12 月 31 日)



金鹰元安保本混合 C

(2013 年 5 月 20 日至 2016 年 12 月 31 日)



注：1、本基金 2013 年 5 月 20 日成立。

2、按基金合同规定，本基金的建仓期为 6 个月。建仓期满后，股票、权证等风险资产占基金资产的比例不超过 40%；债券、货币市场工具等安全资产占基金资产的比例不低于 60%，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%。

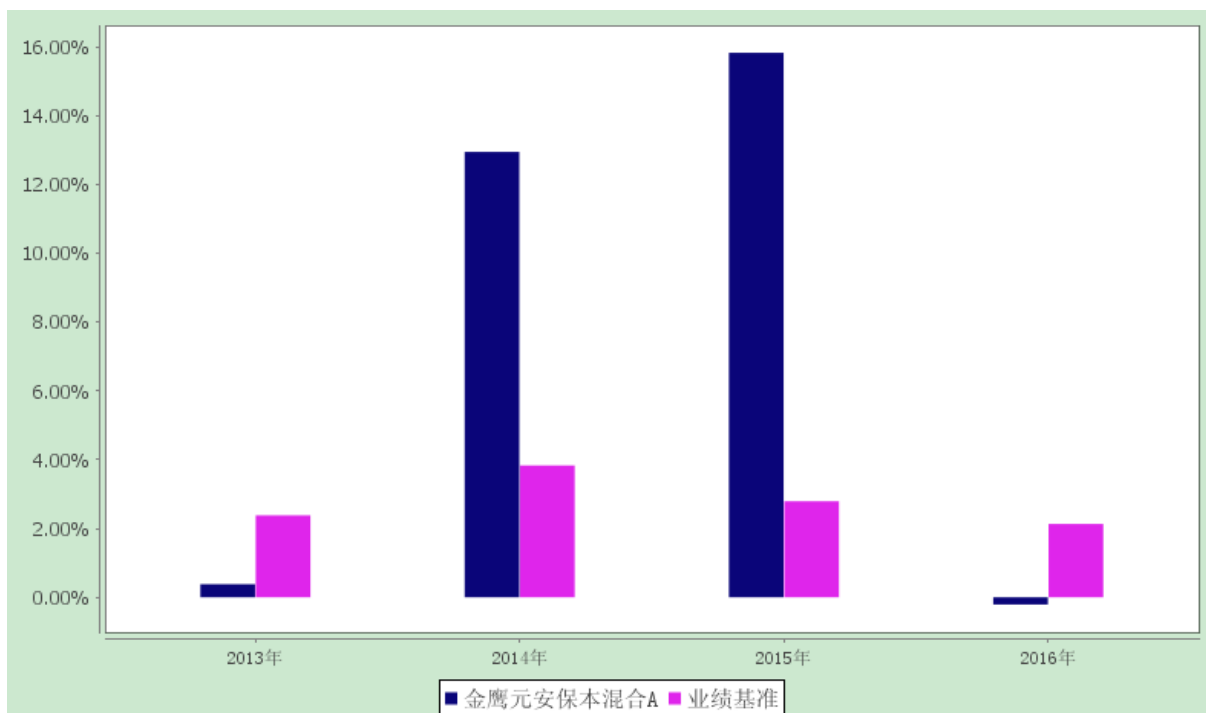
3、本基金的业绩比较基准是：2 年期银行定期存款利率（税后）。

3.2.3 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

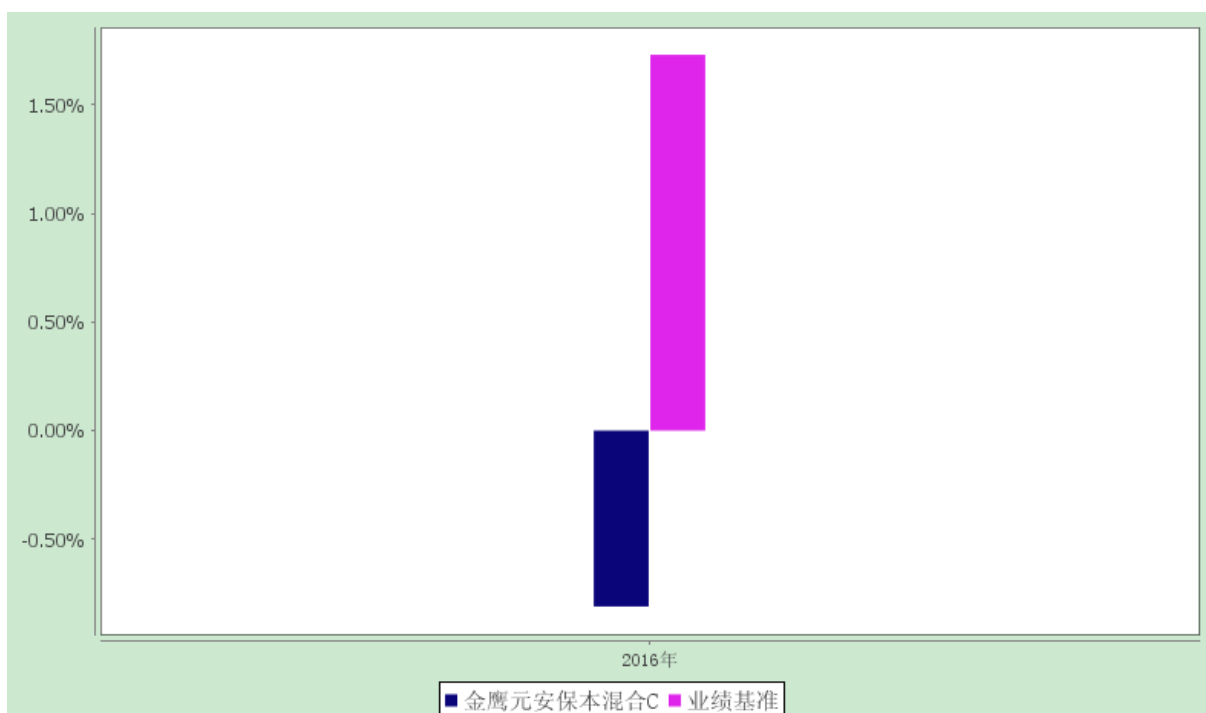
金鹰元安保本混合型证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图

金鹰元安保本混合 A



金鹰元安保本混合 C



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金及过去三年内未进行利润分配。

§ 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金字[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		
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。

于利强	研究部总监、基金经理	2015-09-07	-	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。
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	2016-06-24	-	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，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 年债券市场行情，整个市场经历了三轮起落，第一轮起落（1 月—4 月），第二轮起落（5 月—9 月），第三轮起落（9 月-12 月）。

第一轮起落：15 年 12 月-16 年 1 月初：对 2016 经济预期较为悲观、资产荒背景下机构配置需求强劲，10 年国债、10 年国开一度触及 2.7% 与 3.0% 的收益率低点。16 年 1 月初-16 年 4 月底：供给侧改革进展较慢导致市场对政府重回需求侧刺激预期有所加强，1 月信贷天量数据，大宗商品价格反弹，CPI 超预期，经济企稳预期再起，4 月爆发多起信用风险事件，营改增、去杠杆等导致收益率大幅上行：10 年国债升至 2.95%；10 年国开升至 3.5%。第二轮起落：16 年 5 月-16 年 8 月初：5 月受营改增补丁，信用事件平息，权威人士讲话的利好影响，收益率开始回落；6 月虽有保险通道类业务监管文件引发市场对金融去杠杆担忧，以及美国加息预期反复等影响，导致债市有所反复，但并未形成趋势；6 月下旬英国脱欧，引发全球央行相继放水的预期，7 月金融和投资数据大幅回落，前期集聚的配置压力集中释放，收益率继续下行直到 8 月中旬：10 年国债下行至 2.64%；10 年国开下行至 3.04%；16 年 8 月中-16 年 8 月底：央行重启 14 天逆回购、企业盈利数据改善、美联储加息预期上升、国内债市去杠杆预期，造成 8 月后半月收益率大幅上行，10 年国债升至 2.8%，10 年国开升至 3.2%。第三轮起落：16 年 9 月中-16 年 10 月中，经济数据低于预期，央行祭出 28 天逆回购下调利率，国庆长假期间出台房地产限购政策，收益率再下一城：10 年国债降至 2.64%，10 年国开降至 3.04%。16 年 10 月-16 年 12 月：国内经济形势持续好转，主要经济指标持续改善，11 月美国大选，特朗普意外获胜，其宽财政及振兴制造业政策导致海外风险偏好大幅回升，美国国债收益率持续回升，中美国债利差持续收窄，同时，央行要求抑制资产泡沫和防范经济金融风险，货币政策转向为收紧，伴随理财纳入 MPA 考核传闻，机构代持事件、监管出台理财新规、联储 17 年加息前瞻指引超预期等负面事件集中冲击债券市场，资金市场也经历数次紧张时刻，受此影响，短端债券收益大幅攀升，十年国开上行幅度近 80bp，同业存款、同业存单上行幅度近 200BP，调整速度前所未有。随后央行公开市场操作连续大额净投放，对冲维稳市场流动性，年底财政存款集中投放，整个银行间流动性危机得到缓解。

2016 年股票市场整体呈现震荡分化的行情，全年上证指数下跌了 12.31%，深成指数下跌了 19.64%，市场整体分化较大。本基金在 2016 年固定收益投资方面，维持了高评级、中短久期、适

度杠杆的策略，同时，积极参与货币市场回购套利，赚取稳定的利差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，基金 A 类份额净值 1.0426 元，本报告期份额净值增长-0.21%，同期业绩比较基准增长率为 2.13%；基金 C 类份额净值 0.9919 元，本报告期份额净值增长-0.81%，同期业绩比较基准增长率为 1.73%。

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 17 年，从经济基本面来看，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 年商品房销售放缓之后，商品房库存可能再次累积，对经济形成较大压力。工业企业利润今年持续改善，但主要由价格驱动，需求相对不足，工业企业利润改善向投资传导有限，当前库存处于低位，后续制造业企业或主动补库存，但幅度与持续性预计都有限。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。2017 年非食品通胀可能温和回升，食品通胀可能有所放缓，通胀总体温和的可能性较大。春节移动假日因素使得明年 1 月 CPI 处于高位，2 月快速回落，3 月之后有所回升，下半年通胀相对平稳，总体处于相对温和状态。长期来看对债市构成支撑。

从货币政策来看，“稳健中性”“调节好货币闸门”不仅仅是方向上偏紧，更意在调整资金投放结构。保量不保价，银行非银有别，拉长负债久期等或是可能的方向。因此我们认为 2017 年一季度流动性整体将维持在中性偏紧的状态，且一季度理财将正式纳入 MPA 考核，管理层防风险去杠杆的思路将持续，机构代持事件可能会在年后迎来正式的监管，债券市场一季度陷入震荡行情的概率较大。从供需来看，供给方面，2017 年财政赤字上升有限且专项金融债放缓的大背景下，整体利率债的供给不会明显超过 2016 年。而信用债的净增量可能因为表外机构的配置需求减弱以及监管重新限制房地产等企业发债而较 2016 年减少。需求方面，尽管表外理财因为放缓而配债需求减弱，但大型银行的自营、保险、地方社保以及养老金的配置需求在增强，供需仍相对均衡。而需求增强的这些机构风险偏好更低，偏好于投资利率债和高等级信用债，对利率债和高等级信用债的支撑相对明显。

基于以上判断，我们认为目前债券市场利率债、高等级信用债、同业存单及回购资产性价比好于其他品种。在操作上本基金仍将以配置中短久期、中高等级信用债为主，维持一定杠杆的操作，同时积极进行长端利率债的波段操作，提高组合收益。

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

本基金本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，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

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，广发银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对金鹰元安保本混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作方面进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、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：金鹰元安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	1,189,612.53	4,259,466.46
结算备付金	6,430,507.01	2,000,323.69
存出保证金	194,713.45	288,954.72
交易性金融资产	571,639,789.80	235,799,196.11
其中：股票投资	0.00	29,490,375.81
基金投资	-	-
债券投资	571,639,789.80	206,308,820.30
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	122,762,864.04	-
应收证券清算款	-	-

应收利息	8,373,836.55	4,161,748.36
应收股利	-	-
应收申购款	99.21	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	710,591,422.59	246,509,689.34
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	185,099,515.90	40,100,000.00
应付证券清算款	5,555.55	-
应付赎回款	67,032.24	654,585.79
应付管理人报酬	582,847.24	281,945.52
应付托管费	97,141.22	46,990.92
应付销售服务费	41,974.21	-
应付交易费用	94,291.14	268,231.67
应交税费	2,143.80	2,143.80
应付利息	56,696.37	3,475.86
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	771,031.50	550,102.26
负债合计	186,818,229.17	41,907,475.82
所有者权益:		
实收基金	521,182,127.07	155,819,821.03
未分配利润	2,591,066.35	48,782,392.49
所有者权益合计	523,773,193.42	204,602,213.52

负债和所有者权益总计	710,591,422.59	246,509,689.34
------------	----------------	----------------

7.2 利润表

会计主体：金鹰元安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	3,660,882.66	49,628,519.13
1.利息收入	18,816,275.48	11,086,570.42
其中：存款利息收入	193,046.86	1,295,550.04
债券利息收入	16,276,198.54	9,034,102.70
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	2,347,030.08	756,917.68
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-3,794,957.66	29,741,548.85
其中：股票投资收益	-3,060,089.54	27,624,777.22
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-751,656.12	1,865,842.23
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	16,788.00	250,929.40
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-12,097,277.89	1,476,191.37
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	736,842.73	7,324,208.49
减：二、费用	10,486,085.67	8,725,165.89
1. 管理人报酬	5,905,116.00	5,245,962.86

2. 托管费	984,186.04	874,327.15
3. 销售服务费	358,650.24	-
4. 交易费用	722,607.82	731,662.40
5. 利息支出	2,125,025.57	1,538,563.48
其中：卖出回购金融资产支出	2,125,025.57	1,538,563.48
6. 其他费用	390,500.00	334,650.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-6,825,203.01	40,903,353.24
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-6,825,203.01	40,903,353.24

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金鹰元安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）	155,819,821.03	48,782,392.49	204,602,213.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-6,825,203.01	-6,825,203.01
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）	365,362,306.04	-39,366,123.13	325,996,182.91
其中：1.基金申购款	1,004,409,066.62	2,024,134.49	1,006,433,201.11
2.基金赎回款	-639,046,760.58	-41,390,257.62	-680,437,018.20
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）	521,182,127.07	2,591,066.35	523,773,193.42
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）	99,468,059.57	13,302,468.47	112,770,528.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	40,903,353.24	40,903,353.24
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）	56,351,761.46	-5,423,429.22	50,928,332.24
其中：1.基金申购款	1,258,659,055.23	316,410,577.81	1,575,069,633.04
2.基金赎回款	-1,202,307,293.77	-321,834,007.03	-1,524,141,300.80
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）	155,819,821.03	48,782,392.49	204,602,213.52

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

金鹰元安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]361号文《关于金鹰元安保本混合型证券投资基金备案确认的函》批准,于2013年5月20日募集成立。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为257,736,730.13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,基金托管人为广发银行股份有限公司。

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

本基金财务报表符合企业会计准则和《证券投资基金会计核算业务指引》的要求,真实、完整地反映了本基金2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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

本基金报告期内无差错更正。

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》以及财政部、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。

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
广发银行股份有限公司	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	540,190,737.17	100.00%	549,725,510.47	100.00%

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	成交金额	占当期债

		券成交总 额的比例		券成交总 额的比例
广州证券股份有限公司	319,275,421.24	100.00%	182,041,330.68	100.00%

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	4,777,900,000.00	100.00%	3,313,854,000.00	100.00%

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016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
广州证券股份有限公司	384,235.33	100.00%	76,361.62	100.00%
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
广州证券股份有限公司	386,907.95	100.00%	266,908.17	100.00%

注：1、股票交易佣金的计提标准：支付佣金=股票成交金额*佣金比例-证管费-经手费-结算风险金（含债券交易）；

2、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

3、本基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。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。

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	5,905,116.00	5,245,962.86
其中：支付销售机构的客户维护费	136,005.77	241,624.91

注：1、基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.2% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% / \text{当年天数}$$

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、基金管理费每日计提，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，基金托管人复核后与次月前 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。

保本周期内，本基金的担保费用从基金管理人的管理费用收入中列支。

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“金鹰元安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 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托管费	984,186.04	874,327.15

注：1、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

2、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“金鹰元安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		
	金鹰元安保本混合 A	金鹰元安保本混合 C	合计
金鹰基金管理有限公司	-	358,650.22	358,650.22
合计	-	358,650.22	358,650.22
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		
	金鹰元安保本混合 A	金鹰元安保本混合 C	合计
金鹰直销	-	-	0.00
广州证券	-	-	0.00
广发银行	-	-	0.00
合计	-	-	0.00

注：1、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费率为 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：

$$H = E \times 0.1\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

2、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照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。销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金行销广告费、促销活动费、基金份额持有人服务费等。

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

本基金本报告期无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		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	2015年1月1日至2015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
广发银行股份有限公司	1,189,612.53	119,942.28	4,259,466.46	1,261,400.74

注：本基金用于证券交易结算的资金通过“广发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。本基金结算备付金本年度期末余额 6,430,507.01 元，结算备付金利息收入 30481.24 元；2015 年结算备付金期末余额 2,000,323.69 元，结算备付金利息收入 31,720.83 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无流通受限证券。

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

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金从事证券银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券余额款 109,399,515.90 元，抵押证券如下：

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
1480271	14 虞交通债	2017-01-03	106.24	100,000.00	10,624,000.00
101553018	15 联通 MTN002	2017-01-03	100.35	500,000.00	50,175,000.00
101660049	16 赣高速 MTN003	2017-01-03	98.69	500,000.00	49,345,000.00
111699018	16 瑞丰银行	2017-01-03	97.98	30,000.00	2,939,400.00

	CD073				
合计				1,130,000.00	113,083,400.00

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本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余额款 75,700,000.00 元。其中 35,700,000.00 元于 2017 年 1 月 3 日到期，20,000,000.00 元于 2016 年 1 月 5 日到期，20,000,000.00 元于 2016 年 1 月 6 日到期。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	-	-

	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	571,639,789.80	80.45
	其中：债券	571,639,789.80	80.45
	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	122,762,864.04	17.28
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	53,962,864.04	7.59
6	银行存款和结算备付金合计	7,620,119.54	1.07
7	其他各项资产	8,568,649.21	1.21
8	合计	710,591,422.59	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

本基金本报告期末未持有股票投资。

8.3 报告期内股票投资组合的重大变动

8.3.1 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	000426	兴业矿业	10,331,759.00	5.05
2	002174	游族网络	7,942,111.60	3.88
3	600428	中远海特	7,832,861.44	3.83
4	000662	天夏智慧	7,363,868.48	3.60
5	000657	中钨高新	6,815,474.76	3.33
6	600961	株冶集团	5,998,915.00	2.93
7	000725	京东方 A	5,953,000.00	2.91
8	600195	中牧股份	5,831,702.59	2.85
9	000778	新兴铸管	5,461,295.39	2.67
10	300315	掌趣科技	5,016,681.00	2.45
11	300347	泰格医药	4,907,737.64	2.40

12	002221	东华能源	4,822,908.00	2.36
13	600221	海南航空	4,746,000.00	2.32
14	300436	广生堂	4,251,384.00	2.08
15	600497	驰宏锌锗	4,229,134.90	2.07
16	603883	老百姓	3,460,601.50	1.69
17	002112	三变科技	3,456,000.00	1.69
18	002556	辉隆股份	3,077,353.00	1.50
19	000063	中兴通讯	3,073,483.57	1.50
20	600711	盛屯矿业	3,032,192.00	1.48

8.3.2 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	000426	兴业矿业	10,581,551.00	5.17
2	600428	中远海特	8,915,442.67	4.36
3	002174	游族网络	7,133,382.00	3.49
4	000657	中钨高新	6,615,724.44	3.23
5	600873	梅花生物	6,448,741.00	3.15
6	000662	天夏智慧	6,405,240.26	3.13
7	000725	京东方 A	6,218,000.00	3.04
8	600195	中牧股份	5,891,010.00	2.88
9	002510	天汽模	5,860,417.75	2.86
10	000778	新兴铸管	5,488,800.00	2.68
11	600961	株冶集团	5,382,217.00	2.63
12	300315	掌趣科技	4,863,028.00	2.38
13	600221	海南航空	4,705,071.00	2.30
14	600497	驰宏锌锗	4,647,035.52	2.27
15	300347	泰格医药	4,373,101.50	2.14
16	002221	东华能源	4,364,446.00	2.13
17	300436	广生堂	3,882,230.69	1.90
18	002438	江苏神通	3,564,916.40	1.74
19	603883	老百姓	3,466,956.00	1.69
20	000063	中兴通讯	3,269,261.00	1.60

8.3.3 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	258,385,297.23
卖出股票收入（成交）总额	282,044,350.98

8.4 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	27,990,000.00	5.34
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	143,175,789.80	27.34
5	企业短期融资券	49,650,000.00	9.48
6	中期票据	243,061,000.00	46.41
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	107,763,000.00	20.57
9	其他	-	-
10	合计	571,639,789.80	109.14

8.5 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	088040	08 铁道 01	500,000.00	50,695,000.00	9.68
2	101553018	15 联通 MTN002	500,000.00	50,175,000.00	9.58
3	011698670	16 西江 SCP004	500,000.00	49,650,000.00	9.48
4	136513	16 电投 03	500,000.00	49,430,000.00	9.44
5	101660049	16 赣高速 MTN003	500,000.00	49,345,000.00	9.42

8.6 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投资。

8.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.8 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投资。

8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**8.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

8.9.2 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。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.10.1 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。

8.10.2 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进行国债期货投资。

8.10.3 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。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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	194,713.45
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,373,836.55
5	应收申购款	99.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	8,568,649.21
---	----	--------------

8.11.4 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可转换债券投资。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票投资。

8.11.6 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
金鹰元安保本混合 A	2,912	9,249.54	748,073.73	2.78%	26,186,598.91	97.22%
金鹰元安保本混合 C	2	249,874,572.69	499,749,125.44	100.00%	19.94	0.00%
合计	2,914	180,742.56	500,497,199.17	95.03%	26,186,618.85	4.97%

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	金鹰元安保本混合 A	-	-
	金鹰元安保本混合 C	-	-
	合计	0.00	0.00%

注：无

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	金鹰元安保本混合 A	-
	金鹰元安保本混合 C	-
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	金鹰元安保本混合 A	-
	金鹰元安保本混合 C	-
	合计	0

注：无

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	金鹰元安保本混合 A	金鹰元安保本混合 C
基金合同生效日（2013 年 5 月 20 日）基金份额总额	257,736,730.13	-
本报告期期初基金份额总额	195,825,317.24	-
本报告期基金总申购份额	6,190,655.61	999,483,002.35
减：本报告期基金总赎回份额	175,081,300.21	499,733,856.97
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	26,934,672.64	499,749,145.38

§ 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

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。

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 53000 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

本基金报告期内无管理人、托管人的托管业务部门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	
广州证券股份有限公司	2	540,190,737.17	100.00%	384,235.33	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		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	319,275,421.24	100.00%	4,777,900,000.00	100.00%	-	-

§ 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