

# 金鹰技术领先灵活配置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	金鹰技术领先灵活配置混合	
基金主代码	210007	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 7 月 9 日	
基金管理人	金鹰基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	17,406,138.21 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	金鹰技术领先混合 A	金鹰技术领先混合 C
下属分级基金的交易代码	210007	002196
报告期末下属分级基金的份额总额	16,990,288.29 份	415,849.92 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制风险并保持良好流动性的前提下，投资于技术领先相关主题的上市公司，通过对股票、固定收益和现金类等资产的积极配置，力争使基金份额持有人获得超额收益与长期资本增值。
投资策略	本基金将从宏观经济、宏观政策、证券市场和行业因素等维度进行综合分析，主动判断市场时机，在严格控制投资组合风险的前提下，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票类资产、固定收益类资产、现金类资产等各类资产类别上的投资比例，最大限度的提高收益。本基金投资组合中股票资产占基金资产的比例为 0-95%，投资于技术领先相关主题证券比例不低于非现金资产的 80%。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中高等风险水平的投资品种。

## 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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	苏文锋	王永民
	联系电话	020-83282627	010-66594896
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4006135888,020-83936180	95566
传真		020-83282856	010-66594942

## 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	<a href="http://www.gefund.com.cn">http://www.gefund.com.cn</a>
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 7 月 9 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日	
	金鹰技术领先混合 A	金鹰技术领先混合 C	金鹰技术领先混合 A	金鹰技术领先混合 C
本期已实现收益	2,008,203.57	37,630.11	6,038,702.85	-
本期利润	1,004,817.01	7,558.99	4,157,633.90	-
加权平均基金份额本期利润	0.0319	0.0032	0.1017	-
本期基金份额净值增长率	1.42%	14.60%	12.90%	-
3.1.2 期末 数据和指 标	2016 年末		2015 年末	
	金鹰技术领先混合 A	金鹰技术领先混合 C	金鹰技术领先混合 A	金鹰技术领先混合 C

期末可供分配基金份额利润	0.4575	0.1461	0.1837	-
期末基金资产净值	19,459,307.10	476,626.03	67,463,545.07	-
期末基金份额净值	1.145	1.146	1.129	-

注：1、本基金由金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金自 2015 年 7 月 8 日转型而来，故上年度可比期间的数据为 2015 年 7 月 9 日至 2015 年 12 月 31 日的财务数据。

### 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

##### 金鹰技术领先混合 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	-1.97%	0.20%	0.00%	0.39%	-1.97%	-0.19%
过去六个月	-1.80%	0.15%	2.72%	0.40%	-4.52%	-0.25%
过去一年	1.42%	0.57%	-4.29%	0.71%	5.71%	-0.14%
自基金合同生效起至今	14.50%	0.54%	-0.18%	0.93%	14.68%	-0.39%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%

##### 金鹰技术领先混合 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	-1.80%	0.20%	0.00%	0.39%	-1.80%	-0.19%
过去六个月	14.60%	1.50%	2.72%	0.40%	11.88%	1.10%
自基金合同生效起至今	14.60%	1.33%	4.20%	0.42%	10.40%	0.91%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%

#### 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

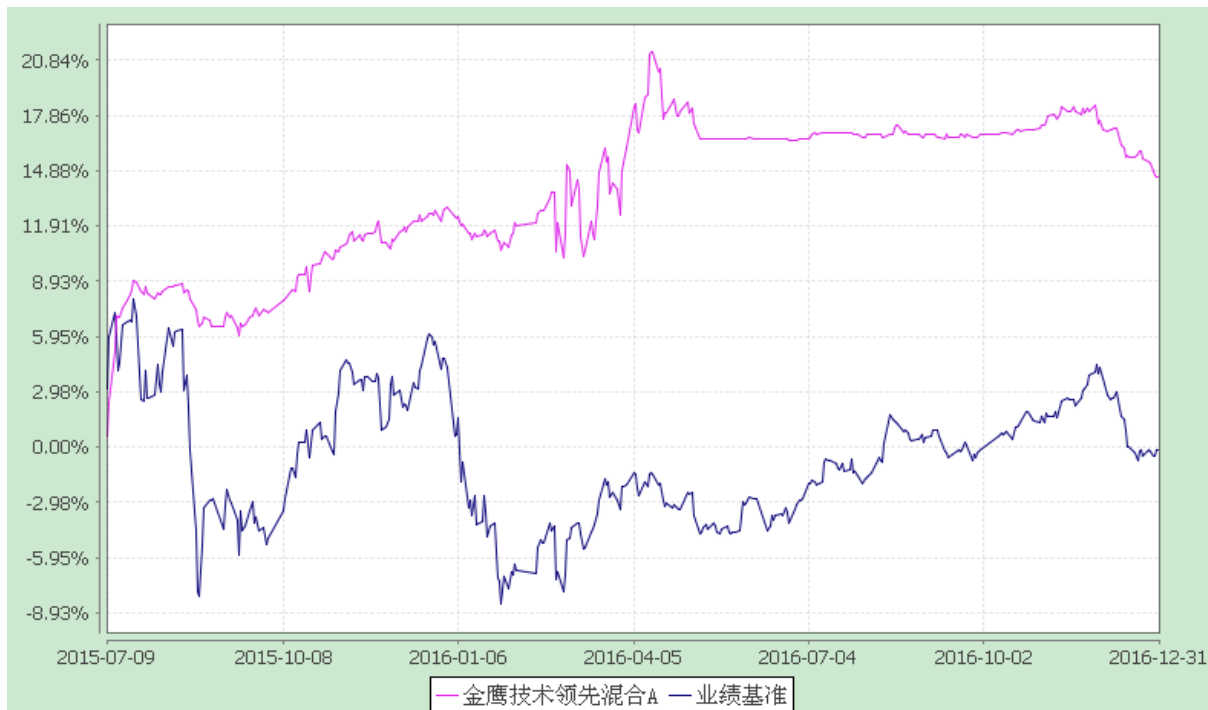
金鹰技术领先灵活配置混合型证券投资基金

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

(2015 年 7 月 9 日至 2016 年 12 月 31 日)

金鹰技术领先混合 A

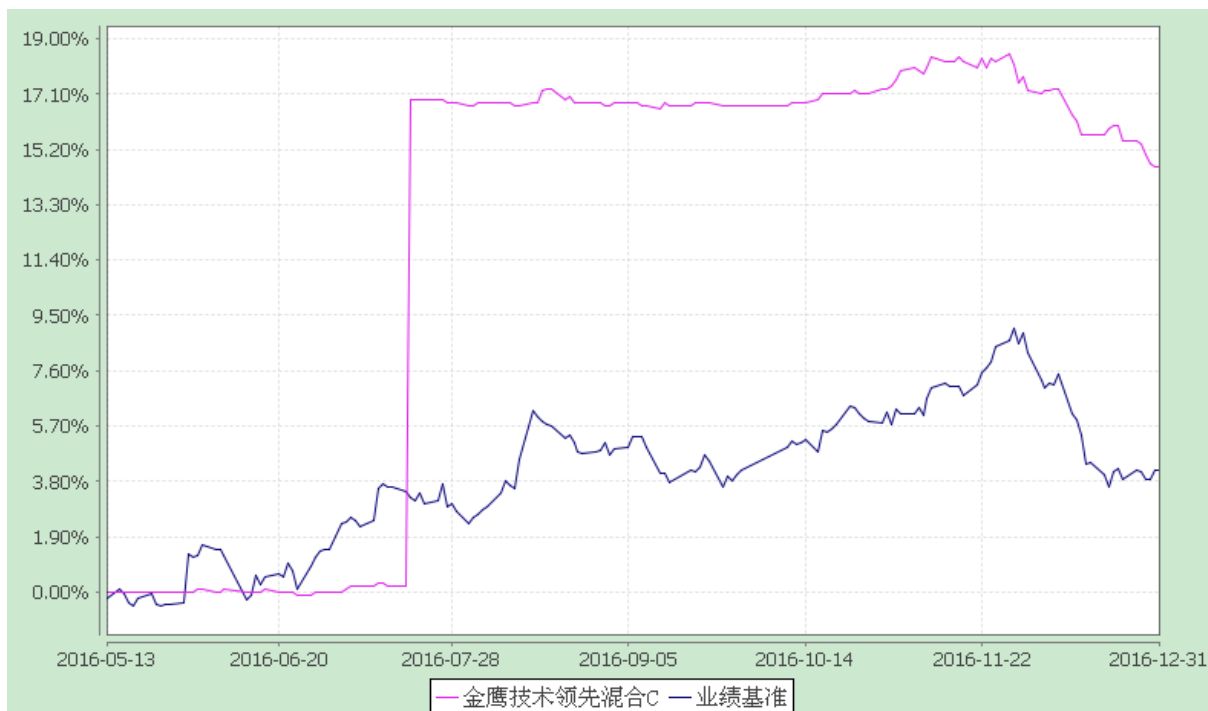
(2015 年 7 月 9 日至 2016 年 12 月 31 日)



注：本基金 A 类份额 2015 年 7 月 9 日合同生效。

金鹰技术领先混合 C

(2015 年 7 月 9 日至 2016 年 12 月 31 日)



注：本基金 C 类份额 2016 年 5 月 13 日合同生效。

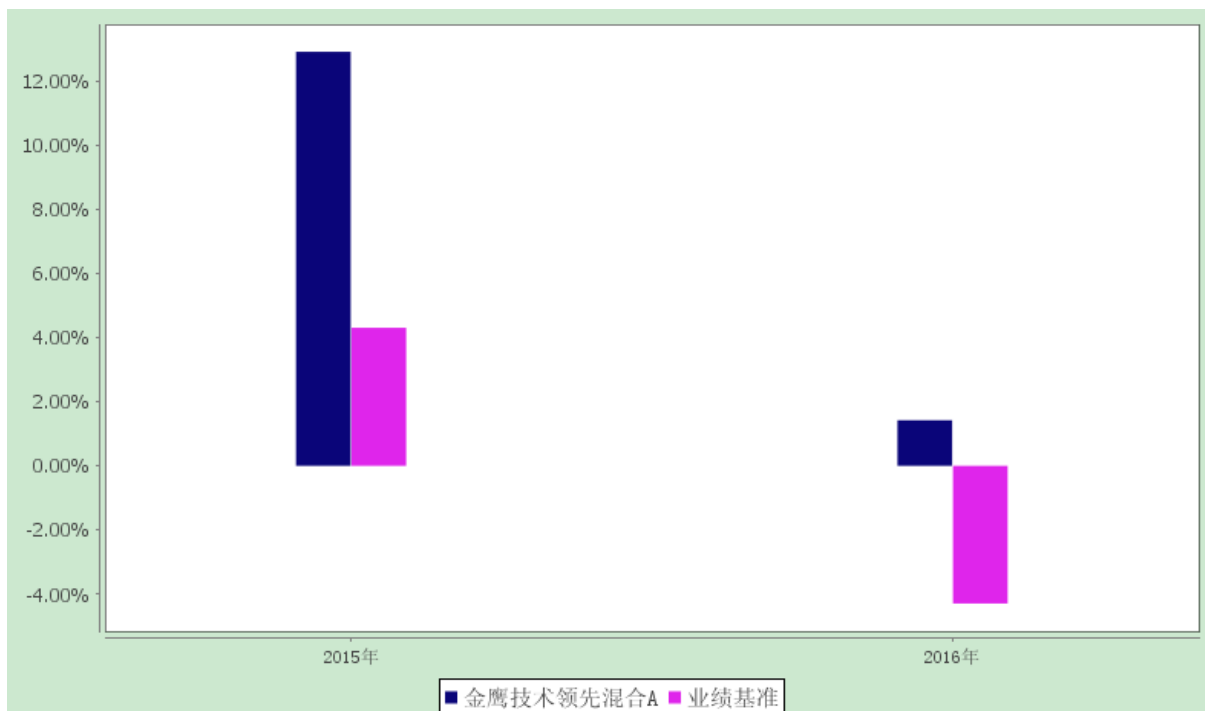
(1) 本基金各类资产比例符合基金合同规定。(2) 本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%

### 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

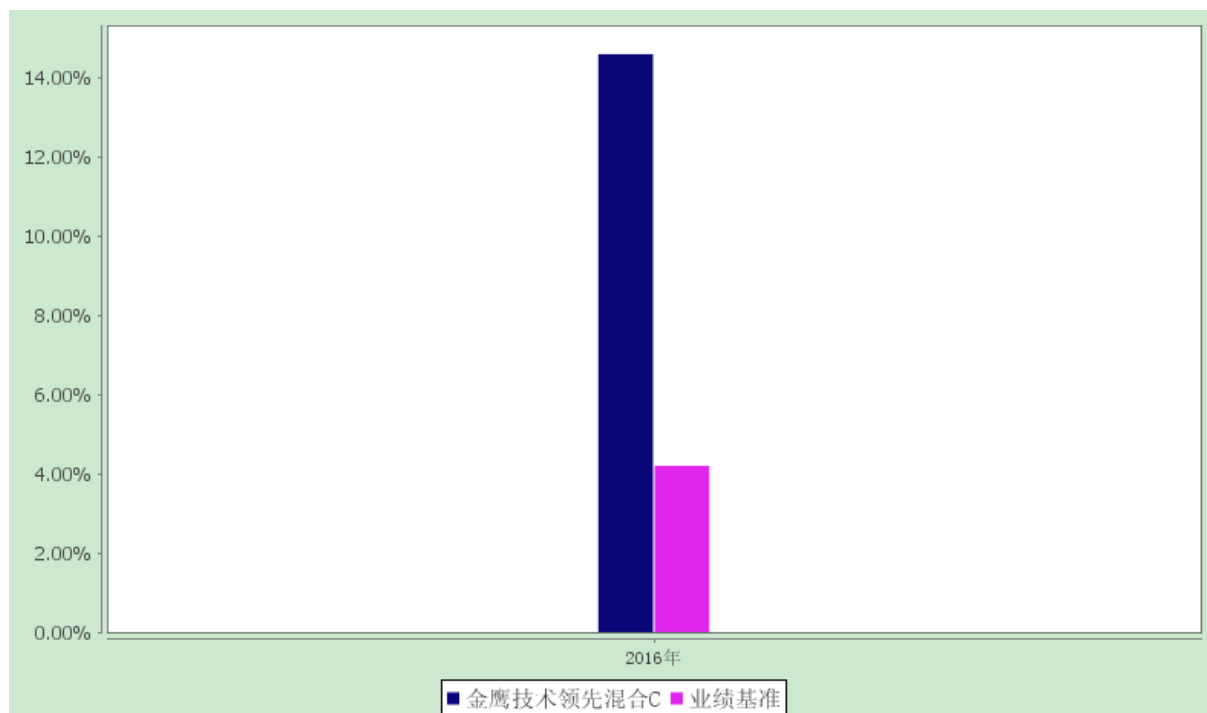
金鹰技术领先灵活配置混合型证券投资基金

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

#### 金鹰技术领先混合 A



#### 金鹰技术领先混合 C



## § 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		
王喆	权益投资部总监、基金经理	2015-08-13	-	18	王喆先生，工商管理硕士。历任沈阳商品交易所分析员、宏源研究发展中心高级行业研究员、宏源证券资产管理部高级投资经理。2010 年加入广州证券，担任投资管理部助理投资总监、广州证券红棉 1 号投资主办等职。2014 年 11 月加入金鹰基金管理有限公司，现任权益投资部总监、金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金、金鹰成份股优选证券投资基金、金鹰技术领先灵活配置混合型证券投资基金、金鹰民族新兴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基金经理。
吴德瑄	基金经理、基金经理助理	2016-12-27	-	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。

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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》和其他有关法律法规及其各项实施准则，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

2016 年，宏观经济启稳回升，企业盈利明显改善。流动性全年整体宽松，但四季度央行主动引导利率上行。全年 A 股市场整体呈现探底回升走势，年初市场大幅下挫，股指连续熔断。此后在经济基本面推动下，市场一路震荡上行，各板块轮番有所表现，但市场整体涨幅相对有限，未能收复年初失地。虽然市场热点不断轮动，但整体来看，以煤炭、钢铁、建筑等为代表的周期股，及以白酒、家电为代表大盘蓝筹股，在盈利回升的驱动下表现出色，而计算机、互联网、传媒等为代表的小盘成长股表现相对较弱。全年上证综指下跌 12.31%，创业板指数下跌 27.71%。

上半年我们采取了相对稳健的操作策略，保持股票持仓的弹性，在回避市场系统性风险的同时，积极布局行业景气周期回升的煤炭钢铁等周期类行业，并取得了较好的效果。但在此后操作中较为保守，整体持仓较低，未能主动参与市场阶段性热点，下半年整体表现落后于市场。

#### 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 份额净值为 1.145，本报告期份额净值增长率为 1.42%，同期业绩比较基准增长率为-4.29%；本基金 C 份额自 2016 年 5 月 13 日生效，2016 年 12 月 31 日净值为 1.146，本报告期份额净值增长率为 14.60%，同期业绩比较基准增长率为 4.20%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年底中央经济工作会议中，政策重心明显发生改变，从“稳增长”转向“防范金融风险”“深化改革”。在防范系统性风险的政策下，因此预计 2017 年国家宏观经济政策将有所调整，流动性会明显转向中性。宏观经济进一步复苏的动力也会有所减弱，整体呈现前高后低，略有回落。同时在美国经济持续复苏下，美元加息有望提速，人民币汇率及资产价格面临一定压力。

在流动性边际收紧的影响下，预计 A 股市场系统性机会不大，以结构性机会为主。同时高估值个股也会面临着一定估值的压力。因此在操作中我们仍将坚持稳健的操作策略，权益类资产方面，保持整体持仓弹性。重点把握结构性机会，侧重选择景气行业周期上行且估值合理的板块及个股。债券方面，上半年以短期配置为主，持有短久期、高评级品种。同时根据市场变化，灵活调整资产配置。

#### 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

截至报告期末,本基金可分配利润为 7,834,613.50 元,本报告期内未实施利润分配。

#### 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

报告期内,本基金资产净值发生过已连续超过 60 个工作日低于 5000 万元的情形,本基金管理人已按法规要求向证监会报送解决方案。

### § 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,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在金鹰技术领先灵活配置混合型证券投资基金(原金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金)(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的复核,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(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、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：金鹰技术领先灵活配置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
<b>资 产：</b>		
银行存款	10,633,509.05	13,668,955.91
结算备付金	1,448,918.70	237,940.46
存出保证金	4,993.86	14,847.89
交易性金融资产	8,019,300.00	3,268,234.94
其中：股票投资	8,019,300.00	3,268,234.94
基金投资	-	-
债券投资	-	-
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	-	50,000,150.00
应收证券清算款	-	836,892.70
应收利息	1,693.39	24,425.61
应收股利	-	-
应收申购款	494,999.97	2,082.08
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>20,603,414.97</b>	<b>68,053,529.59</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2016 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>		

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	-	3.00
应付赎回款	19,647.32	99.63
应付管理人报酬	25,274.50	85,839.77
应付托管费	4,212.43	14,306.66
应付销售服务费	44.81	-
应付交易费用	13,302.78	20,387.63
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	605,000.00	469,347.83
<b>负债合计</b>	<b>667,481.84</b>	<b>589,984.52</b>
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	12,101,319.63	41,110,002.60
未分配利润	7,834,613.50	26,353,542.47
<b>所有者权益合计</b>	<b>19,935,933.13</b>	<b>67,463,545.07</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>20,603,414.97</b>	<b>68,053,529.59</b>

## 7.2 利润表

会计主体：金鹰技术领先灵活配置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	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 7 月 9 日（基金 合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日

一、收入	<b>2,098,865.76</b>	<b>4,677,887.47</b>
1.利息收入	617,455.54	223,087.71
其中：存款利息收入	97,260.07	104,452.88
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	520,195.47	118,634.83
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	2,402,400.02	6,178,392.47
其中：股票投资收益	2,394,298.16	6,171,371.54
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
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	8,101.86	7,020.93
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-1,033,457.68	-1,881,068.95
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	112,467.88	157,476.24
<b>减：二、费用</b>	<b>1,086,489.76</b>	<b>520,253.57</b>
1. 管理人报酬	576,263.01	308,913.62
2. 托管费	96,043.92	53,277.03
3. 销售服务费	1,513.18	-
4. 交易费用	142,875.31	63,357.58
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	269,794.34	94,705.34
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>1,012,376.00</b>	<b>4,157,633.90</b>

减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>1,012,376.00</b>	<b>4,157,633.90</b>

注：1、本基金由金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金自 2015 年 7 月 8 日转型而来，故上年度可比期间的数据为 2015 年 7 月 9 日至 2015 年 12 月 31 日的财务数据。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金鹰技术领先灵活配置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)	41,110,002.60	26,353,542.47	67,463,545.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,012,376.00	1,012,376.00
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)	-29,008,682.97	-19,531,304.97	-48,539,987.94
其中：1.基金申购款	14,621,554.41	4,032,910.90	18,654,465.31
2.基金赎回款	-43,630,237.38	-23,564,215.87	-67,194,453.25
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)	12,101,319.63	7,834,613.50	19,935,933.13
项目	上年度可比期间		



	2015 年 7 月 9 日（基金合同生效日）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）	14,238,036.37	6,457,440.87	20,695,477.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,157,633.90	4,157,633.90
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）	26,871,966.23	15,738,467.70	42,610,433.93
其中：1.基金申购款	43,418,498.80	25,098,169.78	68,516,668.58
2.基金赎回款	-16,546,532.57	-9,359,702.08	-25,906,234.65
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）	41,110,002.60	26,353,542.47	67,463,545.07

注：1、本基金由金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金自 2015 年 7 月 8 日转型而来，故上年度可比期间的数据为 2015 年 7 月 9 日至 2015 年 12 月 31 日的财务数据。

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

金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金(简称"本基金")，经中国证券监督管理委员会（简称"中国证监会"）证监基金字[2011]342 号文《关于同意金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金备案确认的函》批准，于 2011 年 6 月 1 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 431,551,810.02 份基金份额。本基金募集期间自 2011 年 4 月 26 日起至 2011 年 5 月 27 日止，净认购额 431,530,928.80 元，认购资金在认购期间的银行利息 20,881.22 元折算成基金资产。上述资金已于 2011 年 6 月 1 日全额划入本基金在基金托管人中国银行开立的本基金托管专户。验资机构为立信羊城会计师事务所。本基金的基金管理人为金鹰基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司（简称：“中国银行”）

#### 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 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

本基金本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)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变。

## 2、营业税、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；

## 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

本基金本报告及上年度可比期间均无通过关联方进行股票交易。

###### 7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告及上年度可比期间均无通过关联方进行权证交易。

###### 7.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告及上年度可比期间均无通过关联方进行债券交易。

###### 7.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告及上年度可比期间均无通过关联方进行债券回购交易。

###### 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7月9日（基金合同 生效日）至2015年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	576,263.01	308,913.62
其中：支付销售机构的客户维护费	173,744.63	81,569.60

注：1、基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

2、基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

3、本基金由金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金自 2015 年 7 月 8 日转型而来，转型前管理费年费率为 1.0%，转型后管理费年费率为 1.5%，上年度可比期间的数据为 2015 年 7 月 9 日至 2015 年 12 月 31 日的财务数据。

#### 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7月9日（基金合同 生效日）至2015年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	96,043.92	53,277.03

注：1、基金托管人的基金托管费按基金财产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金财产净值

2、基金托管费每日计提，按月支付。基金管理人应于次月首日起 5 个工作日内做出划付指令；基金托管人应在次月首日起 10 个工作日内完成复核，并从该基金财产中一次性支付托管费给该基金托管人。

3、本基金由金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金自 2015 年 7 月 8 日转型而来，转型前托管费年费率为 0.15%，转型后托管费年费率为 0.25%，上年度可比期间的数据为 2015 年 7 月 9 日至 2015 年 12 月 31 日的财务数据。

#### 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		
	金鹰技术领先混合 A	金鹰技术领先混合 C	合计
金鹰基金管理有限公司	-	1,399.73	1,399.73
合计	-	1,399.73	1,399.73

获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间 2015年7月9日（基金合同生效日）至2015年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	金鹰技术领先混合A	金鹰技术领先混合C	合计
合计	-	-	-

注：1、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，本基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 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 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人并由基金管理人代付给各基金销售机构。

#### 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

1、本基金本报告期及上年度可比期间均未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

份额单位：份

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7月9日（基金合同生效日）至 2015年12月31日	
	金鹰技术领先混合 A	金鹰技术领先混合C	金鹰技术领先混合A	金鹰技术领先混合C
报告期初持有的基金份额	13,849,492.15	-	13,849,492.15	-
报告期间申购/买入总份额	-	-	0.00	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	0.00	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	13,849,492.15	-	0.00	-
报告期末持有的基金份额	0.00	-	13,849,492.15	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	-	23.18%	-

##### 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

## 金鹰技术领先混合 A

本基金本报告期末及上年度末其他关联方未投资本基金。

## 金鹰技术领先混合 C

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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年7月9日（基金合同生效日） 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
中国银行股份有限公司	10,633,509.05	71,448.82	13,668,955.91	98,489.05

注：1、本基金清算备付金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算公司等结算账户，本度期末余额 1,448,918.70 元，清算备付金利息收入 25,743.48 元，上一年度期末余额 237,940.46 元，清算备付金利息收入 1,222.59 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
601375	中原证券	2016-12-21	2017-01-03	网下新股申购	4.00	4.00	1,000.00	4,000.00	4,000.00	网上新股待上市

## 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无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

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日，本基金报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 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，本基金报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 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	8,019,300.00	38.92



	其中：股票	8,019,300.00	38.92
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	-	-
	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	12,082,427.75	58.64
7	其他各项资产	501,687.22	2.43
8	合计	20,603,414.97	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	1,064,600.00	5.34
B	采矿业	1,252,350.00	6.28
C	制造业	5,108,550.00	25.62
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	589,800.00	2.96
J	金融业	4,000.00	0.02
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	8,019,300.00	40.23

## 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股票投资。

## 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	000731	四川美丰	90,000	898,200.00	4.51
2	600961	株冶集团	80,000	896,000.00	4.49
3	600010	包钢股份	300,000	837,000.00	4.20
4	600251	冠农股份	90,000	729,900.00	3.66
5	000972	中基健康	100,000	700,000.00	3.51
6	600259	广晟有色	15,000	637,350.00	3.20
7	600871	石化油服	150,000	615,000.00	3.08
8	600718	东软集团	30,000	589,800.00	2.96
9	600359	新农开发	60,000	563,400.00	2.83
10	600299	安迪苏	35,000	503,650.00	2.53

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601699	潞安环能	2,310,000.00	3.42

2	000983	西山煤电	2,082,300.00	3.09
3	600348	阳泉煤业	1,866,026.70	2.77
4	600976	健民集团	1,851,000.00	2.74
5	000933	*ST 神火	1,738,911.86	2.58
6	600961	株冶集团	1,677,934.00	2.49
7	600395	盘江股份	1,184,111.00	1.76
8	300181	佐力药业	1,160,818.00	1.72
9	600259	广晟有色	1,118,368.00	1.66
10	600800	天津磁卡	1,095,113.21	1.62
11	000886	海南高速	1,075,412.00	1.59
12	603456	九洲药业	1,071,300.00	1.59
13	600449	宁夏建材	1,065,265.00	1.58
14	600898	三联商社	1,052,698.97	1.56
15	300456	耐威科技	1,045,800.00	1.55
16	002777	久远银海	1,001,650.00	1.48
17	300515	三德科技	1,001,099.00	1.48
18	000731	四川美丰	941,850.00	1.40
19	002786	银宝山新	940,915.00	1.39
20	601169	北京银行	932,000.00	1.38

## 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	000983	西山煤电	2,225,000.00	3.30
2	601699	潞安环能	2,193,482.00	3.25
3	600348	阳泉煤业	2,077,924.00	3.08
4	600976	健民集团	1,933,938.00	2.87
5	002777	久远银海	1,505,200.00	2.23
6	600961	株冶集团	1,473,871.00	2.18
7	000933	*ST 神火	1,443,000.00	2.14
8	600395	盘江股份	1,414,157.00	2.10
9	002786	银宝山新	1,323,800.00	1.96
10	600800	天津磁卡	1,302,379.34	1.93
11	600987	航民股份	1,284,700.00	1.90
12	300181	佐力药业	1,224,367.00	1.81
13	000886	海南高速	1,147,497.20	1.70
14	300456	耐威科技	1,146,200.00	1.70
15	600821	津劝业	1,108,990.00	1.64
16	600449	宁夏建材	1,086,556.00	1.61
17	600898	三联商社	1,084,045.00	1.61

18	603456	九洲药业	1,039,681.10	1.54
19	300515	三德科技	1,033,834.00	1.53
20	600594	益佰制药	1,024,300.00	1.52

#### 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	49,827,212.09
卖出股票收入（成交）总额	46,436,987.51

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末无债券投资。

#### 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

本基金本报告期末无债券投资。

#### 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

本基金本报告期末无资产支持证券投资。

#### 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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

#### 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

本基金本报告期末无权证投资。

#### 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

本基金本报告期末未投资股指期货。

##### 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

##### 8.11.2 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 本基金转型前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	4,993.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,693.39
5	应收申购款	494,999.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	501,687.22

## 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末无处于转股期的可转换债券。

## 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票无流通受限情况。

## 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
金鹰技术领先混	947	17,941.17	0.00	0.00%	16,990,288.29	100.00

合 A						%
金鹰技术领先混 合 C	69	6,026.81	0.00	0.00%	415,849.92	100.00%
合计	1,016	17,132.03	0.00	0.00%	17,406,138.21	100.00%

## 9.2 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	金鹰技术领先混合 A	0.00	0.00%
	金鹰技术领先混合 C	0.00	0.00%
	合计	0.00	0.00%

## 9.3 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	金鹰技术领先混合 A	0
	金鹰技术领先混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	金鹰技术领先混合 A	0
	金鹰技术领先混合 C	0
	合计	0

## 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金非发起式基金

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	金鹰技术领先混合 A	金鹰技术领先混合 C
基金合同生效日（2015 年 7 月 9 日）基金份额总额	20,695,477.24	-
本报告期期初基金份额总额	59,747,822.50	-
本报告期基金总申购份额	8,654,062.69	8,668,281.53
减：本报告期基金总赎回份额	51,411,596.90	8,252,431.61
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期末基金份额总额	16,990,288.29	415,849.92
-------------	---------------	------------

## § 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、2016 年 12 月，郭德秋先生担任基金托管人中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 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

1、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）。

2、本报告期内实际应支付会计师事务所的审计费为 25000 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	
广发证券	1	2,117,286.00	2.20%	1,929.47	2.19%	-
光大证券	1	46,156,378.10	47.98%	42,062.65	47.85%	-
中金公司	1	11,529,523.59	11.98%	10,737.33	12.21%	-
招商证券	1	31,993,207.55	33.25%	29,155.31	33.17%	-

平安证券	1	2,177,247.55	2.26%	1,984.16	2.26%	-
民生证券	1	2,021,313.00	2.10%	1,842.02	2.10%	-
中银国际证券	1	211,900.00	0.22%	193.10	0.22%	-

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比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
广发证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	2,469,700,000.00	64.47%	-	-
中金公司	-	-	1,361,000,000.00	35.53%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-



§ 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