

金鹰红利价值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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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	金鹰红利价值混合
基金主代码	210002
交易代码	210002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 12 月 4 日
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	188,652,074.30 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对分红能力良好且长期投资价值突出的优质股票投资，为基金资产获取稳定的当期收益和长期增值。
投资策略	本基金采取积极主动式投资管理，通过积极的资产配置策略，深入研究、调研基础上的主动性证券选择和市场时机选择，在合理控制投资风险的前提下，最大限度地获取投资收益。本基金主要投资于分红能力良好且长期价值突出的优质企业，股票资产占基金资产净值比例为 30%—80%；现金、债券资产、其他资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产净值的比例为 20%—70%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；权证投资占基金资产净值的比例不超过 3%。
业绩比较基准	中证红利指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。
风险收益特征	本基金风险收益特征从长期来看，其风险与预期收益高于货币型基金和债券型基金，低于股票型基金。

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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	苏文锋	陆志俊
	联系电话	020-83282627	95559
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		4006135888,020-83936180	95559
传真		020-83282856	021-62701216

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	15,482,196.91	64,049,762.83	25,174,740.28
本期利润	11,111,006.74	42,802,324.01	49,374,916.59
加权平均基金份额本期利润	0.0709	0.2671	0.3988
本期基金份额净值增长率	5.33%	46.26%	40.14%
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	0.2535	0.1901	0.1087
期末基金资产净值	236,468,891.85	91,980,042.31	276,752,194.07
期末基金份额净值	1.2535	1.1901	1.1539

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	2.96%	0.29%	1.81%	0.44%	1.15%	-0.15%
过去六个月	5.29%	0.29%	6.02%	0.46%	-0.73%	-0.17%
过去一年	5.33%	0.80%	-2.79%	0.86%	8.12%	-0.06%
过去三年	115.89%	1.07%	53.73%	1.11%	62.16%	-0.04%
过去五年	160.06%	1.04%	46.61%	0.97%	113.45%	0.07%
自基金合同生效起至今	199.58%	1.20%	97.76%	1.00%	101.82%	0.20%

注：本基金的业绩比较基准是：中证红利指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。

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

金鹰红利价值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的历史走势对比图

(2008 年 12 月 4 日至 2016 年 12 月 31 日)

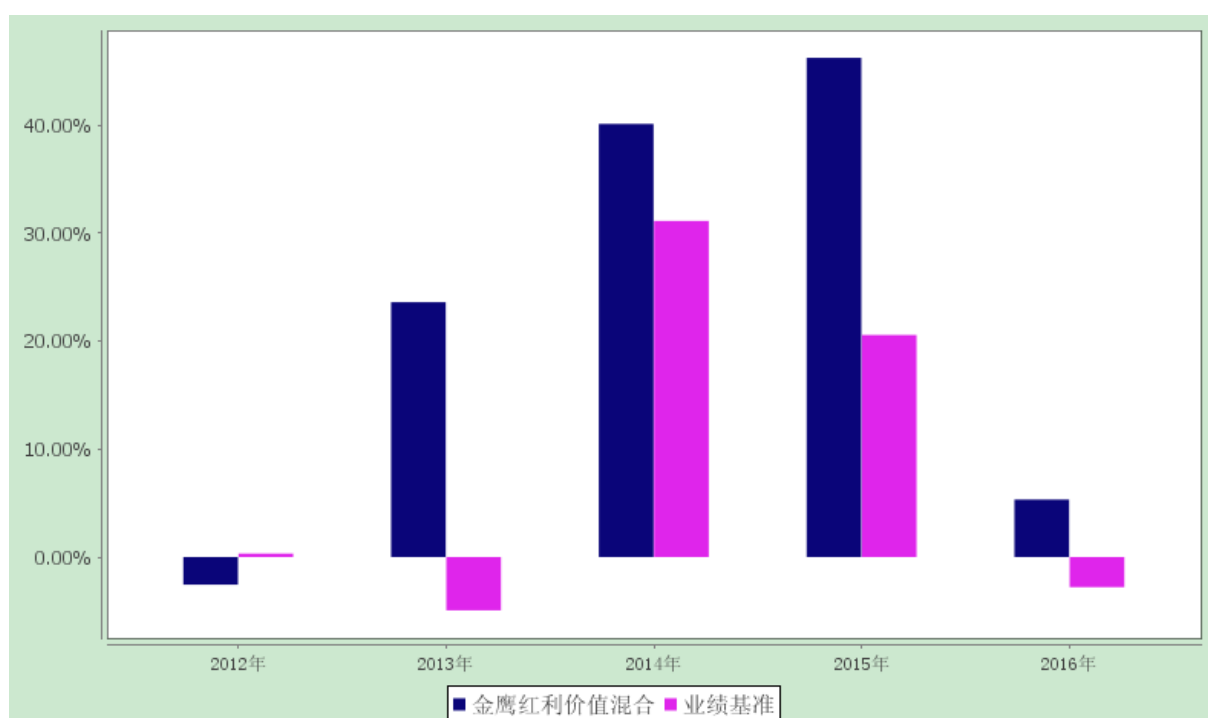


注：1、截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同规定的各项比例,股票资产占基金资产比例为 30%—80%；现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 20%-70%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；权证投资占基金资产净值的比例不超过 3%；2、本基金的业绩比较基准是：中证红利指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。

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

金鹰红利价值灵活配置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收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

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
2014年	2.700	414,218,298.00	7,116,042.55	421,334,340.55	-
2015年	5.400	3,418,961,449.95	12,656,323.88	3,431,617,773.83	-
合计	8.100	3,833,179,747.95	19,772,366.43	3,852,952,114.38	-

注：本基金 2016 年度未进行利润分配。

§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		
王喆	权益投资部总监、基金经理	2015-01-15	-	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	2016-05-	-	5	吴德瑄先生，兰州交通大学工学

	金经理助理	27			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、《金鹰红利价值灵活配置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，基金份额净值为 1.2535 元，本报告期份额净值增长率为 5.33%，同期业绩比较基准增长率为-2.79%。

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，保持整体持仓弹性。重点把握结构性机会，侧重选择行业景气周期上行且估值合理的板块及个股。

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 2016 年度未进行利润分配。

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

2016 年度，基金托管人在金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应

的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2016 年度，金鹰基金管理有限公司在金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，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

2016 年度，由金鹰基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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）050048 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：金鹰红利价值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
资产：	-	-
银行存款	8,674,905.08	2,406,693.89
结算备付金	9,563,473.43	53,462,610.37
存出保证金	34,021.18	34,091.31
交易性金融资产	71,998,027.22	36,728,531.26

其中：股票投资	71,998,027.22	36,728,531.26
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	100,000,000.00	-
应收证券清算款	50,025,208.34	-
应收利息	91,852.40	345,632.32
应收股利	-	-
应收申购款	203,388.70	478,114.19
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	240,590,876.35	93,455,673.34
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	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	2,605,654.27	292,472.76
应付管理人报酬	300,146.07	125,977.30
应付托管费	50,024.38	20,996.19
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	56,339.58	43,082.58
应交税费	-	-
应付利息	-	-

应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,109,820.20	993,102.20
负债合计	4,121,984.50	1,475,631.03
所有者权益：	-	-
实收基金	188,652,074.30	77,286,739.05
未分配利润	47,816,817.55	14,693,303.26
所有者权益合计	236,468,891.85	91,980,042.31
负债和所有者权益总计	240,590,876.35	93,455,673.34

7.2 利润表

会计主体：金鹰红利价值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 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入	15,235,849.69	47,514,688.39
1.利息收入	2,439,393.40	2,350,980.21
其中：存款利息收入	754,555.09	2,193,261.82
债券利息收入	-	799.64
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,684,838.31	156,918.75
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	16,860,760.84	55,838,702.88
其中：股票投资收益	16,050,647.61	55,660,613.47
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	88,064.34
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	810,113.23	90,025.07
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-4,371,190.17	-21,247,438.82
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	306,885.62	10,572,444.12
减：二、费用	4,124,842.95	4,712,364.38
1. 管理人报酬	2,820,031.65	3,020,054.47
2. 托管费	470,005.25	503,342.39
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	575,676.38	824,128.87
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	259,129.67	364,838.65
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	11,111,006.74	42,802,324.01
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	11,111,006.74	42,802,324.01

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金鹰红利价值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）	77,286,739.05	14,693,303.26	91,980,042.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本	-	11,111,006.74	11,111,006.74

期利润)			
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)	111,365,335.25	22,012,507.55	133,377,842.80
其中：1.基金申购款	314,941,310.69	63,902,101.57	378,843,412.26
2.基金赎回款	-203,575,975.44	-41,889,594.02	-245,465,569.46
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)	188,652,074.30	47,816,817.55	236,468,891.85
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)	239,834,123.14	36,918,070.93	276,752,194.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	42,802,324.01	42,802,324.01
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)	-162,547,384.09	3,366,590,682.15	3,204,043,298.06
其中：1.基金申购款	6,399,267,778.10	5,262,724,311.87	11,661,992,089.97
2.基金赎回款	-6,561,815,162.19	-1,896,133,629.72	-8,457,948,791.91
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基	-	-3,431,617,773.83	-3,431,617,773.83

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）	77,286,739.05	14,693,303.26	91,980,042.31

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

金鹰红利价值灵活配置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"）证监许可[2008]521 号文《关于金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》、基金部函字[2008]509 号文《关于金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金备案确认的函》批准，于 2008 年 12 月 4 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 367,018,547.39 份基金份额。本基金募集期间自 2008 年 10 月 8 日起至 2008 年 11 月 29 日止，认购金额为 366,942,740.65 元，认购资金在认购期间的银行利息 75,806.74 元折算成基金资产。上述资金已于 2008 年 12 月 4 日全额划入本基金在基金托管人交通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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金 2016 年度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

本基金本年度报告中财务报表的编制遵守了企业会计准则及其他有关规定,真实、完整地反映了本基金于 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。

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 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

本基金本年度无会计政策变更。

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
交通银行股份有限公司	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%	2,194,695.10	0.45%

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%	0.00	0.00%

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无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%	0.00	0.00%

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无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%	0.00	0.00%

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无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

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
-	-	-	-	-
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	1,942.08	0.02%	0.00	0.00%
------------	----------	-------	------	-------

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除中国证券登记结算公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

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等。

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	2,820,031.65	3,020,054.47
其中：支付销售机构的客户维护费	992,259.25	315,453.93

注：1、基金管理费按前一日的基金资产净值的 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；由基金管理人向基金托管人发送基金管理人报酬划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇节假日、休息日等，支付日期顺延。

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	470,005.25	503,342.39

注：1、基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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、基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内，从基金资产中一次性支付，若遇节假日、休息日等，支付日期顺延。

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
金鹰直销	0.00
交通银行股份有限公司	0.00
广州证券股份有限公司	0.00
合计	0.00

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付给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均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。

7.4.8.4.2 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
交通银行	8,674,905.08	113,202.46	2,406,693.89	1,321,200.76

注：本基金用于证券交易结算的资金通过"交通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，在资产负债表中"结算备付金"科目中单独列示，按银行同业利率计息。结算备付金 2015 年末余额 53,462,610.37 元，当期结算备付金利息收入 580,697.78 元；结算备付金 2014 年末余额为 71,346,006.68 元,当期结算备付金利息收入为 443,317.60 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
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

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	复牌开盘单价	数量 (单位: 股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002462	嘉事堂	2016-09-28	重大事项停牌	42.53	2017-01-12	38.90	80,000.00	2,978,932.80	3,402,400.00	重大事项
300323	华灿光电	2016-04-18	重大事项停牌	8.99	2017-01-09	8.50	25.00	216.36	224.75	重大事项

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

本基金报告期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	71,998,027.22	29.93
	其中：股票	71,998,027.22	29.93
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	100,000,000.00	41.56
	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	18,238,378.51	7.58
7	其他各项资产	50,354,470.62	20.93
8	合计	240,590,876.35	100.00

注：其他资产包括：交易保证金、应收利息、应收证券清算款、其他应收款、应收申购款。

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	15,290,000.00	6.47
B	采矿业	3,863,008.80	1.63

C	制造业	28,757,410.52	12.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,084,000.00	0.88
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	10,919,816.00	4.62
G	交通运输、仓储和邮政业	1,836,000.00	0.78
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,891,232.19	0.80
J	金融业	412,659.71	0.17
K	房地产业	4,405,000.00	1.86
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	648,200.00	0.27
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	1,890,700.00	0.80
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	71,998,027.22	30.45

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	600598	北大荒	670,000	8,174,000.00	3.46
2	600961	株冶集团	700,000	7,840,000.00	3.32
3	002147	新光圆成	250,000	4,405,000.00	1.86
4	600259	广晟有色	90,000	3,824,100.00	1.62
5	600108	亚盛集团	600,000	3,432,000.00	1.45
6	002462	嘉事堂	80,000	3,402,400.00	1.44
7	600549	厦门钨业	150,000	3,303,000.00	1.40
8	000998	隆平高科	150,000	3,214,500.00	1.36
9	600737	中粮糖业	250,000	3,115,000.00	1.32
10	600861	北京城乡	178,400	2,763,416.00	1.17

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	600348	阳泉煤业	9,140,491.27	9.94
2	000983	西山煤电	9,123,903.80	9.92
3	601699	潞安环能	8,201,768.60	8.92
4	600598	北大荒	8,104,963.00	8.81
5	000959	首钢股份	7,039,673.86	7.65
6	600428	中远海特	6,010,000.00	6.53
7	601985	中国核电	5,444,000.00	5.92
8	600259	广晟有色	5,370,499.00	5.84
9	601857	中国石油	5,221,891.20	5.68
10	601939	建设银行	4,720,000.00	5.13
11	600395	盘江股份	4,553,592.00	4.95
12	000933	*ST 神火	4,360,338.00	4.74
13	600549	厦门钨业	4,165,277.00	4.53
14	002128	露天煤业	4,075,280.00	4.43
15	000028	国药一致	3,919,478.20	4.26
16	002462	嘉事堂	3,723,666.00	4.05
17	000786	北新建材	3,707,423.49	4.03
18	601818	光大银行	3,680,000.00	4.00
19	600737	中粮糖业	3,526,128.00	3.83
20	000886	海南高速	3,506,413.00	3.81
21	600961	株冶集团	3,343,144.00	3.63
22	600108	亚盛集团	3,202,152.98	3.48
23	000998	隆平高科	3,105,243.00	3.38
24	002023	海特高新	2,998,129.73	3.26
25	600594	益佰制药	2,869,864.00	3.12
26	600667	太极实业	2,865,854.00	3.12
27	600123	兰花科创	2,813,617.91	3.06
28	000657	中钨高新	2,784,950.00	3.03
29	600157	永泰能源	2,769,000.00	3.01
30	600898	三联商社	2,764,068.64	3.01
31	603909	合诚股份	2,678,589.00	2.91
32	600111	北方稀土	2,630,464.33	2.86
33	300336	新文化	2,585,600.00	2.81
34	000778	新兴铸管	2,547,000.00	2.77
35	002229	鸿博股份	2,483,659.00	2.70

36	600900	长江电力	2,458,000.00	2.67
37	000937	冀中能源	2,437,000.00	2.65
38	601028	玉龙股份	2,415,752.72	2.63
39	002782	可立克	2,301,866.00	2.50
40	600396	金山股份	2,138,128.00	2.32
41	300347	泰格医药	2,118,600.00	2.30
42	603000	人民网	2,062,430.00	2.24
43	600467	好当家	2,024,377.00	2.20
44	000877	天山股份	2,022,024.00	2.20
45	601919	中远海控	1,947,637.68	2.12
46	600987	航民股份	1,945,691.00	2.12
47	002556	辉隆股份	1,862,000.00	2.02
48	601398	工商银行	1,835,438.00	2.00

注：该表的累计买入金额按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,未考虑相关交易费用。

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	600348	阳泉煤业	9,848,957.47	10.71
2	000983	西山煤电	9,421,856.03	10.24
3	000959	首钢股份	7,973,000.00	8.67
4	601699	潞安环能	7,715,683.93	8.39
5	601985	中国核电	5,694,000.00	6.19
6	601939	建设银行	5,300,000.00	5.76
7	601857	中国石油	5,089,000.00	5.53
8	600395	盘江股份	5,070,781.46	5.51
9	600428	中远海特	4,961,294.00	5.39
10	601818	光大银行	4,070,000.00	4.42
11	000886	海南高速	4,039,744.80	4.39
12	002128	露天煤业	3,961,657.00	4.31
13	002019	亿帆医药	3,834,226.22	4.17
14	000786	北新建材	3,813,500.00	4.15
15	300456	耐威科技	3,645,900.00	3.96
16	002023	海特高新	3,401,497.00	3.70
17	601028	玉龙股份	3,302,266.80	3.59
18	600594	益佰制药	3,210,707.20	3.49
19	000933	*ST 神火	3,204,000.00	3.48
20	600123	兰花科创	3,127,624.05	3.40
21	600667	太极实业	3,087,797.00	3.36

22	000937	冀中能源	3,069,308.00	3.34
23	002782	可立克	2,908,000.00	3.16
24	600987	航民股份	2,897,000.00	3.15
25	002147	新光圆成	2,789,860.00	3.03
26	600157	永泰能源	2,717,000.00	2.95
27	600898	三联商社	2,645,576.10	2.88
28	600900	长江电力	2,599,692.12	2.83
29	603909	合诚股份	2,562,400.12	2.79
30	002229	鸿博股份	2,551,785.56	2.77
31	600976	健民集团	2,538,365.86	2.76
32	000657	中钨高新	2,489,900.00	2.71
33	002160	常铝股份	2,409,788.36	2.62
34	300336	新文化	2,304,872.00	2.51
35	600467	好当家	2,175,000.00	2.36
36	000877	天山股份	2,169,000.00	2.36
37	600960	渤海活塞	1,957,058.00	2.13
38	601398	工商银行	1,953,995.00	2.12
39	600285	羚锐制药	1,936,167.00	2.10

注：该表的累计卖出金额按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,未考虑相关交易费用。

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	211,212,808.79
卖出股票的收入（成交）总额	187,611,608.35

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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**

报告期本基金未投资股指期货。

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**

报告期本基金未投资国债期货。

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	34,021.18
2	应收证券清算款	50,025,208.34
3	应收股利	-
4	应收利息	91,852.40
5	应收申购款	203,388.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	50,354,470.62

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	002462	嘉事堂	3,402,400.00	1.44	重大事项

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
20,427	9,235.43	35,952,080.39	19.06%	152,699,993.90	80.94%

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	24,911.05	0.01%

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

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

基金合同生效日(2008年12月4日)基金份额总额	367,018,547.39
本报告期期初基金份额总额	77,286,739.05
本报告期基金总申购份额	314,941,310.69
减：本报告期基金总赎回份额	203,575,975.44
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	188,652,074.30

§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，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、基金财产的诉讼。

本报告期内无涉及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 30000 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及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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	
华林证券	1	42,566,713.83	10.73%	30,277.75	8.58%	-
中信证券	1	1,549,837.56	0.39%	1,412.36	0.40%	-
中金公司	1	78,714,107.36	19.84%	73,306.17	20.77%	-
华创证券	2	58,904,339.87	14.84%	53,678.88	15.21%	-
爱建证券	1	12,026,603.91	3.03%	11,200.29	3.17%	-
财达证券	1	9,359,212.14	2.36%	8,716.20	2.47%	-
湘财证券	1	12,318,332.59	3.10%	8,762.18	2.48%	-
英大证券	1	81,293,518.88	20.49%	74,082.82	20.99%	-
中银国际证券	1	53,579,221.96	13.50%	48,827.48	13.84%	-
中信建投证券	1	2,538,334.90	0.64%	2,313.19	0.66%	-
财通证券	1	10,480,603.73	2.64%	9,760.58	2.77%	-
国信证券	1	33,496,591.32	8.44%	30,525.02	8.65%	-

注：本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元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；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
中金公司	-	-	320,000,000.00	1.99%	-	-
华创证券	-	-	2,681,900,000.00	16.69%	-	-
爱建证券	-	-	110,000,000.00	0.68%	-	-
财达证券	-	-	350,000,000.00	2.18%	-	-
中银国际证券	-	-	6,740,000,000.00	41.93%	-	-
财通证券	-	-	2,480,000,000.00	15.43%	-	-
国信证券	-	-	3,391,000,000.00	21.10%	-	-

§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