

**金鹰行业优势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

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	金鹰行业优势混合
基金主代码	210003
交易代码	210003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 7 月 1 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	176,264,182.80 份
基金合同存续期	不定期

## 2.2 基金产品说明

投资目标	以追求长期资本可持续增值为目的，以深入的基本面分析为基础，通过投资于优势行业当中的优势股票，在充分控制风险的前提下，分享中国经济快速发展的成果，进而实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金采用“自上而下”的投资方法，定性分析与定量分析并用，综合分析国内外政治经济环境、政策形势、金融市场走势、行业景气等因素，研判市场时机，结合货币市场、债券市场和股票市场估值等状况，进行资产配置及组合的构建，合理确定基金在股票、债券、现金等资产类别上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时动态地调整股票、债券和货币市场工具的投资比例，以最大限度地降低投资组合的风险、提高收益。</p> <p>本基金的股票资产占基金资产净值的比例为 60%-95%；债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产净值的比例为 5%-40%，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%，权证投资的比例范围占基金资产净值的 0-3%。</p>
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×75%+中证全债指数收

	益率×25%。
风险收益特征	本基金为主动管理的混合型证券投资基金，属于证券投资基金中的风险和预期收益较高品种。一般情形下，其预期风险和收益均高于货币型基金和债券型基金。

### 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	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

登载基金年度报告摘要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	2014 年
本期已实现收益	-9,393,565.13	235,023,255.40	98,889,607.65
本期利润	-50,150,619.15	271,378,471.89	99,533,914.75
加权平均基金份额本期利润	-0.2635	1.0099	0.1331
本期基金份额净值增长率	-20.11%	74.62%	19.62%
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	-0.0134	0.6430	-0.0591

期末基金资产净值	173,898,274.43	256,000,474.68	521,000,275.73
期末基金份额净值	0.9866	1.6430	0.9409

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	-2.43%	0.95%	0.88%	0.55%	-3.31%	0.40%
过去六个月	-9.31%	1.04%	3.85%	0.57%	-13.16%	0.47%
过去一年	-20.11%	1.89%	-7.71%	1.05%	-12.40%	0.84%
过去三年	66.86%	2.11%	37.09%	1.34%	29.77%	0.77%
过去五年	77.15%	1.85%	38.95%	1.22%	38.20%	0.63%
自基金合同生效起至今	34.57%	1.76%	14.92%	1.21%	19.65%	0.55%

注：本基金的原业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×75%+中信标普国债指数收益率×25%；2015 年 9 月 28 日变更为：

沪深 300 指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%。并对基金合同等法律文件进行了相应修改，该事项已与托管人协商一致并报监管部门备案,变更业绩比较基准公告已于 2015 年 9 月 23 日在指定媒体披露。

#### 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

金鹰行业优势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

(2009 年 7 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日)

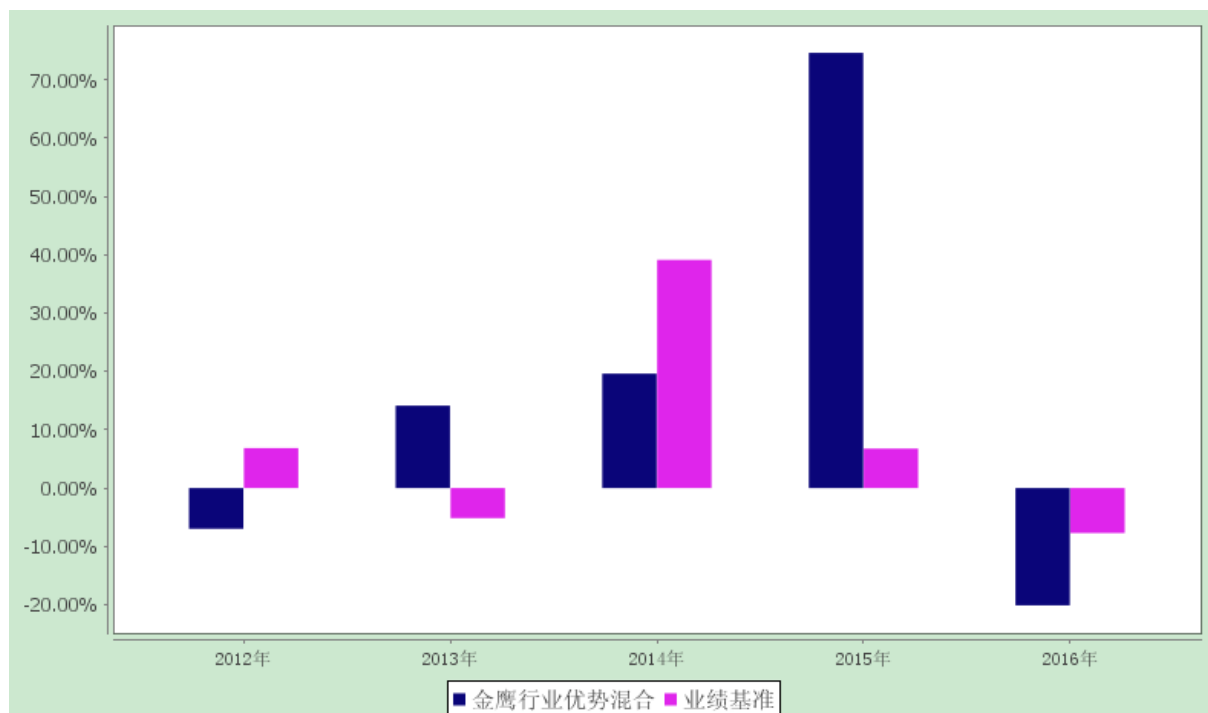


注：1、截至报告日本基金的各项投资比例符合本基金基金合同规定的各项比例，即本基金股票资产占基金资产净值的比例为 60%-95%；债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产净值的比例为 5%-40%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证投资的比例范围占基金资产净值的 0-3%；2、本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%。

### 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

金鹰行业优势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
2016	3.600	394,352,939.41	19,271,546.17	413,624,485.58	-
2015	-	-	-	-	-
2014	-	-	-	-	-
合计	3.600	394,352,939.41	19,271,546.17	413,624,485.58	-

## §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		
倪超	基金经理	2015-06-11	-	8	倪超先生，厦门大学硕士研究生。2009 年 6 月加盟金鹰基金管理有限公司，先后任行业研究员，消费品研究小组组长、基金经理助理。现任金鹰行业优势混合型证券投资基金、金鹰保本混合型证券投资基金、金鹰元祺保本混合型证券投资基金基金经理。
何晓春	基金经理	2012-07-26	2016-06-15	17	何晓春先生，产业经济学博士，17 年金融行业从业经验，曾任世纪证券有限责任公司江西分公司筹办组负责人等职，2011 年 4 月加入金鹰基金管理有限公司，曾任公司权益投资部总监、金鹰中证 500 指数分级证券投资基金、金鹰稳健成长混合型证券投资基金、金鹰行业优势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基金经理

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 年的市场：从整体指数市场表现和个股表现来看我们可以用分化这个关键词来概论 2016 年的市场；

市场的几个代表性指数表现出明显的分化，上证 50 下跌 2.5 个百分点，沪深 300 下跌 9.3 个百

分点，中证 500 下跌 18 个百分点，创业板下跌接近 28 个百分点，直观的表现就是小盘股弱于大盘股，或者说传统的低估值偏周期消费板块战胜高估值新兴成长板块；个股的表现层面也呈现出明显的分化，很多有业绩有估值的行业龙头创出了历史新高，成长逻辑被证伪的小票甚至创出股灾以来的新低。

宏观经济层面：受益于地产汽车两大产业销售增速提升和制造业的底部企稳，国内经济实现底部企稳，gdp 连续三个季度增长 6.7%；供给侧改革在煤炭钢铁领域取得成效使得部分周期行业盈利趋势向上，虽然有汇率因素的扰动，流动性前三季度整体上呈现稳健偏松的格局。

从市场内在运行逻辑层面，典型的熊市一般分为三个阶段：一是降杠杆；二是降估值；三是杀逻辑（ppt 公司谈梦想的，被市场证伪）。股灾 1.0，2.0 以及今年年初的股灾 3.0 基本上已完成了第一阶段的降杆杆；那么降杠杆完成以后那些逻辑通顺估值合理基本面向上改善的股票就有了上涨的动力。代表性的行业有食品饮料，家电，银行共同的特征估值便宜，基本面有向好预期，全年录得正收益；

从 2 月份至今的三个阶段市场波动向上的主线也是盈利增长；2 月-5 月份以新能源为代表的兑现高业绩成长一批成长股成为反弹领头羊，后来因为骗补及补贴政策原因行业成长逻辑遭到破坏而有所调整，目前还处于调整期；5-8 月份伴随煤炭有色等价格的超预期上涨市场重新评估供给侧改革的影响和需求边际改善的影响，煤炭有色类股票成为市场上涨的主力。9-11 月份在第三批 PPP 项目公布，基建预期升温，尤其是在十月初房地产调控政策密集出台的背景下，市场对于明年基建投资增速超 20%已经形成一致预期，同时叠加险资举牌大市值蓝筹，确立了此轮反弹中大市值蓝筹的核心地位。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值为 0.9866 元，本报告期基金净值增长率为-20.11%，同期业绩比较基准增长率为-7.71%。

#### 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：整体判断市场前低后高，震荡上行的格局。

震荡上行的信心来源于三个层面，在长达一年半的下跌过程中估值相对消化充分。大类资产配置中，在类滞涨环境和目前的去资产泡沫杠杆的背景下股票相对于债券和房地产配置价值凸显；供给侧改革和国改的纵深推进，包括 17 年 19 大的召开，也将进一步推升市场风险偏好。

企业盈利层面：目前阶段是去产能已经证实经济复苏尚未证伪。核心变量在于涨价能否从成本

推动变为需求拉动，最终还是要看制造业、房地产和基建投资的合力：一是制造业近期的反弹是否可持续（历史数据观察，地产投资和汽车销量是影响制造业投资增速的重要因素，目前两者均面临增速向下压力。地产受调控政策影响，中性预计地产投资增速 17 年零增长，汽车销量增速受购置税降低和高基数影响可能下滑至 5%。今年制造业投资增速大概 3.5%-4%，考虑到内在库存周期动能大概率能走平）。二是基建投资能否对冲地产投资下滑（今年基建投资增速预计 18.5%，明年需要跳跃到 23%才能对冲地产投资为零假设下保证实现经济 6.5 的增长，同时这将给财政带来较大压力，因此需跟踪 PPP 项目的推进数量和速度）

无风险收益率方面：短期面临的压力包括金融去杠杆，美国加息影响，大宗商品涨价形成的短期类滞涨格局，这几个因素可能都会在一季度体现，所以会制约央行的货币政策放松预期。预期 2017 年中期会观察到经济下滑的压力，届时偏紧的货币政策将获得边际上的改善。

在不确定的市场中几个确定性主题机会值得跟踪投资：债转股（那些丧失融资能力的企业因为债转股带来企业利润增长和资产负债表修复的机会）、一带一路（短期受特朗普政策的干扰，国家战略纵深发展方向不变）、国企混改（一批国有企业通过混改提升企业运营效率给企业质变机会）。

配置层面，在分化延续的宏观策略大背景下，选择优势行业和竞争优势明显的企业在合理估值的基础上重仓持有；优势行业有两层含义：产业层面符合未来发展趋势，景气度向上。同时相应的行业资产契合市场大类资产轮动逻辑；动态的根据股价和估值变化评估股票风险收益比从而调整股票持仓。

#### 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

1、截至本报告期末，本基金可分配利润为-2,365,908.37 元。

2、本报告期内，本基金实施过一次利润分配，利润分配情况如下：本基金管理人以 2016 年 6 月 27 日的可分配收益为基准，向本基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 3.60 元，分红权益登记日为 2016 年 6 月 30 日，除权日为 2016 年 6 月 30 日。本次利润分配总金额为 413,624,485.58 元，其中现金形式发放总额为 19,271,546.17 元，再投资形式发放总额为 394,352,939.41 元。

#### 4.8 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

本报告期，会计师事务所未对本基金出具非标准审计报告。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在金鹰行业优势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

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）050042 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：金鹰行业优势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	29,596,353.19	19,640,635.75
结算备付金	1,509,290.72	845,254.92
存出保证金	114,518.16	154,680.41
交易性金融资产	145,570,938.87	240,504,016.06
其中：股票投资	145,570,938.87	240,504,016.06
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	-	-
应收证券清算款	10,295,238.25	2,442,109.96

应收利息	5,765.16	5,194.27
应收股利	-	-
应收申购款	23,862.32	1,418,375.53
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>187,115,966.67</b>	<b>265,010,266.90</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2016 年 12 月 31 日</b>	<b>2015 年 12 月 31 日</b>
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	10,776,891.04	5,413,067.66
应付赎回款	43,558.00	1,275,765.94
应付管理人报酬	227,477.51	316,421.16
应付托管费	37,912.90	52,736.87
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	693,688.66	447,992.46
应交税费	96,000.00	96,000.00
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,342,164.13	1,407,808.13
<b>负债合计</b>	<b>13,217,692.24</b>	<b>9,009,792.22</b>
<b>所有者权益:</b>	-	-
实收基金	176,264,182.80	155,812,932.34
未分配利润	-2,365,908.37	100,187,542.34
<b>所有者权益合计</b>	<b>173,898,274.43</b>	<b>256,000,474.68</b>

负债和所有者权益总计	187,115,966.67	265,010,266.90
------------	----------------	----------------

## 7.2 利润表

会计主体：金鹰行业优势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
<b>一、收入</b>	<b>-43,096,733.27</b>	<b>282,318,266.06</b>
1.利息收入	694,857.11	246,907.58
其中：存款利息收入	339,977.39	195,499.74
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	354,879.72	51,407.84
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-4,488,688.13	244,780,440.79
其中：股票投资收益	-5,375,123.47	241,862,964.43
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	886,435.34	2,917,476.36
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-40,757,054.02	36,355,216.49
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	1,454,151.77	935,701.20
<b>减：二、费用</b>	<b>7,053,885.88</b>	<b>10,939,794.17</b>
1. 管理人报酬	3,348,515.53	5,244,012.42

2. 托管费	558,085.83	874,002.08
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	2,787,734.87	4,443,077.12
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	359,549.65	378,702.55
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-50,150,619.15</b>	<b>271,378,471.89</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-50,150,619.15</b>	<b>271,378,471.89</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金鹰行业优势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）	155,812,932.34	100,187,542.34	256,000,474.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-50,150,619.15	-50,150,619.15
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）	20,451,250.46	361,221,654.02	381,672,904.48
其中：1.基金申购款	1,082,718,649.69	462,263,882.79	1,544,982,532.48
2.基金赎回款	-1,062,267,399.23	-101,042,228.77	-1,163,309,628.00
四、本期向基金份额持	-	-413,624,485.58	-413,624,485.58



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）	176,264,182.80	-2,365,908.37	173,898,274.43
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）	553,700,022.47	-32,699,746.74	521,000,275.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	271,378,471.89	271,378,471.89
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）	-397,887,090.13	-138,491,182.81	-536,378,272.94
其中：1.基金申购款	149,505,271.52	62,658,575.65	212,163,847.17
2.基金赎回款	-547,392,361.65	-201,149,758.46	-748,542,120.11
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）	155,812,932.34	100,187,542.34	256,000,474.68

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

金鹰行业优势混合型证券投资基金（原名为：金鹰行业优势股票型证券投资基金）（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可【2009】340号《关于核准金鹰行业优势股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由金鹰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《金鹰行业优势股票型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。首次设立募集资金为 2,166,862,092.21 元，认购资金在募集期间产生的利息 227,207.39 元，合计为 2,167,089,299.60 元，按照每份基金份额面值人民币 1.00 元计算，折合基金份额为 2,167,089,299.60 份，业经立信羊城会计师事务所出具验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《金鹰行业优势股票型证券投资基金基金合同》于 2009 年 7 月 1 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,167,089,299.60 份。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。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的股票、债券、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。股票资产占基金资产净值的比例为 60%-95%；债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产净值的比例为 5%-40%，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%，权证投资的比例范围占基金资产净值的 0-3%。

### 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 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

本基金本报告期内及上年度可比期间内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

本基金本报告期内及上年度可比期间内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

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未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

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未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

本基金本报告期内及上年度可比期间内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	3,348,515.53	5,244,012.42
其中：支付销售机构的客户维护费	823,733.23	1,328,703.28

注：1、基金管理人的基金管理费按基金财产净值的 1.5% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金财产净值

2、基金管理费每日计提，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基金管理费给该基金管理人。

#### 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	558,085.83	874,002.08

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
中国银行	0.00
广州证券	0.00
合计	0.00

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内均无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

份额单位：份

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
期初持有的基金份额	-	0.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注：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
中国银行股份有限公司	29,596,353.19	309,250.69	19,640,635.75	165,302.97

注：本基金用于证券交易结算的资金通过“中国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。，结算备付金本年度期末余额 1,509,290.72 元，结算备付金利息收入 19,714.05 元，上年度可比期间期末结算备付金期末余额 845,254.92 元，结算备付金利息收入 29,573.75 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
300583	赛托生物	2016-12-29	2017-01-06	网下新股申购	40.29	40.29	1,582.00	63,738.78	63,738.78	网下新股待上市
603877	太平鸟	2016-12-29	2017-01-09	网下新股申购	21.30	21.30	2,544.00	54,187.20	54,187.20	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
603266	天龙股份	2016-12-30	2017-01-10	网下新股申购	14.63	14.63	1,562.00	22,852.06	22,852.06	网下新股待上



										市
300587	天铁股份	2016-12-28	2017-01-05	网下新股申购	14.11	14.11	1,438.00	20,290.18	20,290.18	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
603689	皖天然气	2016-12-30	2017-01-10	网下新股申购	7.87	7.87	4,818.00	37,917.66	37,917.66	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
603032	德新交运	2016-12-27	2017-01-05	网下新股申购	5.81	5.81	1,628.00	9,458.68	9,458.68	网下新股待上市
603186	华正新材	2016-12-26	2017-01-03	网下新股申购	5.37	5.37	1,874.00	10,063.38	10,063.38	网下新股待上市
300588	熙菱信息	2016-12-27	2017-01-05	网下新股申购	4.94	4.94	1,380.00	6,817.20	6,817.20	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	24,516.00	98,064.00	98,064.00	网下新股待上市
300591	万里马	2016-12-30	2017-01-10	网下新股申购	3.07	3.07	2,397.00	7,358.79	7,358.79	网下新股待上市

#### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本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

本基金本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

本基金本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	145,570,938.87	77.80
	其中：股票	145,570,938.87	77.80
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	31,105,643.91	16.62
7	其他各项资产	10,439,383.89	5.58
8	合计	187,115,966.67	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	7,929,182.60	4.56
B	采矿业	8,115,000.00	4.67
C	制造业	97,000,613.34	55.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,917.66	0.02
E	建筑业	12,519,000.00	7.20
F	批发和零售业	5,864,000.00	3.37
G	交通运输、仓储和邮政业	9,458.68	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,278,702.59	3.04
J	金融业	5,406,064.00	3.11
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	3,411,000.00	1.96
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	145,570,938.87	83.71

### 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末无沪港通股票投资组合。

### 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	000630	铜陵有色	3,200,000	9,856,000.00	5.67
2	600667	太极实业	1,250,000	9,637,500.00	5.54
3	000422	湖北宜化	1,100,000	8,745,000.00	5.03
4	600028	中国石化	1,500,000	8,115,000.00	4.67
5	002564	天沃科技	800,000	8,000,000.00	4.60
6	600598	北大荒	649,933	7,929,182.60	4.56
7	000910	大亚圣象	400,832	7,655,891.20	4.40
8	601669	中国电建	1,000,000	7,260,000.00	4.17
9	600104	上汽集团	300,000	7,035,000.00	4.05
10	002507	涪陵榨菜	499,984	6,689,785.92	3.85

### 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	600886	国投电力	20,254,534.30	7.91
2	000630	铜陵有色	14,898,540.95	5.82

3	000910	大亚圣象	14,811,639.08	5.79
4	600029	南方航空	14,554,066.36	5.69
5	600115	东方航空	13,723,205.84	5.36
6	600686	金龙汽车	11,874,938.00	4.64
7	600667	太极实业	10,953,536.96	4.28
8	600028	中国石化	10,895,000.00	4.26
9	600565	迪马股份	10,696,004.00	4.18
10	300259	新天科技	10,685,897.00	4.17
11	603111	康尼机电	10,277,781.49	4.01
12	601618	中国中冶	10,002,304.93	3.91
13	000978	桂林旅游	9,977,661.53	3.90
14	300310	宜通世纪	9,762,247.40	3.81
15	600801	华新水泥	9,734,802.87	3.80
16	601766	中国中车	9,674,224.00	3.78
17	002165	红宝丽	9,302,039.63	3.63
18	300161	华中数控	9,189,350.38	3.59
19	600198	大唐电信	9,157,614.00	3.58
20	600919	江苏银行	8,884,934.00	3.47
21	600079	人福医药	8,660,799.84	3.38
22	600517	置信电气	8,405,929.71	3.28
23	002564	天沃科技	8,313,530.00	3.25
24	000422	湖北宜化	8,302,541.00	3.24
25	600887	伊利股份	8,226,857.12	3.21
26	600039	四川路桥	8,061,000.00	3.15
27	601555	东吴证券	8,031,537.03	3.14
28	002614	蒙发利	7,932,042.00	3.10
29	600598	北大荒	7,857,076.31	3.07
30	300486	东杰智能	7,785,000.90	3.04
31	000977	浪潮信息	7,643,448.26	2.99
32	002538	司尔特	7,610,177.00	2.97
33	600104	上汽集团	7,508,722.00	2.93
34	002371	北方华创	7,502,698.60	2.93
35	601669	中国电建	7,480,576.00	2.92
36	600136	当代明诚	7,107,619.34	2.78
37	002368	太极股份	6,818,791.00	2.66
38	603869	北部湾旅	6,755,437.16	2.64
39	601997	贵阳银行	6,711,396.94	2.62
40	300236	上海新阳	6,669,714.00	2.61
41	002507	涪陵榨菜	6,669,141.66	2.61
42	000400	许继电气	6,663,760.78	2.60
43	002315	焦点科技	6,623,360.40	2.59
44	000822	山东海化	6,525,768.38	2.55
45	001979	招商蛇口	6,490,941.00	2.54
46	300007	汉威电子	6,490,623.27	2.54

47	002195	二三四五	6,422,683.18	2.51
48	000060	中金岭南	6,385,524.00	2.49
49	002385	大北农	6,336,622.67	2.48
50	600110	诺德股份	6,310,157.50	2.46
51	000568	泸州老窖	6,293,079.00	2.46
52	600155	宝硕股份	6,283,234.97	2.45
53	002386	天原集团	6,255,329.04	2.44
54	300137	先河环保	6,191,156.43	2.42
55	000661	长春高新	6,139,910.48	2.40
56	603100	川仪股份	6,120,657.92	2.39
57	300146	汤臣倍健	6,095,924.00	2.38
58	600153	建发股份	6,024,129.00	2.35
59	600894	广日股份	5,987,787.00	2.34
60	601886	江河集团	5,939,158.00	2.32
61	300422	博世科	5,903,305.26	2.31
62	002026	山东威达	5,828,179.90	2.28
63	600969	郴电国际	5,805,791.06	2.27
64	000906	浙商中拓	5,725,733.00	2.24
65	600128	弘业股份	5,704,129.93	2.23
66	300033	同花顺	5,688,366.00	2.22
67	000930	中粮生化	5,649,428.00	2.21
68	002402	和而泰	5,640,093.70	2.20
69	002340	格林美	5,583,738.00	2.18
70	600821	津劝业	5,540,733.88	2.16
71	600310	桂东电力	5,494,967.00	2.15
72	300364	中文在线	5,487,748.86	2.14
73	000100	TCL 集团	5,444,321.00	2.13
74	300440	运达科技	5,430,018.00	2.12
75	600498	烽火通信	5,379,038.00	2.10
76	600073	上海梅林	5,294,658.26	2.07
77	300436	广生堂	5,283,622.11	2.06
78	600197	伊力特	5,172,386.04	2.02
79	601111	中国国航	5,170,328.50	2.02
80	000928	中钢国际	5,161,102.00	2.02
81	600461	洪城水业	5,124,925.08	2.00
82	603566	普莱柯	5,118,429.31	2.00

## 8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	600079	人福医药	25,702,142.63	10.04
2	600969	郴电国际	25,260,896.53	9.87
3	002594	比亚迪	20,586,602.19	8.04
4	002614	蒙发利	20,535,805.55	8.02
5	001979	招商蛇口	20,054,597.38	7.83
6	600886	国投电力	19,880,978.66	7.77
7	002249	大洋电机	16,650,051.15	6.50
8	600699	均胜电子	16,601,984.60	6.49
9	600029	南方航空	14,573,154.01	5.69
10	600115	东方航空	13,755,378.43	5.37
11	603111	康尼机电	12,922,515.30	5.05
12	002236	大华股份	12,704,154.69	4.96
13	600565	迪马股份	10,942,900.00	4.27
14	002096	南岭民爆	10,797,255.62	4.22
15	000978	桂林旅游	10,567,563.44	4.13
16	300161	华中数控	9,997,374.00	3.91
17	300259	新天科技	9,885,328.18	3.86
18	600801	华新水泥	9,870,754.68	3.86
19	002165	红宝丽	9,750,122.69	3.81
20	601618	中国中冶	9,463,700.00	3.70
21	002039	黔源电力	9,379,478.00	3.66
22	601766	中国中车	9,194,300.00	3.59
23	600686	金龙汽车	8,991,894.83	3.51
24	600919	江苏银行	8,675,420.00	3.39
25	000910	大亚圣象	8,602,147.28	3.36
26	600517	置信电气	8,379,868.00	3.27
27	600198	大唐电信	8,356,652.00	3.26
28	300486	东杰智能	8,168,204.50	3.19
29	600887	伊利股份	8,015,329.00	3.13
30	000977	浪潮信息	7,829,964.00	3.06
31	600039	四川路桥	7,818,393.40	3.05
32	300007	汉威电子	7,620,273.00	2.98
33	002402	和而泰	7,269,224.00	2.84
34	002368	太极股份	7,200,025.00	2.81
35	002340	格林美	7,129,445.85	2.78
36	002371	北方华创	6,994,863.81	2.73
37	002386	天原集团	6,897,729.03	2.69
38	300236	上海新阳	6,874,819.00	2.69
39	002315	焦点科技	6,842,191.40	2.67
40	600821	津劝业	6,840,333.93	2.67
41	000400	许继电气	6,759,418.58	2.64
42	600310	桂东电力	6,740,000.00	2.63

43	000661	长春高新	6,672,942.16	2.61
44	000822	山东海化	6,585,137.95	2.57
45	603869	北部湾旅	6,418,540.00	2.51
46	600136	当代明诚	6,357,242.24	2.48
47	601997	贵阳银行	6,346,855.63	2.48
48	002398	建研集团	6,280,212.80	2.45
49	002385	大北农	6,272,330.00	2.45
50	603100	川仪股份	6,256,811.21	2.44
51	000568	泸州老窖	6,256,570.26	2.44
52	600155	宝硕股份	6,131,673.00	2.40
53	002195	二三四五	6,077,164.00	2.37
54	601222	林洋能源	6,044,511.70	2.36
55	300146	汤臣倍健	5,994,763.74	2.34
56	002011	盾安环境	5,933,803.40	2.32
57	600894	广日股份	5,923,874.52	2.31
58	300137	先河环保	5,824,618.64	2.28
59	600073	上海梅林	5,777,541.00	2.26
60	002664	信质电机	5,708,491.88	2.23
61	600128	弘业股份	5,707,100.00	2.23
62	300033	同花顺	5,692,600.00	2.22
63	002026	山东威达	5,685,302.96	2.22
64	002110	三钢闽光	5,668,095.01	2.21
65	600183	生益科技	5,600,306.55	2.19
66	300364	中文在线	5,598,778.52	2.19
67	300310	宜通世纪	5,581,882.07	2.18
68	000630	铜陵有色	5,500,000.00	2.15
69	300250	初灵信息	5,434,337.28	2.12
70	002271	东方雨虹	5,433,282.89	2.12
71	601886	江河集团	5,414,598.46	2.12
72	600153	建发股份	5,413,005.38	2.11
73	300325	德威新材	5,401,366.87	2.11
74	300422	博世科	5,369,326.00	2.10
75	600197	伊力特	5,338,199.00	2.09
76	601208	东材科技	5,282,810.63	2.06
77	603566	普莱柯	5,231,494.00	2.04
78	600461	洪城水业	5,177,386.00	2.02

#### 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	899,549,610.91
卖出股票的收入（成交）总额	948,350,510.61



## 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

本基金本报告期末无股指期货的持仓。

### 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 本基金本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	114,518.16
2	应收证券清算款	10,295,238.25
3	应收股利	-
4	应收利息	5,765.16
5	应收申购款	23,862.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,439,383.89

**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不存在流通受限的情况。

**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

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	持有份额	占总份

			额比例		额比例
8,821	19,982.34	4,822,976.33	2.74%	171,441,206.50	97.26%

## 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	1,490.80	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

基金合同生效日(2009年7月1日)基金份额总额	2,167,089,299.60
本报告期期初基金份额总额	155,812,932.34
本报告期基金总申购份额	1,082,718,649.69
减：本报告期基金总赎回份额	1,062,267,399.23
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	176,264,182.80

## §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**

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 42000 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	
安信证券	1	247,831,861.23	13.43%	225,846.21	13.48%	-
广发证券	1	109,545,658.97	5.94%	99,829.22	5.96%	-
光大证券	1	165,652,118.88	8.98%	150,957.06	9.01%	-
中信证券	1	4,850,128.35	0.26%	4,419.86	0.26%	-
申万宏源证券	1	138,841,235.77	7.52%	129,302.30	7.72%	-
中金公司	1	24,125,600.66	1.31%	22,468.12	1.34%	-
平安证券	2	202,640,738.92	10.98%	184,668.83	11.02%	-
民生证券	1	288,712,208.57	15.65%	263,104.27	15.70%	-
东北证券	1	46,055,171.87	2.50%	32,759.05	1.95%	-
东吴证券	1	65,818,771.73	3.57%	59,980.98	3.58%	-
国金证券	1	109,068,939.34	5.91%	99,394.53	5.93%	-
宏源证券	1	13,815,101.00	0.75%	12,589.79	0.75%	-

联合证券	1	68,648,030.07	3.72%	62,559.36	3.73%	-
英大证券	1	31,172,772.05	1.69%	28,406.63	1.70%	-
中信建投证券	1	253,965,971.59	13.76%	231,439.34	13.81%	-
中银国际证券	1	74,571,474.98	4.04%	67,957.17	4.06%	-

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
安信证券	-	-	11,000,000.00	1.02%	-	-
中信证券	-	-	1,070,000,000.00	98.98%	-	-

#### §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