

金鹰元丰债券型证券投资基金
(原金鹰元丰保本混合型证券投资基金转型)
2017年年度报告
2017年12月31日

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇一八年三月二十八日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 27 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。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	错误!未定义书签。
1.1 重要提示.....	错误!未定义书签。
§2 基金简介.....	错误!未定义书签。
2.1 基金基本情况.....	错误!未定义书签。
2.2 基金产品说明.....	错误!未定义书签。
2.3 基金管理人和基金托管人.....	错误!未定义书签。
2.4 信息披露方式.....	错误!未定义书签。
2.5 其他相关资料.....	错误!未定义书签。
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	错误!未定义书签。
3.1 主要会计数据和财务指标.....	错误!未定义书签。
3.2 基金净值表现.....	错误!未定义书签。
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	错误!未定义书签。
§4 管理人报告.....	错误!未定义书签。
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	错误!未定义书签。
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	错误!未定义书签。
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	错误!未定义书签。
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.....	错误!未定义书签。
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	错误!未定义书签。
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	错误!未定义书签。
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	错误!未定义书签。
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	错误!未定义书签。
4.9 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.....	错误!未定义书签。
§5 托管人报告.....	错误!未定义书签。
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	错误!未定义书签。
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.....	错误!未定义书签。
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.....	错误!未定义书签。
§6 审计报告.....	错误!未定义书签。
§7 年度财务报表.....	错误!未定义书签。
7.1 资产负债表.....	错误!未定义书签。
7.2 利润表.....	错误!未定义书签。
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	错误!未定义书签。
7.4 报表附注.....	错误!未定义书签。
§8 投资组合报告.....	错误!未定义书签。
8.1 期末基金资产组合情况.....	错误!未定义书签。
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	错误!未定义书签。
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	错误!未定义书签。
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	错误!未定义书签。
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	错误!未定义书签。
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	错误!未定义书签。
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	错误!未定义书签。
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	错误!未定义书签。
8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	错误!未定义书签。

8.10	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	错误!未定义书签。
8.11	投资组合报告附注	错误!未定义书签。
§9	基金份额持有人信息	错误!未定义书签。
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	错误!未定义书签。
9.2	期末上市基金前十名持有人	错误!未定义书签。
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	错误!未定义书签。
9.4	发起式基金发起资金持有份额情况	错误!未定义书签。
§10	开放式基金份额变动	错误!未定义书签。
§11	重大事件揭示	错误!未定义书签。
11.1	基金份额持有人大会决议	错误!未定义书签。
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	错误!未定义书签。
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	错误!未定义书签。
11.4	基金投资策略的改变	错误!未定义书签。
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	错误!未定义书签。
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	错误!未定义书签。
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	错误!未定义书签。
11.8	其他重大事件	错误!未定义书签。
§12	发起式基金发起资金持有份额情况	错误!未定义书签。
§13	影响投资者决策的其他重要信息	错误!未定义书签。
§14	备查文件目录	错误!未定义书签。
14.1	备查文件目录	错误!未定义书签。
14.2	存放地点	错误!未定义书签。
14.3	查阅方式	错误!未定义书签。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

2.1.1 金鹰元丰债券型证券投资基金

基金名称	金鹰元丰债券型证券投资基金
基金简称	金鹰元丰债券
基金主代码	210014
交易代码	210014
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 9 月 20 日
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	122,153,210.74 份
基金合同存续期	不定期

2.1.2 金鹰元丰保本混合型证券投资基金

基金名称	金鹰元丰保本混合型证券投资基金
基金简称	金鹰元丰保本混合
基金主代码	210014
交易代码	210014
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 1 月 30 日
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	210,027,195.67 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

2.2.1 金鹰元丰债券型证券投资基金

投资目标	在严格控制投资风险的前提下,力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将综合考虑国内外政治经济环境、政策形势、宏观经济与资本市场运行状况、固定收益类与权益类资产风险收益特征,定性分析与定量分析并用,灵活确定大类资产配置比例,并将在实际运作中根据证券市场走势以及本基金业绩表现不断对大类资产配置比例进行调整,以期优化大类资产配置,力争获取超额投资收益。
业绩比较基准	中国债券综合指数(全价)×90%+沪深 300 指数×10%。

风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金当中风险较低的品种，其长期平均风险与预期收益率低于股票型基金、混合型基金，但高于货币市场基金。
--------	---

2.2.2 金鹰元丰保本混合型证券投资基金

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		金鹰基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李云亮	郭明
	联系电话	010-59944986	010-66105799
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006135888,020-83936180	95588
传真		020-83282856	010-66105798
注册地址		广东省广州市南沙区滨海路 171号11楼自编1101之一J79	北京市西城区复兴门内大街55 号
办公地址		广州市天河区珠江东路28号越 秀金融大厦30层	北京市西城区复兴门内大街55 号
邮政编码		510623	100140
法定代表人		刘岩	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》
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

2.5 其他相关资料

2.5.1 金鹰元丰债券型证券投资基金

项目	名称	办公地址
会计师事务所	中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）	武汉市武昌区东湖路169号中审众环大厦

注册登记机构	金鹰基金管理有限公司	广州市天河区珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层
--------	------------	-------------------------------

2.5.2 金鹰元丰保本混合型证券投资基金

项目	名称	办公地址
会计师事务所	中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）	武汉市武昌区东湖路 169 号中审众环大厦
注册登记机构	金鹰基金管理有限公司	广州市天河区珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层
基金保证人	深圳市高新投集团有限公司	广东省深圳市福田区深南大道 7028 号时代 科技大厦 22-23 楼

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

3.1.1 金鹰元丰债券型证券投资基金

金额单位：人民币元

3.1.1.1 期间数据和指标	报告期 2017 年 9 月 20 日至 2017 年 12 月 31 日	
	本期已实现收益	
本期利润		-1,420,185.30
加权平均基金份额本期利润		-0.0082
本期加权平均净值利润率		-0.79%
本期基金份额净值增长率		-0.98%
3.1.1.2 期末数据和指标	2017 年末	
	期末可供分配利润	
期末可供分配基金份额利润		0.2089
期末基金资产净值		126,036,578.55
期末基金份额净值		1.0318
3.1.1.3 累计期末指标	2017 年末	

基金份额累计净值增长率	26.30%
-------------	--------

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）。

3.1.2 金鹰元丰保本混合型证券投资基金

金额单位：人民币元

3.1.2.1 期间数据和指标	报告期	2016年	2015年
	2017年1月1日至2017年9月19日		
本期已实现收益	9,394,921.25	30,008,563.48	118,357,851.11
本期利润	16,780,315.18	13,769,741.17	123,424,840.05
加权平均基金份额本期利润	0.0227	0.0167	0.1247
本期加权平均净值利润率	2.21%	1.63%	11.46%
本期基金份额净值增长率	2.16%	0.55%	17.34%
3.1.2.2 期末数据和指标	报告期末(2017年9月19日)	2016年末	2015年末
期末可供分配利润	46,559,848.32	179,890,843.94	61,269,619.55
期末可供分配基金份额利润	0.2217	0.2016	0.2311
期末基金资产净值	218,798,144.83	909,810,911.89	315,837,835.86
期末基金份额净值	1.0418	1.0200	1.1910
3.1.2.3 累计期末指标	报告期末(2017年9月19日)	2016年末	2015年末
基金份额累计净值增长率	27.55%	24.88%	24.22%

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、金鹰元丰保本混合型证券投资基金从 2017 年 9 月 20 日起正式转型为金鹰元丰债券型证券投资基金，上年度可比期间为 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日，上上年度可比期间为 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日，下同。

3.2 基金净值表现

3.2.1 金鹰元丰债券型证券投资基金

3.2.1.1 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	-0.81%	0.21%	-0.53%	0.09%	-0.28%	0.12%
自基金合同生效起至今	-0.98%	0.20%	-0.44%	0.09%	-0.54%	0.11%

注：

1、金鹰元丰保本混合型证券投资基金自 2017 年 9 月 20 日起转型为金鹰元丰债券型证券投资基金；

2、本基金由金鹰元丰保本混合型证券投资基金于 2017 年 9 月 20 日转型而来，目前仍在建仓期；

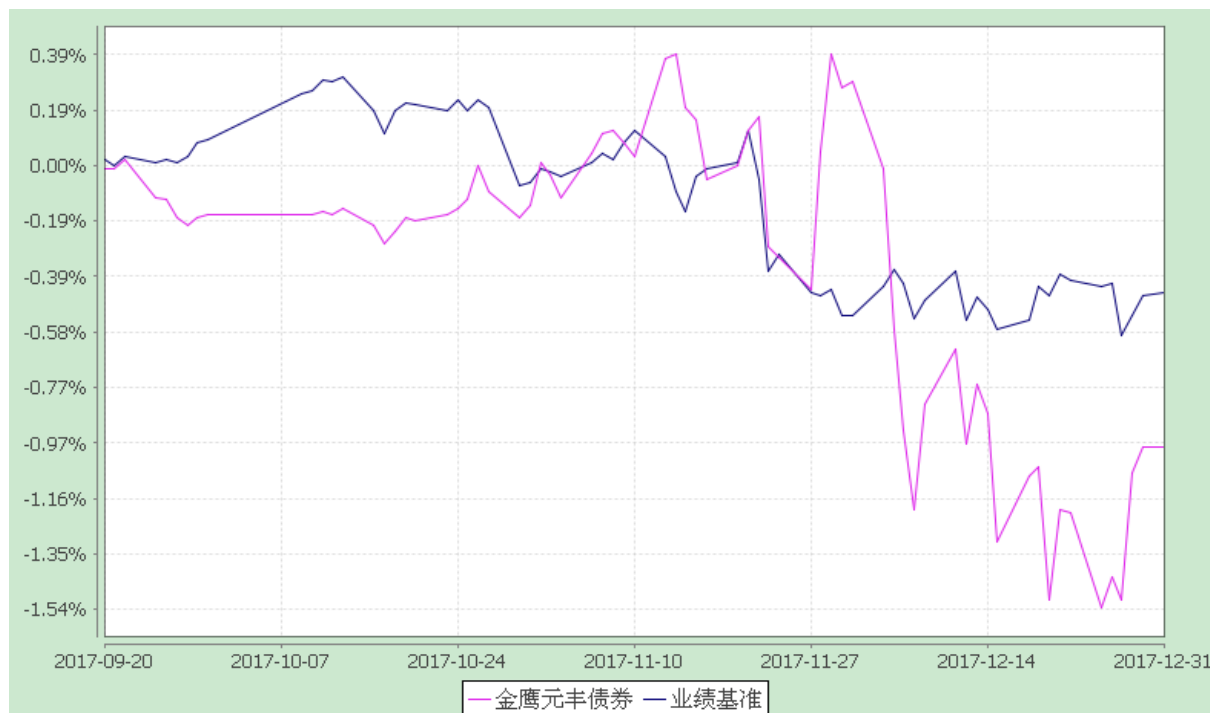
3、转型后本基金的业绩比较基准是：中国债券综合指数(全价)*90%+沪深 300 指数*10%。

3.2.1.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

金鹰元丰债券型证券投资基金

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

(2017 年 9 月 20 日至 2017 年 12 月 31 日)



注：1、金鹰元丰保本混合型证券投资基金自 2017 年 9 月 20 日起转型为金鹰元丰债券型证券投资基金。

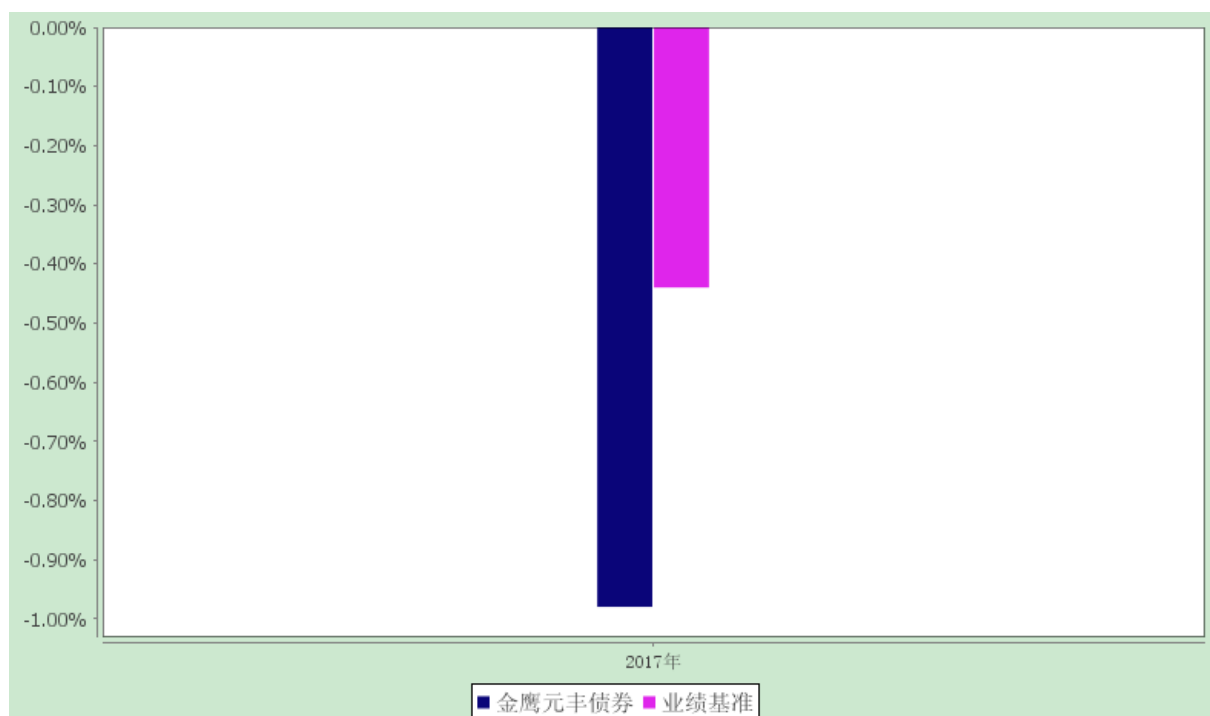
2、本基金由金鹰元丰保本混合型证券投资基金于 2017 年 9 月 20 日转型而来，目前仍在建仓期。

3、转型后本基金的业绩比较基准是：中国债券综合指数(全价)*90%+沪深 300 指数*10%。

3.2.1.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

金鹰元丰债券型证券投资基金

自基金转型以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：

1、金鹰元丰保本混合型证券投资基金自 2017 年 9 月 20 日起转型为金鹰元丰债券型证券投资基金；

3.2.2 金鹰元丰保本混合型证券投资基金

3.2.2.1 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	1.46%	0.06%	0.54%	0.00%	0.92%	0.06%
过去六个月	1.66%	0.06%	1.09%	0.01%	0.57%	0.05%
过去一年	2.36%	0.08%	2.15%	0.01%	0.21%	0.07%
过去三年	22.22%	0.21%	7.73%	0.01%	14.49%	0.20%
自基金合同生效起至今	27.58%	0.19%	14.65%	0.01%	12.93%	0.18%

注：

1、金鹰元丰保本混合型证券投资基金自 2017 年 9 月 20 日起转型为金鹰元丰债券型证券投资基金；

2、转型前，“过去三个月”计算期间为 2017 年 6 月 20 日至 2017 年 9 月 19 日

3、转型前，“过去六个月”计算期间为 2017 年 03 月 20 日至 2017 年 9 月 19 日

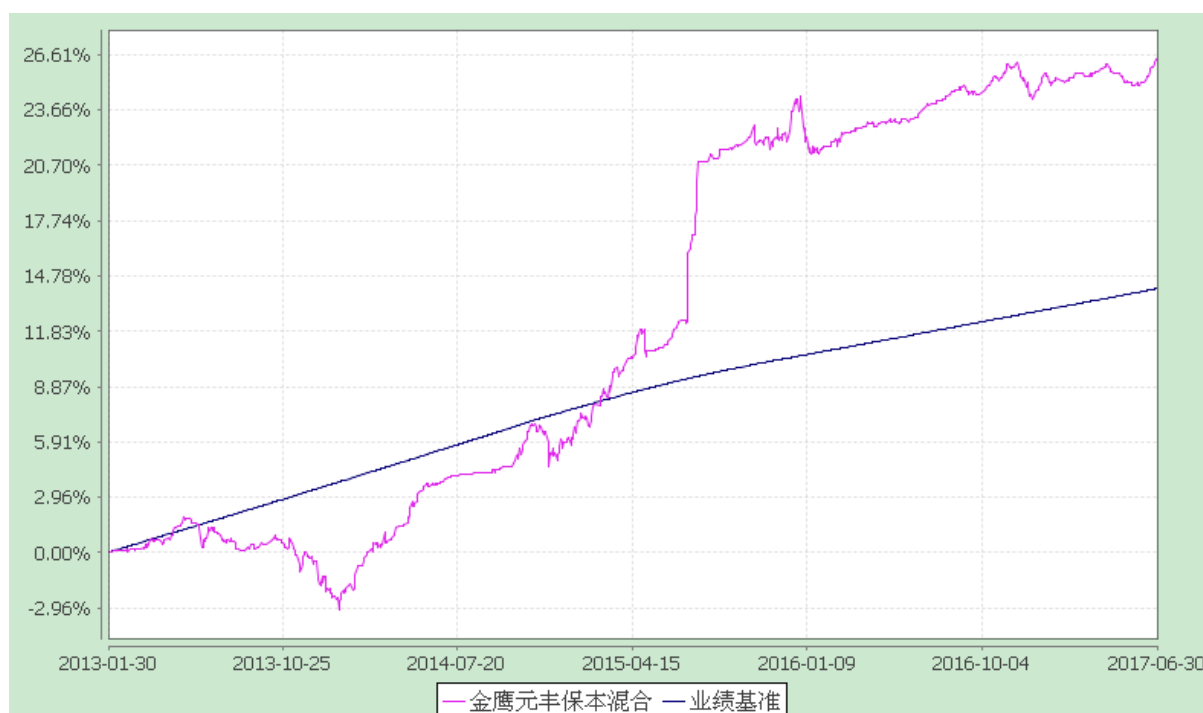
4、转型前，“过去一年”计算期间为 2016 年 9 月 20 日至 2017 年 9 月 19 日

- 5、转型前，“过去三年”计算期间为 2014 年 9 月 20 日至 2017 年 9 月 19 日
- 7、转型前，“自基金合同生效起至今”计算期间为 2013 年 1 月 30 日至 2017 年 9 月 19 日
- 8、转型前本基金的业绩比较基准是：2 年期银行定期存款利率（税后）。

3.2.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

金鹰元丰保本混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2013 年 1 月 30 日至 2017 年 9 月 19 日)



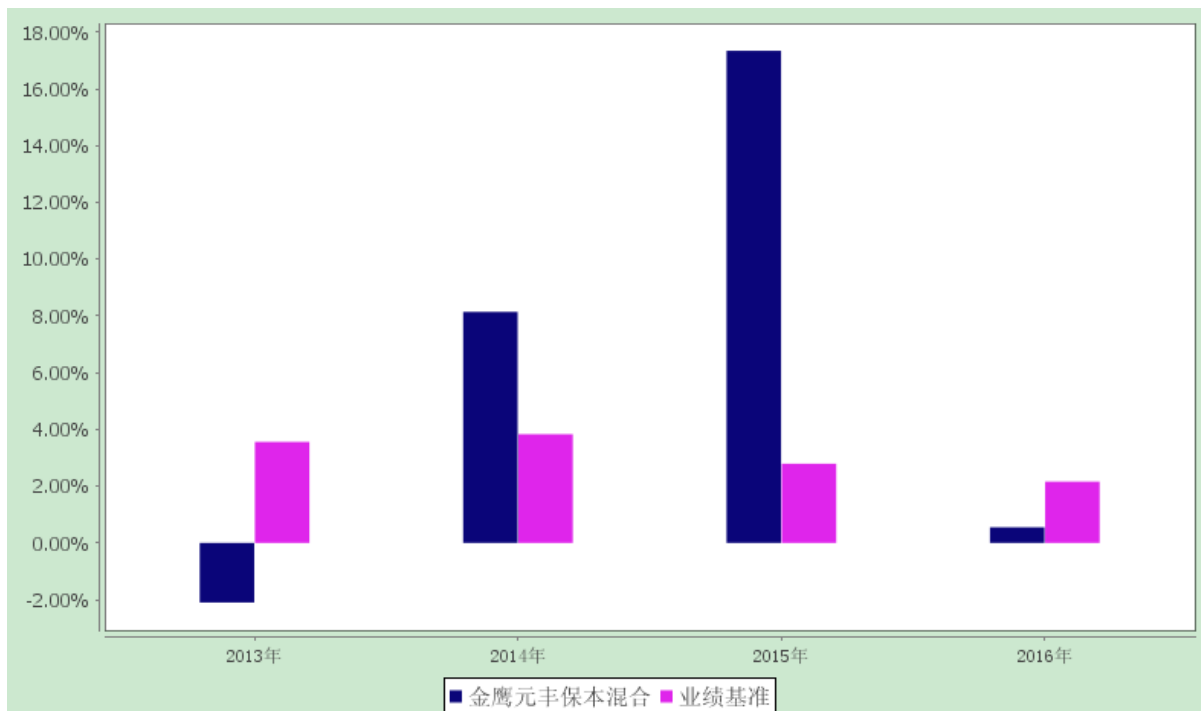
注：1、金鹰元丰保本混合型证券投资基金自 2017 年 9 月 20 日起转型为金鹰元丰债券型证券投资基金。

- 2、截至 2017 年 9 月 19 日，各项投资比例符合基金合同的约定。
- 3、转型前本基金的业绩比较基准是：2 年期银行定期存款利率（税后）。

3.2.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

金鹰元丰保本混合型证券投资基金

自基金转型以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：

1、金鹰元丰保本混合型证券投资基金自 2017 年 9 月 20 日起转型为金鹰元丰债券型证券投资基金；

3.3 过去三年基金的利润分配情况

3.3.1 金鹰元丰债券型证券投资基金

本基金合同生效日为 2017 年 9 月 20 日，截止本报告期末未进行利润分配。

3.3.2 金鹰元丰保本混合型证券投资基金

本基金过去三年未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基字[2002]97 号文批准，金鹰基金管理有限公司于 2002 年 12 月 25 日成立，总部设在广州。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。公司下设权益投资部等 18 个一级职能部门以及北京、广州、上海、深圳、成都等 5 个分公司。

“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，公司回归投资本源，坚持价值投资为导向，资产规模结构持续优化，不断为投资者创造稳健收益。

截至 2017 年 12 月 31 日，公司公募基金规模 447.64 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		
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资产管理总部固定收益投资总监。2014 年 12 月加入金鹰基金管理有限公司，任固定收益部总监。现任金鹰货币市场证券投资基金、金鹰添益纯债债券型证券投资基金、金鹰灵活配置混合型证券投资基金、金鹰元安混合型证券投资基金、金鹰元丰债券型证券投资基金、金鹰元祺信用债债券型证券投资基金、金鹰元和保本混合型证券投资基金、金鹰添利中长期信用债债券型证券投资基金、金鹰添享纯债债券型证券投资基金、金鹰现金增益交易型货币市场基金、金鹰添荣纯债债券型证券投资基金、金鹰添惠纯债债券型证券投资基金、金鹰民丰回报定期开放混合型证券投资基金、金鹰鑫富灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
汪伟	基金经理	2017-09-21	-	4	汪伟先生，2013 年 7 月至 2014 年 9 月曾任广州证券股份有限公司交易员、投资经理等职务，2014 年 9 月至 2016 年 2 月曾任金鹰基金管理有限公司交易主管，2016 年 3 月至 2017 年 7 月曾任广东南粤银行股份有限公司交易员、宏观分析师等职务，2017 年 7 月加入金鹰基金管理有限公司，现任金鹰元安混合型证券投资基金、金鹰元丰债券型证券投资基金基金经理。
吴德瑄	基金经理	2017-09-3	-	4	吴德瑄先生，曾任广州证券股份

		0			有限公司研究员。2015 年 1 月加入金鹰基金管理有限公司，任研究部研究员、基金经理助理、基金经理职务。现任金鹰技术领先灵活配置混合型证券投资基金、金鹰元禧混合型证券投资基金、金鹰元丰债券型证券投资基金、金鹰元安混合型证券投资基金基金经理。
黄倩倩	基金经理助理	2016-08-19	-	5	黄倩倩女士，西南财经大学金融学硕士研究生，历任广州证券股份有限公司资产管理总部债券交易员，2014 年 11 月加入金鹰基金管理有限公司，担任固定收益部债券交易员、基金经理助理，现任金鹰现金增益交易型货币市场基金、金鹰添益纯债债券型证券投资基金基金经理，金鹰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颁布的《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

2017 年，国内债市在经济基本面超预期以及金融去杠杆政策的持续冲击下，延续了 2016 年四季度开启的债券熊市。纵观全年，宏观经济在地产投资及外需发力的双引擎支撑下，全年经济增速小幅反弹至 6.9%。经济基本面的超预期以及金融去杠杆的深入推进，导致货币政策持续收紧，流动性波动加剧，银行体系负债端持续承压。表内资产负债调整压力持续，表外面临资管新规的制约，收益率曲线在此冲击下，整体上行 100bp，债市由此深陷熊市调整。

权益市场风险偏好显著降低，行情二八分化，全年只有大盘蓝筹及业绩白马在资金抱团的推动下，表现抢眼。其余板块全年惨淡。

金鹰元丰在从保本型产品转型为二级债基后，产品配置主要集中在收益短端品种，以存单和短久期信用债，提供稳定票息收益。并通过择时把握长端利率波段，增厚产品收益。四季度开始加入权益操作，以绝对收益选择业绩为主线的品种进行投资，基本不参与主题性博弈机会，以确保业绩带来的稳定性收益。整体仓位最高没有超过 20%，综合考虑了系统性风险以及安全垫问题后最终仓位运作在 10-20% 之间，系统性风险的回避主要依靠仓位来控制。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 9 月 19 日, 金鹰元丰保本混合型证券投资基金, 份额净值为 1.0418 元, 报告期内 (2017 年 1 月 1 日-2017 年 9 月 19 日) 份额净值增长率为 2.16%, 同期业绩比较基准增长率为 1.54%。

截至 2017 年 12 月 31 日, 本基金 (金鹰元丰债券), 份额净值为 1.0318 元, 报告期内 (2017 年 9 月 20 日-2017 年 12 月 31 日) 份额净值增长率为-0.98%, 同期业绩比较基准增长率为-0.44%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年, 我们认为经济基本面缓中趋稳, 通胀阶段性有抬头迹象, 金融去杠杆进入下半场, 货币政策仍将保持中性偏紧基调, 而资管新规落地可能对银行表内表外同时造成压力, 故债市未来仍将高位震荡, 熊牛拐点仍需等待。从相对性价比的角度来看, 当前季度平台的收益率曲线, 短端品种收益较高, 久期风险低, 故倾向于采取骑乘策略, 以 2 年内高评级信用债及存单为主要配置品种, 一方面可以获取稳定票息, 等待行情开启的机会成本低; 另一方面, 商业银行同业负债收缩和货币基金流动性新规约束下, 未来短端利率水平有望缓步回落, 骑乘策略因而可以收获未来短端收益下行的期限价差收益。

股票方面, 展望 2018 年, 预计宏观经济仍以平稳为主, 但仍存在超预期回落的风险。而金融监管政策仍将持续对 A 股市场构成较大影响。因此我们判断 18 年市场整体震荡为主, 存阶段性回落的风险。而市场仍会以结构性机会为主。不过由于 2018 年上市公司整体盈利增速明显回落, 且存在分化的风险。预计部分行业盈利高增长难以持续。在配置上, 我们仍以盈利为主线, 至上而下的配置盈利持续提升的板块, 同时优选业绩持续增长且估值合理的个股。就一季度而言, 部分上游周期型行业的景气度有望持续, 盈利增长的确性较高, 具备较好的配置价值。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内, 监察稽核工作根据独立、客观、公正的原则, 按照规定的权限和程序独立开展本基金运作的合规性监察, 认真履行职责, 通过材料审阅、监督监控、覆盖检查、重点抽查等多种方法开展工作, 督促各项业务的合规运作, 发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告, 定期向公司董事会和监管部门出具监察稽核报告。

本报告期有关本基金的监察稽核内容包括投资、交易、研究、市场营销、信息披露等各项业务的每个环节以及信息技术、运营保障、行政管理等后台支持工作。监察结果显示, 本报告期内公司对本基金的管理始终都能按照法律法规、基金合同、基金招募说明书的要求和公司制度的规定进行。本基金的投资决策、投资交易程序、投资权限等各方面均符合规定的要求; 交易行为合法合规, 未出现异常交易、操纵市场的现象; 未发现内幕交易的情况; 基金持有的证券符合规定的比例要求;

基金专用交易席位年度交易量比例符合证监会的有关规定；相关的信息披露真实、完整、准确、及时；销售工作合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会由基金估值业务分管领导、督察长、基金事务部负责人、基金会计、合规风控部人员及相关投研人员等组成。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。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理、投资经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行，一切以维护基金持有人利益为准则。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场债券品种的估值数据及交易所交易的债券品种的估值数据、流通受限股票流动性折扣。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

4.9 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。

4.10 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

本报告期内无应当说明的预警事项。

§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，中国工商银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对金鹰元丰保本混合型证券

投资基金（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 9 月 19 日）及金鹰元丰债券型证券投资基金（2017 年 9 月 20 日至 2017 年 12 月 31 日）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——金鹰基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，本基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对金鹰基金管理有限公司编制和披露的本基金 2017 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 金鹰元丰债券型证券投资基金

众环审字（2018）050154 号

金鹰元丰债券型证券投资基金全体份额持有人：

我们审计了金鹰基金管理有限公司担任管理人（以下简称“基金管理人”）的金鹰元丰债券型证券投资基金（以下简称“金鹰元丰债券基金”）财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年 9 月 20 日至 2017 年 12 月 31 日期间的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

6.1.1 审计意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照《企业会计准则》并参照《证券投资基金会计核算业务指引》的规定编制，公允反映了金鹰元丰债券基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年 9 月 20 日至 2017 年 12 月 31 日期间的经营成果和净值变动情况。

6.1.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们

独立于基金管理人，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.1.3 其他信息

基金管理人对其他信息负责。其他信息包括 2017 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告，金鹰元丰债券基金 2017 年年度报告预期将在审计报告日后提供给我们。

我们对财务报表发表的审计意见并不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读上述其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

当我们阅读金鹰元丰债券基金 2017 年年度报告后，如果确定其中存在重大错报，审计准则要求我们与基金管理人沟通该事项并采取以下措施：如果其他信息得以更正，将根据具体情形实施必要的程序；如果与基金管理人沟通后其他信息未得到更正，将考虑其法律权利和义务，并采取恰当的措施，以提醒审计报告使用者恰当关注未更正的重大错报。

6.1.4 管理层对财务报表的责任

基金管理人负责按照《企业会计准则》并参照《证券投资基金会计核算业务指引》的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

6.1.5 注册会计师的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

（一）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

（二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性

发表意见。

(三) 评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露), 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

中审众环会计师事务所(特殊普通合伙) 中国注册会计师
武汉市武昌区东湖路 169 号中审众环大厦
2018 年 3 月 20 日

6.2 金鹰元丰保本混合型证券投资基金

众环审字(2018)050153 号

金鹰元丰保本混合型证券投资基金全体份额持有人:

我们审计了金鹰基金管理有限公司担任管理人(以下简称“基金管理人”)的金鹰元丰保本混合型证券投资基金(以下简称“金鹰元丰保本混合基金”)财务报表, 包括 2017 年 9 月 19 日(基金转型前一日)的资产负债表, 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 9 月 19 日(基金转型前一日)期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

6.2.1 审计意见

我们认为, 后附的财务报表在所有重大方面按照《企业会计准则》并参照《证券投资基金会计核算业务指引》的规定编制, 公允反映了金鹰元丰保本混合基金 2017 年 9 月 19 日(基金转型前一日)的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 9 月 19 日(基金转型前一日)期间的经营成果和净值变动情况。

6.2.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则, 我们独立于基金管理人, 并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。

6.2.3 其他信息

基金管理人对其他信息负责。其他信息包括 2017 年年度报告中涵盖的信息, 但不包括财务报表和我们的审计报告, 金鹰元丰保本混合基金 2017 年年度报告预期将在审计报告日后提供给我们。

我们对财务报表发表的审计意见并不涵盖其他信息, 我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证

结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读上述其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

当我们阅读金鹰元丰保本混合基金 2017 年年度报告后，如果确定其中存在重大错报，审计准则要求我们与基金管理人沟通该事项并采取以下措施：如果其他信息得以更正，将根据具体情形实施必要的程序；如果与基金管理人沟通后其他信息未得到更正，将考虑其法律权利和义务，并采取恰当的措施，以提醒审计报告使用者恰当关注未更正的重大错报。

6.2.4 管理层对财务报表的责任

基金管理人负责按照《企业会计准则》并参照《证券投资基金会计核算业务指引》的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

6.2.5 注册会计师的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

（一）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

（二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

（三）评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

（四）评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

武汉市武昌区东湖路 169 号中审众环大厦

2018年3月20日

§7 年度财务报表

7.1 金鹰元丰债券型证券投资基金

7.1.1 资产负债表

会计主体：金鹰元丰债券型证券投资基金

报告截止日：2017年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017年12月31日
资产：		-
银行存款	7.1.4.7.1	342,261.93
结算备付金		1,441,469.03
存出保证金		48,217.56
交易性金融资产	7.1.4.7.2	151,243,449.32
其中：股票投资		25,098,481.42
基金投资		-
债券投资		126,144,967.90
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.1.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.1.4.7.4	-
应收证券清算款		4,087,839.23
应收利息	7.1.4.7.5	1,947,323.68
应收股利		-
应收申购款		2,694.51
递延所得税资产		-
其他资产	7.1.4.7.6	-
资产总计		159,113,255.26
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017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		30,000,000.00

应付证券清算款		-
应付赎回款		2,087,385.86
应付管理人报酬		91,865.52
应付托管费		24,497.48
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.1.4.7.7	101,741.86
应交税费		-
应付利息		-14,634.93
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.1.4.7.8	785,820.92
负债合计		33,076,676.71
所有者权益：		-
实收基金	7.1.4.7.9	99,898,695.85
未分配利润	7.1.4.7.10	26,137,882.70
所有者权益合计		126,036,578.55
负债和所有者权益总计		159,113,255.26

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，本基金份额净值 1.0318 元，基金份额总额 122,153,210.74 份。

7.1.2 利润表

会计主体：金鹰元丰债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 9 月 20 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2017 年 9 月 20 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		-373,216.35
1.利息收入		2,225,075.58
其中：存款利息收入	7.1.4.7.11	41,314.07
债券利息收入		2,149,179.30
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		34,582.21
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-3,475,931.16
其中：股票投资收益	7.1.4.7.12	-134,752.31
基金投资收益	7.1.4.7.13	-
债券投资收益	7.1.4.7.14	-3,341,088.23

资产支持证券投资收益	7.1.4.7.14 .2	-
贵金属投资收益	7.1.4.7.15	-
衍生工具收益	7.1.4.7.16	-
股利收益	7.1.4.7.17	-90.62
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.1.4.7.18	876,192.82
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.1.4.7.19	1,446.41
减：二、费用		1,046,968.95
1. 管理人报酬		381,698.77
2. 托管费		101,786.30
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.1.4.7.20	167,766.43
5. 利息支出		283,090.34
其中：卖出回购金融资产支出		283,090.34
6. 其他费用	7.1.4.7.21	112,627.11
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,420,185.30
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,420,185.30

7.1.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金鹰元丰债券型证券投资基金

本报告期：2017年9月20日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2017年9月20日至2017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）	171,768,505.80	47,029,639.03	218,798,144.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,420,185.30	-1,420,185.30
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）	-71,869,809.95	-19,471,571.03	-91,341,380.98

其中：1.基金申购款	208,824.27	55,368.21	264,192.48
2.基金赎回款	-72,078,634.22	-19,526,939.24	-91,605,573.46
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）	99,898,695.85	26,137,882.70	126,036,578.55

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1.1 至 7.1.4，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

7.1.4 报表附注

7.1.4.1 基金基本情况

金鹰元丰保本混合型证券投资基金(简称"本基金")，经中国证券监督管理委员会（简称"中国证监会"）基金部函[2013]58 号文《关于金鹰元丰保本混合型证券投资基金备案确认的函》批准，于 2013 年 1 月 30 日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定，保本周期为 18 个月。本基金首次设立募集规模 781,278,046.90 份基金份额。本基金自 2016 年 3 月 24 日起转入第三个保本周期，第三个保本周期仍为 18 个月，至 2017 年 9 月 25 日止，基金担保人为深圳市高新投集团有限公司。本基金的基金管理人为金鹰基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据本基金合同规定，本基金第三个保本周期到期日为 2018 年 9 月 14 日。因未能符合保本基金存续条件，按照《金鹰元丰保本混合型证券投资基金基金合同》的约定转型为非保本的债券型基金，即“金鹰元丰债券型证券投资基金”。基金托管人及基金注册登记机构不变，基金代码亦保持不变为（代码：210014）。转型后基金的投资目标、投资范围、投资策略及基金费率等按照《金鹰元丰债券型证券投资基金基金合同》相关规定进行运作。转型过渡期为 2017 年 9 月 14 日至 2017 年 9 月 19 日，本基金于 2017 年 9 月 20 日转型为非保本的债券型基金。

7.1.4.2 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。

7.1.4.3 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 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年 9 月 20 日至 2017 年 12 月 31 日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。

7.1.4.4 重要会计政策和会计估计

7.1.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。本基金本报告期会计年度为 2017 年 9 月 20 日至 2017 年 12 月 31 日。

7.1.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.1.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产包括股票投资、债券投资和衍生工具投资(主要为权证投资)等，其中股票投资和债券投资在资产负债表中作为交易性金融资产列报，衍生工具投资在资产负债表中作为衍生金融资产列报。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

(2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时全部划分为其他金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

7.1.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

基金初始确认金融资产或金融负债，应当按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以

公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票投资、债券投资等，以及不作为有效套期工具的衍生金融工具，相关的交易费用在发生时计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，相关交易费用在发生时计入初始确认金额。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量。

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，其中包括同时结转的公允价值变动收益。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方)。本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1)股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账。

因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价，于股权分置改革方案实施后的股票复牌日，冲减股票投资成本。

卖出股票于成交日确认股票投资收益，出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(2)债券投资

买入证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本。

买入未上市债券和银行间同业市场交易的债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交总额扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本。

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限计算应收利息，按上述会计处理方法核算。

卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券投资收益。

卖出未上市债券和银行间同业市场交易的债券于成交日确认债券投资收益。

卖出债券的成本按移动加权平均法结转。

(3)权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账。

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，出售权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(4)分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本。

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算。

(5)回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购）以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.1.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金目前金融资产和金融负债的估值原则和方法如下：

1、股票估值原则和方法

(1) 上市流通股票的估值

上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后发生了影响公允价值计量的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(2) 未上市股票的估值

送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后发生了影响公允价值计量的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。

(3) 长期停牌股票的估值

已停牌股票，最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，依据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(4) 流通受限股票的估值

流通受限股票，指在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于首次公开发行有明确锁定期的股票，非公开发行且处于明确锁定期的股票、通过大宗交易取得的带限售期的股票，按监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

2、固定收益证券的估值原则和方法

(1) 交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。

(2) 交易所市场上市交易的可转换债券、可交换债券，实行全价交易的，按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息后得到的净价进行估值；实行净价交易的，按估值日收盘价进行估值。估值日没有交易的，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，实行全价交易的，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价；实行净价交易的，按估值日收盘价进行估值。如最近交易日后发生了影响公允价值计量的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(3) 交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(4) 交易所市场发行未上市或未挂牌转让的固定收益品种，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(5) 对银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资者回售权的固定收益品种，回售登记截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。

(6) 对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的固定收益品种，在发行利率与

二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

(7) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

3、权证估值原则和方法

认沽/认购权证的估值，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的认沽/认购权证按估值日的最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后发生了影响公允价值计量的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。未上市交易的认沽/认购权证采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值；停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

4、股指期货估值原则和方法

股指期货合约，一般以估值当日股指期货的结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日结算价估值。当日结算价及结算规则以《中国金融期货交易所结算细则》为准。如法律法规今后另有规定的，从其规定。

5、如有确凿证据表明按上述方法不能客观反映交易性金融工具的公允价值，基金管理人将根据具体情况与基金托管人商定后确定最能反映公允价值的方法。

6、国家有最新规定的，按其规定进行估值。

7.1.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.1.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.1.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。

损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现平准金与已实现平准金均在“损益

平准金"科目中核算，并于期末全额转入未分配利润。

7.1.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

1、存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示。

2、债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。

3、资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，在证券实际持有期内逐日计提。

4、买入返售金融资产收入,按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提。

5、股票投资收益于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额入账。

6、债券投资收益于卖出债券成交日确认，并按卖出债券成交金额与其成本、应收利息的差额入账。

7、衍生工具投资收益于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交总额与其成本的差额入账。

8、股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账。

9、公允价值变动收益系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

10、其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.1.4.4.10 费用的确认和计量

1、基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.75%的年费率逐日计提；

2、基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.2%的年费率逐日计提；

3、卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

4、其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第五位的，则采用待摊或预提的方法。

7.1.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式：

现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；投资者可以在不同销售机构对本基金设置为相同的分红方式，亦可设置为不同的分红方式，即同一基金账户对本基金在各销售机构设置的分红方式相互独立、互不影响；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.1.4.4.12 分部报告

本基金本报告期内无分部报告。

7.1.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.1.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金报告期内无需说明的重要会计政策变更。

7.1.4.5.2 会计估计变更的说明

为确保证券投资基金估值的合理性和公允性，根据中国证监会 证监会公告[2017]13 号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国证券投资基金业协会中基协发[2017]6 号《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》的相关规定，本基金自 2017 年 12 月 20 日起，对所持有的流通受限股票的估值技术进行变更。新的估值技术为市价折扣法，考虑了估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值以及该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣的影响，其中剩余限售期对应的流动性折扣为关键输入值，流动性折扣越高，对应流通受限股票的公允价值越低。上述流通受限股票是指在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售份、通过大宗交易取得的带限售期股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票。

7.1.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计差错更正。

7.1.4.6 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[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》，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。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号《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、债券免征增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《财政部 税务总局关于资管产品增值税有关问题的通知》，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税

额中抵减。

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。

7.1.4.7 重要财务报表项目的说明

7.1.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	
	活期存款	342,261.93
定期存款	-	
其他存款	-	
合计	342,261.93	

7.1.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	25,779,360.54	25,098,481.42	-680,879.12
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	39,906,659.02	38,918,967.90	-987,691.12
	银行间市场	87,911,124.31	87,226,000.00	-685,124.31
	合计	127,817,783.33	126,144,967.90	-1,672,815.43
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		153,597,143.87	151,243,449.32	-2,353,694.55

7.1.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期内未投资衍生金融工具。

7.1.4.7.4 买入返售金融资产

7.1.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.1.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.1.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	133.12
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	648.60
应收债券利息	1,946,520.26
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	21.70

合计	1,947,323.68
----	--------------

7.1.4.7.6其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

7.1.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日
交易所市场应付交易费用	98,677.26
银行间市场应付交易费用	3,064.60
合计	101,741.86

7.1.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2.05
其他应付款	141,818.87
信息披露费	591,000.00
审计费用	53,000.00
合计	785,820.92

7.1.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年9月20日至2017年12月31日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	210,027,195.67	171,768,505.80
-基金份额折算调整	-	-
-未领取红利份额折算调整（若有）	-	-
-集中申购募集资金本金及利息	-	-
-基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	255,342.64	208,824.27
本期赎回（以“-”号填列）	-88,129,327.57	-72,078,634.22
本期末	122,153,210.74	99,898,695.85

7.1.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	46,559,848.32	469,790.71	47,029,639.03
本期利润	-2,296,378.12	876,192.82	-1,420,185.30
本期基金份额交易产生的变动数	-18,739,657.74	-731,913.29	-19,471,571.03
其中：基金申购款	53,508.02	1,860.19	55,368.21
基金赎回款	-18,793,165.76	-733,773.48	-19,526,939.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	25,523,812.46	614,070.24	26,137,882.70

7.1.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年9月20日至2017年12月31日
活期存款利息收入	11,933.93
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	29,228.82
其他	151.32
合计	41,314.07

7.1.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年9月20日至2017年12月31日
卖出股票成交总额	53,849,043.63
减：卖出股票成本总额	53,983,795.94
买卖股票差价收入	-134,752.31

7.1.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期末投资本基金。

7.1.4.7.14 债券投资收益**7.1.4.7.14.1 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2017年9月20日至2017年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	265,051,139.43
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	263,650,032.50
减：应收利息总额	4,742,195.16
买卖债券差价收入	-3,341,088.23

7.1.4.7.14.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内未投资资产支持证券。

7.1.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内未投资贵金属。

7.1.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内未投资权证。

7.1.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017年9月20日至2017年12月31日
股票投资产生的股利收益	-90.62
基金投资产生的股利收益	-
合计	-90.62

7.1.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2017年9月20日至2017年12月31日
1.交易性金融资产	876,192.82
——股票投资	-868,222.70
——债券投资	1,744,415.52
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-

3.其他	-
合计	876,192.82

7.1.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年9月20日至2017年12月31日
基金赎回费收入	1,444.47
转换费收入	1.94
合计	1,446.41

7.1.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年9月20日至2017年12月31日
交易所市场交易费用	164,891.43
银行间市场交易费用	2,875.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	167,766.43

7.1.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年9月20日至2017年12月31日
审计费用	14,954.98
信息披露费	84,659.58
帐户维护费	9,000.00
银行汇划费	3,712.55
其他	300.00
合计	112,627.11

7.1.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**7.1.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

7.1.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

7.1.4.9 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
广州白云山医药集团股份有限公司	基金管理人股东
美的集团股份有限公司	基金管理人股东
东亚联丰投资管理有限公司	基金管理人股东
金鹰基金管理有限公司	基金发起人、管理人、销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
深圳前海金鹰资产管理有限公司	基金管理人子公司

7.1.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.1.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.1.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.1.4.10.1.2 权证交易

本基金报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.1.4.10.1.3 债券交易

本基金报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.1.4.10.1.4 债券回购交易

本基金报告期内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.1.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

7.1.4.10.2 关联方报酬

7.1.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年9月20日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	381,698.77

其中：支付销售机构的客户维护费	206,116.75
-----------------	------------

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.75% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.75\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

7.1.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2017年9月20日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	101,786.30

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，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。

7.1.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期没有应支付关联方的销售服务费。

7.1.4.10.3 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。

7.1.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.1.4.10.4.1 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。

7.1.4.10.4.2 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。

7.1.4.10.5 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 2017年9月20日至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	342,261.93	11,933.93

注：本基金本报告期末的清算备付金余额 1,441,469.03 元，结算备付金利息收入 29,228.82 元。

7.1.4.10.6 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。

7.1.4.10.7 其他关联交易事项的说明**7.1.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明**

无。

7.1.4.10.7.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

本基金本报告期末投资本基金。

7.1.4.11 利润分配情况

本基金报告期内未进行利润分配。

7.1.4.12 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券**7.1.4.12.1 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
300580	贝斯特	2017-09-15	重大事项停牌	21.74	2018-03-01	19.57	2,489.00	23,869.51	54,110.86	重大事项

7.1.4.12.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.1.4.12.2.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.1.4.12.2.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 30,000,000.00 元,于 2018 年 1 月 2 日(先后)到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

7.1.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险等。基金成立以来,本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发,依照公司内部控制的整体要求,致力于内控机制的建立和完善,公司内部管理制度及业务规范流程的制定和完善,加强内部风险的控制与有效防范,以保证各项法规和管理制度的落实,保证基金合同得到严格履行。

7.1.4.13.1 风险管理政策和组织架构

为保证公司规范化运作,有效地防范和化解经营风险,确保基金和公司财务和其他信息真实、准确、完整、及时,从而最大程度地保护基金持有人的合法权益,本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设,建立了科学合理、控制严密、运行高效的各项管理制度:

(1) 风险管理控制制度

风险控制制度由总则、风险控制的目标和原则、风险控制的机构设置、风险控制的程序、风险类型的界定、风险控制的主要措施、风险控制的具体制度、风险控制制度的监督与评价等部分组成。

风险控制的具体制度主要包括投资风险管理制度、交易风险控制制度、财务风险控制制度、公司资产管理制度等业务风险控制制度,以及岗位分离制度、业务空间隔离制度、作业规则、岗位职责、反馈制度、资料保全制度、保密制度、员工行为守则等程序性风险管理制度。

(2) 投资管理制度

投资管理制度包括研究业务管理制度、投资决策管理制度、基金交易管理制度等。

制订研究业务管理制度的目的是保持研究工作的独立、客观。研究业务管理制度包括:建立严密的研究工作业务流程,形成科学、有效的研究方法;根据基金合同要求,在充分研究的基础上建立和维护投资对象备选库;建立研究与投资的业务交流制度,保持通畅的交流渠道;建立研究报告质量评价体系。

制订投资决策业务管理制度的目的是严格遵守法律法规的有关规定,确保基金的投资符合基金合同所规定的投资目标、投资范围、投资策略、投资组合和投资限制等要求。投资决策业务管理制度包括投资决策授权制度;投资决策支持制度,重要投资要有详细的研究报告和风险分析支持;投资风险评估与管理制度,在设定的风险权限额度内进行投资决策;投资管理业绩评价制度等。

制订基金交易管理制度的目的是保证基金投资交易的安全、有效、公平。基金交易管理制度包括基金交易的集中交易制度；交易监测、预警、反馈机制；投资指令审核制度；投资指令公平分配制度；交易记录保管制度；交易绩效评价制度等。

(3) 监察稽核制度

公司设立督察长，负责监察稽核工作，督察长由总经理提名，经董事会聘任，对董事会负责，报中国证监会核准。

除应当回避的情况外，督察长可以列席公司相关会议，调阅公司相关档案，就内部控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能。

督察长应当定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况，董事会应当对督察长的报告进行审议。

公司设立监察稽核部门，具体执行监察稽核工作。公司明确规定了监察稽核部门及内部各岗位的具体职责，严格审查监察稽核人员的专业任职条件，配备了充足的合格的监察稽核人员，明确规定了监察稽核的操作程序和组织纪律。

监察稽核制度包括检查公司各业务部门和工作人员是否遵守法律、法规、规章的有关规定；检查公司各业务部门和工作人员对公司内部控制制度、各项管理制度、业务规章的执行情况；对公司各部门作业流程的遵守合规性和有效性的检查、监督、评价及建议等。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.1.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级度的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评

估控制证券发行人的信用风险，建立了内部评级体系，通过内部评级与外部评级相结合的方法充分评估证券以及交易对手的信用风险。

7.1.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017年12月31日
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

注：本统计数据未包含国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债和同业存单。

7.1.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017年12月31日
AAA	33,300,900.00
AAA 以下	34,137,067.90
未评级	0.00
合计	67,437,967.90

注：本统计数据未包含国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债和同业存单。

7.1.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自于投资品种流动性不足，导致金融资产不能在合理价格变现。本基金采用分散投资、监控流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时基金管理人通过分析持有人结构、申购赎回行为分析、变现比例、压力测试等方法评估组合的流动性风险。

7.1.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金为债券型基金，主要投资于具备高流动性的国内依法发行上市的股票、债券等金融工具；另外，本基金将持有不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，也具备较强的流动性。总体来看，本基金的投资标的具有良好的流动性。

报告期内，在流动性新规实施后本基金主动投资于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、

资产支持证券等流动性受限资产的市值合计未超过该基金资产净值的 15%。报告期末, 本基金持有的股票资产占基金资产净值的比例为 19.91%, 本基金持有的债券资产占基金资产净值的比例为 100.09%, 持有流动性受限资产的市值合计占基金资产净值的比例符合法规要求。总体来看, 本基金的资产组合具有良好的流动性。

报告期内, 本基金的投资比例严格遵守相关法律法规和基金合同规定的比例, 符合组合管理、分散投资的原则, 持仓结构保持一定的高流动性资产, 严格控制流动性受限资产的投资比例, 并且充分降低金融工具的集中度, 确保组合的分散度, 将基金的流动性风险控制在较低的水平。

7.1.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险, 包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.1.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。基金管理人通过久期、凸度等方法评估组合面临的利率风险敞口, 并通过调整投资组合的久期等方法对利率风险进行管理。

7.1.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位: 人民币元

本期末 2017年12月31日	1个月 以内	1-3 个月	6个月 以内	3个月 -1年	6个月 -1年	1年以 内	1-5年	5年以 上	不计息	合计
资产										
银行存款	342,261.93	-	-	-	-	-	-	-	-	342,261.93
结算备付金	1,441,469.03	-	-	-	-	-	-	-	-	1,441,469.03
存出保证金	48,217.56	-	-	-	-	-	-	-	-	48,217.56
交易性金融资产	-	-	-	-	-	57,742,400.00	68,402,567.90	-	25,098,481.42	151,243,449.32
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	4,087,839.23	4,087,839.23
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	1,947,323.68	1,947,323.68
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	-2,694.51	2,694.51

其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,831,948.52	-	-	-	-	57,742,400.00	68,402,567.90	-	31,136,338.84	159,113,255.26
负债										
短期借款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	30,000,000.00	-	-	-	-	-	-	-	-	30,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	2,087,385.86	2,087,385.86
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	91,865.52	91,865.52
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	24,497.48	24,497.48
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	101,741.86	101,741.86
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-	-14,634.93	-14,634.93
应付利润	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	785,820.92	785,820.92
负债总计	30,000,000.00	-	-	-	-	-	-	-	3,076,676.71	33,076,676.71
利率敏感度缺口	-28,168,051.48	-	-	-	-	57,742,400.00	68,402,567.90	-	28,059,662.13	126,036,578.55

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

7.1.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他变量不变，只有利率变动通过债券公允价值变动对基金资产净值产生影响。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末

		2017年12月31日
	利率上升25个基点	-296,347.70
	利率下降25个基点	296,347.70

注：

(1)金鹰元丰保本混合型证券投资基金自2017年9月20日起转型为金鹰元丰债券型证券投资基金；

7.1.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.1.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

7.1.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	25,098,481.42	19.91
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	126,144,967.90	100.09
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
合计	151,243,449.32	120.00

7.1.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	市场其他变量保持不变，只有业绩比较基准所对应的市场组合价格发生合理、可能的变动；	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)
		本期末 2017年12月31日
	业绩比较基准变动+5%	5,451,950.47
	业绩比较基准变动-5%	-5,451,950.47

注：

(1) 金鹰元丰保本混合型证券投资基金自 2017 年 9 月 20 日起转型为金鹰元丰债券型证券投资基金;

7.1.4.14 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)，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，相关债券的公允价值属第二层次。

除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7.2 金鹰元丰保本混合型证券投资基金

7.2.1 资产负债表

会计主体：金鹰元丰保本混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 9 月 19 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 9 月 19 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日-
资产：		-	-
银行存款	7.2.4.7.1	133,027,399.51	707,635.31
结算备付金		16,507,651.15	18,000,373.42
存出保证金		8,793.91	91,239.11
交易性金融资产	7.2.4.7.2	149,851,908.34	1,146,510,012.89
其中：股票投资		287,322.14	62,848,828.39
基金投资		-	-

债券投资		149,564,586.20	1,083,661,184.50
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.2.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.2.4.7.4	-	240,700,240.00
应收证券清算款		97,665,102.36	898,191.28
应收利息	7.2.4.7.5	2,776,841.49	15,380,641.06
应收股利		-	-
应收申购款		-	404.46
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.2.4.7.6	-	-
资产总计		399,837,696.76	1,422,288,737.53
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年9月19日	上年度末 2016年12月31日-
负 债:		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	509,800,948.20
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		179,936,266.73	701,278.62
应付管理人报酬		180,199.60	582,682.25
应付托管费		48,053.24	155,381.93
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.2.4.7.7	25,574.60	186,180.27
应交税费		141,818.87	141,818.87
应付利息		-	128,161.28
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.2.4.7.8	707,638.89	781,374.22
负债合计		181,039,551.93	512,477,825.64
所有者权益:		-	-
实收基金	7.2.4.7.9	171,768,505.80	729,920,067.95
未分配利润	7.2.4.7.10	47,029,639.03	179,890,843.94
所有者权益合计		218,798,144.83	909,810,911.89
负债和所有者权益总计		399,837,696.76	1,422,288,737.53

注：报告截止日 2017 年 9 月 19 日，本基金份额净值 1.0420 元，基金份额总额 210,027,195.67 份。

7.2.2 利润表

会计主体：金鹰元丰保本混合型证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年9月19日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017年1月1日至 2017年9月19日	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年12月31日-
一、收入		28,508,253.02	25,683,335.96
1.利息收入	7.2.4.7.11	30,967,569.77	26,651,236.73
其中：存款利息收入		207,581.22	343,288.83
债券利息收入		23,670,540.36	23,159,544.81
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		7,089,448.19	3,148,403.09
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-10,443,599.93	13,848,127.10
其中：股票投资收益	7.2.4.7.12	1,521,513.54	14,209,848.28
基金投资收益	7.2.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.2.4.7.14	-12,033,685.61	-743,768.59
资产支持证券投资收益	7.2.4.7.15	-	-
贵金属投资收益	7.2.4.7.16	-	-
衍生工具收益	7.2.4.7.17	-	-
股利收益	7.2.4.7.18	68,572.14	382,047.41
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.2.4.7.19	7,385,393.93	-16,238,822.31
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.2.4.7.20	598,889.25	1,422,794.44
减：二、费用		11,727,937.84	11,913,594.79
1. 管理人报酬		4,053,741.58	6,216,567.29
2. 托管费		1,080,997.71	1,657,751.28
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.2.4.7.21	146,274.12	824,187.91
5. 利息支出		6,140,651.15	2,788,090.67
其中：卖出回购金融资产支出		6,140,651.15	2,788,090.67
6. 其他费用	7.2.4.7.22	306,273.28	426,997.64
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		16,780,315.18	13,769,741.17
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		16,780,315.18	13,769,741.17
-------------------	--	---------------	---------------

7.2.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金鹰元丰保本混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 9 月 19 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 9 月 19 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）	729,920,067.95	179,890,843.94	909,810,911.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	16,780,315.18	16,780,315.18
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）	-558,151,562.15	-149,641,520.09	-707,793,082.24
其中：1.基金申购款	3,219,628.68	824,399.88	4,044,028.56
2.基金赎回款	-561,371,190.83	-150,465,919.97	-711,837,110.80
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）	171,768,505.80	47,029,639.03	218,798,144.83
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	254,568,216.31	61,269,619.55	315,837,835.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13,769,741.17	13,769,741.17
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	475,351,851.64	104,851,483.22	580,203,334.86

其中：1.基金申购款	714,956,380.20	159,352,565.22	874,308,945.42
2.基金赎回款	-239,604,528.56	-54,501,082.00	-294,105,610.56
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	729,920,067.95	179,890,843.94	909,810,911.89

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.2.1 至 7.2.4，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

7.2.4 报表附注

7.2.4.1 基金基本情况

金鹰元丰保本混合型证券投资基金(简称“本基金”)，经中国证券监督管理委员会（简称“中国证监会”)基金部函[2013]58 号文《关于金鹰元丰保本混合型证券投资基金备案确认的函》批准，于 2013 年 1 月 30 日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定，保本周期为 18 个月。本基金首次设立募集规模 781,278,046.90 份基金份额。本基金自 2016 年 3 月 24 日起转入第三个保本周期，第三个保本周期仍为 18 个月，至 2017 年 9 月 25 日止，如保本周期到期日为非工作日，则保本周期到期日顺延至下一个工作日。该保本周期的保本和担保安排以本基金管理人公告为准。本基金的基金管理人为金鹰基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

7.2.4.2 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。

7.2.4.3 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 2017 年 9 月 19 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 9 月 19 日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。

7.2.4.4 重要会计政策和会计估计

7.2.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日至12月31日。本基金本报告期会计年度为2017年1月1日至9月19日。

7.2.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.2.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产包括股票投资、债券投资和衍生工具投资(主要为权证投资)等，其中股票投资和债券投资在资产负债表中作为交易性金融资产列报，衍生工具投资在资产负债表中作为衍生金融资产列报。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

(2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时全部划分为其他金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

7.2.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

基金初始确认金融资产或金融负债，应当按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票投资、债券投资等，以及不作为有效套期工具的衍生金融工具，相关的交易费用在发生时计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，相关交易费用在发生时计入初始确认金额。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公

允价值变动计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量。

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，其中包括同时结转的公允价值变动收益。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方)。本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1)股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账。

因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价，于股权分置改革方案实施后的股票复牌日，冲减股票投资成本。

卖出股票于成交日确认股票投资收益，出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(2)债券投资

买入证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本。

买入未上市债券和银行间同业市场交易的债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交总额扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本。

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限计算应收利息，按上述会计处理方法核算。

卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券投资收益。

卖出未上市债券和银行间同业市场交易的债券于成交日确认债券投资收益。

卖出债券的成本按移动加权平均法结转。

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账。

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，出售权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本。

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算。

(5) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购）以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.2.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金目前金融资产和金融负债的估值原则和方法如下：

1、股票估值原则和方法

(1) 上市流通股票的估值

上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后发生了影响公允价值计量的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(2) 未上市股票的估值

送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后发生了影响公允价值计量的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。

(3) 长期停牌股票的估值

已停牌股票，最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大的事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，本基金根据中国证

监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，依据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(4) 流通受限股票的估值

流通受限股票，指在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于首次公开发行有明确锁定期的股票，非公开发行且处于明确锁定期的股票、通过大宗交易取得的带限售期的股票，按监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

2、固定收益证券的估值原则和方法

(1) 交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。

(2) 交易所市场上市交易的可转换债券、可交换债券，实行全价交易的，按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息后得到的净价进行估值；实行净价交易的，按估值日收盘价进行估值。估值日没有交易的，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，实行全价交易的，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价；实行净价交易的，按估值日收盘价进行估值。如最近交易日后发生了影响公允价值计量的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(3) 交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(4) 交易所市场发行未上市或未挂牌转让的固定收益品种，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(5) 对银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资者回售权的固定收益品种，回售登记截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。

(6) 对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的固定收益品种，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

(7) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

3、权证估值原则和方法

认沽/认购权证的估值，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的认沽/认购权证按估值日的最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后发生了影响公允价值计量的重大事件的，可参考类

似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。未上市交易的认沽/认购权证采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值；停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

4、股指期货估值原则和方法

股指期货合约，一般以估值当日股指期货的结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日结算价估值。当日结算价及结算规则以《中国金融期货交易所结算细则》为准。如法律法规今后另有规定的，从其规定。

5、如有确凿证据表明按上述方法不能客观反映交易性金融工具的公允价值，基金管理人将根据具体情况与基金托管人商定后确定最能反映公允价值的方法。

6、国家有最新规定的，按其规定进行估值。

7.2.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.2.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.2.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。

损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现平准金与已实现平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入未分配利润。

7.2.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

1、存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示。

2、债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。

3、资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，在证券实际持有期内逐日计提。

4、买入返售金融资产收入,按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提。

5、股票投资收益于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额入账。

6、债券投资收益于卖出债券成交日确认，并按卖出债券成交金额与其成本、应收利息的差额入账。

7、衍生工具投资收益于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交总额与其成本的差额入账。

8、股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账。

9、公允价值变动收益系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

10、其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.2.4.4.10 费用的确认和计量

1、基金管理费按前一日基金资产净值的0.75%的年费率逐日计提；

2、基金托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率逐日计提；

3、卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

4、其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第五位的，则采用待摊或预提的方法。

7.2.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为6次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的20%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式：

(1) 保本周期内：仅采取现金分红一种收益分配方式，不进行红利再投资；

(2) 转型后：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；投资者可以在不同销售机构对本基金设置为相同的分红方式，亦可设置为不同的分红方式，即同一基金账户对本基金在各销售机构设置的分红方式相互独立、互不影响；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.2.4.4.12 分部报告

本基金本报告期内无分部报告。

7.2.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《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》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4) 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)，按照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》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

7.2.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.2.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.2.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无会计估计变更说明。

7.2.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无差错更正。

7.2.4.6 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[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》，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。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号《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、债券免征增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《财政部 税务总局关于资管产品增值税有关问题的通知》，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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。

7.2.4.7 重要财务报表项目的说明

7.2.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 9 月 19 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	133,027,399.51	707,635.31

定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	133,027,399.51	707,635.31

7.2.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2017年9月19日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		99,978.56	287,322.14	187,343.58
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	102,223,455.12	99,827,586.20	-2,395,868.92
	银行间市场	50,758,362.03	49,737,000.00	-1,021,362.03
	合计	152,981,817.15	149,564,586.20	-3,417,230.95
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		153,081,795.71	149,851,908.34	-3,229,887.37
项目		上年度末 2016年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		61,280,196.84	62,848,828.39	1,568,631.55
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	317,259,580.34	310,338,184.50	-6,921,395.84
	银行间市场	778,585,517.01	773,323,000.00	-5,262,517.01
	合计	1,095,845,097.35	1,083,661,184.50	-12,183,912.85
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,157,125,294.19	1,146,510,012.89	-10,615,281.30

7.2.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期内未投资衍生金融工具。

7.2.4.7.4 买入返售金融资产

7.2.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017年9月19日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2016年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	160,700,000.00	-
银行间市场	80,000,240.00	-
合计	240,700,240.00	-

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.2.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.2.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年9月19日	上年度末 2016年12月31日
应收活期存款利息	28,263.60	2,597.59
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	56,049.15	8,100.20
应收债券利息	2,692,442.19	14,439,027.79
应收买入返售证券利息	-0.06	930,874.38
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	86.61	41.10
合计	2,776,841.49	15,380,641.06

7.2.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产。

7.2.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末

	2017年9月19日	2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	8,938.80	161,366.30
银行间市场应付交易费用	16,635.80	24,813.97
合计	25,574.60	186,180.27

7.2.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年9月19日	上年度末 2016年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	3,253.45	10,374.22
信息披露费	666,340.42	60,000.00
审计费用	38,045.02	711,000.00
合计	707,638.89	781,374.22

7.2.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年9月19日	
	基金份额	账面金额
上年度末	892,272,863.74	729,920,067.95
本期申购	3,936,108.14	3,219,628.68
本期赎回（以“-”号填列）	-686,181,776.21	-561,371,190.83
本期末	210,027,195.67	171,768,505.80

7.2.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	210,347,437.71	-30,456,593.77	179,890,843.94
本期利润	9,394,921.25	7,385,393.93	16,780,315.18
本期基金份额交易产生的变动数	-173,182,510.64	23,540,990.55	-149,641,520.09
其中：基金申购款	979,216.94	-154,817.06	824,399.88
基金赎回款	-174,161,727.58	23,695,807.61	-150,465,919.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	46,559,848.32	469,790.71	47,029,639.03

7.2.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年9月 19日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12 月31日-
活期存款利息收入	41,441.60	170,201.73
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	165,510.60	56,484.69
其他	629.02	116,602.41
合计	207,581.22	343,288.83

7.2.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年9 月19日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12 月31日
卖出股票成交总额	70,074,694.16	290,596,335.68
减：卖出股票成本总额	68,553,180.62	276,386,487.40
买卖股票差价收入	1,521,513.54	14,209,848.28

7.2.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间未投资基金。

7.2.4.7.14 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年9月 19日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月 31日-
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,193,033,000.69	1,159,559,198.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,181,161,558.97	1,144,419,458.41
减：应收利息总额	23,905,127.33	15,883,508.78
买卖债券差价收入	-12,033,685.61	-743,768.59

7.2.4.7.15 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均未投资资产支持证券。

7.2.4.7.16 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均未投资贵金属。

7.2.4.7.17 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均未投资权证。

7.2.4.7.18 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年9月19日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
		-
股票投资产生的股利收益	68,572.14	382,047.41
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	68,572.14	382,047.41

7.2.4.7.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年9月19日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
		-
1.交易性金融资产	7,385,393.93	-16,238,822.31
——股票投资	-1,381,287.97	-3,014,115.49
——债券投资	8,766,681.90	-13,224,706.82
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
合计	7,385,393.93	-16,238,822.31

7.2.4.7.20 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年9月19日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日-
基金赎回费收入	591,642.73	1,386,742.28
转换费收入	7,246.52	31,120.66
其他	-	4,931.50
合计	598,889.25	1,422,794.44

7.2.4.7.21 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年9月19日	2016年1月1日至2016年12月31日
交易所市场交易费用	142,704.12	811,522.91
银行间市场交易费用	3,570.00	12,665.00
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	146,274.12	824,187.91

注：本基金本报告期及上年度可比期间未投资基金。

7.2.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年9月19日	2016年1月1日至2016年12月31日
审计费用	38,045.02	60,000.00
信息披露费	215,340.42	300,000.00
帐户维护费	27,300.00	36,900.00
其他	600.00	300.00
汇划手续费	24,987.84	29,797.64
合计	306,273.28	426,997.64

7.2.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**7.2.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

7.2.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

7.2.4.9 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
广州白云山医药集团股份有限公司	基金管理人股东
美的集团股份有限公司	基金管理人股东

东亚联丰投资管理有限公司	基金管理人股东
金鹰基金管理有限公司	基金发起人、管理人、销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
深圳前海金鹰资产管理有限公司	基金管理人子公司

7.2.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.2.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.2.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.2.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期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。

7.2.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年9月19日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	92,300,000.00	100.00%	-	-

7.2.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.2.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

7.2.4.10.2 关联方报酬

7.2.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年9月19日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日-
当期发生的基金应支付的管理费	4,053,741.58	6,216,567.29
其中：支付销售机构的客户维护费	1,635,644.52	2,128,772.16

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。在保本周期内，本基金的担保费用从基金管理人的管理费收入中列支。

7.2.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年9月 19日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12 月31日-
当期发生的基金应支付的托管费	1,080,997.71	1,657,751.28

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

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

7.2.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间内均没有应支付关联方的销售服务费。

7.2.4.10.3 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。

7.2.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.2.4.10.4.1 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。

7.2.4.10.4.2 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。

7.2.4.10.5 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 2017年1月1日至2017年9月19日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	133,027,399.51	41,441.60	707,635.31	170,201.73

注：本基金本报告期末的清算备付金余额 16,507,651.15 元，结算备付金利息收入 165,510.6 元；上年度可比期间度结算备付金期末余额 18,000,373.42 元，结算备付金利息收入 56,484.69 元。

7.2.4.10.6 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。

7.2.4.10.7 其他关联交易事项的说明

7.2.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.2.4.10.7.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

本基金本报告期及上年度可比期间未投资本基金。

7.2.4.11 利润分配情况

本基金报告期内未进行利润分配。

7.2.4.12 期末（2017年9月19日）本基金持有的流通受限证券

7.2.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

7.2.4.12.2 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
300580	贝斯特	2017-09-15	重大事项停牌	21.74	2018-03-01	19.57	2,489.00	23,869.51	54,110.86	重大事项

7.2.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.2.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.2.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.2.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险等。基金成立以来，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，致力于内控机制的建立和完善，公司内部管理制度及业务规范流程的制定和完善，加强内部风险的控制与有效防范，以保证各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

7.2.4.13.1 风险管理政策和组织架构

为保证公司规范化运作，有效地防范和化解经营风险，确保基金和公司财务和其他信息真实、准确、完整、及时，从而最大程度地保护基金持有人的合法权益，本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了科学合理、控制严密、运行高效的各项管理制度：

(1) 风险管理控制制度

风险控制制度由总则、风险控制的目标和原则、风险控制的机构设置、风险控制的程序、风险类型的界定、风险控制的主要措施、风险控制的具体制度、风险控制制度的监督与评价等部分组成。

风险控制的具体制度主要包括投资风险管理制度、交易风险控制制度、财务风险控制制度、公司资产管理制度等业务风险控制制度，以及岗位分离制度、业务空间隔离制度、作业规则、岗位职责、反馈制度、资料保全制度、保密制度、员工行为守则等程序性风险管理制度。

(2) 投资管理制度

投资管理制度包括研究业务管理制度、投资决策管理制度、基金交易管理制度等。

制订研究业务管理制度的目的是保持研究工作的独立、客观。研究业务管理制度包括：建立严密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法；根据基金合同要求，在充分研究的基础上建立和维护投资对象备选库；建立研究与投资的业务交流制度，保持通畅的交流渠道；建立研究报告质量评价体系。

制订投资决策业务管理制度的目的是严格遵守法律法规的有关规定，确保基金的投资符合基金合同所规定的投资目标、投资范围、投资策略、投资组合和投资限制等要求。投资决策业务管理制度包括投资决策授权制度；投资决策支持制度，重要投资要有详细的研究报告和风险分析支持；投

资风险评估与管理制度，在设定的风险权限额度内进行投资决策；投资管理业绩评价制度等。

制订基金交易管理制度的目的是保证基金投资交易的安全、有效、公平。基金交易管理制度包括基金交易的集中交易制度；交易监测、预警、反馈机制；投资指令审核制度；投资指令公平分配制度；交易记录保管制度；交易绩效评价制度等。

（3）监察稽核制度

公司设立督察长，负责监察稽核工作，督察长由总经理提名，经董事会聘任，对董事会负责，报中国证监会核准。

除应当回避的情况外，督察长可以列席公司相关会议，调阅公司相关档案，就内部控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能。

督察长应当定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况，董事会应当对督察长的报告进行审议。

公司设立监察稽核部门，具体执行监察稽核工作。公司明确规定了监察稽核部门及内部各岗位的具体职责，严格审查监察稽核人员的专业任职条件，配备了充足的合格的监察稽核人员，明确规定了监察稽核的操作程序和组织纪律。

监察稽核制度包括检查公司各业务部门和工作人员是否遵守法律、法规、规章的有关规定；检查公司各业务部门和工作人员对公司内部控制制度、各项管理制度、业务规章的执行情况；对公司各部门作业流程的遵守合规性和有效性的检查、监督、评价及建议等。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.2.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级度的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以

控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估控制证券发行人的信用风险，建立了内部评级体系，通过内部评级与外部评级相结合的方法充分评估证券以及交易对手的信用风险。

7.2.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017年9月19日	上年末 2016年12月31日-
A-1	0.00	50,150,000.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	20,034,000.00
合计	0.00	70,184,000.00

注：本统计数据未包含国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债和同业存单。

7.2.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017年9月19日	上年末 2016年12月31日-
AAA	67,335,500.00	308,019,236.40
AAA 以下	82,229,086.20	194,780,948.10
未评级	0.00	0.00
合计	149,564,586.20	502,800,184.50

注：本统计数据未包含国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债和同业存单。

7.2.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自于投资品种流动性不足，导致金融资产不能在合理价格变现。本基金采用分散投资、监控流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时基金管理人通过分析持有人结构、申购赎回行为分析、变现比例、压力测试等方法评估组合的流动性风险。

7.2.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金为混合型基金，主要投资于具备高流动性的国内依法发行上市的股票、债券等金融工具；另外，本基金将持有不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，也具备较强的流动性。总体来看，本基金的投资标的具有良好的流动性。

报告期末，本基金持有的股票资产占基金资产净值的比例为 0.13%，本基金持有的债券资产占

基金资产净值的比例为 68.36%，持有流动性受限资产的市值合计占基金资产净值的比例符合法规要求。总体来看，本基金的资产组合具有良好的流动性。

报告期内，本基金的投资比例严格遵守相关法律法规和基金合同规定的比例，符合组合管理、分散投资的原则，持仓结构保持一定的高流动性资产，严格控制流动性受限资产的投资比例，并且充分降低金融工具的集中度，确保组合的分散度，将基金的流动性风险控制在较低的水平。

7.2.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.2.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。基金管理人通过久期、凸度等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对利率风险进行管理。

7.2.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年9月19日	1个月 以内	1-3 个月	6个月 以内	3个月 -1年	6个月 -1年	1年以 内	1-5年	5年以 上	不计息	合计
资产										
银行存款	133,027,399.51	-	-	-	-	-	-	-	-	133,027,399.51
结算备付金	16,507,651.15	-	-	-	-	-	-	-	-	16,507,651.15
存出保证金	8,793.91	-	-	-	-	-	-	-	-	8,793.91
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	149,564,586.20	-	287,322.14	149,851,908.34
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	97,665,102.36	97,665,102.36
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	2,776,841.49	2,776,841.49
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	149,543,	-	-	-	-	-	149,564,	-	100,729,	399,837,

	844.57						586.20		265.99	696.76
负债										
短期借款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	179,936,266.73	179,936,266.73
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	180,199.60	180,199.60
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	48,053.24	48,053.24
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	25,574.60	25,574.60
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	-	141,818.87	141,818.87
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	707,638.89	707,638.89
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	181,039,551.93	181,039,551.93
利率敏感度缺口	149,543,844.57	-	-	-	-	-	149,564,586.20	-	-80,310,285.94	218,798,144.83
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	6 个月以内	3 个月-1 年	6 个月-1 年	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产										
银行存款	707,635.31	-	-	-	-	-	-	-	-	707,635.31
结算备付金	18,000,373.42	-	-	-	-	-	-	-	-	18,000,373.42
存出保证金	91,239.11	-	-	-	-	-	-	-	-	91,239.11

交易性金融资产	99,220,000.00	-	-	-	-	481,646,000.00	451,145,236.40	51,649,948.10	62,848,828.39	1,146,510,012.89
买入返售金融资产	240,700,240.00	-	-	-	-	-	-	-	-	240,700,240.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	898,191.28	898,191.28
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	15,380,641.06	15,380,641.06
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	404.46	404.46
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	358,719,487.84	-	-	-	-	481,646,000.00	451,145,236.40	51,649,948.10	79,128,065.19	1,422,288,737.53
负债										
短期借款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	509,800,948.20	-	-	-	-	-	-	-	-	509,800,948.20
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	701,278.62	701,278.62
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	582,682.25	582,682.25
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	155,381.93	155,381.93
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	186,180.27	186,180.27
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	-	141,818.87	141,818.87
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-	128,161.28	128,161.28
应付利润	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	781,374.22	781,374.22
负债总计	509,800,948.20	-	-	-	-	-	-	-	2,676,877.44	512,477,825.64
利率敏感度缺口	-151,081	-	-	-	-	-481,646	451,145	51,649,9	76,451,1	909,810,

	,460.36					000.00	236.40	48.10	87.75	911.89
--	---------	--	--	--	--	--------	--------	-------	-------	--------

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

7.2.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他变量不变，只有利率变动通过债券公允价值变动对基金资产净值产生影响。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2017年9月19日	上年度末 2016年12月31日
	利率上升 25 个基点	-2,772,217.75	-3,254,885.98
	利率下降 25 个基点	2,772,217.75	3,254,885.98

注：

(1) 金鹰元丰保本混合型证券投资基金自 2017 年 9 月 20 日起转型为金鹰元丰债券型证券投资基金；

7.2.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.2.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

7.2.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年9月19日		上年度末 2016年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	287,322.14	0.13	62,848,828.39	6.91
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	149,564,586.20	68.36	1,083,661,184.50	119.11

交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	149,851,908.34	68.49	1,146,510,012.89	126.02

7.2.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	市场其他变量保持不变，只有业绩比较基准所对应的市场组合价格发生合理、可能的变动；		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2017年9月19日	上年度末 2016年12月31日
	业绩比较基准变动+5%	16,046,985.93	-7,917,194.65
	业绩比较基准变动-5%	-16,046,985.93	7,917,194.65

注：

(1) 金鹰元丰保本混合型证券投资基金自 2017 年 9 月 20 日起转型为金鹰元丰债券型证券投资基金；

7.2.4.14 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)，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，相关债券的公允价值属第二层次。

除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 金鹰元丰债券型证券投资基金

8.1.1 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	25,098,481.42	15.77
	其中：股票	25,098,481.42	15.77
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	126,144,967.90	79.28
	其中：债券	126,144,967.90	79.28
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,783,730.96	1.12
8	其他各项资产	6,086,074.98	3.82
9	合计	159,113,255.26	100.00

8.1.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.1.2.1 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	24,404,128.42	19.36
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	-	-
J	金融业	694,353.00	0.55
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	25,098,481.42	19.91

8.1.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未通过港股通投资股票。

8.1.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600507	方大特钢	365,600	4,639,464.00	3.68
2	600019	宝钢股份	446,124	3,854,511.36	3.06
3	000898	鞍钢股份	595,000	3,778,250.00	3.00
4	600961	株冶集团	397,200	3,388,116.00	2.69
5	300473	德尔股份	80,436	3,193,309.20	2.53
6	600808	马钢股份	689,100	2,845,983.00	2.26
7	300199	翰宇药业	162,800	2,650,384.00	2.10
8	601988	中国银行	174,900	694,353.00	0.55
9	300580	贝斯特	2,489	54,110.86	0.04

8.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.1.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601111	中国国航	14,336,623.00	11.37
2	600115	东方航空	8,694,160.00	6.90
3	600019	宝钢股份	6,727,285.48	5.34

4	600507	方大特钢	6,106,215.67	4.84
5	600961	株冶集团	4,452,159.00	3.53
6	600782	新钢股份	3,965,275.00	3.15
7	000898	鞍钢股份	3,916,533.00	3.11
8	300473	德尔股份	3,746,928.00	2.97
9	600808	马钢股份	2,925,298.00	2.32
10	002007	华兰生物	2,789,226.00	2.21
11	300199	翰宇药业	2,555,409.00	2.03
12	603885	吉祥航空	2,406,401.00	1.91
13	600050	中国联通	2,342,255.00	1.86
14	002156	通富微电	1,960,665.00	1.56
15	002292	奥飞娱乐	1,957,164.00	1.55
16	601021	春秋航空	1,955,809.00	1.55
17	601899	紫金矿业	1,950,356.00	1.55
18	002722	金轮股份	1,760,259.97	1.40
19	000581	威孚高科	975,628.00	0.77
20	600522	中天科技	830,103.00	0.66

8.1.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601111	中国国航	14,609,550.00	11.59
2	600115	东方航空	8,743,653.00	6.94
3	600782	新钢股份	3,642,165.40	2.89
4	600019	宝钢股份	3,538,419.00	2.81
5	002007	华兰生物	2,813,535.00	2.23
6	603885	吉祥航空	2,414,597.20	1.92
7	600050	中国联通	2,158,826.00	1.71
8	601021	春秋航空	1,953,724.00	1.55
9	601899	紫金矿业	1,937,185.00	1.54
10	002156	通富微电	1,893,343.68	1.50
11	002292	奥飞娱乐	1,786,820.77	1.42
12	002722	金轮股份	1,681,678.00	1.33
13	600507	方大特钢	1,371,282.00	1.09
14	000581	威孚高科	969,009.00	0.77
15	600522	中天科技	875,095.50	0.69
16	000915	山大华特	767,011.00	0.61
17	600961	株冶集团	630,105.00	0.50
18	603200	上海洗霸	594,994.00	0.47
19	600029	南方航空	410,929.00	0.33
20	600160	巨化股份	389,213.27	0.31

8.1.4.3 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	87,036,140.26
卖出股票的收入（成交）总额	53,849,043.63

8.1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,952,000.00	7.90
	其中：政策性金融债	9,952,000.00	7.90
4	企业债券	67,437,967.90	53.51
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	48,755,000.00	38.68
9	其他	-	-
10	合计	126,144,967.90	100.09

8.1.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	111709524	17 浦发银行 CD524	500,000.00	48,755,000.00	38.68
2	1380069	13 长投建债	200,000.00	12,150,000.00	9.64
3	170207	17 国开 07	100,000.00	9,952,000.00	7.90
4	136198	16 上药 01	100,000.00	9,764,000.00	7.75
5	136452	16 南航 02	100,000.00	9,718,000.00	7.71

8.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

8.1.8 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

本基金本报告期末无贵金属投资。

8.1.9 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。

8.1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期无股指期货交易。

8.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期无国债期货交易。

8.1.12 本报告期投资基金情况**8.1.12.1 投资政策及风险说明**

本基金本报告期内未投资基金。

8.1.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

本基金本报告期内未投资基金。

8.1.13 投资组合报告附注

8.1.13.1 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。

8.1.13.2 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。

8.1.13.3 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	48,217.56
2	应收证券清算款	4,087,839.23
3	应收股利	-
4	应收利息	1,947,323.68
5	应收申购款	2,694.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,086,074.98

8.1.13.4 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处于转股期的可转换债券。

8.1.13.5 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	300580	贝斯特	54,110.86	0.04	重大事项停牌

8.1.13.6 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。

8.2 金鹰元丰保本混合型证券投资基金

8.2.1 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	287,322.14	0.07
	其中：股票	287,322.14	0.07
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	149,564,586.20	37.41
	其中：债券	149,564,586.20	37.41
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	149,535,050.66	37.40
8	其他各项资产	100,450,737.76	25.12
9	合计	399,837,696.76	100.00

8.2.2 报告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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	287,322.14	0.13
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	-	-
J	金融业	-	-
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	287,322.14	0.13

8.2.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未通过港股通投资股票。

8.2.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	603639	海利尔	1,206	62,374.32	0.03
2	300580	贝斯特	2,489	54,110.86	0.02
3	603628	清源股份	2,581	52,136.20	0.02
4	002840	华统股份	1,814	51,191.08	0.02
5	002838	道恩股份	1,021	39,512.70	0.02
6	300586	美联新材	1,006	27,996.98	0.01

8.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.2.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
----	------	------	----------	----------------

1	000778	新兴铸管	5,220,000.00	0.57
2	000807	云铝股份	2,084,626.96	0.23
3	603639	海利尔	30,089.70	0.00
4	300580	贝斯特	23,869.51	0.00
5	603628	清源股份	14,376.17	0.00

8.2.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600961	株冶集团	10,198,880.40	1.12
2	600598	北大荒	7,135,781.93	0.78
3	000778	新兴铸管	5,975,082.95	0.66
4	000735	罗牛山	4,554,600.00	0.50
5	600251	冠农股份	4,323,695.26	0.48
6	002556	辉隆股份	4,293,871.00	0.47
7	002174	游族网络	4,147,192.58	0.46
8	600108	亚盛集团	3,931,587.00	0.43
9	600299	安迪苏	3,171,236.06	0.35
10	000998	隆平高科	3,102,682.00	0.34
11	600354	敦煌种业	2,858,314.00	0.31
12	600737	中粮糖业	2,769,949.00	0.30
13	000972	*ST 中基	2,440,805.00	0.27
14	000807	云铝股份	2,319,928.40	0.25
15	300436	广生堂	2,234,925.00	0.25
16	600359	新农开发	1,900,261.00	0.21
17	600426	华鲁恒升	1,074,584.60	0.12
18	000930	中粮生化	754,500.00	0.08
19	002295	精艺股份	709,606.38	0.08
20	300558	贝达药业	585,530.00	0.06

8.2.4.3 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	87,036,140.26
卖出股票的收入（成交）总额	70,074,694.16

8.2.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-

2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	149,564,586.20	68.36
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	149,564,586.20	68.36

8.2.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	111709524	17 浦发银行 CD524	500,000.00	48,755,000.00	22.28
2	1380069	13 长投建债	200,000.00	12,150,000.00	5.55
3	170207	17 国开 07	100,000.00	9,952,000.00	4.55
4	136198	16 上药 01	100,000.00	9,764,000.00	4.46
5	136452	16 南航 02	100,000.00	9,718,000.00	4.44

8.2.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

8.2.8 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

本基金本报告期末无贵金属投资。

8.2.9 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。

8.2.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期无股指期货交易。

8.2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期无国债期货交易。

8.2.12 本报告期投资基金情况**8.2.12.1 投资政策及风险说明**

本基金本报告期内未投资基金。

8.2.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

本基金本报告期内未投资基金。

8.2.13 投资组合报告附注

8.2.13.1 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。

8.2.13.2 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。

8.2.13.3 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	8,793.91
2	应收证券清算款	97,665,102.36
3	应收股利	-
4	应收利息	2,776,841.49
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	100,450,737.76

8.2.13.4 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处于转股期的可转换债券。

8.2.13.5 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	300580	贝斯特	54,110.86	0.02	重大事项停牌

8.2.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

9 基金份额持有人信息

9.1 金鹰元丰债券型证券投资基金

(报告期: 2017年9月20日-2017年12月31日)

9.2.1 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
1,754	69,642.65	0.00	0.00%	122,153,210.70	100.00%

9.2.2 期末上市基金前十名持有人

本基金非上市基金。

9.2.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,095.63	0.00%

9.2.4 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

9.2.5 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。

9.3 金鹰元丰保本混合型证券投资基金

(报告期: 2017年1月1日-2017年9月19日)

9.3.1 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

16,758	12,532.95	0.00	0.00%	210,027,195.70	100.00%
--------	-----------	------	-------	----------------	---------

9.3.2 期末上市基金前十名持有人

本基金非上市基金。

9.3.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,095.63	0.00%

9.3.4 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

9.3.5 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

10.1 金鹰元丰债券型证券投资基金

（报告期：2017年9月20日-2017年12月31日）

单位：份

基金合同生效日(2017年9月20日)基金份额总额	210,027,195.67
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	255,342.64
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	88,129,327.57
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	122,153,210.74

10.2 金鹰元丰保本混合型证券投资基金

（报告期：2017年1月1日-2017年9月19日）

单位：份

基金合同生效日(2013年1月30日)基金份额总额	781,278,046.90
本报告期期初基金份额总额	892,272,863.74
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	3,936,108.14
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	686,181,776.21
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-

本报告期末基金份额总额	210,027,195.67
-------------	----------------

§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陈瀚先生为公司副总经理，该事项已于 2017 年 6 月 29 日在《证券时报》等媒体进行了披露。

报告期内基金管理人免去苏文锋先生督察长职务，免去李云亮先生副总经理职务，聘请李云亮先生担任公司督察长，该事项已于 2017 年 9 月 13 日在《证券时报》等媒体进行了披露。

本基金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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金报告期内未持有基金。

11.6 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太会计师事务所（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 53000 元。

11.7 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。

11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.8.1 金鹰元丰债券型证券投资基金

11.8.1.1 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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	----	------	-----------	----

	单元数量	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	
银河证券	2	90,422,939.48	67.73%	64,313.88	65.18%	-
方正证券	2	18,568,515.06	13.91%	16,921.62	17.15%	-
开源证券	2	11,833,475.27	8.86%	8,417.15	8.53%	-
长城证券	2	12,687,291.74	9.50%	9,024.62	9.15%	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-

注：本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单位作为本基金的专用交易单位。本基金专用交易单位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析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。

11.8.1.2 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
银河证券	2,349,967.70	2.49%	422,600,000.00	41.34%	-	-
方正证券	62,519,450.41	66.25%	30,000,000.00	2.93%	-	-
开源证券	-	-	483,700,000.00	47.31%	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	29,496,221.92	31.26%	-	-	-	-

首创证券	-	-	86,000,000.00	8.41%	-	-
------	---	---	---------------	-------	---	---

11.8.2 金鹰元丰保本混合型证券投资基金

11.8.2.1 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	
爱建证券	1	33,313,872.15	43.05%	30,358.77	46.31%	-
中信建投证券	3	19,736,858.64	25.51%	14,038.99	21.42%	-
东北证券	1	13,407,103.49	17.33%	12,217.77	18.64%	-
方正证券	2	5,849,989.78	7.56%	5,331.07	8.13%	-
山西证券	1	5,071,497.06	6.55%	3,607.73	5.50%	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-

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。

11.8.2.2 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
爱建证券	-	-	3,811,000,000.00	13.83%	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	179,932,481.38	85.22%	3,805,240,000.00	13.81%	-	-
山西证券	-	-	1,941,600,000.00	7.04%	-	-
东兴证券	29,197,684.93	13.83%	844,990,000.00	3.07%	-	-
首创证券	2,011,200.34	0.95%	4,199,100,000.00	15.23%	-	-
广州证券	-	-	92,300,000.00	0.33%	-	-
招商证券	-	-	12,600,000.00	0.05%	-	-
开源证券	-	-	18,000,000.00	0.07%	-	-
齐鲁证券	-	-	4,365,900,000.00	15.84%	-	-
天风证券	-	-	521,700,000.00	1.89%	-	-
浙商证券	-	-	7,950,400,000.00	28.84%	-	-

11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	金鹰基金管理有限公司北京分公司办公地址变更的公告	证券时报等	2017-01-07
2	金鹰基金有限公司关于董事变更的公告	证券时报等	2017-01-12
3	金鹰基金有限公司关于独立董事变更的公告	证券时报等	2017-01-18
4	金鹰元丰保本混合型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	证券时报等	2017-01-20
5	关于金鹰旗下保本基金及未开放基金净值的公告	证券时报等	2017-02-06

6	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华龙证券股份有限公司为代销机构的公告	证券时报等	2017-02-17
7	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	证券时报等	2017-02-23
8	金鹰元丰保本混合型证券投资基金更新的招募说明书全文 2017 年第 1 号	证券时报等	2017-02-25
9	金鹰元丰保本混合型证券投资基金更新的招募说明书摘要 2017 年第 1 号	证券时报等	2017-02-25
10	金鹰基金管理有限公司关于放开部分代销机构转换转入业务的公告	证券时报等	2017-03-03
11	金鹰基金管理有限公司关于新增上海华夏财富投资管理有限公司为本公司旗下部分基金代销机构的公告	证券时报等	2017-03-23
12	金鹰基金管理有限公司关于放开部分代销机构转换转入业务的公告	证券时报等	2017-03-24
13	【年报】金鹰元丰保本混合型证券投资基金 2016 年年度报告	证券时报等	2017-03-29
14	【年报】金鹰元丰保本混合型证券投资基金 2016 年年度报告（摘要）	证券时报等	2017-03-29
15	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	证券时报等	2017-03-31
16	金鹰基金管理有限公司关于新增大河财富基金销售有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务的公告	证券时报等	2017-04-06
17	金鹰基金管理有限公司关于开放部分代销机构转换业务的公告	证券时报等	2017-04-11
18	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	证券时报等	2017-04-22
19	金鹰元丰保本混合型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	证券时报等	2017-04-24
20	金鹰基金管理有限公司关于增加湖北银行股份有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务的公告	证券时报等	2017-04-27
21	金鹰基金管理有限公司关于新增深圳盈信基金销售有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务的公告	证券时报等	2017-06-02
22	金鹰基金管理有限公司关于开放珠海盈米财富管理有限公司代销基金转换业务的公告	证券时报等	2017-06-12
23	金鹰基金管理有限公司关于金鹰元丰保本混合型证券投资基金基金经理变更的公告	证券时报等	2017-06-21
24	金鹰基金管理有限公司关于新增上海挖财金	证券时报等	2017-06-26

	融信息服务有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务的公告		
25	金鹰基金管理有限公司关于增聘副总经理的公告	证券时报等	2017-06-29
26	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	证券时报等	2017-06-30
27	金鹰基金管理有限公司关于旗下开放式基金资产净值等的公告	证券时报等	2017-07-01
28	金鹰基金管理有限公司关于开放部分代销机构转换业务的公告	证券时报等	2017-07-03
29	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行申购手续费率优惠的公告	证券时报等	2017-07-04
30	金鹰基金管理有限公司关于新增中民财富管理(上海)有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务的公告	证券时报等	2017-07-07
31	金鹰基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告	证券时报等	2017-07-15
32	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告	证券时报等	2017-07-18
33	金鹰基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	证券时报等	2017-07-20
34	金鹰元丰保本混合型证券投资基金 2017 年第 2 季度报告	证券时报等	2017-07-20
35	金鹰基金管理有限公司关于新增中衍期货有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	证券时报等	2017-07-25
36	金鹰基金管理有限公司关于开放部分代销机构转换业务的公告	证券时报等	2017-08-02
37	金鹰基金管理有限公司关于新增深圳前海汇联基金销售有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务的公告	证券时报等	2017-08-04
38	金鹰基金管理有限公司关于上海浦东发展银行股份有限公司代销旗下部分基金并开通转换业务的公告	证券时报等	2017-08-15
39	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金参与湘财证券等代销机构的定投及费率优惠活动的公告	证券时报等	2017-08-23
40	【半年报】金鹰元丰保本混合型证券投资基金 2017 年半年度报告	证券时报等	2017-08-26
41	金鹰基金管理有限公司关于金鹰元丰保本混合型证券投资基金保本周期即将到期的第一次提示性公告	证券时报等	2017-08-30

42	金鹰基金管理有限公司关于金鹰元丰保本混合型证券投资基金保本周期即将到期的第二次提示性公告	证券时报等	2017-09-01
43	关于金鹰元丰保本混合型证券投资基金暂停申购、转换转入、定期定额投资、转托管等业务的公告	证券时报等	2017-09-07
44	关于修订金鹰元丰保本混合型证券投资基金基金合同的公告	证券时报等	2017-09-07
45	金鹰基金管理有限公司关于网上直销平台开通工行快捷支付业务的公告	证券时报等	2017-09-07
46	金鹰元丰保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型为金鹰元丰债券型证券投资基金后相关业务规则的公告	证券时报等	2017-09-07
47	金鹰元丰债券型证券投资基金基金合同	证券时报等	2017-09-07
48	金鹰元丰债券型证券投资基金基金合同内容摘要	证券时报等	2017-09-07
49	金鹰元丰债券型证券投资基金基金招募说明书	证券时报等	2017-09-07
50	金鹰元丰保本混合基金更新的招募说明书全文 2017 年第 2 号	证券时报等	2017-09-08
51	金鹰元丰保本混合基金更新的招募说明书摘要 2017 年第 2 号	证券时报等	2017-09-08
52	金鹰基金管理有限公司关于督察长变更的公告	证券时报等	2017-09-13
53	金鹰基金管理有限公司关于新增东莞证券股份有限公司等为金鹰元丰债券混合型证券投资基金代销机构的公告	证券时报等	2017-09-20
54	关于元丰债券型证券投资基金暂停赎回、转换转出业务的公告	证券时报等	2017-09-20
55	金鹰基金管理有限公司关于金鹰元丰债券型证券投资基金增聘基金经理的公告	证券时报等	2017-09-21
56	金鹰基金管理有限公司关于新增华泰期货有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务及费率优惠的公告	证券时报等	2017-09-22
57	关于金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增宜信普泽投资顾问(北京)有限公司为代销机构并开通基金转换、基金定投及费率优惠的公告	证券时报等	2017-09-25
58	金鹰基金管理有限公司关于新增喜鹊财富基金销售有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务的公告	证券时报等	2017-09-28
59	金鹰基金管理有限公司关于金鹰元丰债券型证券投资基金增聘基金经理的公告	证券时报等	2017-09-30
60	金鹰基金管理有限公司关于新增通华财富(上	证券时报等	2017-10-11

	海)基金销售有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务的公告		
61	金鹰基金管理有限公司关于新增海银基金销售有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务的公告	证券时报等	2017-10-25
62	金鹰元丰债券型证券投资基金 2017 年第 3 季度报告	证券时报等	2017-10-25
63	金鹰基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新身份证件或者身份证明文件的公告	证券时报等	2017-10-26
64	金鹰基金管理有限公司关于新增北京电盈基金销售有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通定投、转换及费率优惠的公告	证券时报等	2017-11-02
65	金鹰基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新身份证件或者身份证明文件的公告	证券时报等	2017-11-06
66	金鹰基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	证券时报等	2017-11-21
67	金鹰基金管理有限公司关于金鹰元丰债券型证券投资基金修改基金合同及托管协议的公告	证券时报等	2017-11-28
68	金鹰基金管理有限公司金鹰元丰债券型证券投资基金开放日常申购(赎回、转换、定期定额投资)业务公告	证券时报等	2017-11-28
69	金鹰元丰债券型证券投资基金基金合同	证券时报等	2017-11-28
70	金鹰元丰债券型证券投资基金基金合同内容摘要	证券时报等	2017-11-28
71	金鹰元丰债券型证券投资基金托管协议	证券时报等	2017-11-28
72	金鹰元丰债券型证券投资基金招募说明书	证券时报等	2017-11-28
73	金鹰基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新身份证件或者身份证明文件的公告	证券时报等	2017-12-22
74	金鹰基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新身份证件或者身份证明文件的公告	证券时报等	2017-12-25
75	金鹰基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新身份证件或者身份证明文件的公告	证券时报等	2017-12-27
76	金鹰基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新身份证件或者身份证明文件的公告	证券时报等	2017-12-29
77	金鹰基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金缴纳增值税及附加税费的公告	证券时报等	2017-12-30

注：相关信息披露文件请登录本基金管理人网站查询。

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 影响投资者决策的其他重要信息

经基金管理人第六届董事会第八次会议审议通过，免去凌富华先生董事长职务，聘请李兆廷先生担任公司董事长，该事项已于 2018 年 1 月 18 日在证监会指定媒体披露。

经基金管理人 2016 年第三次临时股东会审议通过，并经中国证券监督管理委员会批复核准（证监许可[2017]2135），公司原股东美的集团股份有限公司、东亚联丰投资管理有限公司分别将其持有的本公司 20%和 11%股权转让给东旭集团有限公司。公司股东东旭集团有限公司向本公司增资人民币 260,200,000 元。本次股权转让及增资后，公司股权结构变更为：东旭集团有限公司 66.19%，广州证券股份有限公司 24.01%，广州白云山医药集团股份有限公司 9.80%，本公司注册资本由人民币 250,000,000 元增加至人民币 510,200,000 元。公司《公司章程》的有关条款已根据本次股权变更情况进行了相应修改。本公司已完成注册资本及股权变更事项的工商变更登记。上述事项已于 2018 年 1 月 30 日在证监会指定媒体披露。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准发行及募集的文件。
- 2、《金鹰元丰债券型证券投资基金基金合同》。
- 3、《金鹰元丰债券型证券投资基金托管协议》。
- 4、金鹰基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程。
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照。
- 6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、季度报告、半年度报告、更新的招募说明书及其他临时公告。

13.2 存放地点

广州市天河区珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅或按工本费购买复印件，也可登录本基金管理人网站查阅，本基金管理人网址：<http://www.gefund.com.cn>。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人客户服务中心，客户服务中心电话：4006-135-888 或 020-83936180。

金鹰基金管理有限公司

二〇一八年三月二十八日