

**金鹰核心资源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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	金鹰核心资源混合
基金主代码	210009
交易代码	210009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 5 月 23 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	1,683,997,311.63 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，通过投资于拥有或者预期将注入稀缺资源的个股，在充分控制风险的前提下，分享中国经济快速发展的成果与稀缺资源的价值增值，进而实现基金资产的长期可持续稳健增长。
投资策略	<p>本基金采用“自上而下”的分析视角，综合宏观经济、证券市场、政府政策等层面的因素，定性与定量相结合分析研判股票市场、债券市场、货币市场的预期收益与风险，并据此进行资产配置与组合构建，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，以规避或控制市场风险，提高基金投资收益。</p> <p>本基金股票资产占基金资产的比例为 60%~95%，其中，不低于 80% 的股票资产将投资于国内 A 股市场上拥有核心资源（资产）的上市公司；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的 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	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	本基金风险收益特征属于证券投资基金当中较高风险、较高预期收益的品种。从长期来看，其风险和预期收益高于货币型基金、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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	苏文锋	郭明
	联系电话	020-83282627	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

### 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	-121,445,126.94	3,307,520.52	4,206,852.10
本期利润	-373,076,853.47	14,274,613.24	4,265,503.26
加权平均基金份额本期利润	-0.5376	0.2394	0.1768
本期基金份额净值增长率	-25.26%	52.53%	16.96%
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	0.0878	0.3978	0.1860
期末基金资产净值	2,276,792,673.07	176,328,238.92	26,380,145.87

期末基金份额净值	1.352	1.809	1.186
----------	-------	-------	-------

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	-6.63%	1.91%	0.88%	0.55%	-7.51%	1.36%
过去六个月	-23.40%	1.98%	3.85%	0.57%	-27.25%	1.41%
过去一年	-25.26%	2.84%	-7.71%	1.05%	-17.55%	1.79%
过去三年	33.33%	2.72%	37.09%	1.34%	-3.76%	1.38%
自基金合同生效起至今	48.05%	2.31%	26.96%	1.23%	21.09%	1.08%

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：

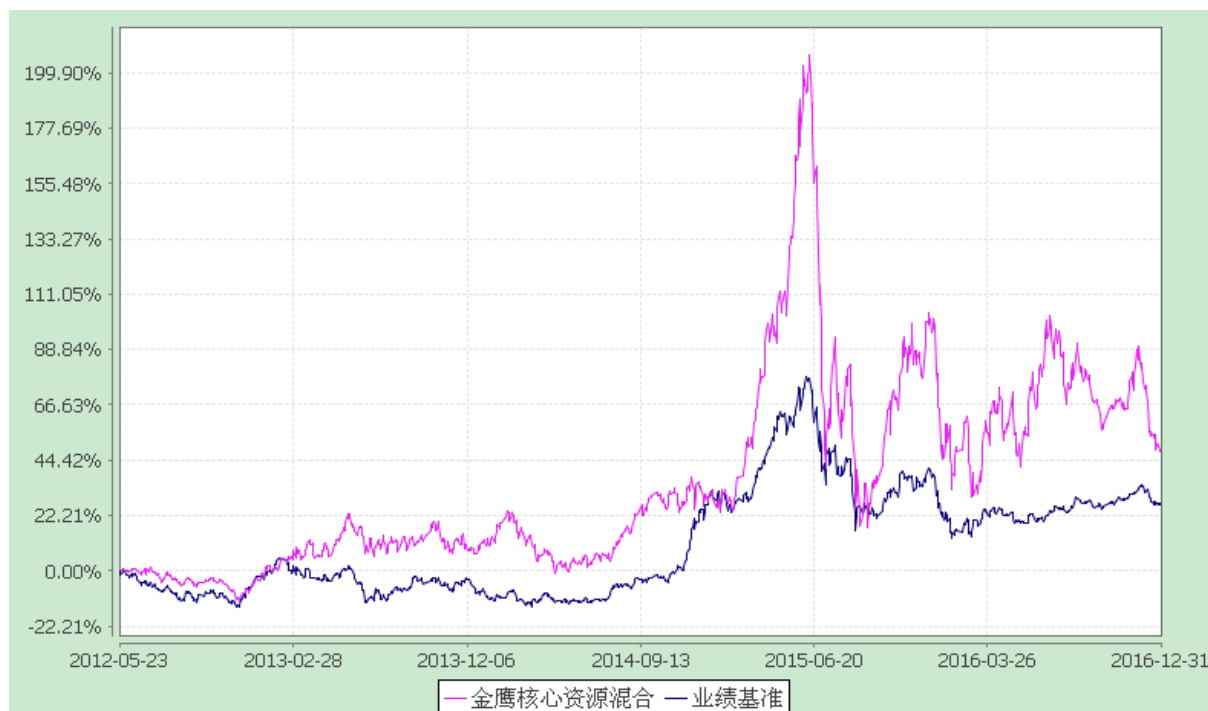
沪深 300 指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%。并对基金合同等法律文件进行了相应修改，该事项已与托管人协商一致并报监管部门备案，变更业绩比较基准公告已于 2015 年 9 月 23 日在指定媒体披露。

#### 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

金鹰核心资源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

(2012 年 5 月 23 日至 2016 年 12 月 31 日)

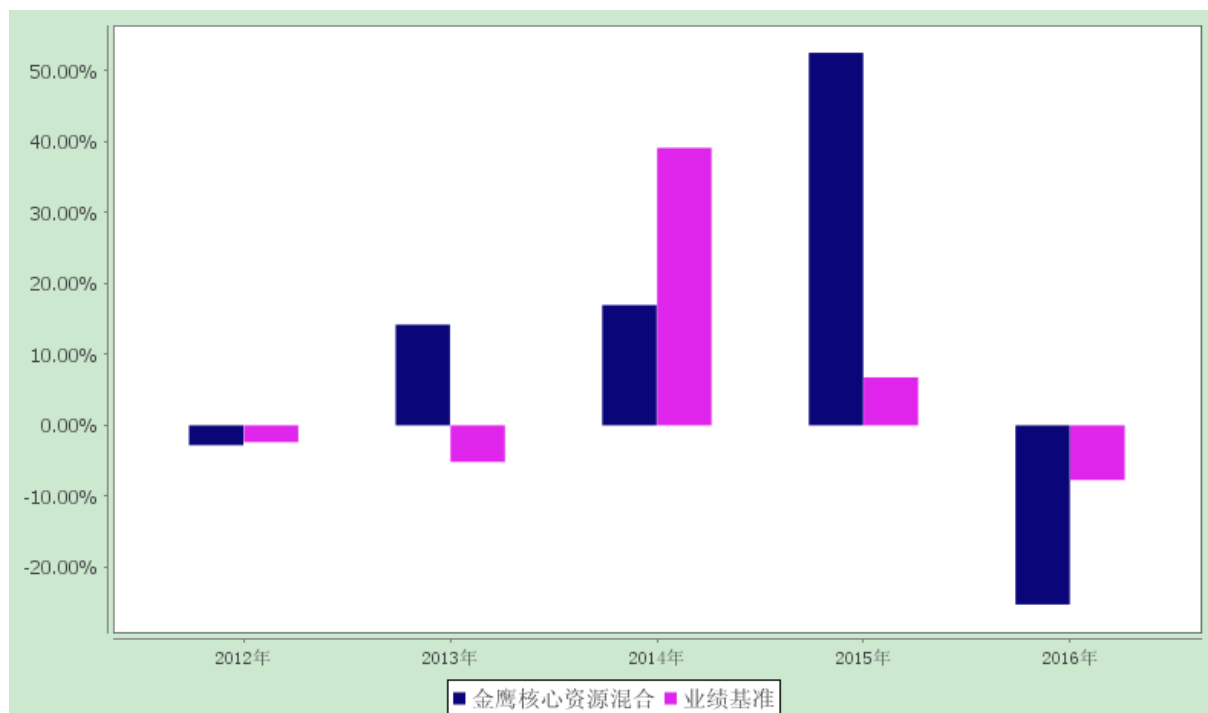


注：1、本基金合同于 2012 年 5 月 23 日正式生效。2、按基金合同规定，本基金建仓期为六个月。建仓期满后，本基金的各项投资比例应符合股票资产占基金资产的比例为 60%~95%，债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%~40%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证投资的比例范围占基金资产净值的 0%~3%；3、本基金业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×75% + 中证全债指数收益率×25%。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

金鹰核心资源混合型证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年内未进行利润分配。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

金鹰基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]97 号文批准，于 2002 年 12 月 25 日成立，总部设在广州，目前注册资本 2.5 亿元人民币。2011 年 12 月公司获得特定客户资产管理计划业务资格，2013 年 7 月子公司-深圳前海金鹰资产管理有限公司成立。

“以人为本、互信协作；创新谋变、挑战超越”是金鹰人的核心价值观，在新经营团队的带领下，通过全体员工的奋发努力，公司近两年各方面都发生了积极的蜕变，追求以更高的标准为投资者提供贴心专业的财富管理服务，赢得市场认可。

截至 2016 年 12 月末，公司下设权益投资部等 17 个一级职能部门、北京、广州、上海、深圳、成都分公司以及一个子公司—深圳前海金鹰资产管理有限公司。截至 2016 年 12 月末，公司旗下管理公募基金 30 只以及特定客户资产管理计划 101 个、子公司专项资产管理计划 195 个，资产管理总规模约 1800 亿元。

**4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介**

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		
洗鸿鹏	基金经理	2014-09-30	-	10	洗鸿鹏先生，华南理工大学学士，中山大学岭南学院数量经济学硕士。曾任广发证券投资银行高级经理，2007 年 4 月加入金鹰基金管理有限公司，先后担任行业研究员、研究组长、金鹰中小盘精选证券投资基金基金经理助理、金鹰主题优势证券投资基金基金经理等职。现任金鹰核心资源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内的公平交易功能执行交易，以尽可能确保公平对待各投资组合。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年的中国经济受益于地产汽车两大传统产业销售增速提升，部分制造业的底部企稳，供给侧改革在煤炭和钢铁领域取得成效，部分周期行业虽然需求并未有效增长但是实现了价格上涨，gdp 全年增长了 6.7%，国内经济实现了阶段性的底部企稳；流动性整体上呈现稳健偏松的格局。

反映在 A 股市场，市场整体下跌，但是各个指数之间出现了明显的分化，以市场的几个代表性指数为例，上证 50 下跌 2.5%，沪深 300 下跌 9.3%，上证指数下跌 12.31%，中证 500 下跌 18%，创业板指数下跌 27.71%，剔除年初熔断制度的影响，大盘股为主的指数全年走出高位震荡并上涨的走势，小盘股为主的指数则走出底部震荡的走势。

2016 年的成长股进行了杀故事和降估值，但是我们看到很多有真实增长逻辑的成长股已经回到 PEG 小于 1 的估值，而新股发行制度也要求新股以大幅低于市场同类公司估值的 20 多倍市盈率发行。

在 2016 年本基金仍然坚守成长股，继续以十三五规划受益逻辑为主线，重点在军工、教育、体育、智能驾驶与新能源汽车、高端装备与工业 4.0、OLED 主题中轮动，继续关注这些行业中的市值洼地的个股带来的投资机会。我们一直秉承在成长行业中寻找小市值的细分行业龙头和潜在龙头的投资理念，寻找有护城河壁垒的成长性公司，因此我们并不在乎标的公司上市的时间的长短，我们关注的是其所在行业的前景，自身业务的成长性，以及标的公司相对于同行业其他公司的估值与市值的差距。因此满足这些条件的次新股成为我们的主要投资标的。但是因为对监管带来的市场风险

偏好的阶段性改变预计不足，本年度基金增长率为-25.26%。

#### 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 1.352 元，本报告期份额净值增长率为-25.26%，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

进入 2017 年，我们认为经济数据仍然将维持低位运行，市场流动性预计延续过去年初相对宽松的惯性，人民币汇率在经历了 2016 年的大幅下跌后有可能进入盘整阶段。三月份两会将释放今年的整体政策方向。美国在新总统上任后将加强自身经济发展和科技发展，因此我国只有继续加快转型科技升级才能在科技实力和经济实力上保持原有的地位。因此我们认为 2017 年政策将在产业转型、军工升级、供给侧改革等继续发力。

2016 年的成长股进行了杀故事和降估值，但是我们看到很多有真实增长逻辑的成长股已经回到 PEG 小于 1 的估值，而新股发行制度也要求新股以大幅低于市场同类公司估值的 20 多倍市盈率发行。因此今年成长股的机会比 2016 年更好。

因此我们预计 2017 年市场依旧以宽幅震荡为主，而政策发布速度、上市公司年报季报中业绩增长质量、机构在周期股和成长股之间的持仓比例切换，市场对估值切换的预期都将决定全年市场震荡的高度和低度。

在配置上，本基金将继续以成长股和新兴产业的主题投资为主，重点关注方向为受益经济转型的工业 4.0、PPP、大健康主题、体育、教育、新能源汽车以及军工等行业。本基金将继续在具有市值优势和估值优势的成长股中寻找投资机会，尤其注重这些成长性行业新上市公司中的预期差带来的投资机会。

#### 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**

根据《证券投资基金运作管理办法》及本基金的基金合同等规定，本基金本报告期未实施利润  
分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### **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，本基金托管人在对金鹰核心资源混合型证券投资基金的托管过程中，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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明**

本报告期内，金鹰核心资源混合型证券投资基金的管理人——金鹰基金管理有限公司在金鹰核  
心资源混合型证券投资基金的投资运作、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，金鹰核心资源混合型证券投资基金对基金份额持有人未实施利润分  
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金鹰核心资源混合型证券投资基金 2016 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**

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）050030 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：金鹰核心资源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	158,731,630.06	12,319,780.87
结算备付金	4,839,129.71	315,276.29
存出保证金	957,298.67	121,240.35
交易性金融资产	2,119,279,889.96	165,714,089.72
其中：股票投资	2,119,279,889.96	165,714,089.72
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	12,567,168.35	6,370,888.02
应收利息	33,185.74	3,463.66
应收股利	-	-
应收申购款	25,667,810.57	774,344.78
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>2,322,076,113.06</b>	<b>185,619,083.69</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	-	-
应付赎回款	37,873,578.63	8,001,421.83
应付管理人报酬	2,480,256.48	170,830.54
应付托管费	413,376.06	28,471.75
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,385,921.01	290,190.50
应交税费	285,600.00	285,600.00
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	844,707.81	514,330.15
<b>负债合计</b>	<b>45,283,439.99</b>	<b>9,290,844.77</b>
<b>所有者权益：</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
实收基金	1,683,997,311.63	97,475,093.17
未分配利润	592,795,361.44	78,853,145.75

所有者权益合计	<b>2,276,792,673.07</b>	<b>176,328,238.92</b>
负债和所有者权益总计	<b>2,322,076,113.06</b>	<b>185,619,083.69</b>

## 7.2 利润表

会计主体：金鹰核心资源混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	<b>-340,516,854.18</b>	<b>17,821,340.67</b>
1.利息收入	634,977.98	75,310.21
其中：存款利息收入	634,977.98	67,625.65
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	-	7,684.56
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-98,499,679.38	6,086,910.88
其中：股票投资收益	-99,552,934.56	5,828,765.21
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	1,053,255.18	258,145.67
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-251,631,726.53	10,967,092.72
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	8,979,573.75	692,026.86
<b>减：二、费用</b>	<b>32,559,999.29</b>	<b>3,546,727.43</b>

1. 管理人报酬	15,965,844.70	1,499,272.75
2. 托管费	2,660,974.12	249,878.76
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	13,620,624.10	1,738,108.26
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	312,556.37	59,467.66
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-373,076,853.47</b>	<b>14,274,613.24</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-373,076,853.47</b>	<b>14,274,613.24</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金鹰核心资源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）	97,475,093.17	78,853,145.75	176,328,238.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-373,076,853.47	-373,076,853.47
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）	1,586,522,218.46	887,019,069.16	2,473,541,287.62
其中：1.基金申购款	6,049,204,528.73	3,610,525,650.97	9,659,730,179.70
2.基金赎回款	-4,462,682,310.27	-2,723,506,581.81	-7,186,188,892.08
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）	1,683,997,311.63	592,795,361.44	2,276,792,673.07
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）	22,243,062.68	4,137,083.19	26,380,145.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,274,613.24	14,274,613.24
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	75,232,030.49	60,441,449.32	135,673,479.81
其中：1.基金申购款	394,470,665.84	305,794,153.59	700,264,819.43
2.基金赎回款	-319,238,635.35	-245,352,704.27	-564,591,339.62
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）	97,475,093.17	78,853,145.75	176,328,238.92

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

金鹰核心资源混合型证券投资基金（原名：金鹰核心资源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（简称“中国证监会”）证监许可【2012】5号《关于核准金鹰核心资源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》、《证券投资基金运作管理办法》、《金鹰核心资源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 402,665,567.41 元，认购资金在募集期间产生的利息 33,479.62 元，合计为 402,699,047.03 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 402,699,047.03 份，业经立信会计师事务所（特殊普通合伙）出具验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《金鹰核心资源股票型证券投资基金基金合同》于 2012 年 5 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 402,699,047.03 份。本基金的基金管理人为金鹰基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《金鹰核心资源股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金可投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、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金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。股票资产占基金资产的比例为 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金融工具占基金资产的 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%。本基金将不低于 80% 的股票资产投资于国内 A 股市场上拥有核心资源（资产）的上市公司。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布并于 2014 年 7 月修改的《企业会计准则—基本准则》和 41 项具体会计准则及其应用指南、解释及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”），中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》和中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定而编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则和《证券投资基金会计核算业务指引》的要求，真实、完整

地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 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。

#### 7.4.4 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

本基金报告期内无会计政策变更。

##### 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

本基金报告期内无会计差错更正。

#### 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

## 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广州证券股份有限公司	0.00	0.00%	-	-

注：本基金本报告期及上年度可比期间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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
广州证券股份有限公司	0.00	0.00%	-	-

注：本基金本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方交易单元进行权证交易。

## 7.4.8.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广州证券股份有限公司	0.00	0.00%	-	-

注：本基金本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 7.4.8.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
广州证券股份有限公司	0.00	0.00%	-	-

注：本基金本报告期及上年度可比期间均没有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

本基金本报告期及上年度可比期间均没有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	15,965,844.70	1,499,272.75

其中：支付销售机构的客户维护费	6,891,267.55	660,505.49
-----------------	--------------	------------

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

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。

#### 7.4.8.2.2 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	2,660,974.12	249,878.76

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

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。

#### 7.4.8.2.3 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	上年度可比期间

名称	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
广州证券		0.00
工商银行		0.00
合计		0.00

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均没有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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

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
中国工商银行股份有限公司	158,731,630.06	559,920.68	12,319,780.87	57,548.24

注：本基金用于证券交易结算的资金通过“中国工商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。结算备付金本报告期末余额 4,839,129.71 元，利息收入 65,275.24 元；上年度末余额 315,276.29 元，利息收入 8,730.70 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	3,180.00	67,734.00	67,734.00	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
30058	熙菱	2016-1	2017-0	网下	4.94	4.94	1,380.	6,817.	6,817.	网下



8	信息	2-27	1-05	新股 申购			00	20	20	新股 待上 市
30059 1	万里 马	2016-1 2-30	2017-0 1-10	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

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
60398 6	兆易创 新	2016-09 -19	重大事 项停牌	177.97	2017-0 3-13	195.77	1,133.00	26,353.58	201,640.01	重大 事项
30052 6	中潜股 份	2016-12 -07	重大事 项停牌	101.47	-	-	1,399,119.0 0	115,275,109.3 2	141,968,604. 93	重大 事项
30053 7	广信材 料	2016-10 -12	重大事 项停牌	48.79	2017-0 1-13	43.91	1,024.00	9,410.56	49,960.96	重大 事项

#### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无银行间市场债券正回购的抵押债券。

##### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无交易所市场债券正回购的抵押债券。

#### 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	2,119,279,889.96	91.27
	其中：股票	2,119,279,889.96	91.27
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	163,570,759.77	7.04
7	其他各项资产	39,225,463.33	1.69
8	合计	2,322,076,113.06	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,392,397,132.20	61.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,917.66	0.00
E	建筑业	119,591,943.00	5.25
F	批发和零售业	145,472,627.88	6.39
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	461,780,269.22	20.28
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	2,119,279,889.96	93.08

## 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末持有沪港通股票。

## 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	300567	精测电子	1,466,841	142,576,945.20	6.26
2	300526	中潜股份	1,399,119	141,968,604.93	6.24
3	300503	昊志机电	1,867,756	127,156,828.48	5.58
4	300568	星源材质	1,548,548	126,795,110.24	5.57
5	300160	秀强股份	9,466,693	113,789,649.86	5.00
6	300532	今天国际	1,507,760	106,040,760.80	4.66
7	300499	高澜股份	2,336,708	103,329,227.76	4.54
8	603716	塞力斯	793,896	100,054,712.88	4.39
9	300521	爱司凯	1,590,000	95,877,000.00	4.21
10	300561	汇金科技	781,700	91,599,606.00	4.02

## 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	002766	索菱股份	208,927,292.60	118.49
2	300467	迅游科技	181,751,429.77	103.08
3	300503	昊志机电	171,290,711.00	97.14
4	300160	秀强股份	166,780,882.90	94.59
5	300444	双杰电气	163,023,198.36	92.45
6	300532	今天国际	162,205,751.14	91.99
7	300491	通合科技	159,723,541.18	90.58
8	300499	高澜股份	145,820,429.83	82.70
9	300520	科大国创	143,203,722.67	81.21
10	300567	精测电子	143,078,054.35	81.14
11	300521	爱司凯	139,417,027.53	79.07
12	300527	华舟应急	135,655,654.76	76.93
13	300530	达志科技	133,563,512.21	75.75
14	300568	星源材质	130,773,192.03	74.16
15	300528	幸福蓝海	129,341,883.34	73.35
16	300561	汇金科技	123,219,592.40	69.88
17	002780	三夫户外	118,072,571.86	66.96
18	300566	激智科技	117,759,456.97	66.78

19	300494	盛天网络	116,418,857.18	66.02
20	300526	中潜股份	115,275,109.32	65.38
21	300536	农尚环境	109,173,799.86	61.92
22	300549	优德精密	105,884,975.77	60.05
23	603322	超讯通信	105,848,288.86	60.03
24	300517	海波重科	104,582,325.96	59.31
25	300506	名家汇	103,532,665.68	58.72
26	300531	优博讯	100,825,358.62	57.18
27	603716	塞力斯	99,958,456.23	56.69
28	603701	德宏股份	98,482,316.07	55.85
29	300510	金冠电气	96,656,371.36	54.82
30	002816	和科达	94,473,159.84	53.58
31	300553	集智股份	92,596,236.62	52.51
32	000851	高鸿股份	92,147,095.29	52.26
33	300516	久之洋	89,175,173.32	50.57
34	300540	深冷股份	88,441,300.50	50.16
35	002813	路畅科技	86,021,302.38	48.78
36	300545	联得装备	83,285,805.13	47.23
37	300542	新晨科技	83,245,385.41	47.21
38	002599	盛通股份	82,662,640.77	46.88
39	300359	全通教育	81,648,521.40	46.30
40	002789	建艺集团	81,391,154.97	46.16
41	300559	佳发安泰	80,959,292.41	45.91
42	300515	三德科技	79,854,347.39	45.29
43	300557	理工光科	77,039,484.47	43.69
44	002777	久远银海	75,820,650.46	43.00
45	300495	美尚生态	74,060,961.83	42.00
46	300162	雷曼股份	65,912,473.74	37.38
47	300501	海顺新材	65,528,776.32	37.16
48	002800	天顺股份	64,607,562.80	36.64
49	300552	万集科技	61,125,464.55	34.67
50	002802	洪汇新材	56,155,535.32	31.85
51	300456	耐威科技	54,495,285.66	30.91
52	603726	朗迪集团	51,812,717.72	29.38
53	300309	吉艾科技	50,152,272.73	28.44
54	000961	中南建设	50,130,169.15	28.43
55	300508	维宏股份	48,808,556.17	27.68
56	300507	苏奥传感	46,003,246.04	26.09
57	002827	高争民爆	38,873,115.30	22.05
58	002638	勤上光电	37,675,088.83	21.37
59	002443	金洲管道	37,098,491.06	21.04
60	300056	三维丝	35,872,565.70	20.34
61	300081	恒信移动	31,226,252.99	17.71
62	300076	GQY 视讯	30,819,481.53	17.48

63	002229	鸿博股份	24,547,324.73	13.92
64	300500	苏州设计	24,539,782.10	13.92
65	002286	保龄宝	23,531,573.44	13.35
66	002235	安妮股份	23,070,792.16	13.08
67	600661	新南洋	21,699,711.27	12.31
68	002402	和而泰	16,689,880.32	9.47
69	002786	银宝山新	14,460,391.00	8.20
70	300551	古鳌科技	13,005,609.26	7.38
71	002730	电光科技	9,513,149.24	5.40
72	002587	奥拓电子	8,160,679.49	4.63
73	300093	金刚玻璃	7,860,485.88	4.46
74	300465	高伟达	7,198,591.96	4.08
75	600520	*ST 中发	6,576,292.33	3.73
76	002514	宝馨科技	5,626,033.24	3.19
77	002659	中泰桥梁	5,290,338.75	3.00
78	002762	金发拉比	4,707,095.00	2.67
79	600977	中国电影	4,038,012.22	2.29

## 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300467	迅游科技	159,697,279.21	90.57
2	300506	名家汇	145,111,695.52	82.30
3	300444	双杰电气	142,508,004.90	80.82
4	300531	优博讯	136,498,697.05	77.41
5	300510	金冠电气	131,923,068.69	74.82
6	300520	科大国创	120,613,266.42	68.40
7	300527	华舟应急	113,285,509.92	64.25
8	300530	达志科技	113,148,480.00	64.17
9	300494	盛天网络	109,859,806.23	62.30
10	002766	索菱股份	105,648,385.62	59.92
11	300528	幸福蓝海	102,091,525.75	57.90
12	300549	优德精密	99,518,889.12	56.44
13	300517	海波重科	90,986,331.19	51.60
14	603701	德宏股份	87,586,660.40	49.67
15	000851	高鸿股份	86,863,076.82	49.26
16	300491	通合科技	85,004,548.92	48.21
17	300516	久之洋	83,726,092.15	47.48
18	300495	美尚生态	80,469,876.93	45.64

19	002789	建艺集团	77,685,948.87	44.06
20	300540	深冷股份	77,343,207.24	43.86
21	002599	盛通股份	76,081,845.56	43.15
22	002780	三夫户外	75,689,623.80	42.93
23	300359	全通教育	74,275,759.88	42.12
24	002802	洪汇新材	73,000,769.99	41.40
25	300501	海顺新材	71,003,325.92	40.27
26	300508	维宏股份	65,305,368.81	37.04
27	300515	三德科技	65,225,385.75	36.99
28	300507	苏奥传感	64,167,510.09	36.39
29	300162	雷曼股份	60,683,081.05	34.41
30	300309	吉艾科技	60,594,183.94	34.36
31	300160	秀强股份	57,207,502.75	32.44
32	002800	天顺股份	56,961,524.01	32.30
33	300456	耐威科技	53,338,499.44	30.25
34	300503	昊志机电	51,337,602.56	29.11
35	603726	朗迪集团	47,040,394.66	26.68
36	002777	久远银海	40,849,933.00	23.17
37	002827	高争民爆	36,364,232.96	20.62
38	300056	三维丝	35,602,498.32	20.19
39	002638	勤上光电	35,546,990.82	20.16
40	300076	GQY 视讯	32,454,768.46	18.41
41	002443	金洲管道	31,336,194.77	17.77
42	300499	高澜股份	31,080,807.34	17.63
43	300532	今天国际	27,429,978.89	15.56
44	603322	超讯通信	26,497,100.36	15.03
45	300081	恒信移动	25,231,248.17	14.31
46	002229	鸿博股份	25,116,533.63	14.24
47	002786	银宝山新	24,672,399.76	13.99
48	300536	农尚环境	24,315,775.95	13.79
49	300500	苏州设计	23,391,816.11	13.27
50	600661	新南洋	22,830,062.22	12.95
51	002235	安妮股份	22,648,771.44	12.84
52	300561	汇金科技	22,639,389.96	12.84
53	002286	保龄宝	20,563,231.68	11.66
54	300553	集智股份	18,140,569.00	10.29
55	300566	激智科技	16,655,947.00	9.45
56	002402	和而泰	16,369,099.74	9.28
57	300542	新晨科技	15,726,667.27	8.92
58	002816	和科达	14,807,750.66	8.40
59	300551	古鳌科技	12,888,378.00	7.31
60	300557	理工光科	11,493,434.64	6.52
61	300559	佳发安泰	11,317,661.00	6.42
62	002587	奥拓电子	11,116,534.43	6.30

63	600136	当代明诚	10,959,609.14	6.22
64	002659	中泰桥梁	10,689,677.00	6.06
65	002730	电光科技	10,002,933.60	5.67
66	300093	金刚玻璃	8,995,661.04	5.10
67	002711	欧浦智网	8,887,162.60	5.04
68	300389	艾比森	8,786,666.00	4.98
69	300240	飞力达	7,821,142.84	4.44
70	300048	合康新能	7,658,274.16	4.34
71	300187	永清环保	7,474,194.40	4.24
72	300137	先河环保	7,325,697.30	4.15
73	002514	宝馨科技	7,230,269.97	4.10
74	002224	三力士	7,030,842.34	3.99
75	600371	万向德农	6,684,129.53	3.79
76	300545	联得装备	6,552,626.00	3.72
77	300521	爱司凯	6,488,526.80	3.68
78	300335	迪森股份	6,284,696.82	3.56
79	002245	澳洋顺昌	6,154,592.59	3.49
80	603588	高能环境	5,561,809.64	3.15
81	000670	*ST 盈方	5,535,191.96	3.14
82	300486	东杰智能	5,311,545.84	3.01
83	002762	金发拉比	5,035,464.00	2.86
84	600520	*ST 中发	4,659,328.00	2.64
85	300400	劲拓股份	4,633,794.00	2.63
86	300465	高伟达	4,594,087.20	2.61
87	600977	中国电影	4,130,296.08	2.34

#### 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	6,228,110,157.81
卖出股票的收入（成交）总额	3,923,374,086.48

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。



**8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

**8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证投资。

**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**

本基金本报告期内未投资股指期货。

**8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

根据本基金基金合同规定，本基金暂不投资股指期货。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****8.11.1 本期国债期货投资政策**

根据本基金基金合同规定，本基金暂不投资国债期货。

**8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期内未投资国债期货。

**8.11.3 本期国债期货投资评价**

根据本基金基金合同规定，本基金暂不投资国债期货。

**8.12 投资组合报告附注**

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 本基金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	957,298.67
2	应收证券清算款	12,567,168.35
3	应收股利	-
4	应收利息	33,185.74

5	应收申购款	25,667,810.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	39,225,463.33

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	300526	中潜股份	141,968,604.93	6.24	重大事项

#### 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	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
151,148	11,141.38	32,731,693.99	1.94%	1,651,265,618.00	98.06%

#### 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	14,220.37	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

本报告期期初基金份额总额	97,475,093.17
本报告期基金总申购份额	6,049,204,528.73
减：本报告期基金总赎回份额	4,462,682,310.27
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,683,997,311.63

**§11 重大事件揭示****11.1 基金份额持有人大会决议**

本基金报告期内未召开基金份额持有人大会。

**11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**

报告期内基金管理人增聘曾长兴先生为公司副总经理，相关事项已于 2016 年 5 月 13 日进行了信息披露。

本报告期内，托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

**11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

本基金报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

#### 11.4 基金投资策略的改变

本基金报告期内没有改变基金投资策略。

#### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金审计的会计师事务所为中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）。

本报告期内实际应支付会计师事务所的审计费为 32000 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	
国信证券	1	41,217,171.06	0.41%	37,561.59	0.43%	-
安信证券	1	450,803,750.84	4.44%	320,657.22	3.65%	-
华林证券	2	1,032,250,869.83	10.17%	938,712.92	10.67%	-
中信证券	1	418,809,677.17	4.13%	381,661.41	4.34%	-
西南证券	2	327,320,828.17	3.23%	298,288.15	3.39%	-
兴业证券	1	721,917,166.48	7.11%	667,636.88	7.59%	-
申万宏源证券	1	522,932,808.26	5.15%	476,548.32	5.42%	-
联讯证券	1	522,202,998.36	5.15%	475,884.28	5.41%	-
中金公司	1	270,142,675.55	2.66%	246,181.77	2.80%	-
华创证券	1	422,444,256.86	4.16%	384,973.93	4.38%	-
招商证券	1	28,455,688.09	0.28%	25,931.59	0.29%	-
平安证券	1	1,044,677,638.15	10.29%	743,080.51	8.45%	-
民生证券	1	600,462,157.75	5.92%	547,202.19	6.22%	-
爱建证券	1	21,974,319.14	0.22%	20,025.09	0.23%	-
渤海证券	2	189,358,975.74	1.87%	134,691.94	1.53%	-
财达证券	1	286,916,687.92	2.83%	261,467.81	2.97%	-
方正证券	1	1,401,033,374.14	13.81%	1,276,761.47	14.51%	-
国金证券	1	86,732,133.01	0.85%	79,038.83	0.90%	-
开源证券	1	83,352,590.34	0.82%	59,288.14	0.67%	-
齐鲁证券	1	435,539,033.52	4.29%	396,906.80	4.51%	-
首创证券	1	57,649,593.23	0.57%	41,003.48	0.47%	-
天风证券	1	44,692,079.77	0.44%	40,727.78	0.46%	-
西部证券	1	70,827,705.01	0.70%	50,379.71	0.57%	-

浙商证券	2	255,332,060.74	2.52%	232,684.40	2.65%	-
长城证券	1	152,990,009.71	1.51%	108,822.20	1.24%	-
中信建投证券	2	338,459,141.90	3.34%	288,004.35	3.27%	-
长江证券	1	176,247,378.15	1.74%	160,611.39	1.83%	-
华宝证券	1	143,793,817.35	1.42%	102,279.25	1.16%	-

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

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

本基金专用交易单位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单位的证券经营机构。
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单位租用协议。

#### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无

#### §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

