

**金鹰科技创新股票型证券投资基金**  
**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	金鹰科技创新股票
基金主代码	001167
交易代码	001167
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 4 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	1,220,215,142.55 份
基金合同存续期	不定期

## 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制风险并保持良好流动性的前提下，重点投资于以科技和创新为动力和支撑，具有核心科技或创新优势的优质上市公司，把握相关领域科技发展与创新所带来的投资机会，力争获得超额收益与长期资本增值。
投资策略	<p>本基金将结合对包括宏观经济形势、政策走势、证券市场环境等在内的因素的分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置策略，合理确定基金在股票、债券等各类资产上的投资比例，最大限度地降低投资组合的风险，提高收益。</p> <p>在股票投资方面,本基金通过“自上而下”及“自下而上”相结合的方法挖掘优质的上市公司，构建股票投资组合:(1)自上而下地分析行业的增长潜在空间、竞争结构、增长节奏、潜在风险等方面，把握投资机会；(2)自下而上地评判企业的核心科技和创新优势、管理层、治理结构以及其提供的产品和服务是否契合科技创新的大趋势，对企业基本面和估值水平进行综合的研判，深度挖掘优质个股。</p> <p>本基金投资组合中股票资产占基金资产的比例不低于 80%。每个交易日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金以及到期日在一年</p>

	以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金投资于科技创新主题的证券不低于非现金基金资产的 80%。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于证券投资基金中较高预期收益、较高预期风险的品种，其预期风险收益平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

### 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 4 月 30 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-180,508,072.61	-423,426,247.37
本期利润	-258,932,665.65	-341,350,313.86

加权平均基金份额本期利润	-0.1920	-0.2038
本期基金份额净值增长率	-22.80%	-15.80%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>2016 年末</b>	<b>2015 年末</b>
期末可供分配基金份额利润	-0.3605	-0.2360
期末基金资产净值	792,828,820.12	1,222,238,046.38
期末基金份额净值	0.650	0.842

注：1、本基金基金合同成立于 2015 年 4 月 30 日，无以前年度数据,以下表格相同。

2、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；

3、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；

4、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	-7.01%	0.93%	1.05%	0.58%	-8.06%	0.35%
过去六个月	-4.69%	0.91%	4.07%	0.61%	-8.76%	0.30%
过去一年	-22.80%	1.88%	-8.42%	1.12%	-14.38%	0.76%
自基金合同生效起至今	-35.00%	2.49%	-23.08%	1.64%	-11.92%	0.85%

注：1、本基金 2015 年 4 月 30 日成立。

2、本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%。

### 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

金鹰科技创新股票型证券投资基金

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

(2015 年 4 月 30 日至 2016 年 12 月 31 日)



注：1、 本基金 2015 年 4 月 30 日成立。

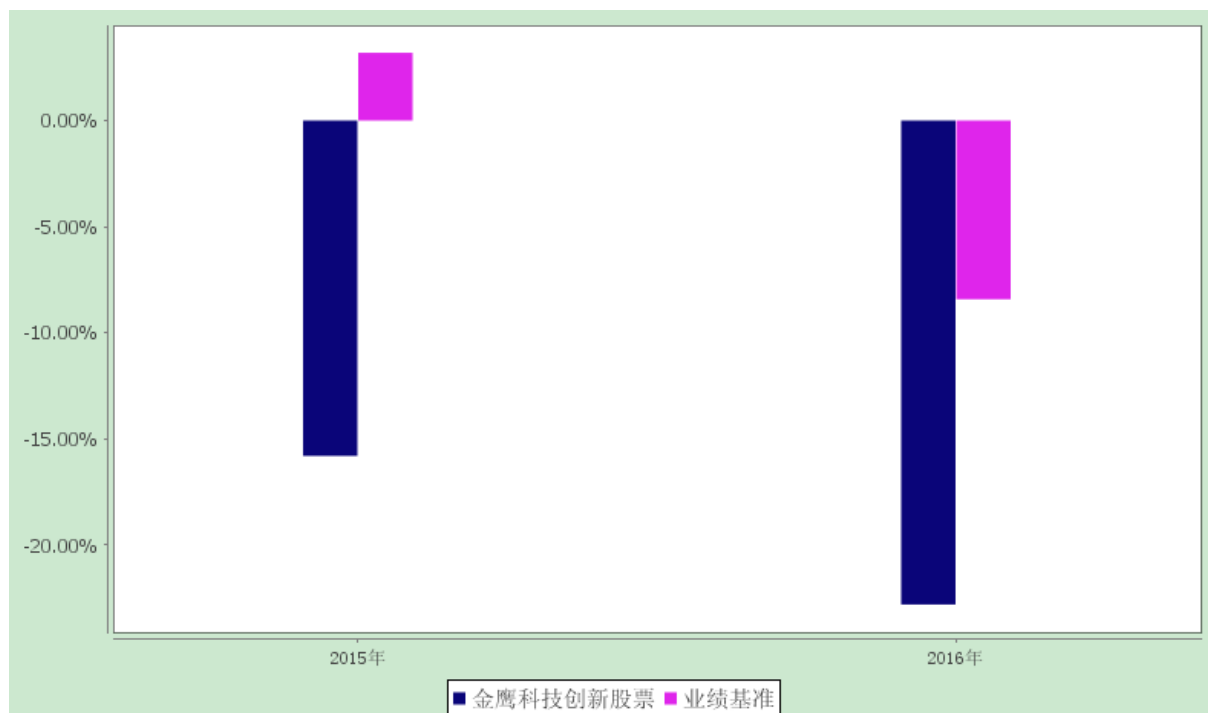
2、 按基金合同规定，本基金的建仓期为 6 个月。建仓期满后，本基金投资组合中股票资产占基金资产的比例不低于 80%。本基金每个交易日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金以及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金投资于科技创新主题的证券不低于非现金基金资产的 80%。

3、 本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%。

### 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

金鹰科技创新股票型证券投资基金

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



注：本基金 2015 年 4 月 30 日成立。

### 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		
方超	基金经理	2015-04-30	-	8	方超先生，中山大学工商管理硕士。曾任职于朗讯科技有限公司、北方电讯科技有限公司。2009 年 5 月加入金鹰基金管理有限公司，先后任 TMT 研究员、非周期组组长、金鹰中小盘精选证券投资基金基金经理助理、专户投资部投资经理，现任金鹰策略配置混合型证券投资基金、金鹰科技创新型股票基金基金经理。

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，市场年初熔断，大幅下跌。后续市场维持震荡，难有持续性投资机会，只有新能源汽车，稀土，农业等有阶段性机会。下半年在保险资金的增量资金的涌入情况下，分红率高的高股息率的蓝筹股有一波上涨，上证指数达到全年高点，然后又回落。本基金在稀土，新能源汽车的板块行情中有所收获，但是在行情下跌中，持有的一些估值较高的股票跌幅较大，损失较多，全年业绩表现一般。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值为 0.650 元，本报告期份额净值增长率为-22.80%，同期业绩比较基准增长率为-8.42%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年下半年以来，各项经济数据明显好转，经过多年的调整，加上国家的供给侧改革，环保实施力度加大，很多产能过剩的传统行业基本出清，原材料价格大幅上涨，并被中游顺利传导，中上游企业盈利状况得到很大好转，虽然上半年是全年 PPI 的高点，但该趋势可能延续的时间超过大家预期，很多行业由于供给侧收缩并很难扩产，周期属性有所下降，而成长属性上升。大宗商品的

大幅上涨预计结束了。总体看来，2017 年经济状况比 2016 年明显好转。但货币政策总体是稳中趋紧的，制约上涨高度，总体而言，预测 2017 年市场是稳中有进，市场重心抬高，全年取得正收益的概率较大。

2017 年随着 IPO 的加速，上市公司越来越多，稀缺性的下降，加上稳中趋紧的货币政策，会造成总体估值的回落，对于估值过高的股票下跌压力较大，而龙头公司在经济调整中是受益的，业绩的稳定性和竞争力更强，龙头公司的估值可能从原先的低估到给予一定溢价。

2017 年的投资主要关注以下几个方面：1) 供需持续紧张的行业的龙头公司，密切跟踪数据，判断持续的时间长度，如铜箔，覆铜板，某些化工子行业。对供给侧改革今年刚刚开始落地的稀土，火电也给予关注。2) 消费升级的行业龙头公司，如处于复苏阶段的白酒行业。3) 苹果十周年，IPHONE8 可能放量和一些新技术的应用，PEG 非常合理的电子行业。4) 一路一带，国企改革。5) 落到合理估值的成长股。

回避估值高的，行业发展不明确的，行业地位不高的公司。

#### 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、研究部总监、基金事务部总监、基金经理、投资经理、基金会计和相关人员组成。在特殊情况下，公司召集估值委员会会议，讨论和决策特殊估值事项，估值委员会集体决策，需到会的三分之二估值委员会成员表决通过。

本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

报告期内,本基金未签约与估值相关的定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

#### 4.8 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

本报告期，会计师事务所未对本基金出具非标准审计报告。

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

在本报告期内，本基金未出现持有人数或资产净值达到或低于预警线的情形。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对金鹰科技创新股票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，金鹰科技创新股票型证券投资基金的管理人——金鹰基金管理有限公司在金鹰科技创新股票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，金鹰科技创新股票型证券投资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金鹰科技创新股票型证券投资基金 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)050032 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：金鹰科技创新股票型证券投资基金

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	110,490,687.72	158,131,051.95
结算备付金	1,905,426.81	2,245,530.59
存出保证金	413,050.62	1,755,493.11
交易性金融资产	649,292,587.35	1,081,253,725.85
其中：股票投资	649,292,587.35	1,081,253,725.85
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	34,796,565.11	-
应收利息	26,030.51	32,621.01
应收股利	-	-
应收申购款	75,493.23	185,980.56
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>796,999,841.35</b>	<b>1,243,604,403.07</b>
负债和所有者权益	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债：	-	-

短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	14,057,669.17
应付赎回款	1,083,399.15	2,682,495.17
应付管理人报酬	1,035,525.48	1,555,370.79
应付托管费	172,587.58	259,228.46
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,423,495.25	2,582,666.62
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	456,013.77	228,926.48
<b>负债合计</b>	<b>4,171,021.23</b>	<b>21,366,356.69</b>
<b>所有者权益：</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
实收基金	1,220,215,142.55	1,451,567,249.91
未分配利润	-427,386,322.43	-229,329,203.53
<b>所有者权益合计</b>	<b>792,828,820.12</b>	<b>1,222,238,046.38</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>796,999,841.35</b>	<b>1,243,604,403.07</b>

## 7.2 利润表

会计主体：金鹰科技创新股票型证券投资基金

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 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日

<b>一、收入</b>	<b>-233,234,242.93</b>	<b>-308,127,391.29</b>
1.利息收入	969,418.80	1,686,442.37
其中：存款利息收入	934,027.68	1,683,770.15
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	35,391.12	2,672.22
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-158,233,753.89	-393,568,317.93
其中：股票投资收益	-161,692,668.12	-395,889,009.61
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	3,458,914.23	2,320,691.68
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-78,424,593.04	82,075,933.51
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	2,454,685.20	1,678,550.76
<b>减：二、费用</b>	<b>25,698,422.72</b>	<b>33,222,922.57</b>
1. 管理人报酬	13,549,489.52	14,216,329.96
2. 托管费	2,258,248.24	2,369,388.31
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	9,554,340.78	16,411,697.09
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	336,344.18	225,507.21
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-258,932,665.65</b>	<b>-341,350,313.86</b>
减：所得税费用	-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-258,932,665.65	-341,350,313.86
-------------------	-----------------	-----------------

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金鹰科技创新股票型证券投资基金

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）	1,451,567,249.91	-229,329,203.53	1,222,238,046.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-258,932,665.65	-258,932,665.65
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）	-231,352,107.36	60,875,546.75	-170,476,560.61
其中：1.基金申购款	375,417,903.08	-137,812,662.49	237,605,240.59
2.基金赎回款	-606,770,010.44	198,688,209.24	-408,081,801.20
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）	1,220,215,142.55	-427,386,322.43	792,828,820.12
项目	上年度可比期间 2015 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基	1,886,895,393.11	-	1,886,895,393.11

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-341,350,313.86	-341,350,313.86
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)	-435,328,143.20	112,021,110.33	-323,307,032.87
其中: 1.基金申购款	65,266,129.23	-16,224,662.04	49,041,467.19
2.基金赎回款	-500,594,272.43	128,245,772.37	-372,348,500.06
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)	1,451,567,249.91	-229,329,203.53	1,222,238,046.38

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

金鹰科技创新股票型证券投资基金(简称“本基金”), 经中国证券监督管理委员会(简称“中国证监会”)机构部函[2015]1192 号文《关于金鹰科技创新股票型证券投资基金备案确认的函》批准, 于 2015 年 4 月 30 日募集成立。本基金为契约型开放式, 存续期限不定, 首次设立募集规模为 1886895393.11 份基金份额。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。

### 7.4.2 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 2016 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。

#### 7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无会计政策变更。

##### 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

本基金本报告期内无差错更正。

#### 7.4.6 税项

##### 1、印花税

根据财政部、国家税务总局财税字[2007]84 号文《关于调整证券(股票)交易印花税率的通知》的规定, 自 2007 年 5 月 30 日起, 调整证券(股票)交易印花税率, 由原先的 1‰调整为 3‰;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的

通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税；

经国务院批准,根据财政部、国家税务总局《关于调整证券（股票）交易印花税率的通知》的规定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自 2008 年 9 月 19 日起，证券（股票）交易印花税调整为单边征税,由出让方按证券(股票)交易印花税率缴纳印花税,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4月30日（基金合同生效日） 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：本基金报告期内未通过关联方进行股票交易。

##### 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4月30日（基金合同生效日） 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：本基金报告期内未通过关联方进行权证交易。

#### 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4月30日（基金合同生效日） 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：本基金报告期内未通过关联方进行债券交易。

#### 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4月30日（基金合同生效日） 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：本基金报告期内未通过关联方进行债券回购交易。

#### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金报告期内无应付关联方的佣金。

#### 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4月30日（基金合同 生效日）至2015年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	13,549,489.52	14,216,329.96
其中：支付销售机构的客户维护费	5,910,278.94	6,470,496.63

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。

管理费计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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首日起 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

##### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年4月30日（基金合同 生效日）至2015年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,258,248.24	2,369,388.31

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 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首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

#### 7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
合计	-
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2015 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
合计	0.00

注：本基金无销售服务费项目。

#### 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

本基金报告期内未通过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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年4月30日（基金合同生效日） 至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	110,490,687.72	869,540.77	158,131,051.95	1,592,341.08

注：本基金报告期末清算备付金余额为 1,905,426.81 元，当期产生的清算备付金利息收入为 47,887.88 元。2015 年末清算备付金余额 2,245,530.59 元，清算备付金利息收入 78,627.66 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	14.63	14.63	1,562.00	22,852.06	22,852.06	网下新股

				申购						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
603035	常熟汽饰	2016-12-27	2017-01-05	网下新股申购	10.44	10.44	2,316.00	24,179.04	24,179.04	网下新股待上市
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	晓天然气	2016-12-30	2017-01-10	网下新股申购	7.87	7.87	4,818.00	37,917.66	37,917.66	网下新股待上市
002840	华统股份	2016-12-29	2017-01-10	网下新股申购	6.55	6.55	1,814.00	11,881.70	11,881.70	网下新股待上市
603032	德新交运	2016-12-27	2017-01-05	网下新股申购	5.81	5.81	1,628.00	9,458.68	9,458.68	网下新股待上市
603186	华正新材	2016-12-26	2017-01-03	网下新股申购	5.37	5.37	1,874.00	10,063.38	10,063.38	网下新股待上市
300588	熙菱信息	2016-12-27	2017-01-05	网下新股申购	4.94	4.94	1,380.00	6,817.20	6,817.20	网下新股待上市
601375	中原证券	2016-12-20	2017-01-03	网下新股申购	4.00	4.00	26,695.00	106,780.00	106,780.00	网下新股待上市
300591	万里马	2016-12-30	2017-01-10	网下新股申购	3.07	3.07	2,397.00	7,358.79	7,358.79	网下新股待上市

## 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票



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	复牌开盘价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603986	兆易创新	2016-09-19	重大事项停牌	177.97	2017-03-13	195.77	1,133.00	26,353.58	201,640.01	重大事项
300526	中潜股份	2016-12-07	重大事项停牌	101.47	-	-	984.00	10,332.00	99,846.48	重大事项
603009	北特科技	2016-12-28	重大事项停牌	47.89	2017-01-04	52.68	456,510.00	18,164,110.22	21,862,263.90	重大0事项
000711	京蓝科技	2016-10-20	重大事项停牌	32.54	2017-03-13	29.29	431,736.00	13,903,278.48	14,048,689.44	重大4事项

#### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金报告期末未持有银行间市场债券正回购债券。

##### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金报告期末未持有交易所市场债券正回购债券。

#### 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	649,292,587.35	81.47
	其中：股票	649,292,587.35	81.47
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	112,396,114.53	14.10
7	其他各项资产	35,311,139.47	4.43
8	合计	796,999,841.35	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	15,869,501.28	2.00
C	制造业	519,536,214.07	65.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,917.66	0.00
E	建筑业	26,820,106.00	3.38
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	9,458.68	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,519,065.62	2.08
J	金融业	18,548,774.60	2.34
K	房地产业	14,048,689.44	1.77
L	租赁和商务服务业	15,806,730.00	1.99
M	科学研究和技术服务业	22,096,130.00	2.79
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	649,292,587.35	81.90

### 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

### 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	000725	京东方 A	13,099,985	37,465,957.10	4.73
2	000910	大亚圣象	1,894,252	36,180,213.20	4.56
3	600110	诺德股份	3,055,300	32,569,498.00	4.11
4	300203	聚光科技	1,063,293	32,483,601.15	4.10

5	002572	索菲亚	510,006	27,621,924.96	3.48
6	601668	中国建筑	3,027,100	26,820,106.00	3.38
7	603898	好莱客	803,598	26,012,467.26	3.28
8	603737	三棵树	330,456	24,129,897.12	3.04
9	300238	冠昊生物	718,996	23,978,516.60	3.02
10	002594	比亚迪	481,804	23,936,022.72	3.02

#### 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	600718	东软集团	67,624,780.58	5.53
2	600259	广晟有色	66,389,989.97	5.43
3	601668	中国建筑	63,812,547.50	5.22
4	000725	京东方 A	59,485,666.64	4.87
5	300364	中文在线	52,034,907.07	4.26
6	600703	三安光电	51,966,773.05	4.25
7	300409	道氏技术	51,676,002.92	4.23
8	002221	东华能源	50,732,147.38	4.15
9	603009	北特科技	44,047,722.71	3.60
10	300203	聚光科技	42,856,058.33	3.51
11	000810	创维数字	42,694,571.07	3.49
12	600674	川投能源	40,756,496.20	3.33
13	300207	欣旺达	40,390,994.38	3.30
14	600392	盛和资源	40,336,322.66	3.30
15	300017	网宿科技	38,097,496.12	3.12
16	002299	圣农发展	36,806,457.93	3.01
17	603737	三棵树	36,732,524.26	3.01
18	600565	迪马股份	35,820,242.00	2.93
19	300014	亿纬锂能	35,770,394.10	2.93
20	300322	硕贝德	34,818,669.64	2.85
21	002683	宏大爆破	34,125,880.40	2.79
22	002078	太阳纸业	32,760,240.92	2.68
23	300389	艾比森	32,643,384.02	2.67
24	300325	德威新材	32,413,350.25	2.65
25	600886	国投电力	31,998,187.72	2.62
26	600549	厦门钨业	30,367,089.18	2.48
27	000910	大亚圣象	30,292,582.44	2.48
28	000558	莱茵体育	30,153,223.01	2.47

29	002047	宝鹰股份	29,744,412.38	2.43
30	601233	桐昆股份	29,614,325.12	2.42
31	002236	大华股份	29,539,418.97	2.42
32	002510	天汽模	29,160,336.64	2.39
33	002206	海利得	29,031,221.24	2.38
34	600688	上海石化	28,714,066.19	2.35
35	300146	汤臣倍健	28,403,719.89	2.32
36	002273	水晶光电	28,400,345.20	2.32
37	600110	诺德股份	28,371,552.02	2.32
38	002123	梦网荣信	28,273,304.92	2.31
39	600328	兰太实业	27,919,373.40	2.28
40	603898	好莱客	27,458,924.73	2.25
41	002643	万润股份	27,012,302.20	2.21
42	000821	京山轻机	26,857,253.20	2.20
43	000970	中科三环	26,784,206.72	2.19
44	002062	宏润建设	26,433,778.20	2.16
45	601339	百隆东方	25,858,763.97	2.12
46	600699	均胜电子	25,829,761.24	2.11
47	601009	南京银行	25,454,815.54	2.08
48	300250	初灵信息	25,165,793.81	2.06
49	600158	中体产业	25,132,474.50	2.06
50	002776	柏堡龙	25,125,796.10	2.06
51	600837	海通证券	24,836,954.85	2.03
52	600030	中信证券	24,725,746.72	2.02

## 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	300409	道氏技术	72,261,214.19	5.91
2	600718	东软集团	61,204,403.68	5.01
3	300364	中文在线	60,252,177.24	4.93
4	000810	创维数字	59,771,825.54	4.89
5	600259	广晟有色	59,678,278.52	4.88
6	002221	东华能源	56,941,659.15	4.66
7	000678	襄阳轴承	56,608,509.67	4.63
8	600392	盛和资源	50,070,709.23	4.10
9	300207	欣旺达	44,885,724.26	3.67
10	601668	中国建筑	43,493,571.90	3.56
11	000638	万方发展	42,319,712.16	3.46

12	300017	网宿科技	41,591,711.29	3.40
13	002325	洪涛股份	40,569,409.59	3.32
14	300335	迪森股份	40,542,204.65	3.32
15	300389	艾比森	39,766,615.29	3.25
16	600674	川投能源	39,506,757.28	3.23
17	300014	亿纬锂能	39,499,884.18	3.23
18	002299	圣农发展	38,683,957.26	3.17
19	300322	硕贝德	38,159,331.50	3.12
20	600703	三安光电	35,957,311.26	2.94
21	002047	宝鹰股份	35,573,658.13	2.91
22	002078	太阳纸业	35,528,145.30	2.91
23	002236	大华股份	35,391,188.02	2.90
24	300325	德威新材	33,556,299.85	2.75
25	000970	中科三环	33,044,082.95	2.70
26	002594	比亚迪	31,235,824.15	2.56
27	600491	龙元建设	31,189,554.06	2.55
28	600886	国投电力	31,180,373.59	2.55
29	002062	宏润建设	30,442,365.21	2.49
30	603009	北特科技	30,083,550.32	2.46
31	300146	汤臣倍健	28,950,173.92	2.37
32	300097	智云股份	28,052,619.96	2.30
33	600565	迪马股份	27,667,426.95	2.26
34	002273	水晶光电	27,636,593.14	2.26
35	603898	好莱客	27,591,124.39	2.26
36	300147	香雪制药	27,332,022.24	2.24
37	000893	东凌国际	27,157,095.05	2.22
38	000725	京东方 A	27,093,528.05	2.22
39	002301	齐心集团	27,013,809.91	2.21
40	300203	聚光科技	26,833,476.96	2.20
41	002296	辉煌科技	26,762,096.65	2.19
42	600328	兰太实业	26,165,852.35	2.14
43	000558	莱茵体育	26,126,224.06	2.14
44	000802	北京文化	25,826,312.71	2.11
45	300250	初灵信息	25,679,237.00	2.10
46	002408	齐翔腾达	25,451,708.93	2.08
47	600549	厦门钨业	25,066,260.27	2.05
48	600158	中体产业	25,019,685.38	2.05
49	600316	洪都航空	24,929,903.49	2.04
50	600048	保利地产	24,765,850.29	2.03
51	600837	海通证券	24,450,314.25	2.00
52	000713	丰乐种业	24,422,470.25	2.00

#### 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	3,150,263,907.52
卖出股票的收入（成交）总额	3,342,107,784.86

**8.5 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。

**8.6 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****8.6.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未投资股指期货。

**8.7 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****8.7.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**8.8 投资组合报告附注**

8.8.1 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。

8.8.2 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。

**8.8.3 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	413,050.62
2	应收证券清算款	34,796,565.11
3	应收股利	-
4	应收利息	26,030.51
5	应收申购款	75,493.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	35,311,139.47
---	----	---------------

#### 8.8.4 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

期末前十名股票中不存在流通受限证券。

#### 8.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### §9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
21,891	55,740.49	61,338,911.07	5.03%	1,158,876,231.00	94.97%

#### 9.2 期末上市基金前十名持有人

本基金非上市交易型基金。

#### 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	19,113.29	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	1,451,567,249.91
本报告期基金总申购份额	375,417,903.08
减：本报告期基金总赎回份额	606,770,010.44
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,220,215,142.55

## §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。

## 11.4 基金投资策略的改变

本基金报告期内没有改变基金投资策略。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金审计的会计师事务所为中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）。

本报告期内实际应支付会计师事务所的审计费为 30000 元。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未发现本基金管理人、托管人及其高级管理人员存在受稽查或处罚的情况。

## 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	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	
国信证券	1	426,349,176.28	6.57%	388,531.08	6.89%	-
安信证券	1	330,437,367.64	5.09%	278,635.59	4.94%	-
华林证券	2	528,884,227.63	8.15%	478,051.83	8.48%	-
中信证券	1	215,577,494.72	3.32%	196,457.35	3.49%	-
西南证券	2	313,112,047.49	4.83%	285,338.50	5.06%	-
兴业证券	1	326,380,051.36	5.03%	298,714.31	5.30%	-
申万宏源证券	1	195,567,081.02	3.01%	178,220.34	3.16%	-
联讯证券	1	94,461,028.09	1.46%	86,082.11	1.53%	-
华创证券	1	37,143,400.38	0.57%	33,848.79	0.60%	-
招商证券	1	114,732,696.43	1.77%	104,555.93	1.85%	-
平安证券	1	114,196,722.14	1.76%	80,157.80	1.42%	-
民生证券	1	130,314,829.83	2.01%	118,756.21	2.11%	-
爱建证券	1	236,027,144.47	3.64%	215,091.04	3.82%	-
渤海证券	1	67,180,199.39	1.04%	47,784.62	0.85%	-
财达证券	1	82,585,902.37	1.27%	75,261.08	1.34%	-
东方证券	1	145,823,217.85	2.25%	132,889.45	2.36%	-
方正证券	1	401,940,998.11	6.20%	366,289.53	6.50%	-
开源证券	2	217,463,609.66	3.35%	154,684.28	2.74%	-
国金证券	1	269,765,428.83	4.16%	245,837.65	4.36%	-
齐鲁证券	1	21,380,387.13	0.33%	19,483.47	0.35%	-
首创证券	1	207,256,790.18	3.19%	147,421.09	2.62%	-
天风证券	1	31,436,412.83	0.48%	28,648.09	0.51%	-
西部证券	1	182,997,471.34	2.82%	130,166.39	2.31%	-
新时代证券	1	165,002,772.80	2.54%	117,366.91	2.08%	-
长城证券	1	126,062,564.62	1.94%	89,668.08	1.59%	-
浙商证券	2	790,634,763.69	12.19%	720,506.41	12.78%	-
中信建投证券	1	148,087,698.79	2.28%	134,952.25	2.39%	-
长江证券	1	395,029,234.90	6.09%	359,988.02	6.39%	-
银河证券	1	173,356,845.71	2.67%	123,306.66	2.19%	-

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

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

型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

本基金专用交易单位的选择程序如下：

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

#### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		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
首创证券	-	-	100,000,000.00	100.00%	-	-

#### §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