

金鹰元和保本混合型证券投资基金

2017 年年度报告摘要

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

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。

本报告中财务资料已经审计。中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2017 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	金鹰元和保本混合	
基金主代码	002681	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 5 月 25 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	1,115,542,780.08 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	金鹰元和保本混合 A	金鹰元和保本混合 C
下属分级基金的交易代码	002681	002682
报告期末下属分级基金的份额总额	915,929,147.32 份	199,613,632.76 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金运用投资组合保险策略，严格控制投资风险，通过安全资产与风险资产的动态配置，为投资者提供保本金额安全的保证，并力争实现基金资产的稳健增值。
投资策略	<p>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，并通过有效的资产配置策略，动态调整安全资产和风险资产的投资比例，以确保保本周期到期时实现基金资产的稳健增值。</p> <p>本基金股票、权证等风险资产占基金资产的比例不超过 40%；债券、货币市场工具等安全资产占基金资产的比例不低于 60%，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%。</p>
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证券投资基金，属于证券投资基金当中的低风险品种，其长期平均风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金，高于货币市场基金。

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	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

2.4 信息披露方式

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

§ 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	2017 年		2016 年 5 月 25 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日	
	金鹰元和保本混合 A	金鹰元和保本混合 C	金鹰元和保本混合 A	金鹰元和保本混合 C
本期已实现收益	19,816,336.61	3,325,914.57	14,347,752.71	2,607,640.99
本期利润	22,610,313.34	3,826,783.31	-2,515,949.09	-1,765,477.64
加权平均基金份额本期利润	0.0207	0.0147	-0.0020	-0.0053
本期基金份额净值增长率	2.10%	1.51%	-0.20%	-0.60%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末		2016 年末	
	金鹰元和保本混合 A	金鹰元和保本混合 C	金鹰元和保本混合 A	金鹰元和保本混合 C
期末可供分配基金份额	0.0187	0.0094	-0.0022	-0.0056

利润				
期末基金资产净值	933,073,744.77	201,496,720.96	1,211,255,025.10	306,221,729.89
期末基金份额净值	1.019	1.009	0.998	0.994

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

金鹰元和保本混合 A

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	0.39%	0.04%	0.54%	0.01%	-0.15%	0.03%
过去六个月	1.09%	0.05%	1.08%	0.01%	0.01%	0.04%
过去一年	2.10%	0.06%	2.15%	0.01%	-0.05%	0.05%
自基金合同生效起至今	1.90%	0.06%	3.48%	0.01%	-1.58%	0.05%

金鹰元和保本混合 C

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	0.20%	0.03%	0.54%	0.01%	-0.34%	0.02%
过去六个月	0.70%	0.04%	1.08%	0.01%	-0.38%	0.03%
过去一年	1.51%	0.06%	2.15%	0.01%	-0.64%	0.05%
自基金合同生效起至今	0.90%	0.06%	3.48%	0.01%	-2.58%	0.05%

1、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 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

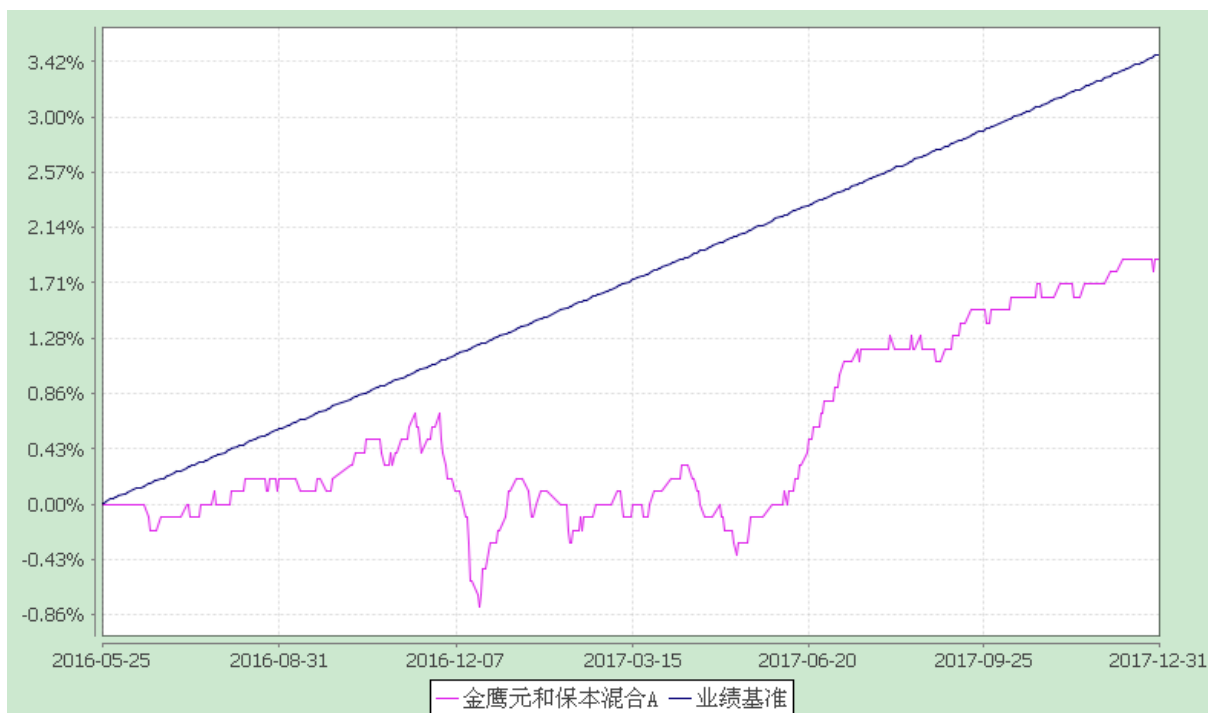
金鹰元和保本混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016 年 5 月 25 日至 2017 年 12 月 31 日)

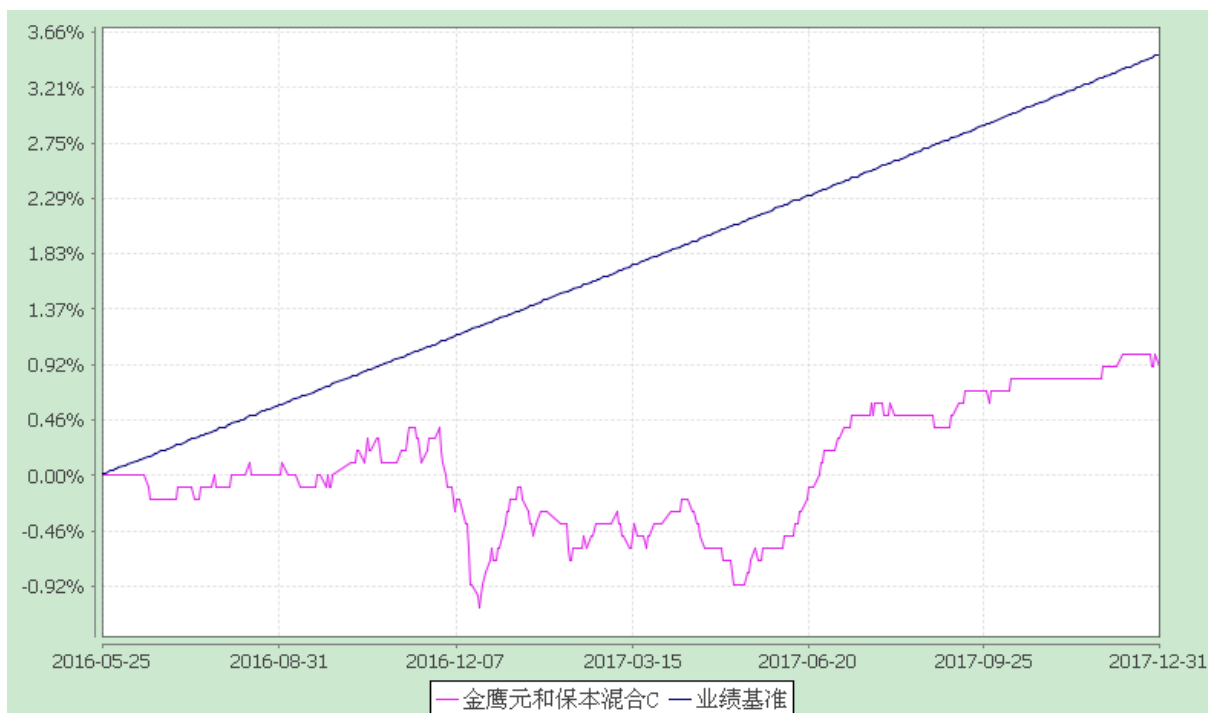
金鹰元和保本混合 A

(2016 年 5 月 25 日至 2017 年 12 月 31 日)



金鹰元和保本混合 C

(2016 年 5 月 25 日至 2017 年 12 月 31 日)



注：

- 1、本基金的基金合同于 2016 年 5 月 25 日生效。
- 2、本报告期末，本基金的投资比例及各项指标符合相关法规及基金合同规定。
- 3、本基金的业绩比较基准是：2 年期银行定期存款利率（税后）。

3.2.3 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

金鹰元和保本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历年收益率对比图

金鹰元和保本混合 A



金鹰元和保本混合 C



注：

- 1、本基金的基金合同于 2016 年 5 月 25 日生效。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金 2016 年 5 月 25 日成立，本年度及上年度未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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。
于利强	研究部总监，基金经理	2016-05-25	2017-06-21	8	于利强先生，复旦大学金融学学士。历任安永华明会计师事务所审计师，华禾投资管理有限公司风险投资经理，2009 年加入银华基金管理有限公司，历任旅游、地产、中小盘行业研究员和银华中小盘基金经理助理。2015 年 1 月加入金鹰基金管理有限公司，担任研究部总监。现任金鹰中小盘精选证券投资基金、金鹰产业整合灵活配置混合型证券投资基金、金鹰改革红利灵活配置混合型证券投资基金、金鹰多元策略灵活配置混合型证券投资基金、金鹰核心资源混合型证券投资基金基金经理。
龙悦芳	基金经理助理	2017-06-03	-	7	龙悦芳女士，曾任平安证券股份有限公司投资助理、交易员、投资经理等职务。2017 年 5 月加入金鹰基金管理有限公司，现任金鹰货币市场证券投资基金、金鹰添瑞中短债债券型证券投资基金基金经理，金鹰鑫益灵活配置混合型证券投资基金等基金的基金经理助理。
吴德瑄	基金经理助理	2016-08-27	-	5	吴德瑄先生，曾任广州证券股份有限公司研究员。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，金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金等基金的基金经理助理。
戴骏	基金经理助理	2016-11-15	-	6	戴骏先生，美国密歇根大学金融工程硕士研究生，历任国泰基金管理有限公司基金经理助理、东兴证券股份有限公司债券交易员等职务，2016 年 7 月加入金鹰基金管理有限公司，现任金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）、金鹰元禧混合型证券投资

					资基金、金鹰持久增利债券型证券投资基金（LOF）、金鹰添利中长期信用债债券型证券投资基金、金鹰添瑞中短债债券型证券投资基金基金经理，金鹰鑫益灵活配置混合型证券投资基金等基金的基金经理助理。
黄倩倩	基金经理助理	2016-08-19	2017-02-17	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《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

回顾 2017 年，债券市场收益率延续震荡向上走势。一季度，经济金融数据超预期，央行两次上调 MLF 和逆回购利率，使得债市延续 16 年末的下跌行情，10 年国债收益率由 3% 左右上行至 3.4% 以上。2 月中旬，央行定向降准例行考核被解读为定向降准，加上 3 月美联储加息幅度低于预期，市场解读为靴子落地，债券市场迎来一波小的反弹。但 3 月底开始，银监会频频发文，剑指近年来快速发展的同业链条和“三套利”行为。由此，影响债市的主基调逐渐从基本面转向金融监管，在防风险、去杠杆的大方向下，债市情绪更加敏感，10 年期国债收益率上行至 3.6% 一线。后因央行季末提前超额续作 MLF，释放流动性，债券市场又迎来一波小的反弹。三季度，经济增速较二季度略有下滑，市场预期在房地产调控和地方融资平台受限的背景下，经济将见顶回落。但由于经济见顶无法证伪，加与对监管趋严悲观预期并存，10 年期国债收益率在 3.6% 一线横盘。直到四季度，主要工业品价格继续保持高位，推动工业企业利润向好。10 月份重要会议明确了防范和化解金融风险是今后三年都要重点抓好的攻坚战，市场对金融监管持续深化的预期得以强化。周行长对下半年经济增长 7% 的乐观言论扭转了市场对经济增速回落的预期，引发了等待慢牛的拥挤的交易盘纷纷止损，债券收益率快速向上突破 4%。在市场收益率上行中，信用利差也有所走阔，但是整体信用利差仍然处于中性偏低位置。金融去杠杆带来流动性收紧，短端利率调整幅度更大，10 年期与 1 年期国债利率之差基本在 60BP 以内，在各别月份一度出现倒挂。收益率曲线平坦的程度和持续时间均创历史新高。

流动性方面，由于经济基本面平稳，加上美国处于加息周期，为保持人民币汇率稳定，面对外

汇占款持续下降、基础货币供应不足的困境，央行没有选择传统的降准模式，而是用公开市场操作的方式来调节货币供给。而金融防风险、去杠杆是贯穿 2017 年市场的主线。在金融防风险去杠杆的大环境下，货币政策整体中性偏紧，央行“削峰填谷”始终维持货币供给的稳定，确保不发生系统性金融风险。货币供给总量有限，同业收缩下存款派生能力减弱，货币流通速度下降，整个金融体系的资金供给放缓，而经济平稳，融资需求依然不弱，使得银行体系超储率依然处于低位。偏低的超储率加上银行各种流动性指标考核以及财政存款剧烈的季节性波动，引发了资金面较为频繁的波动，结构性紧张成为常态。

报告期内，基于对经济基本面、货币政策和监管政策的判断，组合债券部分坚持短久期的操作策略，在市场反弹过程中，卖出长久期债券，新增配置以中高等级、短久期债券为主，适当参与可转债申购，同时保持适度的杠杆比例和组合流动性。由于本基金在建仓初期经历债市大幅调整，未能积累足够的安全垫，受避险策略基金新规的影响，产品配置风险资产比例受限，未能赚取权益市场收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值为 1.019 元，本报告期份额净值增长率为 2.10%，同期业绩比较基准增长率为 2.15%；C 类基金份额净值为 1.009 元，本报告期份额净值增长率 1.51%，同期业绩比较基准增长率为 2.15%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018 年，经济基本上，当前经济环境还没有走出传统经济模式的束缚，以房地产和基建为代表的重资产投资模式对于当下经济仍有较强的影响力。在去杠杆和重质量的背景下，传统经济成分增速将下行。但经济中的积极因素正在逐渐显现，体现在消费贡献占比日益提升、对外贸易对经济重新产生正向推动、“三去一降下”企业资产负债表持续修复、先进制造带动制造业投资复苏的曙光乍现，这些因素对经济产生正向作用，使整体经济下行幅度可控，或呈现缓中趋稳的态势。

基本面整体平稳，为金融监管创造了良好的外部环境。防范和化解金融风险是今后三年都要重点抓好的攻坚战，金融监管在 2018 年将正式进入政策落地和实施的阶段。未来随着监管政策付诸实施，依靠货币政策收紧以倒逼金融去杠杆的必要性降低，加上经济基本面回落，人民币贬值压力减弱，2018 年货币政策在总量上或有边际改善。但考虑到，中央经济工作会议对货币政策的定调仍是“关注货币供应总闸门”，全球货币进入紧缩周期，国内基本面也难回落到需要货币政策宽松刺激的程度，因此货币政策很难明显放松，大概率依然保持中性。随着央行“货币政策+宏观审慎政策”的双支柱调控框架日渐完善，央行通过构建利率走廊，以 DR007 作为基准利率引导，锁定银行资金端的利率水平。而宏观审慎政策作为货币政策的有效补充，通过 MPA 监管，对银行本身的杠杆率、信贷

扩张和流动性方面进行约束，从而压缩同业规模，减少银行对非银等的资金融出，达到逆向拆解非银和影子银行杠杆的作用。在此过程中，流动性分层将进一步加剧，机构间流动性的摩擦成本上升，资金面结构性紧张的局面或难避免。

基于以上判断，在市场流动性问题取得实质性解决之前，本基金将继续采取稳健操作，坚持“吃票息策略”，持仓以中短久期中高等级信用债、存单为主，保持适度的杠杆比例。

4.6 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。

4.7 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元和保本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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，金鹰元和保本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元和保本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，金鹰元和保本混合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元和保本混合型证券投资基金 2017 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

中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）审计了 2017 年 12 月 31 日的资产负债表、2017 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注，并出具了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：金鹰元和保本混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	21,991,892.96	2,298,935.79
结算备付金	29,287,241.54	40,378,125.50
存出保证金	7,871.89	162,328.40
交易性金融资产	1,377,049,792.81	1,890,326,193.78
其中：股票投资	1,078,594.01	44,307,394.48

基金投资	-	-
债券投资	1,375,971,198.80	1,846,018,799.30
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	266,320,000.00	289,138,584.94
应收证券清算款	-	-
应收利息	21,630,524.70	22,228,177.98
应收股利	-	-
应收申购款	799.04	12,570.36
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,716,288,122.94	2,244,544,916.75
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2017 年 12 月 31 日	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	577,884,338.17	723,198,839.90
应付证券清算款	663,651.11	229,166.67
应付赎回款	1,138,223.73	882,231.84
应付管理人报酬	1,174,458.92	1,552,556.05
应付托管费	195,743.17	258,759.36
应付销售服务费	105,504.41	157,830.18
应付交易费用	22,985.75	226,759.30
应交税费	-	-
应付利息	168,462.17	346,334.84
应付利润	-	-

递延所得税负债	-	-
其他负债	364,289.78	215,683.62
负债合计	581,717,657.21	727,068,161.76
所有者权益：		
实收基金	1,115,542,780.08	1,521,883,662.02
未分配利润	19,027,685.65	-4,406,907.03
所有者权益合计	1,134,570,465.73	1,517,476,754.99
负债和所有者权益总计	1,716,288,122.94	2,244,544,916.75

注：截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日，本基金份额总额为 1,115,542,780.08 份。其中 A 类份额净值为 1.019 元，份额总额 915,929,147.32 份；C 类份额净值 1.009 元，份额总额 199,613,632.76 份。

7.2 利润表

会计主体：金鹰元和保本混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 5 月 25 日（基金 合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日
一、收入	71,684,450.93	15,594,838.81
1.利息收入	83,911,250.63	34,389,125.63
其中：存款利息收入	575,730.54	554,116.50
债券利息收入	71,727,797.94	27,149,559.53
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	11,607,722.15	6,685,449.60
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-16,173,178.29	1,827,901.72
其中：股票投资收益	2,712,754.20	4,084,874.50
基金投资收益	-	-

债券投资收益	-18,979,663.39	-2,620,215.12
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	93,730.90	363,242.34
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	3,294,845.47	-21,236,820.43
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	651,533.12	614,631.89
减：二、费用	45,247,354.28	19,876,265.54
1. 管理人报酬	16,343,260.45	11,464,041.55
2. 托管费	2,723,876.78	1,910,673.68
3. 销售服务费	1,568,644.83	1,189,947.67
4. 交易费用	177,118.29	746,862.02
5. 利息支出	24,005,745.48	4,329,909.09
其中：卖出回购金融资产支出	24,005,745.48	4,329,909.09
6. 其他费用	428,708.45	234,831.53
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	26,437,096.65	-4,281,426.73
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	26,437,096.65	-4,281,426.73

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金鹰元和保本混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 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）	1,521,883,662.02	-4,406,907.03	1,517,476,754.99

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	26,437,096.65	26,437,096.65
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）	-406,340,881.94	-3,002,503.97	-409,343,385.91
其中：1.基金申购款	4,257,044.09	21,241.41	4,278,285.50
2.基金赎回款	-410,597,926.03	-3,023,745.38	-413,621,671.41
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）	1,115,542,780.08	19,027,685.65	1,134,570,465.73
项目	上年度可比期间		
	2016年5月25日（基金合同生效日）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）	1,619,654,121.30	-	1,619,654,121.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-4,281,426.73	-4,281,426.73
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）	-97,770,459.28	-125,480.30	-97,895,939.58
其中：1.基金申购款	844,623.76	1,599.64	846,223.40
2.基金赎回款	-98,615,083.04	-127,079.94	-98,742,162.98
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）	1,521,883,662.02	-4,406,907.03	1,517,476,754.99

报表附注为财务报表的组成部分。

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

金鹰元和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") 机构部函[2016]1112 号文《关于金鹰元和保本混合型证券投资基金备案确认的函》批准, 于 2016 年 5 月 25 日募集成立。本基金为契约型开放式, 存续期限不定。本基金募集期间自 2016 年 4 月 22 日起至 2016 年 5 月 20 日止, 认购金额及认购期银行利息合计 1,619,654,121.30 元, 于 2016 年 5 月 24 日划至托管银行账户, 首次设立募集规模为 1,619,654,121.30 份基金份额。验资机构为中审众环会计师事务所(特殊普通合伙)。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 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 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。

7.4.6 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）交易印花税率调整为单边征税，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。

7.4.7 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
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

本基金本报告期内没有通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内没有通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期内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

本基金本报告期内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

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年5月25日（基金合同 生效日）至2016年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	16,343,260.45	11,464,041.55
其中：支付销售机构的客户维护费	5,845,683.54	4,526,448.86

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.2% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

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。

若保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，基金份额持有人将所持有本基金份额转为变更后的“金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金”的基金份额，管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法同上。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年5月25日（基金合同 生效日）至2016年12月31 日
----	---------------------------------	--

当期发生的基金应支付的托管费	2,723,876.78	1,910,673.68
----------------	--------------	--------------

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。

若保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，基金份额持有人将所持有本基金份额转为变更后的“金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金”的基金份额，托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法同上。

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 2017年1月1日至2017年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	金鹰元和保本混合 A	金鹰元和保本混合 C	合计
中国工商银行股份有限公司	-	1,213,421.92	1,213,421.92
金鹰基金管理有限公司	-	257.55	257.55
合计	-	1,213,679.47	1,213,679.47
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016年5月25日（基金合同生效日）至2016年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	金鹰元和保本混合 A	金鹰元和保本混合 C	合计
金鹰基金管理有限公司	1,568,644.83	123.90	1,568,768.73
中国工商银行	-	856,371.54	856,371.54
合计	1,568,644.83	856,495.44	2,425,140.27

注：本基金 C 类基金份额的销售服务年费 0.6% 的年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的 C 类基金份额的销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

C 类基金份额的销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金

托管人发送销售服务费划款指令，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。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内，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

金鹰元和保本混合 A

本基金本报告期内，其他关联方未投资本基金。

金鹰元和保本混合 C

本基金本报告期内，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 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年5月25日（基金合同生效日） 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	1,991,892.96	120,300.77	2,298,935.79	433,442.37

注：本基金清算备付金本年度期末余额 29,287,241.54 元，清算备付金利息收入 395,452.74 元。本基金清算备付金上年度期末余额 40,378,125.50 元，清算备付金利息收入 119,748.14 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，无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

7.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.8.7.2 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基金。

7.4.9 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**7.4.9.1 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.4.9.2.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产余额为 227,884,338.17 元，所抵押债券参见下表：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值总额
111719296	17 恒丰银行 CD296	2018-01-02	96.34	945,000.00	91,041,300.00
111784656	17 哈尔滨银 行 CD179	2018-01-04	97.53	500,000.00	48,765,000.00
111787480	17 威海商行 CD054	2018-01-04	97.44	500,000.00	48,720,000.00
111794564	17 广州农村 商业银行 CD061	2018-01-04	95.31	500,000.00	47,655,000.00
合计				2,445,000.00	236,181,300.00

7.4.9.2.2 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 350,000,000.00 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。

7.4.10 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)，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 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	1,078,594.01	0.06
	其中：股票	1,078,594.01	0.06
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,375,971,198.80	80.17
	其中：债券	1,375,971,198.80	80.17
	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	266,320,000.00	15.52
	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	51,279,134.50	2.99
8	其他各项资产	21,639,195.63	1.26
9	合计	1,716,288,122.94	100.00

8.2 报告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

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	829,974.41	0.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	31,826.56	0.00
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	52,084.89	0.00
J	金融业	164,708.15	0.01
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	1,078,594.01	0.10

8.2.2 积极投资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港股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投资。

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	601375	中原证券	26,695	164,708.15	0.01
2	603877	太平鸟	3,180	86,209.80	0.01

3	603298	杭叉集团	3,641	58,219.59	0.01
4	603639	海利尔	1,206	54,209.70	0.00
5	603239	浙江仙通	2,772	52,834.32	0.00
6	603559	中通国脉	1,349	52,084.89	0.00
7	603585	苏利股份	1,561	48,952.96	0.00
8	603416	信捷电气	1,506	47,167.92	0.00
9	603886	元祖股份	2,241	45,268.20	0.00
10	002838	道恩股份	1,021	42,065.20	0.00

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	600871	石化油服	9,506,070.92	0.63
2	601808	中海油服	5,181,822.00	0.34
3	600010	包钢股份	4,845,000.00	0.32
4	600428	中远海特	2,866,576.33	0.19
5	000807	云铝股份	974,160.00	0.06
6	603639	海利尔	30,089.70	0.00
7	603628	清源股份	14,376.17	0.00
8	603388	元成股份	10,793.20	0.00

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	600961	株冶集团	10,663,685.10	0.70
2	600871	石化油服	9,407,000.00	0.62
3	600010	包钢股份	5,593,000.00	0.37
4	601808	中海油服	5,400,095.00	0.36
5	600598	北大荒	5,257,003.00	0.35
6	600299	安迪苏	4,765,941.31	0.31
7	000735	罗牛山	4,542,081.00	0.30
8	002556	辉隆股份	4,332,575.00	0.29
9	600108	亚盛集团	3,926,998.00	0.26
10	600251	冠农股份	3,919,824.58	0.26
11	000998	隆平高科	3,098,513.06	0.20

12	600428	中远海特	2,774,097.00	0.18
13	600540	*ST 新赛	1,810,047.00	0.12
14	000807	云铝股份	1,101,593.10	0.07
15	000930	中粮生化	754,500.00	0.05

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

买入股票成本（成交）总额	23,428,888.32
卖出股票收入（成交）总额	67,346,953.15

8.5 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	69,895,000.00	6.16
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	437,102,194.80	38.53
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	146,585,000.00	12.92
7	可转债（可交换债）	6,654,004.00	0.59
8	同业存单	715,735,000.00	63.08
9	其他	-	-
10	合计	1,375,971,198.80	121.28

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

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	111719296	17 恒丰银行 CD296	2,000,000.00	192,680,000.00	16.98
2	111715425	17 民生银行 CD425	1,000,000.00	97,530,000.00	8.60

3	111720145	17 广发银行 CD145	1,000,000.00	96,540,000.00	8.51
4	122233	12 招商 02	800,000.00	79,888,000.00	7.04
5	136039	15 石化 01	800,000.00	78,696,000.00	6.94

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

本基金本报告期内未投资资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期内未投资权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货的持仓。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 本报告期投资基金情况

8.12.1 投资政策及风险说明

本基金本报告期内未投资基金。

8.12.2 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。

8.13 投资组合报告附注

8.13.1 本基金投资的前十名证券发行主体之一的中原证券,因担任财务顾问过程中涉嫌未勤勉尽责,于 2017 年 11 月 30 日被中国证券监督管理委员会立案调查;因内部制度不完善、未依法履行职责,于 2017 年 5 月 25 日被中国证券监督管理委员会处以责令改正的监管措施。

8.13.2 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。

8.13.3 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	7,871.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	21,630,524.70
5	应收申购款	799.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,639,195.63

8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	132007	16 凤凰 EB	5,197,920.00	0.46

8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.13.6 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。

§ 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

份额级别	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
金鹰元和保本混合 A	4,579	200,028.20	249,998,000.00	27.29%	665,931,147.32	72.71%

金鹰元和保本混 合 C	1,613	123,753.03	800,591.11	0.40%	198,813,041.65	99.60%
合计	6,192	180,158.72	250,798,591.11	22.48%	864,744,188.97	77.52%

9.2 期末上市基金前十名持有人

本基金非上市基金。

金鹰元和保本混合 A

本基金非上市基金。

金鹰元和保本混合 C

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开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	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	金鹰元和保本混合 A	0
	金鹰元和保本混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	金鹰元和保本混合 A	0
	金鹰元和保本混合 C	0
	合计	0

9.4 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

项目	金鹰元和保本混合 A	金鹰元和保本混合 C
本报告期期初基金份额总额	1,213,930,226.46	307,953,435.56
本报告期基金总申购份额	2,127,209.26	2,129,834.83
减：本报告期基金总赎回份额	300,128,288.40	110,469,637.63
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	915,929,147.32	199,613,632.76

§ 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 53000 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金报告期内无管理人、托管人的托管业务部门及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
爱建证券	1	45,110,450.60	49.72%	41,109.02	53.18%	-
浙商证券	1	14,807,095.00	16.32%	13,493.61	17.45%	-
东北证券	2	13,701,829.06	15.10%	9,746.01	12.61%	-
山西证券	1	13,133,038.31	14.48%	9,343.88	12.09%	-
齐鲁证券	1	2,866,576.33	3.16%	2,612.45	3.38%	-

财达证券	1	1,101,593.10	1.21%	1,003.89	1.30%	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	3	-	-	-	-	-
华融证券	2	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	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。

11.7.2 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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券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	203,072,159.92	42.36%	7,910,200,000.00	12.74%	-	-
浙商证券	-	-	11,079,200,000.00	17.84%	-	-
东北证券	-	-	140,100,000.00	0.23%	-	-
山西证券	-	-	7,364,600,	11.86%	-	-

			000.00			
齐鲁证券	-	-	10,913,800,000.00	17.58%	-	-
财达证券	-	-	413,700,000.00	0.67%	-	-
开源证券	-	-	168,593,000.00	0.27%	-	-
首创证券	385,560.00	0.08%	10,741,300,000.00	17.30%	-	-
天风证券	14,460,000.00	3.02%	629,500,000.00	1.01%	-	-
华融证券	-	-	3,004,400,000.00	4.84%	-	-
广州证券	-	-	41,000,000.00	0.07%	-	-
东莞证券	261,516,552.00	54.55%	-	-	-	-
银河证券	-	-	7,967,100,000.00	12.83%	-	-
东兴证券	-	-	1,723,130,000.00	2.77%	-	-

§ 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。

金鹰基金管理有限公司

二〇一八年三月二十八日