

金鹰主题优势混合型证券投资基金
2015 年年度报告摘要
2015 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：二〇一六年三月三十日

§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 2016 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 2015 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	金鹰主题优势混合
基金主代码	210005
交易代码	210005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 12 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	314,365,560.08 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，把握主题投资的脉络，在充分控制风险的前提下，分享中国经济快速发展的成果以及企业经营绩效提升所带来的股权溢价，力争实现基金资产的长期可持续稳健增值。
投资策略	本基金坚持“自上而下”为主、“自下而上”为辅的投资视角，在实际投资过程中充分体现“主题优势”这个核心理念，以主题情景分析法把握经济发展不同阶段的主题投资节奏，优选并深挖不同阶段热点主题投资机会，优化资产配置，降低市场波动的冲击，扩大投资收益。 本基金股票资产占基金总资产的比例为 60%~95%，其中，不低于 80% 的股票资产将配置于投资主题驱动下的行业与上市公司，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总资产的 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%。
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	从长期来看，其风险和预期收益均高于货币型基金、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	蒋松云
	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	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	2015 年	2014 年	2013 年
本期已实现收益	251,150,945.44	71,575,436.48	-2,463,038.90
本期利润	266,468,327.60	70,654,635.06	64,171,948.38
加权平均基金份额本期利润	0.7169	0.0945	0.0741
本期基金份额净值增长率	79.23%	18.24%	11.48%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配基金份额利润	0.2676	-0.2486	-0.3789
期末基金资产净值	453,025,385.07	405,662,603.14	613,986,023.44
期末基金份额净值	1.441	0.804	0.680

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；

2、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、所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，采用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	37.76%	2.26%	13.07%	1.25%	24.69%	1.01%
过去六个月	9.17%	3.20%	-11.61%	2.01%	20.78%	1.19%
过去一年	79.23%	2.93%	6.77%	1.86%	72.46%	1.07%
过去三年	136.23%	2.00%	40.90%	1.34%	95.33%	0.66%
过去五年	43.67%	1.75%	23.12%	1.21%	20.55%	0.54%
成立至今	44.10%	1.74%	21.54%	1.20%	22.56%	0.54%

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，修改后的基金合同已于 2015 年 9 月 28 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

金鹰主题优势混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2010 年 12 月 20 日至 2015 年 12 月 31 日)

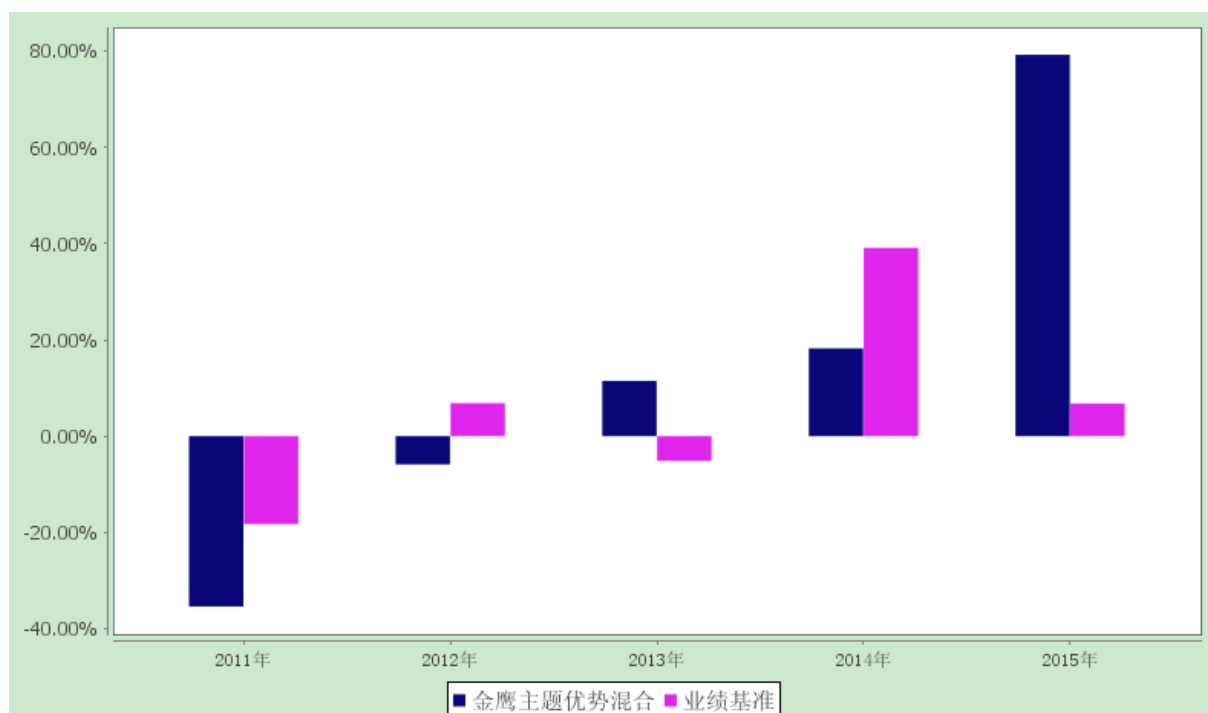


注：1、截至报告日本基金各项投资比例基本符合基金合同规定的各项比例，其中股票资产占基金总资产的比例不足 60%为支付赎回的流动性管理所致，本基金管理人已及时调整完毕；2、本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

金鹰主题优势混合型证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

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，是自律制度下中国证监会批准设立的首批基金管理公司之一。公司注册资本 2.5 亿元人民币，股东包括广州证券股份有限公司、广州白云山医药集团股份有限公司、美的集团股份有限公司和东亚联丰投资管理有限公司，分别持有 49%、20%、20%和 11%的股份。

公司设立了投资决策委员会、风险控制委员会、资产估值委员会等专业委员会。投资决策委员会负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。风险控制委员会负责全面评估公司的经营过程中的各项风险，并提出防范措施。资产估值委员会负责依照基金合同和基金估值制度的规定，确定基金资产估值的原则、方法、程序及其他相关的估值事宜。

公司目前下设 16 个一级职能部门，分别是权益投资部、研究部、集中交易部、指数及量化投资部、产品研发部、固定收益部、零售业务部、电子商务部、机构业务部、专户投资部、信息技术部、基金事务部、风险管理部、监察稽核部、财务管理部、综合管理部。

权益投资部负责基金权益类投资；研究部负责宏观经济、行业、上市公司研究和投资策略研究；集中交易部负责完成基金经理投资指令；指数及量化投资部负责指数量化产品的研究投资、金融工程研究、数量分析工作；产品研发部负责基金新产品、新业务的研究和设计工作；固定收益部负责固定收益证券以及债券、货币市场的研究和投资管理工作；零售业务部负责市场营销策划、基金销售与渠道管理、客户服务及媒介宣传推广等业务；电子商务部负责公司网络平台及网上交易系统的建设、维护和电子商务的推广；机构业务部负责机构客户的开发、维护、管理及业务拓展；专户投资部负责特定客户资产的投资和管理；信息技术部负责公司信息系统的日常运行与维护,跟踪研究新技术,进行相应的技术系统规划与开发；基金事务部负责基金会计核算、估值、开放式基金注册、登记和清算等业务；风险管理部负责公司风险的识别、评估、控制等管理工作；监察稽核部负责对公司和基金运作以及公司员工遵守国家相关法律、法规和公司内部规章制度等情况进行监督和检查；财务管理部负责公司的财务预算、财务管理及会计核算等工作；综合管理部负责公司企业文化建设、文字档案、后勤服务、人力资源管理、薪酬制度、人员培训、人事档案等综合事务管理。

截至 2015 年 12 月 31 日,公司共管理二十一只开放式基金:金鹰成份股优选证券投资基金、金鹰中小盘精选证券投资基金、金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金、金鹰行业优势混合型证券投资基金、金鹰稳健成长混合型证券投资基金、金鹰主题优势混合型证券投资基金、金鹰保本混合型证券投资基金、金鹰技术领先灵活配置混合型证券投资基金、金鹰策略配置混合型证券投资基金、金鹰持久增利债券型证券投资基金 (LOF)、金鹰核心资源混合型证券投资基金、金鹰中证 500 指数分级证券投资基金、金鹰灵活配置混合型证券投资基金、金鹰货币市场证券投资基金、金鹰元丰保本混合型证券投资基金、金鹰元安保本混合型证券投资基金、金鹰元盛债券型发起式证券投资基金 (LOF)、金鹰科技创新股票型证券投资基金、金鹰民族新兴灵活配置混合型证券投资基金、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。

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		
陈立	基金经理	2013-08-15	-	9	陈立先生,复旦大学经济学硕士。曾任银华基金管理有限公司医药行业研究员,2009 年 6 月加盟金鹰基金管理有限公司,先后任行业研究员,非周期组组长、基金经理助理、投资经理。现任金鹰

					主题优势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

2015 年 A 股市场整体表现为大起大落、宽幅震荡格局。上半年延续 2014 年 11 月份降息后市场上涨的趋势，受到央行进一步降准降息、改革持续推进、居民财富向股市配置、加杠杆等多因素推动，市场快速上涨。但在 6 月中下旬，市场涨幅剧烈的背景下风险累积，受宽松货币政策可能延后的预期对市场形成的边际影响以及对杠杆强平的恐慌，市场又出现超预期的剧烈调整。三季度在经济数据表现疲弱、清理场外配资以及人民币对美元的阶段性贬值等因素下，市场再次经历一波向下大幅调整。四季度，清理场外配资得到按期完成，加上人民币在经历新汇改后阶段性趋稳，三季度以来的市场过度悲观预期得以修复，市场迎来一轮反弹。

从全年看，上证综指上涨 9.3%，深成指上涨 15.0%，中小板指数上涨 53.7%，而创业板指数大幅上涨 84.4%。行业表现上，计算机、餐饮旅游、通信、轻工、纺织服装板块涨幅巨大、涨幅居前，计算机板块上涨 126%，涨幅最高。非银金融、煤炭、钢铁则表现为下跌，非银金融下跌 18.7%，跌幅最大。

2015 年市场宽幅震荡局面，使得市场风险偏好也随之大起大落。总体上，本基金在 2015 年上半年重点布局互联网技术应用与渗透、医疗健康、节能环保等转型升级方向，6 月中下旬进行了一定的组合调整和降仓，但力度不够，导致基金净值也随市场出现明显的回撤。3 季度在市场风险偏好下降趋势下，本基金采取相对谨慎的投资策略，清理场外配资和人民币阶段贬值使得市场再次下行，风险偏好表现为过度悲观。4 季度随着这些短期冲击完成，过度悲观预期修复，本基金进行了加仓，重点布局体育、教育、传媒等成长股板块。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值为 1.441 元，本报告期份额净值增长率 79.23%，同期业绩比较基准增长率为 6.77%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

海外市场方面，美联储在 2015 年 12 月份开启了近十年来的首次加息，虽然此次加息市场预期

较为充分，但毕竟这标志着美国正式开启加息周期，未来的加息节奏仍将对全球经济、特别是新兴国家货币形成影响，其风险因素仍需持续关注。

国内方面，政府大力推进供给侧结构性改革，提升改造“旧动能”，有助于加速传统经济过剩产能的出清，预计 2016 年经济增速将温和下行。对于稳经济，预计货币政策继续加大宽松的力度有限，将更多依靠财政政策。

综合国内外市场，协调汇率、利率和流动性之间的难度将加大，不确定性因素增多，也带来股票市场短期风险偏好的下降。不过中期看，支持市场向好的动力依然存在。例如居民大类资产配置权益的比重上升趋势持续、证券市场繁荣有助于经济转型升级，中国各项改革任务持续推进、改革红利不断落实。

展望 2016 年，随着供给侧结构性改革政策大力推进，预计传统经济板块存在短期阶段性机会，但从产业发展的角度，我们中期更看好符合转型升级产业发展趋势的行业。继续看好体育、教育、传媒、医疗服务等方向的投资机会。主题方面关注军工、迪斯尼等方向。

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

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

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，本基金托管人在对金鹰主题优势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，金鹰主题优势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主题优势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，金鹰主题优势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主题优势混合型证券投资基金本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，出具了众环审字（2016）050125 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：金鹰主题优势混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资 产：	-	-
银行存款	41,191,469.33	41,859,626.04
结算备付金	5,458,364.40	4,212,493.14
存出保证金	902,336.23	626,362.70
交易性金融资产	414,591,850.84	367,138,520.95
其中：股票投资	414,591,850.84	367,138,520.95
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	9,235,535.74	4,065,082.91
应收利息	12,555.78	12,661.99
应收股利	-	-
应收申购款	394,636.79	194,009.22
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	471,786,749.11	418,108,756.95
负债和所有者权益	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 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	4,412,691.74	8,029,557.18
应付赎回款	10,107,238.40	1,540,986.68
应付管理人报酬	610,862.35	536,484.83
应付托管费	101,810.40	89,414.12
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,838,828.31	1,793,795.65
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	689,932.84	455,915.35
负债合计	18,761,364.04	12,446,153.81
所有者权益：	-	-
实收基金	314,365,560.08	504,350,594.96
未分配利润	138,659,824.99	-98,687,991.82
所有者权益合计	453,025,385.07	405,662,603.14
负债和所有者权益总计	471,786,749.11	418,108,756.95

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.441 元，基金份额总额 314,365,560.08 份。

7.2 利润表

会计主体：金鹰主题优势混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入	288,964,807.61	90,340,034.15
1.利息收入	603,845.55	1,387,149.31
其中：存款利息收入	521,932.07	786,296.69

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	81,913.48	600,852.62
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	271,792,034.22	89,733,803.80
其中：股票投资收益	270,230,437.00	85,256,625.71
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	1,561,597.22	4,477,178.09
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	15,317,382.16	-920,801.42
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	1,251,545.68	139,882.46
减：二、费用	22,496,480.01	19,685,399.09
1. 管理人报酬	6,578,940.60	7,849,773.78
2. 托管费	1,096,490.06	1,308,295.57
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	14,435,650.31	10,145,042.08
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	385,399.04	382,287.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	266,468,327.60	70,654,635.06
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	266,468,327.60	70,654,635.06

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金鹰主题优势混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	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）	504,350,594.96	-98,687,991.82	405,662,603.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	266,468,327.60	266,468,327.60
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）	-189,985,034.88	-29,120,510.79	-219,105,545.67
其中：1.基金申购款	942,757,542.04	314,958,570.28	1,257,716,112.32
2.基金赎回款	-1,132,742,576.92	-344,079,081.07	-1,476,821,657.99
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）	314,365,560.08	138,659,824.99	453,025,385.07
项目	上年度可比期间		
	2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	902,804,055.11	-288,818,031.67	613,986,023.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本	-	70,654,635.06	70,654,635.06

期利润)			
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）	-398,453,460.15	119,475,404.79	-278,978,055.36
其中：1.基金申购款	22,480,991.76	-5,945,442.98	16,535,548.78
2.基金赎回款	-420,934,451.91	125,420,847.77	-295,513,604.14
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）	504,350,594.96	-98,687,991.82	405,662,603.14

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

金鹰主题优势混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会证监许可【2010】1480 号文核准《关于核准金鹰主题优势股票型证券投资基金募集的批复》批准募集，于 2010 年 12 月 20 日正式成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定，设立募集规模为 2,051,271,200.80 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 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 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不变，会计估计与最近一期年度报告相比有调整。

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)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变。

2、营业税、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;

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 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	35,859,819.28	0.37%	432,965,288.56	6.19%

7.4.8.1.2 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	-	-	-	-

注： 本基金报告期内及上年度可比期间均未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	上年度可比期间
-------	----	---------

	2015年1月1日至2015年12月31日		2014年1月1日至2014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	-	-	-	-

注： 本基金报告期及上年度可比期间内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 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	-	-	118,800,000.00	4.47%

注： 本基金报告期及上年度可比期间内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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广州证券股份有限公司	32,277.03	0.38%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广州证券股份有限公司	374,076.72	6.48%	0.00	0.00%

司				
---	--	--	--	--

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，并扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取、由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2、向关联方支付的交易佣金采用公允的交易佣金比率计算。关联方席位租用合同还规定佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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 2015年1月1日至2015年12 月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	6,578,940.60	7,849,773.78
其中：支付销售机构的客户维护费	2,860,809.53	2,786,875.65

注：1、基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

2、基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12 月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,096,490.06	1,308,295.57

注：1、基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

2、基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

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 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
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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：本基金报告期内及上年度均无应支付关联方的销售服务费。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金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 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	41,191,469.33	444,173.96	41,859,626.04	709,723.88

注：本基金清算备付金 2015 年度期末余额 5,458,364.40 元，清算备付金利息收入 66,600.81 元；2014 年度期末余额 4,212,493.14 元，清算备付金利息收入 66,082.12 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（2015 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

本基金报告期内没有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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
000002	万科A	2015-12-21	重大事项	24.43	-	-	900,113.00	16,198,956.89	21,989,760.59	
002631	德尔未来	2015-11-27	重大事项	29.07	-	-	447,000.00	12,554,431.10	12,994,290.00	
300038	梅泰诺	2015-12-16	重大事项	56.68	-	-	103,600.00	4,903,731.00	5,872,048.00	
300242	明家科技	2015-12-18	重大事项	49.96	2016-01-22	44.96	430,200.00	20,592,786.81	21,492,792.00	

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

本基金报告期末没有银行间市场债券正回购。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金报告期末没有交易所市场债券正回购。

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	414,591,850.84	87.88
	其中：股票	414,591,850.84	87.88
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	46,649,833.73	9.89
7	其他各项资产	10,545,064.54	2.24
8	合计	471,786,749.11	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	209,760,861.23	46.30
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	19,033,896.00	4.20
G	交通运输、仓储和邮政业	60,357,259.90	13.32
H	住宿和餐饮业	28,626,296.00	6.32
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,639,634.80	1.91
J	金融业	-	-
K	房地产业	34,074,753.59	7.52
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	14,134,683.20	3.12
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	39,964,466.12	8.82
S	综合	-	-
	合计	414,591,850.84	91.52

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	600136	道博股份	640,867	39,964,466.12	8.82
2	600630	龙头股份	1,095,164	32,504,467.52	7.17
3	600754	锦江股份	557,800	28,626,296.00	6.32
4	002425	凯撒股份	975,400	28,276,846.00	6.24
5	002348	高乐股份	1,608,064	28,189,361.92	6.22
6	600650	锦江投资	581,135	26,581,114.90	5.87
7	000002	万 科 A	900,113	21,989,760.59	4.85
8	300242	明家科技	430,200	21,492,792.00	4.74
9	002284	亚太股份	948,362	19,612,126.16	4.33
10	000705	浙江震元	1,014,600	19,033,896.00	4.20

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	002348	高乐股份	92,007,949.65	22.68
2	600038	中直股份	83,844,763.13	20.67
3	002268	卫 士 通	81,881,061.50	20.18
4	002439	启明星辰	71,145,449.67	17.54
5	000002	万 科 A	70,209,344.10	17.31
6	601288	农业银行	68,625,992.59	16.92
7	600446	金证股份	67,601,308.46	16.66
8	002657	中科金财	67,369,299.87	16.61
9	002243	通产丽星	63,428,610.98	15.64

10	002227	奥 特 迅	60,526,676.48	14.92
11	600391	成发科技	59,733,354.60	14.72
12	002425	凯撒股份	58,186,452.57	14.34
13	300027	华谊兄弟	57,986,500.34	14.29
14	601166	兴业银行	55,307,916.83	13.63
15	002090	金智科技	54,664,807.11	13.48
16	000060	中金岭南	51,990,384.50	12.82
17	600650	锦江投资	51,828,917.93	12.78
18	600630	龙头股份	51,004,657.02	12.57
19	600136	道博股份	50,916,719.18	12.55
20	300247	乐金健康	50,261,316.50	12.39
21	002614	蒙发利	45,642,715.24	11.25
22	600754	锦江股份	45,443,689.40	11.20
23	601009	南京银行	43,969,393.52	10.84
24	300183	东软载波	43,967,271.53	10.84
25	601988	中国银行	41,110,889.29	10.13
26	002177	御银股份	41,074,040.25	10.13
27	600115	东方航空	41,048,719.59	10.12
28	300104	乐视网	40,939,343.04	10.09
29	000802	北京文化	39,278,518.02	9.68
30	300147	香雪制药	38,811,071.34	9.57
31	600536	中国软件	38,549,979.50	9.50
32	600662	强生控股	38,224,681.18	9.42
33	002458	益生股份	37,661,869.48	9.28
34	002327	富安娜	35,634,496.52	8.78
35	601186	中国铁建	34,940,953.80	8.61
36	300352	北信源	33,796,285.08	8.33
37	300329	海伦钢琴	33,755,703.67	8.32
38	300160	秀强股份	33,395,915.91	8.23
39	600645	中源协和	30,632,159.50	7.55
40	000503	海虹控股	28,902,226.23	7.12
41	601668	中国建筑	28,757,961.00	7.09
42	600029	南方航空	28,155,442.54	6.94
43	300085	银之杰	27,079,287.20	6.68
44	002329	皇氏集团	27,039,140.00	6.67
45	600993	马应龙	26,987,825.70	6.65
46	601628	中国人寿	26,252,096.63	6.47
47	300242	明家科技	25,954,827.21	6.40
48	002146	荣盛发展	25,939,376.48	6.39
49	300287	飞利信	25,863,075.88	6.38
50	600358	国旅联合	25,731,354.78	6.34
51	600422	昆药集团	25,564,919.82	6.30
52	000056	皇庭国际	24,732,635.40	6.10
53	601818	光大银行	23,968,840.00	5.91

54	300018	中元华电	23,764,075.48	5.86
55	300253	卫宁健康	23,351,281.79	5.76
56	002111	威海广泰	23,218,265.35	5.72
57	300030	阳普医疗	22,795,785.45	5.62
58	300056	三维丝	22,792,235.74	5.62
59	601888	中国国旅	22,572,467.40	5.56
60	300188	美亚柏科	22,520,487.35	5.55
61	300369	绿盟科技	22,229,883.00	5.48
62	600016	民生银行	21,612,126.95	5.33
63	000547	航天发展	21,606,438.59	5.33
64	002276	万马股份	21,353,530.44	5.26
65	300096	易联众	20,883,158.76	5.15
66	600476	湘邮科技	20,356,220.00	5.02
67	300059	东方财富	20,254,135.00	4.99
68	603019	中科曙光	19,806,761.51	4.88
69	600976	健民集团	19,529,179.10	4.81
70	000705	浙江震元	19,457,598.73	4.80
71	300273	和佳股份	19,322,295.38	4.76
72	002308	威创股份	19,164,744.01	4.72
73	002456	欧菲光	18,971,278.00	4.68
74	002407	多氟多	18,716,078.66	4.61
75	300246	宝莱特	18,613,925.78	4.59
76	300144	宋城演艺	18,510,063.72	4.56
77	300170	汉得信息	18,496,812.18	4.56
78	300238	冠昊生物	17,768,547.15	4.38
79	300046	台基股份	17,183,404.59	4.24
80	002256	彩虹精化	17,170,135.81	4.23
81	300275	梅安森	17,102,975.70	4.22
82	002236	大华股份	16,996,397.47	4.19
83	300141	和顺电气	16,883,310.65	4.16
84	002587	奥拓电子	16,849,572.59	4.15
85	601599	鹿港科技	16,793,136.81	4.14
86	600343	航天动力	16,644,752.77	4.10
87	600048	保利地产	16,455,759.29	4.06
88	002284	亚太股份	16,454,326.54	4.06
89	600757	长江传媒	16,419,830.58	4.05
90	002508	老板电器	16,413,863.90	4.05
91	300442	普丽盛	16,333,958.12	4.03
92	300086	康芝药业	16,332,772.01	4.03
93	600111	北方稀土	16,301,880.36	4.02
94	601390	中国中铁	16,296,853.51	4.02
95	601111	中国国航	16,117,505.00	3.97
96	002219	恒康医疗	16,111,796.01	3.97
97	601377	兴业证券	16,035,918.62	3.95

98	601901	方正证券	16,027,017.40	3.95
99	600310	桂东电力	15,987,761.00	3.94
100	002405	四维图新	15,892,604.86	3.92
101	600895	张江高科	15,614,322.00	3.85
102	000661	长春高新	15,544,388.00	3.83
103	002245	澳洋顺昌	15,512,073.00	3.82
104	300335	迪森股份	15,501,070.60	3.82
105	002562	兄弟科技	15,430,934.00	3.80
106	000960	锡业股份	15,319,850.34	3.78
107	300178	腾邦国际	15,232,050.56	3.75
108	002234	民和股份	15,027,703.78	3.70
109	000821	京山轻机	15,020,562.00	3.70
110	600172	黄河旋风	15,006,854.20	3.70
111	002184	海得控制	14,982,081.14	3.69
112	601311	骆驼股份	14,957,039.00	3.69
113	000801	四川九洲	14,926,546.62	3.68
114	002507	涪陵榨菜	14,715,837.06	3.63
115	600640	号百控股	14,686,766.98	3.62
116	000587	金叶珠宝	14,659,477.08	3.61
117	002030	达安基因	14,576,573.09	3.59
118	000718	苏宁环球	14,544,646.35	3.59
119	600570	恒生电子	14,517,316.00	3.58
120	600716	凤凰股份	14,505,568.00	3.58
121	300465	高伟达	14,495,682.58	3.57
122	300043	互动娱乐	14,459,078.44	3.56
123	002445	中南重工	14,373,800.94	3.54
124	600028	中国石化	14,129,010.80	3.48
125	002381	双箭股份	14,110,512.10	3.48
126	000009	中国宝安	14,083,110.00	3.47
127	300314	戴维医疗	14,080,177.94	3.47
128	002023	海特高新	14,064,207.08	3.47
129	002566	益盛药业	14,018,499.42	3.46
130	002033	丽江旅游	13,973,299.32	3.44
131	300312	邦讯技术	13,648,301.25	3.36
132	300068	南都电源	13,612,702.06	3.36
133	002247	帝龙新材	13,596,859.00	3.35
134	601857	中国石油	13,464,497.80	3.32
135	300212	易华录	13,181,196.40	3.25
136	600497	驰宏锌锗	12,953,771.05	3.19
137	002224	三力士	12,734,905.00	3.14
138	002631	德尔未来	12,554,431.10	3.09
139	000628	高新发展	12,504,703.93	3.08
140	002646	青青稞酒	12,456,007.39	3.07
141	300186	大华农	12,265,136.80	3.02

142	000988	华工科技	12,237,477.00	3.02
143	002175	东方网络	12,099,214.60	2.98
144	002124	天邦股份	12,095,409.08	2.98
145	300384	三联虹普	11,906,155.00	2.93
146	002519	银河电子	11,845,235.09	2.92
147	300006	莱美药业	11,797,275.66	2.91
148	000800	一汽轿车	11,714,289.65	2.89
149	600436	片仔癀	11,709,129.62	2.89
150	300326	凯利泰	11,672,561.38	2.88
151	300331	苏大维格	11,643,046.56	2.87
152	002262	恩华药业	11,600,221.82	2.86
153	600829	人民同泰	11,597,575.78	2.86
154	002599	盛通股份	11,588,306.83	2.86
155	000970	中科三环	11,523,666.62	2.84
156	601939	建设银行	11,488,134.00	2.83
157	600837	海通证券	11,481,261.98	2.83
158	300388	国祯环保	11,436,825.93	2.82
159	000858	五 粮 液	11,379,754.90	2.81
160	002658	雪迪龙	11,217,556.80	2.77
161	000671	阳 光 城	10,500,376.92	2.59
162	601006	大秦铁路	10,281,441.00	2.53
163	600511	国药股份	10,271,762.74	2.53
164	300284	苏交科	10,226,834.49	2.52
165	002178	延华智能	10,218,080.92	2.52
166	000400	许继电气	10,075,870.00	2.48
167	000971	高升控股	10,026,275.90	2.47
168	002142	宁波银行	9,963,964.00	2.46
169	000523	广州浪奇	9,936,823.10	2.45
170	600080	金花股份	9,936,454.16	2.45
171	000977	浪潮信息	9,867,178.72	2.43
172	600015	华夏银行	9,811,794.00	2.42
173	600979	广安爱众	9,765,932.04	2.41
174	300295	三六五网	9,680,789.00	2.39
175	002156	通富微电	9,391,725.00	2.32
176	600381	青海春天	9,227,945.45	2.27
177	600359	新农开发	9,216,880.42	2.27
178	600969	郴电国际	9,128,707.40	2.25
179	000100	TCL 集团	9,011,805.00	2.22
180	600855	航天长峰	8,959,554.20	2.21
181	600880	博瑞传播	8,815,366.00	2.17
182	002573	清新环境	8,814,927.00	2.17
183	300318	博晖创新	8,787,571.62	2.17
184	002299	圣农发展	8,641,110.54	2.13
185	603885	吉祥航空	8,402,892.00	2.07

186	600118	中国卫星	8,307,140.56	2.05
187	002191	劲嘉股份	8,287,923.40	2.04
188	002179	中航光电	8,257,092.00	2.04

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	600446	金证股份	90,914,112.12	22.41
2	600038	中直股份	89,184,161.63	21.98
3	002657	中科金财	86,492,717.23	21.32
4	002268	卫 士 通	80,439,212.17	19.83
5	002439	启明星辰	78,567,975.13	19.37
6	002348	高乐股份	76,300,885.02	18.81
7	601288	农业银行	68,056,293.98	16.78
8	600391	成发科技	67,315,573.18	16.59
9	002227	奥 特 迅	62,470,762.26	15.40
10	000002	万 科 A	59,255,728.81	14.61
11	601166	兴业银行	56,622,536.87	13.96
12	300183	东软载波	56,412,734.21	13.91
13	002243	通产丽星	56,401,762.87	13.90
14	300027	华谊兄弟	55,391,201.90	13.65
15	002090	金智科技	52,238,440.53	12.88
16	002614	蒙发利	50,485,210.01	12.45
17	600650	锦江投资	49,221,606.92	12.13
18	002177	御银股份	47,246,893.89	11.65
19	300329	海伦钢琴	46,017,287.76	11.34
20	000802	北京文化	45,834,884.50	11.30
21	601009	南京银行	45,339,665.60	11.18
22	000060	中金岭南	44,620,007.90	11.00
23	603019	中科曙光	43,372,954.67	10.69
24	601988	中国银行	40,866,268.35	10.07
25	300104	乐视网	40,336,197.91	9.94
26	002458	益生股份	40,047,097.89	9.87
27	600115	东方航空	39,522,872.17	9.74
28	300369	绿盟科技	39,350,961.39	9.70
29	300247	乐金健康	38,905,748.69	9.59
30	002329	皇氏集团	38,672,587.35	9.53
31	600136	道博股份	37,181,804.45	9.17
32	601186	中国铁建	36,980,985.02	9.12

33	600645	中源协和	36,211,491.94	8.93
34	300352	北信源	34,722,326.18	8.56
35	300170	汉得信息	31,162,960.53	7.68
36	300030	阳普医疗	30,973,354.68	7.64
37	300287	飞利信	30,642,878.61	7.55
38	300018	中元华电	29,804,402.79	7.35
39	601668	中国建筑	28,995,821.87	7.15
40	002425	凯撒股份	28,976,898.49	7.14
41	600029	南方航空	28,957,050.00	7.14
42	300147	香雪制药	28,803,712.37	7.10
43	600993	马应龙	28,362,867.85	6.99
44	002327	富安娜	28,122,161.38	6.93
45	300056	三维丝	27,633,174.38	6.81
46	002407	多氟多	27,545,188.21	6.79
47	600511	国药股份	26,212,058.92	6.46
48	002308	威创股份	26,129,622.77	6.44
49	601628	中国人寿	25,981,215.46	6.40
50	002111	威海广泰	25,861,170.13	6.38
51	000587	金叶珠宝	25,536,086.22	6.29
52	000776	广发证券	25,487,466.31	6.28
53	300248	新开普	25,446,266.15	6.27
54	601377	兴业证券	24,884,142.66	6.13
55	601818	光大银行	24,541,901.72	6.05
56	600358	国旅联合	24,484,411.17	6.04
57	300144	宋城演艺	24,435,606.87	6.02
58	002178	延华智能	24,036,565.96	5.93
59	000728	国元证券	23,942,307.72	5.90
60	000547	航天发展	23,900,306.42	5.89
61	300178	腾邦国际	23,876,306.31	5.89
62	300085	银之杰	23,770,223.61	5.86
63	300253	卫宁健康	23,628,353.50	5.82
64	300159	新研股份	23,541,643.72	5.80
65	300314	戴维医疗	23,030,981.00	5.68
66	000503	海虹控股	22,751,243.50	5.61
67	600662	强生控股	22,660,079.28	5.59
68	600536	中国软件	22,654,116.50	5.58
69	000718	苏宁环球	22,281,230.02	5.49
70	601318	中国平安	22,024,922.80	5.43
71	300160	秀强股份	21,887,242.65	5.40
72	600016	民生银行	21,800,615.92	5.37
73	600757	长江传媒	21,604,229.08	5.33
74	300273	和佳股份	21,535,048.57	5.31
75	002142	宁波银行	21,392,473.00	5.27
76	300246	宝莱特	21,181,249.28	5.22

77	600837	海通证券	21,139,172.92	5.21
78	000056	皇庭国际	21,136,239.80	5.21
79	601888	中国国旅	21,133,327.51	5.21
80	000671	阳光城	21,073,261.63	5.19
81	600422	昆药集团	20,829,289.88	5.13
82	002276	万马股份	20,798,833.65	5.13
83	000661	长春高新	20,483,282.99	5.05
84	002236	大华股份	20,201,393.26	4.98
85	600976	健民集团	19,739,623.93	4.87
86	002089	新海宜	19,642,179.31	4.84
87	002456	欧菲光	19,556,563.40	4.82
88	300059	东方财富	18,923,120.70	4.66
89	002445	中南重工	18,397,963.00	4.54
90	300046	台基股份	18,355,396.00	4.52
91	600630	龙头股份	18,107,685.51	4.46
92	002219	恒康医疗	17,968,116.34	4.43
93	600343	航天动力	17,817,227.52	4.39
94	002508	老板电器	17,792,331.67	4.39
95	601336	新华保险	17,606,158.82	4.34
96	300096	易联众	17,472,908.00	4.31
97	601599	鹿港科技	17,324,568.04	4.27
98	002256	彩虹精化	17,245,652.00	4.25
99	600031	三一重工	16,660,721.19	4.11
100	300326	凯利泰	16,651,554.55	4.10
101	300238	冠昊生物	16,622,302.56	4.10
102	300275	梅安森	16,582,576.61	4.09
103	300086	康芝药业	16,557,718.06	4.08
104	002566	益盛药业	16,523,792.97	4.07
105	300188	美亚柏科	16,428,732.35	4.05
106	000801	四川九洲	15,936,514.20	3.93
107	002247	帝龙新材	15,924,950.50	3.93
108	300335	迪森股份	15,869,000.42	3.91
109	600310	桂东电力	15,817,842.40	3.90
110	601111	中国国航	15,454,111.50	3.81
111	600476	湘邮科技	15,441,393.56	3.81
112	300043	互动娱乐	15,195,958.19	3.75
113	601390	中国中铁	15,150,735.60	3.73
114	601311	骆驼股份	15,150,691.00	3.73
115	002587	奥拓电子	15,142,920.70	3.73
116	600399	抚顺特钢	15,117,769.24	3.73
117	600895	张江高科	15,016,136.71	3.70
118	600111	北方稀土	15,013,842.12	3.70
119	600048	保利地产	14,887,023.92	3.67
120	002562	兄弟科技	14,821,848.23	3.65

121	000821	京山轻机	14,600,104.02	3.60
122	002030	达安基因	14,392,441.46	3.55
123	300465	高伟达	14,307,670.00	3.53
124	600754	锦江股份	14,253,989.47	3.51
125	002234	民和股份	14,189,775.71	3.50
126	300312	邦讯技术	14,181,089.80	3.50
127	000960	锡业股份	14,161,339.40	3.49
128	002184	海得控制	14,131,109.33	3.48
129	600570	恒生电子	14,041,281.55	3.46
130	600172	黄河旋风	14,016,757.00	3.46
131	600640	号百控股	13,972,630.00	3.44
132	002023	海特高新	13,953,991.56	3.44
133	300212	易华录	13,894,543.32	3.43
134	601857	中国石油	13,889,754.66	3.42
135	300295	三六五网	13,877,099.98	3.42
136	002673	西部证券	13,725,307.37	3.38
137	601901	方正证券	13,506,660.40	3.33
138	000971	高升控股	13,464,962.10	3.32
139	600028	中国石化	13,283,464.00	3.27
140	600716	凤凰股份	13,198,726.64	3.25
141	002381	双箭股份	13,031,304.98	3.21
142	002589	瑞康医药	13,010,414.48	3.21
143	600979	广安爱众	12,887,197.28	3.18
144	002124	天邦股份	12,842,527.71	3.17
145	000523	广州浪奇	12,774,582.74	3.15
146	300186	大华农	12,681,333.68	3.13
147	000009	中国宝安	12,660,518.80	3.12
148	002507	涪陵榨菜	12,629,909.80	3.11
149	300284	苏交科	12,508,795.38	3.08
150	000970	中科三环	12,498,349.15	3.08
151	000628	高新发展	12,476,093.31	3.08
152	600999	招商证券	12,394,480.04	3.06
153	000800	一汽轿车	12,327,509.50	3.04
154	000425	徐工机械	12,006,081.32	2.96
155	600436	片仔癀	11,892,056.06	2.93
156	601688	华泰证券	11,858,888.00	2.92
157	600497	驰宏锌锗	11,785,967.27	2.91
158	002262	恩华药业	11,732,123.47	2.89
159	000988	华工科技	11,609,797.52	2.86
160	601100	恒立油缸	11,551,484.22	2.85
161	002599	盛通股份	11,469,685.00	2.83
162	300006	莱美药业	11,453,661.32	2.82
163	000797	中国武夷	11,103,781.00	2.74
164	002175	东方网络	11,065,544.16	2.73

165	300331	苏大维格	11,034,546.94	2.72
166	600829	人民同泰	10,870,579.71	2.68
167	601939	建设银行	10,803,466.00	2.66
168	300388	国祯环保	10,718,867.07	2.64
169	002646	青青稞酒	10,657,028.61	2.63
170	000400	许继电气	10,621,788.88	2.62
171	002698	博实股份	10,447,586.90	2.58
172	002146	荣盛发展	10,434,526.70	2.57
173	600010	包钢股份	10,332,740.00	2.55
174	002191	劲嘉股份	10,275,465.68	2.53
175	600118	中国卫星	10,192,483.90	2.51
176	002658	雪迪龙	9,970,292.16	2.46
177	600381	青海春天	9,907,454.42	2.44
178	300274	阳光电源	9,895,644.50	2.44
179	603885	吉祥航空	9,723,359.00	2.40
180	000758	中色股份	9,472,221.81	2.34
181	600969	郴电国际	9,426,440.46	2.32
182	600080	金花股份	9,355,488.20	2.31
183	300318	博晖创新	9,339,983.12	2.30
184	600855	航天长峰	9,335,083.60	2.30
185	300141	和顺电气	9,314,956.18	2.30
186	000558	莱茵体育	9,297,735.24	2.29
187	002412	汉森制药	9,245,601.80	2.28
188	300442	普丽盛	9,200,050.34	2.27
189	000977	浪潮信息	9,053,218.76	2.23
190	002519	银河电子	9,049,949.14	2.23
191	000858	五 粮 液	9,032,113.50	2.23
192	601006	大秦铁路	9,023,881.10	2.22
193	600359	新农开发	9,009,784.00	2.22
194	600428	中远航运	8,922,955.42	2.20
195	002156	通富微电	8,877,931.74	2.19
196	600015	华夏银行	8,847,436.27	2.18
197	300377	赢时胜	8,617,739.64	2.12
198	002573	清新环境	8,455,592.00	2.08
199	300384	三联虹普	8,440,735.00	2.08
200	600880	博瑞传播	8,430,694.00	2.08
201	002612	朗姿股份	8,419,406.70	2.08
202	000915	山大华特	8,381,104.76	2.07
203	600158	中体产业	8,211,720.00	2.02

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	4,739,717,206.72
卖出股票的收入（成交）总额	4,977,811,695.99

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。

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**

本基金报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无

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

无

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

无

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金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	902,336.23
2	应收证券清算款	9,235,535.74
3	应收股利	-
4	应收利息	12,555.78
5	应收申购款	394,636.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,545,064.54

8.12.4 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	000002	万 科 A	21,989,760.59	4.85	重大事项
2	300242	明家科技	21,492,792.00	4.74	重大事项

8.12.5 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
22,313	14,088.90	8,969,375.59	2.85%	305,396,184.49	97.15%

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	6,148.00	-

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9.5 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金非发起式基金，本公司未持有基金份额。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2010年12月20日)基金份额总额	2,051,271,200.80
本报告期期初基金份额总额	504,350,594.96
本报告期基金总申购份额	942,757,542.04
减：本报告期基金总赎回份额	1,132,742,576.92
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	314,365,560.08

§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

报告期内公司董事长由刘东先生变更为凌富华先生，相关事项已于 2015 年 1 月 10 日进行了信息披露。

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 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	
中泰（齐鲁）证券	2	93,053,572.33	0.96%	84,742.83	1.00%	-
东兴证券	1	88,289,305.26	0.91%	80,232.42	0.95%	-
新时代证券	1	86,435,522.73	0.89%	61,481.76	0.73%	-
德邦证券	1	76,487,546.16	0.79%	54,405.84	0.64%	-
长江证券	1	662,573,220.53	6.82%	595,170.48	7.03%	-
东方证券	1	628,998,210.32	6.47%	559,581.50	6.61%	-
银河证券	2	425,066,030.33	4.38%	294,603.17	3.48%	-
东北证券	1	365,807,072.28	3.77%	327,613.29	3.87%	-

广州证券	1	35,859,819.28	0.37%	32,277.03	0.38%	-
国泰君安	1	338,430,570.15	3.48%	314,738.64	3.72%	-
中投证券	1	330,737,041.29	3.40%	226,522.19	2.68%	-
华林证券	1	281,711,677.99	2.90%	256,723.54	3.03%	-
平安证券	1	252,911,117.61	2.60%	179,895.40	2.13%	-
民生证券	1	227,306,454.57	2.34%	201,143.03	2.38%	-
方正证券	2	206,665,378.12	2.13%	186,209.07	2.20%	-
国信证券	1	1,890,552,775.33	19.46%	1,699,092.35	20.07%	-
华安证券	1	14,599,034.98	0.15%	10,384.23	0.12%	-
首创证券	1	14,431,227.00	0.15%	10,264.91	0.12%	-
财达证券	1	129,092,755.42	1.33%	117,642.40	1.39%	-
联讯证券	1	1,212,794,646.53	12.48%	1,085,167.37	12.82%	-
民族证券	1	12,107,220.91	0.12%	8,611.87	0.10%	-
长城证券	1	106,973,955.30	1.10%	76,090.44	0.90%	-
安信证券	1	105,356,003.24	1.08%	96,009.98	1.13%	-
中信证券	1	102,961,998.89	1.06%	93,828.87	1.11%	-
西南证券	2	1,024,686,581.81	10.55%	924,064.47	10.92%	-
兴业证券	1	1,001,190,512.21	10.31%	887,996.92	10.49%	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
九州（天源） 证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
中信建投证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	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		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
东兴证券	-	-	56,800,000.00	29.19%	-	-
长江证券	-	-	19,900,000.00	10.23%	-	-
银河证券	-	-	6,100,000.00	3.13%	-	-
方正证券	-	-	69,300,000.00	35.61%	-	-
国信证券	-	-	42,500,000.00	21.84%	-	-

§12 影响投资者决策的其他重要信息

1、根据相关法规及监管部门要求，本基金由股票型变更为混合型，并对本基金全称、简称、类型及基金合同作了相应变更。该变更已于 2015 年 8 月 3 日在证券时报等指定媒体上公告。

2、由于中信标普国债指数即将停止发布，本基金的业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率 X75%+ 中信标普国债指数收益率 X25%”变更为“沪深 300 指数收益率 X75%+中证全债指数收益率 X25%”，故对基金合同等法律文件作了相应修改并依法履行了备案及公告手续。

3、本报告期，本基金原审计机构中审亚太会计师事务所（特殊普通合伙）广东分所已与众环海华会计师事务所（特殊普通合伙）合并为中审众环会计师事务所（特殊普通合伙），经公司第五届董事会第 20 次会议决议通过，旗下相关基金的审计机构由“中审亚太会计师事务所（特殊普通合伙）”

相应变更为中审众环会计师事务所（特殊普通合伙），此项变更已于 2015 年 12 月 31 日在证券时报等指定媒体公告，并按规定向证监会备案。

金鹰基金管理有限公司

二〇一六年三月三十日