

金鹰保本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	金鹰保本混合
基金主代码	210006
交易代码	210006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 5 月 17 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	50,886,869.47 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	采用改进的固定比例组合保险策略（CPPI），引入收益锁定机制，在严格控制投资风险、保证本金安全的基础上，力争在保本期末结束时，实现基金资产的稳健增值。
投资策略	<p>本基金的保本策略为改进的固定比例组合保险策略（CPPI），是本基金投资运作过程中的核心策略；投资策略采用“自上而下”的投资视角，根据宏观经济与资本市场运行状况、固定收益类与权益类资产风险收益特性、基金净资产、价值底线，定性分析与定量分析并用，灵活动态地选取适当的风险乘数，以期对固定收益类与权益类资产之间的配置额进行优化调节，力争在确保本金安全的前提下，获取投资收益。</p> <p>本基金的股票、权证占基金资产净值的比例为 0%~40%，其中，权证投资的比例范围占基金资产净值的 0%~3%；债券、资产支持证券、货币市场工具、现金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产净值的 60%~100%，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%；此外，在基金合同和法律法规的允许范围内，本基金将积极参与一级市场新股、新债的申购。</p>
业绩比较基准	3 年期银行定期存款利率（税后）

风险收益特征	本基金为积极配置的保本混合型基金，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，但高于货币市场基金。
--------	---

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	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	-413,565.32	2,194,249.36	29,642,634.15
本期利润	469,455.23	12,905,619.43	19,824,221.73
加权平均基金份额本期利润	0.0058	0.0604	0.0479
本期基金份额净值增长率	12.32%	4.99%	3.67%
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	0.1955	0.1375	0.1007
期末基金资产净值	58,482,120.10	109,797,650.54	377,570,777.03

期末基金份额净值	1.149	1.023	1.101
----------	-------	-------	-------

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、本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	3.05%	0.25%	0.72%	0.01%	2.33%	0.24%
过去六个月	4.26%	0.29%	1.54%	0.01%	2.72%	0.28%
过去一年	12.32%	0.32%	3.47%	0.01%	8.85%	0.31%
过去三年	22.26%	0.22%	12.75%	0.01%	9.51%	0.21%
成立至今	29.84%	0.19%	21.93%	0.01%	7.91%	0.18%

注：本基金的业绩比较基准为 3 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

金鹰保本混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2011 年 5 月 17 日至 2015 年 12 月 31 日)

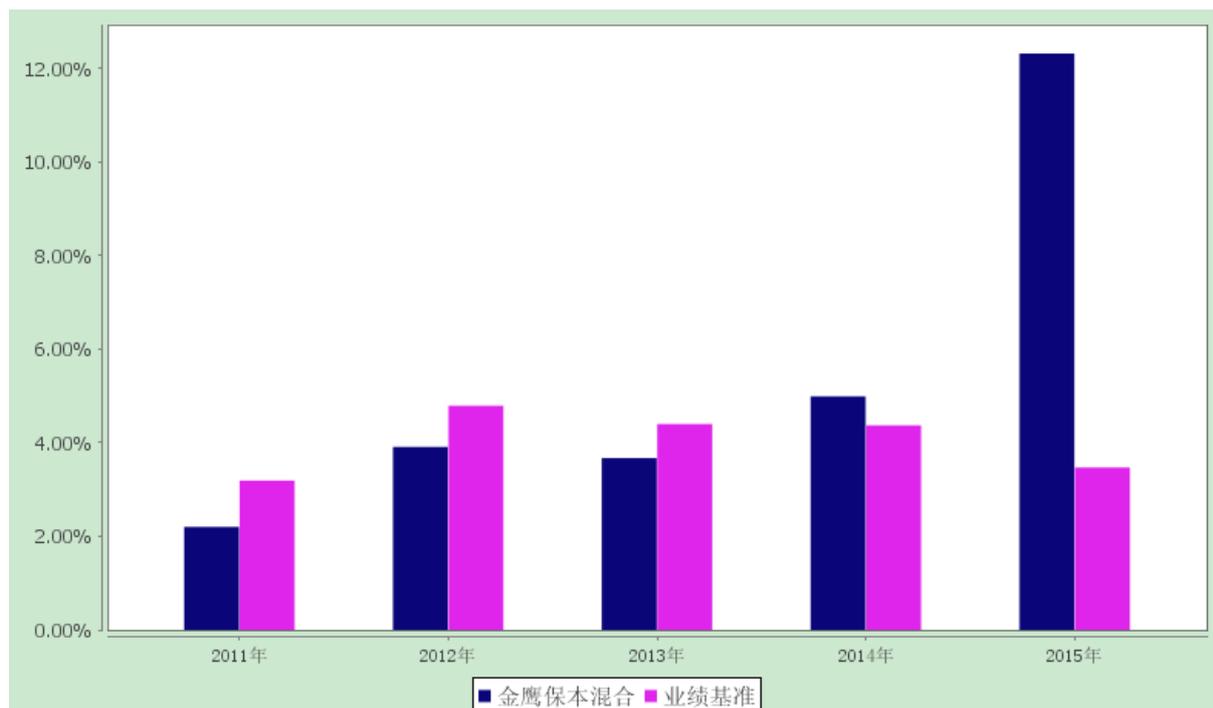


注：1、截至报告日本基金各项投资比例符合基金合同规定的各项比例，即股票、权证占基金资产净值的比例为 0%~40%，其中，权证投资的比例范围占基金资产净值的 0%~3%；债券、资产支持证券、货币市场工具、现金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产净值的 60%~100%，其中，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；此外，在基金合同和法律法规的允许范围内，本基金将积极参与一级市场新股、新债的申购。2、本基金的业绩比较基准为 3 年期银行定期存款利率（税后）。

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；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		
倪超	基金经理	2015-08-13	-	7	倪超先生,厦门大学硕士研究生。2009 年 6 月加盟金鹰基金管理有限公司,先后任行业研究员,消费品研究小组组长、基金经理助理。现任金鹰行业优势混合型证券投资基金、金鹰保本混合型证

					券投资基金基金经理。
李涛	固定收益部 副总监、基金 经理	2015-01-09	-	11	李涛先生,北京大学金融学硕士。历任光大银行总行资金部货币市场自营投资业务主管、中银国际证券研究部宏观研究员、广州证券资产管理总部投研总监。2014年11月加入金鹰基金管理有限公司。现任金鹰保本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)、金鹰元安保本混合型证券投资基金、金鹰元丰保本混合型证券投资基金、金鹰灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
洪利平	基金经理	2013-04-12	2015-08-13	7	洪利平女士,西南财经大学硕士,证券从业年限4年,曾任职于生命人寿保险股份有限公司,任债券交易员;2010年7月加入金鹰基金管理有限公司,先后担任研究员和基金经理。

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;

3、本基金于2015年1月9日增聘李涛先生为基金经理,本基金原基金经理洪利平于2015年8月13日离任,同日聘任倪超先生担任本基金的基金经理,并由李涛先生和倪超先生共同管理本基金。

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 年经济增速低位企稳，GDP 全年 6.9%，四个季度环比分别为 1.3%，1.9%，1.8%，1.6%，其中 2 季度环比改善明显受到金融行业贡献较多，而工业增加值基本上在 6% 附近上下波动；CPI 全年均值 1.45%，季调环比来看，除 6-8 月份略有回升之外，其余多数月份都表现出通缩迹象；PPI 从 2014 年 1 月份开始已经连续 24 个月环比下滑，工业去库存持续。央行年内进行五次降准降息，一年期基准存款利率从 2.75% 下调至 1.5%，大型存款类金融机构法定存款准备金率从 20% 下降至 17%。

债券市场，全年市场走势可以分为三个阶段：1、上半年国债利率整体呈现上行趋势，由于股票市场行情火爆，各种分层配资的资金收益率水平大致在 6%-8% 水平，拉高了整体的债券收益率水平，10 年期国开利率从年初的 3.8% 附近最高上探 4.2%，6 月初仍在 4% 以上；但在央行 4 月份大幅降准并降息后，资金面明显宽松，出现一波利率下行行情，约 50bp；2、下半年随着 IPO 的暂停，各种

配资回流债券市场，同时地产销售、汽车销售等在 7、8 月份也出现了明显的下滑，工业生产的新一轮去库存展开，利率水平持续下行，10 年期国开利率最低下探 3.4%，下行 60bp。但随着 IPO 在 11 月初的重启，大约有 6000-8000 亿的资金重回流入打新市场，引起利率的短期回升，幅度约 20bp；3、12 月份之后，随着中央对去产能的态度逐渐明朗，市场对经济下滑的预期进一步增强，利率展开新一轮下行，至 2016 年 1 月，国开利率跌至 3%，下行幅度超过 50bp。

股票市场全年大幅波动。上半年延续 2014 年 11 月份之后的涨势，但随着市场去杠杆的展开，6 月中旬之后出现快速下跌行情。8 月份随着对人民币贬值预期的强化，出现新一轮下跌行情。10 月份之后市场逐步企稳，并在 11 月份重启 IPO，市场回到正常运行状态。

全年来看，本基金上半年在参与股票市场的上涨行情中保持谨慎，权益仓位维持中性，因此全年收益水平略低，但在 7 月份 IPO 暂停之后，加大了债券投资力度，抓住了下半年的债券行情。

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 1.149 元，本报告期份额净值增长率为 12.32%，同期业绩比较基准增长率为 3.47%，基金业绩表现超越比较基准 8.85%。

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 2016 年：地产销售 2015 年恢复性增长，但面对全国范围的地产高库存形势，央行在 2016 年初调低了住房抵押贷款首付比例，住建部推行居民搬迁的货币或配置，共同推动地产的去库存，但面对历史高位的库存状况，地产投资预计仍将低位运行；国务院积极推动两高一资过剩产业的去产能进程，供给侧改革在短期内对工业产出的增长会带来一定压力，预计工业增加值增速或将维持在 6% 水平运行；2015 年 M2 增长 13.6%，远超年初计划目标，2016 年为稳定经济增速，将维持信贷和货币增速稳定，而大宗商品 2016 年初以来出现反弹趋势，通胀预期有所回升，预计全年通胀水平将高于 2015 年，但受制于经济整体仍然低迷，不会出现快速攀升，预计全年均值将在 2% 以下；美联储已经进入加息周期，美联储第二次加息的时点将推动市场校正全年加息幅度预期，从而决定年内人民币贬值压力大小，将在很大程度上制约货币政策宽松力度，对金融市场流动性水平和实体经济的信用扩张力度都会产生重大影响。

债券市场方面：作为十三五开局之年，财政支出仍将成为稳定经济增长的主要力量，预计 16 年全年债券发行将以政府信用为主，国债、地方债和金融债、专项金融债等发行规模有望达到 10-12 万亿；同时随着去产能加速和信用事件的频繁发生，低等级信用利差则会进一步扩大。但从债券配置需求来说，一方面股市的波动性提高，导致居民风险偏好下降；另一方面大量非标资产到期和资本回报率的持续下降，固定收益类理财产品利率水平仍将在 16 年 1 季度加速下行；虽然债券收益率

水平处于低位，但居民资产配置回流固定收益类资产的过程并未结束，配置需求仍然将追逐安全债券的稳定收益，中高等级信用利差仍将保持历史低位。债市投资在 2016 年 1 季度仍可获得稳定的收益。

股票市场则预计呈现指数宽幅震荡的行情，但个股投资机会仍可把握。中小创股票是中国经济持续增长的动力来源，但目前整体估值水平仍然偏高，同时春节前后新股发行也将回归常态化，中小创指数预计将承受较大的下行压力。必需消费品、制造业细分龙头、水电燃气、交通等股息率稳定的二线蓝筹在整体利率水平处于低位的情况下，具备一定的配置价值。

基于以上判断，本基金在 2016 年将采取积极稳健的投资策略：债券投资维持中性配置，组合维持中短久期和适度杠杆的策略；积极参与新股申购，提升组合整体收益水平；在股票投资则仍将采取绝对收益的策略，灵活调整仓位，捕捉波段性交易机会，个股选择侧重于有业绩支撑的白马股票和国企改革预期确定带来基本面改善的股票。

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保本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）050126 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：金鹰保本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	1,848,660.53	353,539.78
结算备付金	130,347.56	935,851.58
存出保证金	59,438.81	8,873.45
交易性金融资产	56,180,793.82	111,459,193.00
其中：股票投资	8,869,291.82	13,870,045.00
基金投资	-	-
债券投资	47,311,502.00	97,589,148.00
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	-	3,251,071.04
应收利息	1,168,904.22	1,893,347.32
应收股利	-	-
应收申购款	90,425.08	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	59,478,570.02	117,901,876.17
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	-	3,600,000.00
应付证券清算款	24,203.02	3,190,082.47
应付赎回款	51,657.02	481,402.82
应付管理人报酬	59,027.81	116,690.10
应付托管费	9,837.97	19,448.36
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	55,732.94	36,541.96
应交税费	203,866.10	203,866.10
应付利息	-	1,054.56
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	592,125.06	455,139.26
负债合计	996,449.92	8,104,225.63
所有者权益：	-	-
实收基金	45,032,336.57	95,019,178.52
未分配利润	13,449,783.53	14,778,472.02
所有者权益合计	58,482,120.10	109,797,650.54
负债和所有者权益总计	59,478,570.02	117,901,876.17

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2987 元，基金份额总额 45,032,336.57 份。

7.2 利润表

会计主体：金鹰保本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	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
一、收入	2,704,852.29	17,254,828.17
1.利息收入	3,605,141.99	10,812,303.78
其中：存款利息收入	129,527.19	271,760.62

债券利息收入	3,376,226.55	8,499,316.89
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	99,388.25	2,041,226.27
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-2,754,134.75	-4,411,577.63
其中：股票投资收益	-3,721,352.03	-1,215,603.08
基金投资收益	-	-
债券投资收益	953,105.28	-3,357,959.43
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	14,112.00	161,984.88
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	883,020.55	10,711,370.07
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	970,824.50	142,731.95
减：二、费用	2,235,397.06	4,349,208.74
1. 管理人报酬	1,055,832.22	2,566,780.65
2. 托管费	175,972.07	427,796.68
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	558,030.20	168,077.36
5. 利息支出	112,836.78	780,070.48
其中：卖出回购金融资产支出	112,836.78	780,070.48
6. 其他费用	332,725.79	406,483.57
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	469,455.23	12,905,619.43
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	469,455.23	12,905,619.43

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金鹰保本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）	95,019,178.52	14,778,472.02	109,797,650.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	469,455.23	469,455.23
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）	-49,986,841.95	-1,798,143.72	-51,784,985.67
其中：1.基金申购款	216,021,223.22	54,439,766.09	270,460,989.31
2.基金赎回款	-266,008,065.17	-56,237,909.81	-322,245,974.98
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）	45,032,336.57	13,449,783.53	58,482,120.10
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）	343,035,958.74	34,534,818.29	377,570,777.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本	-	12,905,619.43	12,905,619.43

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)	-248,016,780.22	-32,661,965.70	-280,678,745.92
其中：1.基金申购款	3,652,262.67	490,671.46	4,142,934.13
2.基金赎回款	-251,669,042.89	-33,152,637.16	-284,821,680.05
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)	95,019,178.52	14,778,472.02	109,797,650.54

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

金鹰保本混合型证券投资基金(简称“本基金”), 经中国证券监督管理委员会(简称“中国证监会”)基金部函[2011]315 号文《关于金鹰保本混合型证券投资基金备案确认的函》批准, 于 2011 年 5 月 17 日募集成立。本基金为契约型开放式, 存续期限不定, 保本周期为 3 年, 第一个保本周期自 2011 年 5 月 17 日起至 2014 年 5 月 19 日止。保证人为广州越秀金融控股集团有限公司, 基金第一个保本周期届满时, 在符合保本基金存续条件下, 本基金继续存续并进入下一保本周期, 该保本周期的具体起讫日期、保本和担保安排以本基金管理人届时公告为准。本基金第一个保本周期到期日为 2014 年 5 月 19 日, 第二个保本周期为 3 年, 起始日为 2014 年 6 月 21 日, 到期日为 2017 年 6 月 21 日。第二个保本周期由广州越秀金融控股集团有限公司提供不可撤销的连带责任保证。基金首次设立募集规模为 933,906,638.28 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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《金鹰保本混合型证券投资基金基金合同》的有关

规定，本基金可投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。股票、权证占基金净资产的比例为 0%~40%，其中，权证投资的比例范围占基金资产净值的 0%~3%；债券、资产支持证券、货币市场工具、现金、以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金净资产的 60%~100%，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%。此外，在基金合同和法律法规的允许范围内，本基金将积极参与一级市场新股、新债的申购。

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 2015 年度财务报表符合企业会计准则的要求，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。

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

本基金本年度无会计政策变更。

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

本基金本年度无差错更正。

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）交易印花稅调整为单边征税，由出让方按证券（股票）交易印花稅税率繳納印花稅，受讓方不再征收，稅率不变。

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

本基金本年度及上年度可比期间均没有通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	-	-	1,267,014.71	0.38%

注：本基金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

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	-	-	765,800,000.00	9.73%

注：本基金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

本基金本年度及上年度可比期间均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 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	1,055,832.22	2,566,780.65

其中：支付销售机构的客户维护费	399,115.67	1,294,352.56
-----------------	------------	--------------

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“金鹰持续收益债券型证券投资基金”的基金份额，管理费按前一日基金资产净值的 0.75% 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	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
当期发生的基金应支付的托管费	175,972.07	427,796.68

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“金鹰持续收益债券型证券投资基金”的基金份额，托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 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 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可比期间内均没有应支付关联方的销售服务费。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金报告期内及上年度可比期间内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自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自有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末其他关联方未投资本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	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

	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	1,848,660.53	123,126.69	353,539.78	203,584.62

注：本基金清算备付金本年度期末余额 130,347.56 元，清算备付金利息收入 5,717.88 元；上年度可比期间期末余额 935,851.58 元，清算备付金利息收入 67,317.46 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

本基金报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

本基金报告期末无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

本基金报告期末无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	8,869,291.82	14.91
	其中：股票	8,869,291.82	14.91
2	固定收益投资	47,311,502.00	79.54
	其中：债券	47,311,502.00	79.54
	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	1,979,008.09	3.33
7	其他各项资产	1,318,768.11	2.22
8	合计	59,478,570.02	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	5,998,491.82	10.26
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	1,198,000.00	2.05
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,672,800.00	2.86
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	8,869,291.82	15.17

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	000042	中洲控股	80,000	1,672,800.00	2.86
2	002335	科华恒盛	29,950	1,437,600.00	2.46
3	000678	襄阳轴承	100,000	1,241,000.00	2.12
4	000985	大庆华科	39,927	1,224,161.82	2.09

5	000078	海王生物	50,000	1,198,000.00	2.05
6	002061	江山化工	120,000	1,111,200.00	1.90
7	002456	欧菲光	30,000	930,600.00	1.59
8	603800	道森股份	1,000	53,930.00	0.09

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	000651	格力电器	8,852,400.45	8.06
2	600584	长电科技	6,776,411.16	6.17
3	002658	雪迪龙	6,469,718.92	5.89
4	000400	许继电气	5,772,229.66	5.26
5	600690	青岛海尔	5,745,624.17	5.23
6	601336	新华保险	5,731,994.00	5.22
7	002510	天汽模	5,449,863.50	4.96
8	600497	驰宏锌锗	5,412,335.60	4.93
9	600511	国药股份	4,780,861.00	4.35
10	000831	五矿稀土	4,744,286.59	4.32
11	600406	国电南瑞	4,716,626.00	4.30
12	600309	万华化学	4,452,928.00	4.06
13	000402	金融街	4,320,192.87	3.93
14	000880	潍柴重机	4,270,964.76	3.89
15	600348	阳泉煤业	3,959,933.21	3.61
16	600259	广晟有色	3,896,391.03	3.55
17	600597	光明乳业	2,943,812.00	2.68
18	600027	华电国际	2,907,956.00	2.65
19	002385	大北农	2,687,953.10	2.45
20	601798	蓝科高新	2,613,795.60	2.38
21	000001	平安银行	2,492,700.00	2.27
22	000759	中百集团	2,476,048.00	2.26
23	601628	中国人寿	2,285,848.00	2.08

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	000651	格力电器	9,325,636.56	8.49
2	002658	雪迪龙	6,368,712.87	5.80
3	600584	长电科技	5,992,791.00	5.46
4	000048	康达尔	5,961,504.31	5.43
5	600690	青岛海尔	5,916,777.80	5.39
6	000400	许继电气	5,870,205.76	5.35
7	600511	国药股份	5,355,754.22	4.88
8	002630	华西能源	5,322,353.87	4.85
9	601336	新华保险	5,292,332.99	4.82
10	000880	潍柴重机	4,705,749.76	4.29
11	000831	五矿稀土	4,684,093.02	4.27
12	600309	万华化学	4,614,050.26	4.20
13	600497	驰宏锌锗	4,135,388.00	3.77
14	600259	广晟有色	4,022,980.00	3.66
15	600348	阳泉煤业	3,943,023.61	3.59
16	600406	国电南瑞	3,823,281.00	3.48
17	002510	天汽模	3,513,269.86	3.20
18	600027	华电国际	3,132,000.00	2.85
19	000402	金融街	2,742,646.00	2.50
20	601798	蓝科高新	2,683,383.80	2.44
21	600597	光明乳业	2,586,877.00	2.36
22	000759	中百集团	2,566,599.87	2.34
23	002385	大北农	2,504,635.52	2.28
24	601628	中国人寿	2,476,800.00	2.26
25	000001	平安银行	2,438,218.02	2.22
26	601169	北京银行	2,374,751.00	2.16
27	002604	龙力生物	2,321,690.25	2.11

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	185,082,337.25
卖出股票的收入（成交）总额	186,906,290.87

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	30,049,000.00	51.38

2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	17,262,502.00	29.52
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	47,311,502.00	80.90

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	019506	15 国债 06	200,000.00	20,048,000.00	34.28
2	124588	14 济宁债	101,000.00	10,912,040.00	18.66
3	150020	15 付息国债 20	100,000.00	10,001,000.00	17.10
4	124251	13 鲁信投	50,000.00	5,135,000.00	8.78
5	122724	12 攀国投	10,570.00	1,163,757.00	1.99

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	59,438.81
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,168,904.22
5	应收申购款	90,425.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,318,768.11

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
1,319	38,579.89	17,855.71	0.04%	50,869,013.76	99.96%

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	0.00	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

基金合同生效日(2011年5月17日)基金份额总额	933,906,638.28
本报告期期初基金份额总额	107,372,920.57
本报告期基金总申购份额	244,207,563.30
减：本报告期基金总赎回份额	300,693,614.40
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	50,886,869.47

§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。

本报告期内，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 32000 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易 单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股 票成交总 额的比例	佣金	占当期佣 金总量的 比例	
国信证券	1	94,618,136.19	25.44%	85,096.33	25.78%	-
平安证券	1	8,768,320.33	2.36%	6,236.98	1.89%	-
首创证券	1	868,002.09	0.23%	617.35	0.19%	-
长江证券	1	7,699,386.41	2.07%	6,881.81	2.09%	-
中信证券	1	7,427,116.78	2.00%	6,768.36	2.05%	-
联讯证券	1	66,525,121.96	17.89%	58,958.20	17.86%	-
东北证券	1	6,010,681.00	1.62%	5,438.65	1.65%	-
方正证券	2	55,845,993.46	15.02%	49,776.66	15.08%	-
华林证券	1	4,350,167.83	1.17%	3,964.32	1.20%	-
东莞证券	1	32,320,488.76	8.69%	28,600.44	8.67%	-
兴业证券	1	28,688,957.89	7.71%	25,597.31	7.76%	-
安信证券	1	2,383,331.50	0.64%	2,172.00	0.66%	-
德邦证券	1	1,991,536.02	0.54%	1,416.59	0.43%	-
西南证券	2	18,220,126.22	4.90%	16,603.98	5.03%	-
国泰君安	1	1,709,800.00	0.46%	1,592.35	0.48%	-
民生证券	2	16,111,237.21	4.33%	14,256.88	4.32%	-
东方证券	1	15,979,767.07	4.30%	14,140.40	4.28%	-
中泰（齐鲁） 证券	3	1,254,018.80	0.34%	1,142.80	0.35%	-
长城证券	2	1,090,133.60	0.29%	775.41	0.23%	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	2	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	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	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-

红塔证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
中信建投证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	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、个股分析报告及丰富全面的信息服务；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
国信证券	-	-	60,100,000.00	14.40%	-	-
长江证券	-	-	41,000,000.00	9.83%	-	-
方正证券	42,861,773.13	100.00%	295,700,000.00	70.86%	-	-
安信证券	-	-	10,000,000.00	2.40%	-	-

西南证券	-	-	8,000,000. 00	1.92%	-	-
国泰君安	-	-	2,500,000. 00	0.60%	-	-

§12 影响投资者决策的其他重要信息

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