

金鹰灵活配置混合型证券投资基金
(原金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金)
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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年三月三十日

§1 重要提示及目录

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。

基金托管人根据相关法规及本基金合同规定，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基金合同、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。其中，自 2015 年 5 月 6 日起，原《金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金基金合同》、《金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金托管协议》失效，《金鹰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《金鹰灵活配置混合型证券投资基金托管协议》生效。原金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金报告期自 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 5 月 5 日止，金鹰灵活配置混合型证券投资基金报告期自 2015 年 5 月 6 日至 2015 年 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金	
基金简称	金鹰元泰信用债债券	
基金主代码	210010	
交易代码	210010	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012 年 11 月 29 日	
基金管理人	金鹰基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	311571397.69 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	金鹰元泰信用债 A 类	金鹰元泰信用债 C 类
下属分级基金的交易代码	210010	210011
报告期末下属分级基金的份额总额	5,775,597.78 份	305,795,799.91 份

注：上表中“报告期末”指 2015 年 5 月 5 日。

2.2 基金基本情况（转型后）

基金名称	金鹰灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	金鹰灵活配置混合	
基金主代码	210010	
交易代码	210010	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 5 月 6 日	
基金管理人	金鹰基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,098,523,728.20 份	
基金合同存续期	不定期	

下属分级基金的基金简称	金鹰灵活配置混合 A 类	金鹰灵活配置混合 C 类
下属分级基金的交易代码	210010	210011
报告期末下属分级基金的份额总额	9,029,605.16 份	1,089,494,123.04 份

注：上表中“报告期末”指 2015 年 12 月 31 日。

2.3 基金产品说明（转型前）

投资目标	在严格控制投资风险、保持较高流动性的前提下，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报，进而实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金大类资产配置采用自上而下的投资视角，定性分析与定量分析并用，结合国内外政治经济环境、政策形势、金融市场走势（尤其是未来利率的变化趋势），分析判断市场时机，合理确定基金在债券、股票、货币等资产类别上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时动态地调整本基金投资于债券、股票、货币市场工具的比例与期限结构。
业绩比较基准	中债企业债总全价指数收益率 $\times$ 80% + 中国国债总全价指数收益率 $\times$ 20%
风险收益特征	本基金为积极配置的债券型基金，属于证券投资基金当中风险较低的品种，其长期平均风险与预期收益率低于股票型基金、混合型基金，但高于货币市场基金。

2.4 基金产品说明（转型后）

投资目标	本基金在有效控制风险并保持良好流动性的前提下，通过对股票、固定收益和现金类等资产的积极灵活配置，力争使基金份额持有人获得超额收益与长期资本增值。
投资策略	本基金将从宏观面、政策面、基本面和资金面四个维度进行综合分析，主动判断市场时机，在严格控制投资组合风险的前提下，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票类资产、固定收益类资产、现金类资产等

	各类资产类别上的投资比例，最大限度的提高收益。本基金投资组合中股票资产占基金资产净值的比例为 0-95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中高等风险水平的投资品种。

注：2015 年 4 月 18 日至 2015 年 4 月 29 日，金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，大会审议并通过《金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金转型有关事项的议案》。于 2015 年 5 月 6 日正式实施基金转型，自基金转型实施之日起，《金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金基金合同》失效且《金鹰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》同时生效，金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金正式变更为金鹰灵活配置混合型证券投资基金。

2.5 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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	苏文锋	汤嵩彦
	联系电话	020-83282627	95559
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	tangsy@bankcomm.com
客户服务电话		4006135888,020-83936180	95559
传真		020-83282856	021-62701216

2.6 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

3.1.1 期间数据和指标（转型前）

金额单位：人民币元

3.1.1.1 期间数据和指标(转型前)	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 5 月 5 日		2014 年		2013 年	
	金鹰元泰信用债 A 类	金鹰元泰信用债 C 类	金鹰元泰信用债 A 类	金鹰元泰信用债 C 类	金鹰元泰信用债 A 类	金鹰元泰信用债 C 类
本期已实现收益	469,480.28	472,004.38	1,344,543.17	1,237,849.47	2,488,634.22	3,384,717.67
本期利润	564,785.89	562,648.27	2,707,554.85	2,016,364.95	405,263.38	2,821,576.21
加权平均基金份额本期利润	0.1078	0.0875	0.1056	0.0923	0.0048	0.0310
本期加权平均净值利润率	9.30%	7.58%	10.30%	8.78%	0.48%	3.07%
本期基金份额净值增长率	9.85%	9.96%	13.83%	13.33%	-3.45%	-3.86%
3.1.1.2 期末数据和指标(转型前)	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 5 月 5 日		2014 年末		2013 年末	
	金鹰元泰信用债 A 类	金鹰元泰信用债 C 类	金鹰元泰信用债 A 类	金鹰元泰信用债 C 类	金鹰元泰信用债 A 类	金鹰元泰信用债 C 类
期末可供分配利润	805,889.25	40,671,591.54	460,229.38	422,106.48	-1,571,293.69	-561,900.10

金鹰灵活配置混合型证券投资基金
(原金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金) 2015 年年度报告摘要

期末可供分配基金份额利润	0.1395	0.1330	0.0792	0.0697	-0.0321	-0.0365
期末基金资产净值	5,775,597.78	305,795,799.91	6,404,613.10	6,614,554.19	47,371,467.08	14,852,689.22
期末基金份额净值	1.2104	1.2007	1.1018	1.0919	0.9679	0.9635
3.1.1.3 累计期末指标（转型前）	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 5 月 5 日		2014 年末		2013 年末	
	金鹰元泰信用债 A 类	金鹰元泰信用债 C 类	金鹰元泰信用债 A 类	金鹰元泰信用债 C 类	金鹰元泰信用债 A 类	金鹰元泰信用债 C 类
基金份额累计净值增长率	21.04 %	20.07%	10.18%	9.19%	-3.21%	-3.65%

3.1.2 期间数据和指标（转型后）

3.1.2.1 期间数据和指标（转型后）	2015 年 5 月 6 日至 2015 年 12 月 31 日		2014 年		2013 年	
	金鹰灵活配置混合 A 类	金鹰灵活配置混合 C 类	金鹰灵活配置混合 A 类	金鹰灵活配置混合 C 类	金鹰灵活配置混合 A 类	金鹰灵活配置混合 C 类
本期已实现收益	72,521,784.05	62,675,146.58				
本期利润	62,749,476.71	51,258,775.97				
加权平	0.03	0.03				

均基金 份额本 期利润	72	49				
本期加 权平均 净值利 润率	3.66%	3.46%				
本期基 金份额 净值增 长率	4.29%	0.32%				
3.1.2.2 期 末数据和 指标(转型 后)	2015 年 5 月 6 日至 2015 年 12 月 31 日		2014 年末		2013 年末	
	金鹰灵活配置 混合 A 类	金鹰灵活配置 混合 C 类	金鹰灵活配置 混合 A 类	金鹰灵活配置 混合 C 类	金鹰灵活配置 混合 A 类	金鹰灵活配置混 合 C 类
期末可 供分配 利润	1,836,615.6 2	171,258,789 .93				
期末可 供分配 基金份 额利润	0.2034	0.1572				
期末基 金资产 净值	9,417,134.2 5	1,093,000,4 13.67				
期末基 金份额 净值	1.0429	1.0032				
3.1.2.3 累 计期末指	2015 年 5 月 6 日至 2015 年 12 月 31 日		2014 年末		2013 年末	

标 (转型后)	金鹰灵活配置混合 A 类	金鹰灵活配置混合 C 类	金鹰灵活配置混合 A 类	金鹰灵活配置混合 C 类	金鹰灵活配置混合 A 类	金鹰灵活配置混合 C 类
基金份额累计净值增长率	4.29 %	0.32 %				

注：1、金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金从2015年5月6日起正式转型为金鹰灵活配置混合型证券投资基金。本基金转型后合同生效不足一年，无上年度及上上年度可比数据。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

3、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

4、期末可供分配利润，指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现（转型前）

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

1. 金鹰元泰信用债 A 类：

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	6.49%	0.34%	-2.75%	0.29%	9.24%	0.05%
过去六个月	9.96%	0.46%	-3.48%	0.24%	13.44%	0.22%
过去一年	20.40%	0.36%	1.95%	0.18%	18.45%	0.18%
成立至今	21.04%	0.36%	1.73%	0.13%	19.31%	0.23%

2. 金鹰元泰信用债 C 类：

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	①－③	②－④
----	----------	-------------	------------	--------------	-----	-----

				④		
过去三个月	6.63%	0.34%	-2.75%	0.29%	9.38%	0.05%
过去六个月	9.96%	0.46%	-3.48%	0.24%	13.44%	0.22%
过去一年	20.17%	0.36%	1.95%	0.18%	18.22%	0.18%
成立至今	20.07%	0.36%	1.73%	0.13%	18.34%	0.23%

注:

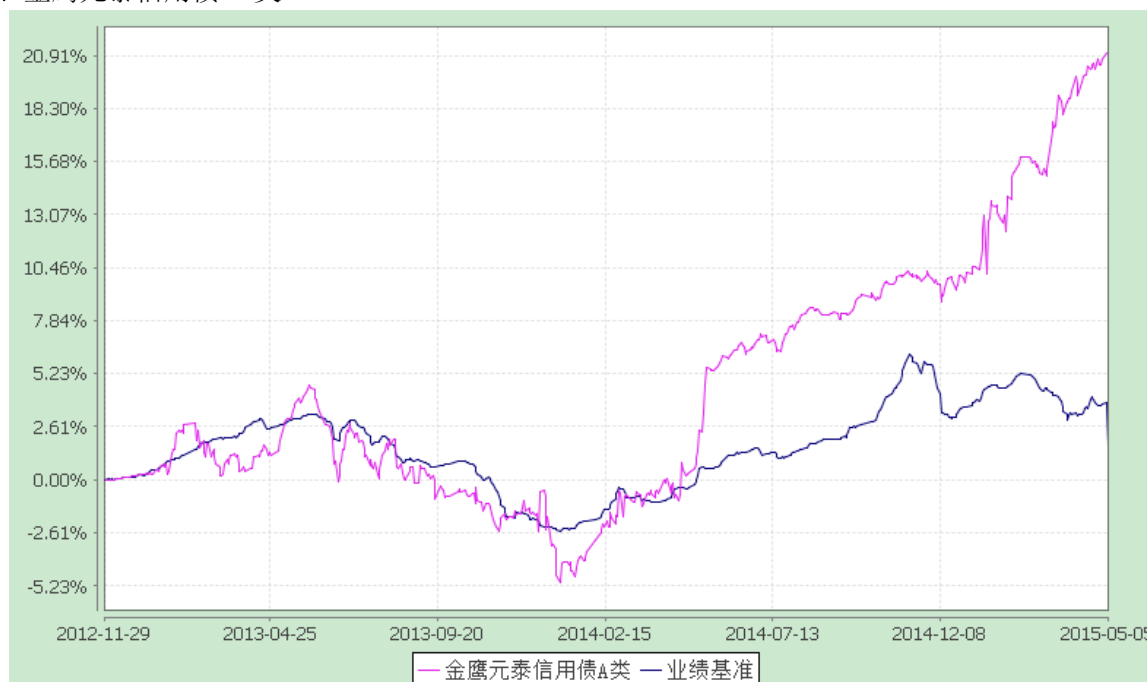
- 1、本基金合同生效日期为 2012 年 11 月 29 日。
- 2、本基金转型前的业绩比较基准是：中债企业债总全价指数收益率×80% + 中国国债总全价指数收益率×20%
- 3、2015 年 4 月 29 日，金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，大会审议并通过《金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金转型有关事项的议案》，于 2015 年 5 月 6 日正式实施基金转型。

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（转型前）

金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2012 年 11 月 29 日至 2015 年 5 月 5 日)

1、金鹰元泰信用债 A 类



2、金鹰元泰信用债 C 类



注：1、本基金合同生效日期为 2012 年 11 月 29 日，转型后合同生效日为 2015 年 5 月 6 日。

2、截至报告日本基金的各项投资比例符合本基金基金合同规定的各项比例，即转型日前本基金对固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%，其中对信用债券的投资比例不低于固定收益类资产的 80%；对股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，权证投资的比例范围占基金资产净值的 0~3%。本基金持有现金和到期日不超过一年的政府债券不低于基金资产净值的 5%。转型日后本基金投资组合中股票资产占基金资产的比例为 0-95%，本基金每个交易日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金以及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

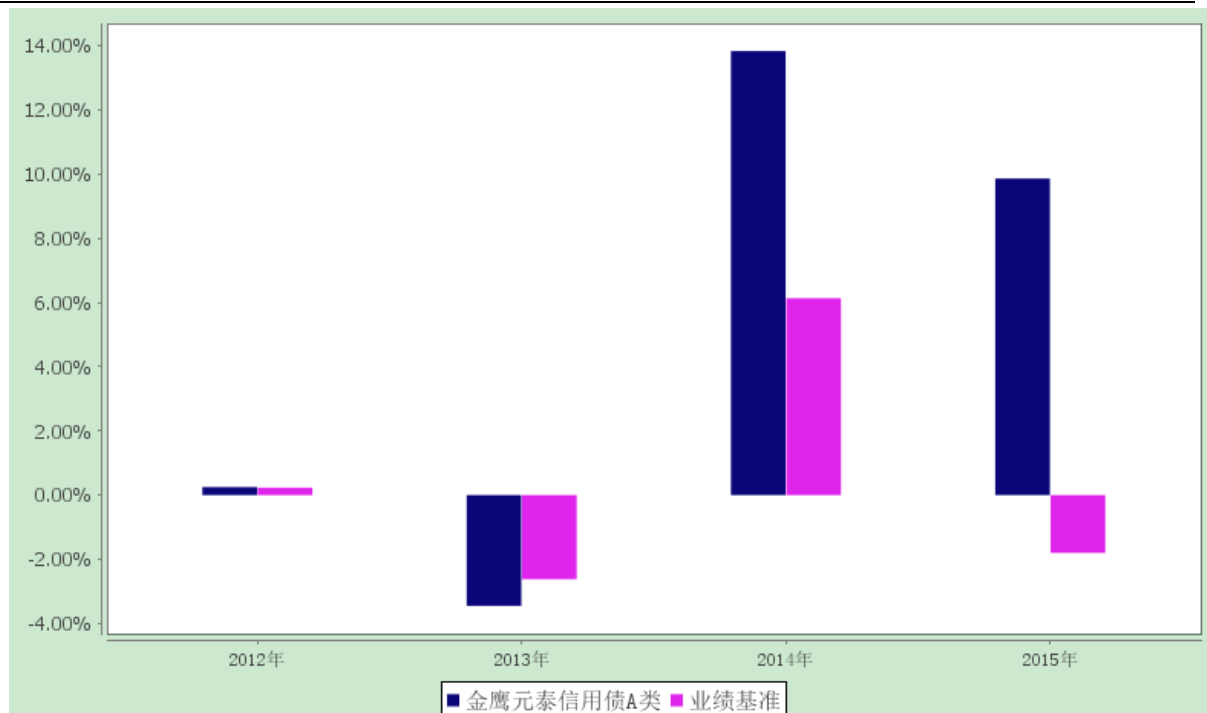
3、本基金转型后的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。

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（转型前）

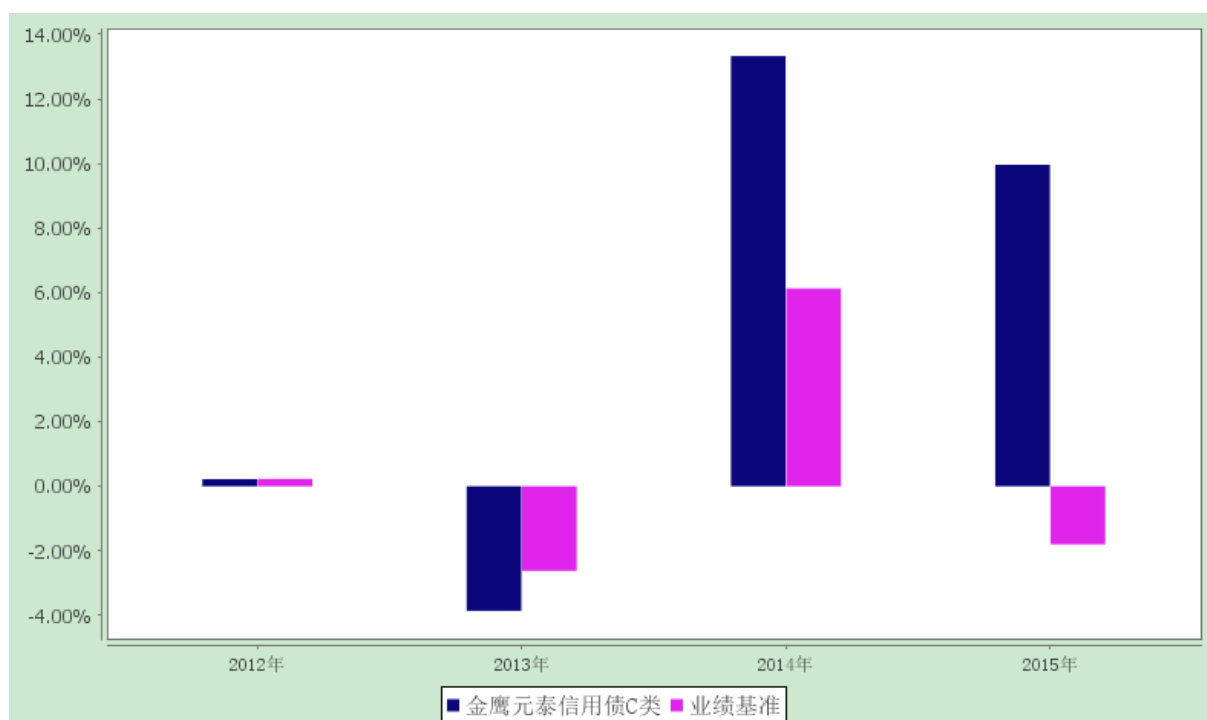
金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金

自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

1、金鹰元泰信用债 A 类



2、金鹰元泰信用债 C 类



注：本基金合同生效日期为 2012 年 11 月 29 日，基金转型当年按实际存续期计算，不按整个自然年度。

3.3 基金净值表现（转型后）

3.3.1 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

1. 金鹰灵活配置混合 A 类

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	0.95%	0.55%	9.64%	0.83%	-8.69%	-0.28%
过去六个月	2.59%	0.39%	-5.16%	1.33%	7.75%	-0.94%
成立至今	4.29%	0.34%	-5.65%	1.37%	9.94%	-1.03%

2. 金鹰灵活配置混合 C 类

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	-1.77%	0.45%	9.64%	0.83%	-11.41%	-0.38%
过去六个月	-1.25%	0.31%	-5.16%	1.33%	3.91%	-1.02%
成立至今	0.32%	0.28%	-5.65%	1.37%	5.97%	-1.09%

注：

1、2015 年 4 月 29 日，金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，大会审议并通过《金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金转型有关事项的议案》，于 2015 年 5 月 6 日正式实施基金转型，基金合同生效日期为 2015 年 5 月 6 日。

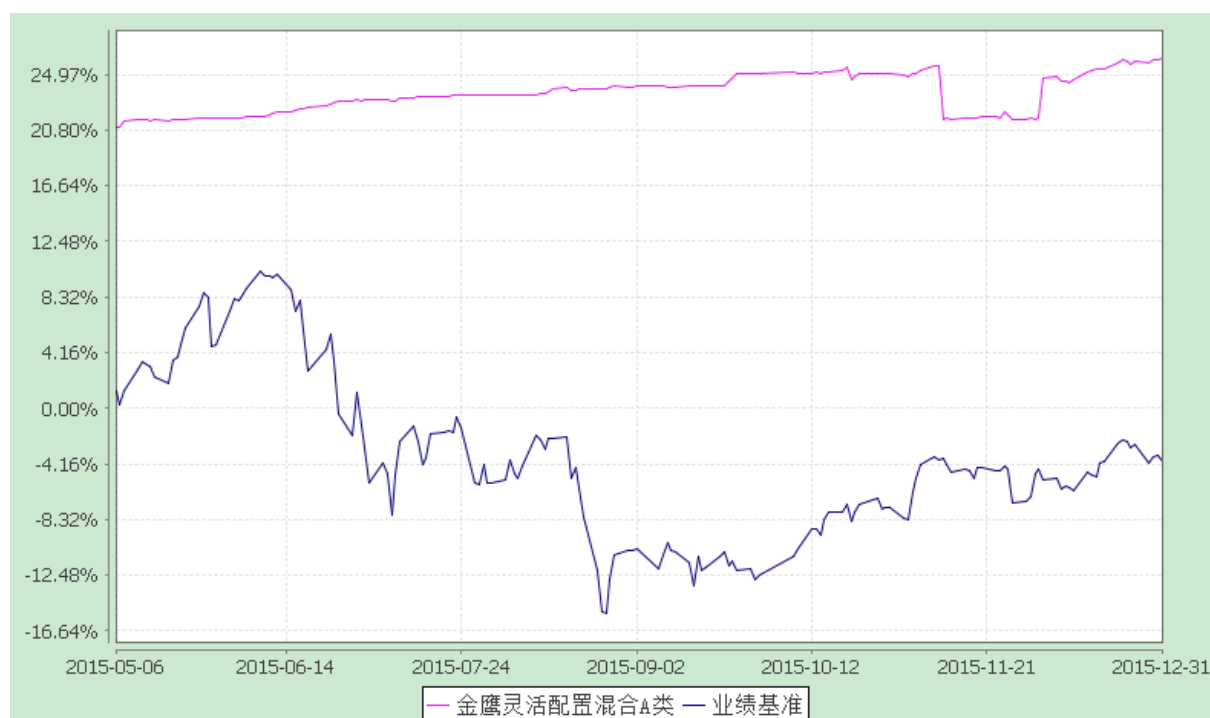
2、本基金转型后的业绩比较基准是：沪深 300 指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%

3.3.2 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（转型后）

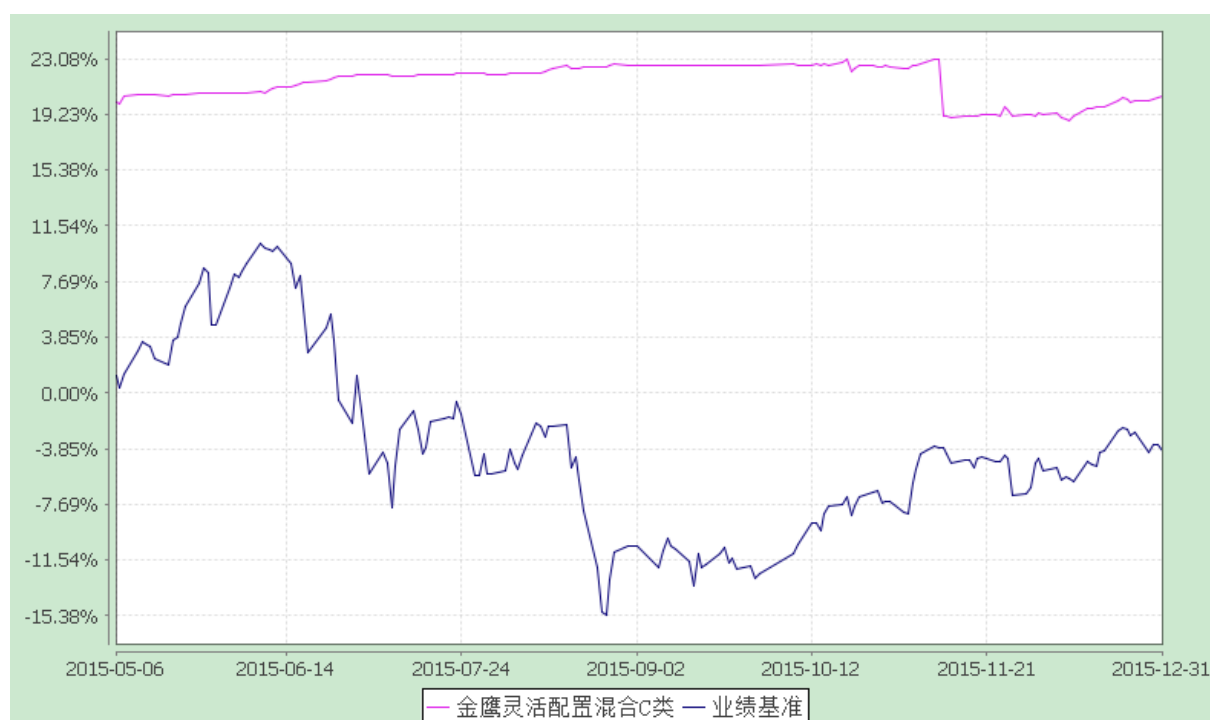
金鹰灵活配置混合型证券投资基金

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2012 年 5 月 6 日至 2015 年 12 月 31 日)

1. 金鹰灵活配置混合 A 类



2、金鹰灵活配置混合 C 类

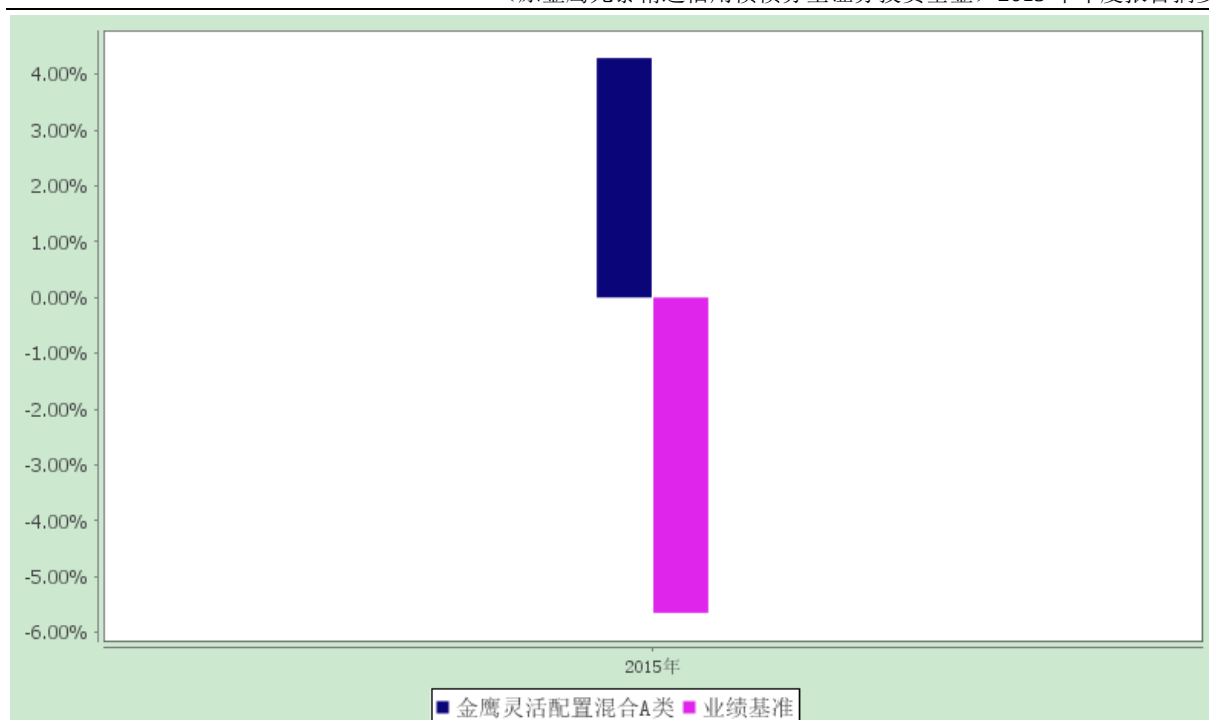


3.3.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较（转型后）

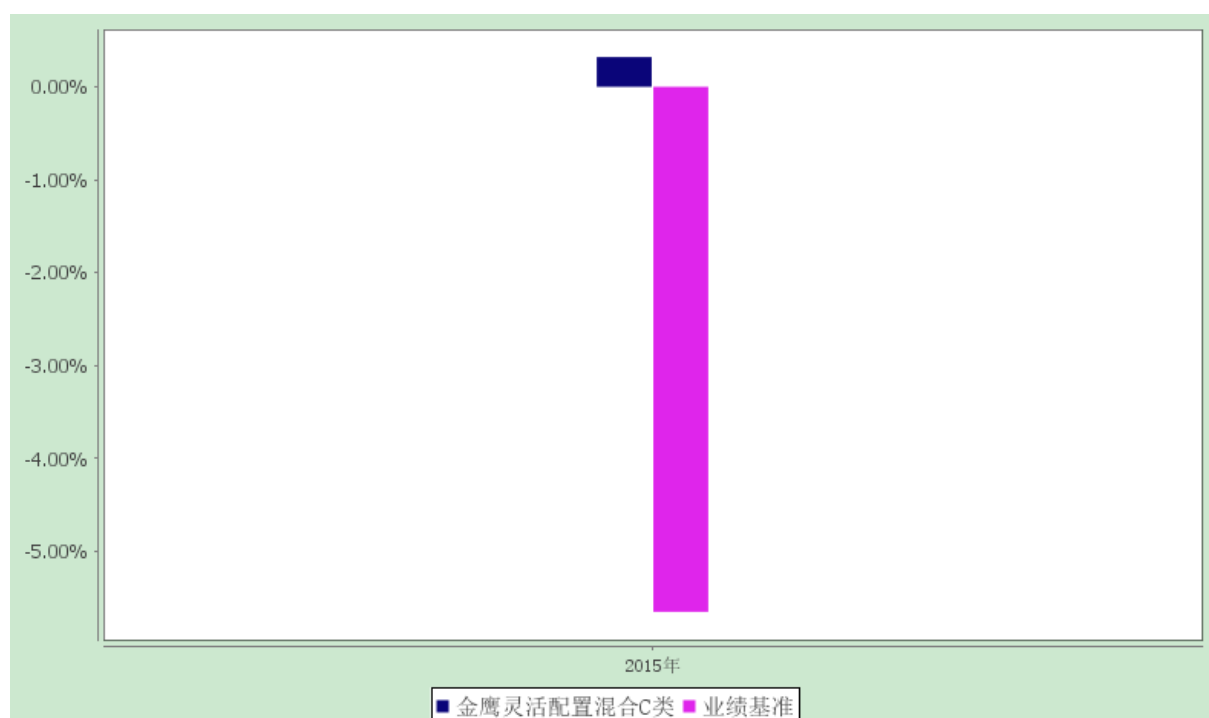
金鹰灵活配置混合型证券投资基金

自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

1、金鹰灵活配置混合 A 类



2、金鹰灵活配置混合 C 类



3.4 过去三年基金的利润分配情况（转型前）

本基金自合同生效无利润分配情况。

3.5 过去三年基金的利润分配情况（转型后）

本基金自合同生效无利润分配情况。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

金鹰基金管理有限公司经中国证监会证监基字[2002]97 号文批准，于 2002 年 12 月 25 日成立，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 (转型前)

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		
张俊杰	基金经理	2013-09-23	-	9	张俊杰先生, 厦门大学金融工程硕士。 2007 年 7 月至 2013 年 4 月任职于平安证券有限责任公司, 历任衍生产品部金融工程研究员、固定收益事业部高级经理, 债券研究员等; 2013 年 4 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)、金鹰灵活配置混合型证券投资基金及金鹰技术领先灵活配置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	2015-05-06	-	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。现任固定收益部副总监及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。
--	--	--	--	--	----------------

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。

4.1.3 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介(转型后)

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		
张俊杰	基金经理	2013-09-23	-	9	张俊杰先生,厦门大学金融工程硕士。 2007 年 7 月至 2013 年 4 月任职于平安证券有限责任公司, 历任衍生产品部金融工程研究员、固定收益事业部高级经理, 债券研究员等; 2013 年 4 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)、金鹰灵活配置混合型证券投资基金及金鹰技术领先灵活配置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	2015-05-06	-	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。现任固定收益部副总监及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。

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、本基金于经持有人通讯表决由金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金转变而来, 本基金合同于 2015 年 5 月 6 日生效。

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、《金鹰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》等规定, 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。本基金持有的“15 山水 SCP001”发行人 山东山水水泥集团有限公司 (以下简称“15 山水 SCP001”发行人) 于 2015 年 11 月 12 日发布《山东山水水泥集团有限公司 2015 年度第一期超短期融资券未按期足额兑付本息的公告》, 由于“15 山水 SCP001”发行人未能按照约定筹措足额偿债资金, 至使该债券于到期后不能按期足额偿付, 本基金管理人已代表金鹰灵活配置混合型证券投资基金向广州市中级人民法院起诉“15 山水 SCP001”发行人, 目前法院已受理。本基金管理人将按照基金合同的有关约定, 采取措施维护基金份额持有人的利益, 并将按照《证券投资基金信息披露管理办法》的规定履行信息披露义务。

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年中国经济在复杂的国内外环境中持续下行, 国内生产总值“破7”, 全年GDP增速为6.9%, 在2015年四季度GDP增速跌至6.8%。固定资产投资全年持续下行, 全年固定资产投资增速仅10%, 其中房地产开发投资增速从2014年的10.5%跌至1.0%; 国内消费相对较为平稳, 下滑幅度较小, 社会消费品零售总额同比增速从2014年的12.0%降至10.7%。伴随着国内经济下行以及国际大宗商品的大幅下跌, 2015年全年通胀维持在较低水平, CPI为1.44%, 处于近年低位, PPI为-5.2%。2015年中国人民银行采取了稳健偏宽松的货币政策, 全年5次下调存贷款基准利率, 一年期存款基准利率从2.75%降至1.5%, 下调125BP; 4次下调存款准备金率, 累计下调2.5个百分点。

2015年对国内资本市场来说是极不平凡的一年。上证指数从年初的3200点附近最高涨至接近5200点, 6月中旬以后发生“股灾”, 下半年最低跌至2850点附近。债券市场在基本面和资金面的支撑下则再度走出了大牛市行情。

本基金在2015年5月份进行了转型, 由债券型基金转型成灵活配置混合型基金, 在转型前, 本基金主要配置短久期的债券, 并保持了较高的杠杆, 同时也配置了部分股票和转债, 取得了较好的收益。转型后, 本基金保持了极低的股票仓位, 债券主要以现金类工具为主, 同时积极参与新股申购, 业绩较为平稳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日, 金鹰灵活配置混合A类基金份额净值1.0429元, 金鹰灵活配置混合C类基金份额净值1.0032元。转型前(即合同生效日至2015年5月5日), 金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金A类份额净值增长率为21.04%, 同期业绩比较基准收益率为1.73%。金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金c类份额净值增长率为21.04%, 同期业绩比较基准

收益率为 1.73%。

转型后(即自 2015 年 5 月 6 日至 2015 年 12 月 31 日),金鹰灵活配置混合型证券投资基金 A 类份额净值增长率为 4.29%,同期业绩比较基准收益率为-5.65%。金鹰灵活配置混合型证券投资基金 c 类份额净值增长率为 0.32%,同期业绩比较基准收益率为-5.65%。

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,我们认为中国经济将总体保持平稳,通胀水平依然保持低位,下半年可能小幅回升。人民银行将继续实施稳健偏宽松的货币政策,但基准利率下调的空间不大,存款准备金率仍有下调的空间。

对于 2016 年的债券市场,我们保持谨慎乐观。一方面,国内经济仍然面临较大的下行压力,稳增长要求政策保持宽松,牛市的基础依然存在;另一方面,当前债市的收益率水平已经反映了未来经济下行和政策宽松的预期,继续下行的空间已经不大。因此,我们判断 2016 年债市收益率将以震荡为主,波动中枢可能小幅下行。与此同时,我们对 2016 年的股票市场和可转债行情保持谨慎。

基于以上判断,本基金将保持适度的组合久期和杠杆水平,以获取票息和息差收益为主,并根据对市场走势的判断进行波段操作,提高组合的收益。同时,本基金将积极进行新股申购,增厚收益。

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

原金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金自 2014 年 11 月 25 日起,截至 2015 年 5 月 4 日已连续 106 个工作日资产净值低于五千万,于 2015 年 5 月 6 日起转型为金鹰灵活配置混合型证券投资基金。

§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

2015 年度,基金托管人在金鹰灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2015 年度,金鹰基金管理有限公司在金鹰灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配,符合基金合同的规定。

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

2015 年度,由金鹰基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关金鹰灵活配置混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

6.1 转型前

我们审计了后附的金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金(以下简称“金鹰元泰信用债债券基

金”)财务报表,包括 2015 年 5 月 5 日(基金合同失效前日)的资产负债表和 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 5 月 5 日(基金合同失效前日)止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注,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。

6.2 转型后

我们审计了后附的金鹰灵活配置混合型证券投资基金(原金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金)(以下简称“金鹰灵活配置混合基金”)财务报表,包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表和 2015 年 5 月 6 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注,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(转型前)

7.1 资产负债表

会计主体:金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金

报告截止日:2015 年 5 月 5 日

单位:人民币元

资产	本期末 2015 年 5 月 5 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资 产:	-	-
银行存款	791,887.04	1,601,541.39
结算备付金	545,301.89	345,453.86
存出保证金	14,983.85	38,166.68
交易性金融资产	19,863,260.30	24,314,168.20
其中:股票投资	404,400.00	917,500.00
基金投资	-	-
债券投资	19458860.30	23,396,668.20
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	4,999,458.58	-
应收利息	254,747.70	436,197.07
应收股利		-
应收申购款	300,752,406.66	398.81
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	327,222,046.02	26,735,926.01
负债和所有者权益	本期末 2015 年 5 月 5 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	15,000,000.00	13,000,000.00
应付证券清算款		-
应付赎回款	157,323.41	98,378.09
应付管理人报酬	10,394.71	16,845.40
应付托管费	2,969.93	4,812.98
应付销售服务费	3,245.89	5,571.61
应付交易费用	170.71	12,978.39
应交税费	116,000.00	116,000.00
应付利息		6,127.45
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	360,543.68	456,044.80
负债合计	15,650,648.33	13,716,758.72
所有者权益:		-
实收基金	259,460,663.74	11,870,796.60

未分配利润	52,110,733.95	1,148,370.69
所有者权益合计	311,571,397.69	13,019,167.29
负债和所有者权益总计	327,222,046.02	26,735,926.01

注：金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金自 2015 年 5 月 6 日起转型为金鹰灵活配置混合型证券投资基金，后附报表附注为本财务报表组成部分。

7.2 利润表

会计主体：金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 5 月 5 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 5 月 5 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入	1,359,174.57	6,861,124.52
1.利息收入	352,217.03	2,990,023.07
其中：存款利息收入	8,273.41	50,516.60
债券利息收入	342,465.04	2,920,739.93
资产支持证券利息收入	.00	-
买入返售金融资产收入	1,478.58	18,766.54
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）	715,683.75	1,703,856.66
其中：股票投资收益	375,121.42	739,139.03
基金投资收益		-
债券投资收益	340,562.33	953,622.63
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		11,095.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号	185,949.50	2,141,527.16

填列)		
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	105,324.29	25,717.63
减: 二、费用	231,740.41	2,137,204.72
1. 管理人报酬	32,761.59	343,355.97
2. 托管费	9,360.51	98,101.71
3. 销售服务费	9,062.10	79,122.03
4. 交易费用	29,905.68	304,965.77
5. 利息支出	131,432.73	940,353.63
其中: 卖出回购金融资产支出	131,432.73	940,353.63
6. 其他费用	19,217.80	371,305.61
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	1,127,434.16	4,723,919.80
减: 所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	1,127,434.16	4,723,919.80

注: 金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金自 2015 年 5 月 6 日起转型为金鹰灵活配置混合型证券投资基金, 后附报表附注为本财务报表组成部分。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金

本报告期: 2015 年 1 月 1 日 至 2015 年 5 月 5 日

单位: 人民币元

项目	本期		
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 5 月 5 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)	11,870,796.60	1,148,370.69	13,019,167.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本	-	1,127,434.16	1,127,434.16

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)	247,589,867.14	49834929.10	297,424,796.24
其中: 1.基金申购款	271160265.00	53932215.11	325092480.11
2.基金赎回款	-23570397.86	-4097286.01	-27667683.87
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)	259460663.74	52110733.95	311571397.69
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)	64,357,350.09	-2,133,193.79	62,224,156.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,723,919.80	4,723,919.80
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)	-52,486,553.49	-1,442,355.32	-53,928,908.81
其中: 1.基金申购款	123,298,659.33	7,901,438.88	131,200,098.21
2.基金赎回款	-175,785,212.82	-9,343,794.20	-185,129,007.02
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)	11,870,796.60	1,148,370.69	13,019,167.29

金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金自 2015 年 5 月 6 日起转型为金鹰灵活配置混合型证券投资基金，后附报表附注为本财务报表组成部分。

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

金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金(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[2012]1084 号文《关于金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金备案确认的函》批准，于 2012 年 11 月 29 日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为 1,783,517,626.11 份基金份额。

2015 年 4 月 29 日经持有人大会表决通过了《关于金鹰元泰精选信用债债券型证券投资转型相关事项的议案》，自金鹰元泰精选信用债基金份额折算日次日(即 2015 年 5 月 6 日)起，《金鹰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效。本基金的基金管理人为金鹰基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

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

本基金本财务报表的编制遵守了企业会计准则及其他有关规定，真实、完整地反映了本基金于 2015 年 5 月 5 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 5 月 5 日期间的经营成果和净值变动情况。

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

本基金报告期内无差错更正。

7.4.6 税项

1、印花税

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

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定, 股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让, 暂免征收印花税;

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

经国务院批准, 财政部、国家税务总局研究决定, 自 2008 年 9 月 19 日起, 证券(股票)交易印花税调整为单边征税, 由出让方按证券(股票)交易印花税率缴纳印花税, 受让方不再征收, 税率不变。

2、营业税、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
交通银行股份有限公司	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5月5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	-	-	122,300,703.69	60.87%

注：本基金 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 5 月 5 日未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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 5 月 5 日及上年度可比期间未通过关联方进行权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年5月5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	-	-	7,161,079.83	2.77%

注：本基金 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 5 月 5 日未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	上年度可比期间
-------	----	---------

	2015年1月1日至2015年5月5日		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	-	-	-	-

注：本基金 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 5 月 5 日及上年度未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 5 月 5 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
-	-	-	-	-
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	108,224.18	61.28%	2,864.22	22.07%

注：本基金 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 5 月 5 日内未通过关联方交易单元进行任何交易，无应支付关联方交易佣金。上述佣金按市场佣金率计算，以扣除中国证券登记结算公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括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等。

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5月 5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	32761.59	343,355.97
其中：支付销售机构的客户维护费	15483.40	171,299.54

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times F \div \text{当年天数}$$

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

F 为年费率，本基金自 5 月 6 日起转型为金鹰灵活配置混合型证券投资基金，管理费率为 1%，5 月 6 日前管理费率为 0.7%

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年5月 5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	9360.51	98,101.71

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times F \div \text{当年天数}$$

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

F 为年费率，本基金自 5 月 6 日起转型为金鹰灵活配置混合型证券投资基金，管理费率为 0.25%，5 月 6 日前托管费率为 0.2%

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各 关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年5月5日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	金鹰元泰信用债 A 类	金鹰元泰信用债 C 类	合计
金鹰基金管理有限公司	0.00	1,938.65	1,938.65
广州证券	0.00	0.00	0.00
交通银行	0.00	2,216.89	2,216.89
合计	0.00	4,155.54	4,155.54
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		
	金鹰元泰信用债A类	金鹰元泰信用债C类	合计
金鹰基金管理有限公司	0.00	15,360.50	15,360.50
广州证券	0.00	359.51	359.51
交通银行	0.00	19,133.13	19,133.13
合计	0.00	34,853.14	34,853.14

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.5%。在通常情况下，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.35% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付，于次月前 5 个工作日内从基金财产中

一次性划出，由基金管理人代收，基金管理人收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。

若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金行销广告费、促销活动费、基金份额持有人服务费等。

本基金自 5 月 6 日起转型为金鹰灵活配置混合型证券投资基金，5 月 6 日前销售服务费率 0.35%

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均没有与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

金鹰灵活配置混合 A 类

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5月5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
交通银行	791887.04	3245.66	1,601,541.39	17,367.58

注：本基金 2015 年 5 月 5 日的清算备付金余额 545301.89 元，清算备付金利息收入 4590.19 元；上年度 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日的清算备付金余额 345,453.86 元，清算备付金利息收入 31,178.56 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 5 月 5 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 2015 年 5 月 5 日无因认购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 2015 年 5 月 5 日无持有因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

截至本报告期末，本基金本报告末未持有未到期的银行间市场卖出回购证券款。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金本报告末未持有未到期的交易所市场卖出回购证券款。

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 年度财务报表(转型后)

8.1 资产负债表

会计主体：金鹰灵活配置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
资 产：	-
银行存款	51,416,218.73
结算备付金	4,491,671.51
存出保证金	701,092.25
交易性金融资产	393,723,077.93

其中：股票投资	39,732,077.93
基金投资	-
债券投资	353,991,000.00
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	700,001,120.00
应收证券清算款	-
应收利息	4,666,200.84
应收股利	-
应收申购款	16,228.17
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	1,155,015,609.43
负债和所有者权益	本期末 2015 年 12 月 31 日
负 债：	-
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	49,998,050.71
应付管理人报酬	971,362.47
应付托管费	242,840.62
应付销售服务费	475,079.42
应付交易费用	649,708.96
应交税费	116,000.00
应付利息	-

应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	145,019.33
负债合计	52,598,061.51
所有者权益：	-
实收基金	914,943,782.02
未分配利润	187,473,765.90
所有者权益合计	1,102,417,547.92
负债和所有者权益总计	1,155,015,609.43

注：2015 年 4 月 18 日至 2015 年 4 月 29 日，金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，大会审议并通过《金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金转型有关事项的议案》。于 2015 年 5 月 6 日正式实施基金转型，自基金转型实施之日起，金鹰灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效，基金转型后运作不足两年，无上年度可比期间数据，下同。

8.2 利润表

会计主体：金鹰灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 5 月 6 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 5 月 6 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入	149,679,854.92
1.利息收入	43,942,849.62
其中：存款利息收入	6,253,657.78
债券利息收入	24,336,097.92
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	13,353,093.92
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	114,758,966.33
其中：股票投资收益	120,781,727.44

基金投资收益	-
债券投资收益	-6,193,750.25
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	170,989.14
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-21,188,677.95
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	12,166,716.92
减：二、费用	35,671,602.24
1. 管理人报酬	20,664,070.27
2. 托管费	5,166,017.55
3. 销售服务费	4,795,022.16
4. 交易费用	4,286,709.66
5. 利息支出	691,847.03
其中：卖出回购金融资产支出	691,847.03
6. 其他费用	67,935.57
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	114,008,252.68
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	114,008,252.68

8.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金鹰灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 5 月 6 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 5 月 6 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）	259460663.74	52110733.95	311571397.69

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	114,008,252.68	114,008,252.68
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）	655,483,118.28	21,354,779.27	676,837,897.55
其中：1.基金申购款	7,834,940,173.04	1,633,202,978.62	9,468,143,151.66
2.基金赎回款	-7,179,457,054.76	-1,611,848,199.35	-8,791,305,254.11
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）	914,943,782.02	187,473,765.90	1,102,417,547.92

注：金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金自 2015 年 5 月 6 日起转型为金鹰灵活配置混合型证券投资基金，后附报表附注为本财务报表组成部分。

本报告页码（序号）从 8.1 至 8.4，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

8.4 报表附注

8.4.1 基金基本情况

金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金(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[2012]1084 号文《关于金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金备案确认的函》批准，于 2012 年 11 月 29 日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为 1,783,517,626.11 份基金份额。

2015 年 4 月 29 日经持有人大会表决通过了《关于金鹰元泰精选信用债债券型证券投资转型相关事项的议案》，自金鹰元泰精选信用债基金份额折算日次日（即 2015 年 5 月 6 日）起，《金鹰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效。本基金的基金管理人为金鹰基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

8.4.2 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。

8.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本财务报表的编制遵守了企业会计准则及其他有关规定,真实、完整地反映了本基金于 2015 年 5 月 6 日的财务状况以及 2015 年 5 月 6 日至 12 月 31 日期间的经营成果和净值变动情况。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

8.4.4 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。

8.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

8.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金报告期内无会计政策变更。

8.4.5.2 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。

8.4.5.3 差错更正的说明

本基金报告期内无差错更正。

8.4.6 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)交易印花税率,由原先的 3‰调整为 1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自 2008 年 9 月 19 日起,证券(股票)交易印花税调整为单边征税,由出让方按证券(股票)交易印花税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变。

2、营业税、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。）

8.4.7 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
交通银行股份有限公司	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

8.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

8.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

8.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年5月6日至2015年12月31日	
	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	-	-

注：本基金 2015 年度 5 月 6 日至 2015 年 12 月 31 日未通过关联方交易单元进行股票交易。

8.4.8.1.2 权证交易

本基金 2015 年度 5 月 6 日至 2015 年 12 月 31 日未通过关联方进行权证交易。

8.4.8.1.3 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	
	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 2015 年度 5 月 6 日至 2015 年 12 月 31 日未通过关联方交易单元进行债券交易。

8.4.8.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年5月6日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
广州证券股份有限公司	-	-

注：本基金 2015 年度 5 月 6 日至 2015 年 12 月 31 日未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

8.4.8.1.5 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 5 月 6 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

注：本基金 2015 年度 5 月 6 日至 2015 年 12 月 31 日未通过关联方交易单元进行任何交易，无应支付关联方交易佣金。上述佣金按市场佣金率计算，以扣除中国证券登记结算公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括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等。

8.4.8.2 关联方报酬

8.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年5月6日至2015年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	20,664,070.27
其中：支付销售机构的客户维护费	40657.44

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times F \div \text{当年天数}$$

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

F 为年费率，本基金自 5 月 6 日起转型为金鹰灵活配置混合型证券投资基金，管理费率为 1%。

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，于次月前 5 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。

8.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年5月6日至2015年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,166,017.55

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times F \div \text{当年天数}$$

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

F 为年费率，本基金自 5 月 6 日起转型为金鹰灵活配置混合型证券投资基金，管理费率为 0.25%。

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，于次月前 5 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。

8.4.8.2.3 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5月6日至2015年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	金鹰灵活配置混合 A 类	金鹰灵活配置混合 C 类	合计
金鹰基金管理有限公司	0.00	4,290,956.62	4,290,956.62
广州证券	0.00	181.85	181.85
交通银行	0.00	2,448.66	2,448.66
合计	0.00	4,293,587.13	4,293,587.13

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，在通常情况下，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.35% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付，于次月前 5 个工作日内从基金财产中

一次性划出，由基金管理人代收，基金管理人收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。

若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金行销广告费、促销活动费、基金份额持有人服务费等。

本基金自 5 月 6 日起转型为金鹰灵活配置混合型证券投资基金。

8.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均没有与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

8.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

8.4.8.4.1 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。

8.4.8.4.2 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

金鹰灵活配置混合 A 类

本基金本报告期末及上年度末其他关联方未投资本基金。

8.4.8.5 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5月6日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行	51,416,218.73	5,652,287.69

注：本基金本报告期末的清算备付金余额 4,491,671.51 元，清算备付金利息收入 348,928.34 元。

8.4.8.6 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。

8.4.9 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

8.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

17.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123001	蓝标转债	2015-12-23	2016-01-18	发行未上市	100.00	100.00	6,520.00	652,000.00	652,000.00	-

8.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600873	梅花生物	2015-12-17-	重大事项	9.80	-	-	2,403,422.00	19,464,287.59	23,553,535.60	-

8.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

8.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末, 本基金本报告末未持有未到期的银行间市场卖出回购证券款。

8.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末, 本基金本报告末未持有未到期的交易所市场卖出回购证券款。

8.4.10 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。

9 投资组合报告 (转型前)

9.1 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	404400.00	0.12
	其中: 股票	404400.00	0.12
2	固定收益投资	19458860.30	5.95
	其中: 债券	19458860.30	5.95

	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	1337188.93	0.41
7	其他各项资产	306,021,596.79	93.52
8	合计	327,222,046.02	100.00

9.2 期末按行业分类的股票投资组合

9.2.1 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	-	-
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	404400.00	0.13
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	-	-
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	404400.00	0.13

9.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600125	铁龙物流	30,000	404,400.00	0.13

9.4 报告期内股票投资组合的重大变动

9.4.1 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	601318	中国平安	607,560.00	4.67
2	600030	中信证券	588,894.00	4.52
3	600016	民生银行	549,900.00	4.22
4	600060	海信电器	450,238.86	3.46
5	600125	铁龙物流	360,600.00	2.77
6	000750	国海证券	353,800.00	2.72
7	300251	光线传媒	344,000.00	2.64
8	601628	中国人寿	333,661.00	2.56
9	600109	国金证券	331,655.00	2.55
10	601989	中国重工	328,650.00	2.52
11	601727	上海电气	327,000.00	2.51
12	600837	海通证券	326,700.00	2.51
13	000681	视觉中国	324,018.00	2.49
14	600150	中国船舶	316,932.24	2.43
15	300028	金亚科技	313,052.30	2.40

16	002405	四维图新	312,750.00	2.40
17	300027	华谊兄弟	309,989.00	2.38
18	002363	隆基机械	301,934.00	2.32
19	000783	长江证券	300,760.00	2.31
20	000952	广济药业	294,565.00	2.26
21	000049	德赛电池	294,199.00	2.26
22	600031	三一重工	281,700.00	2.16
23	601872	招商轮船	281,427.30	2.16
24	600259	广晟有色	278,816.00	2.14
25	300270	中威电子	275,763.00	2.12

9.4.2 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	002197	证通电子	658,590.76	5.06
2	601318	中国平安	607,942.29	4.67
3	600030	中信证券	576,577.07	4.43
4	600016	民生银行	552,673.81	4.25
5	002441	众业达	529,736.64	4.07
6	600060	海信电器	479,070.83	3.68
7	000681	视觉中国	358,715.57	2.76
8	002363	隆基机械	351,540.56	2.70
9	000750	国海证券	350,608.60	2.69
10	002405	四维图新	349,739.69	2.69
11	601628	中国人寿	345,040.95	2.65
12	300028	金亚科技	340,071.94	2.61
13	600109	国金证券	336,117.66	2.58
14	300251	光线传媒	335,046.83	2.57
15	601727	上海电气	333,976.68	2.57
16	600837	海通证券	330,385.11	2.54
17	601989	中国重工	327,582.17	2.52
18	300027	华谊兄弟	314,170.27	2.41
19	600150	中国船舶	310,379.04	2.38
20	000049	德赛电池	301,969.84	2.32
21	000783	长江证券	299,465.71	2.30
22	300270	中威电子	297,043.38	2.28
23	002253	川大智胜	290,212.04	2.23
24	600259	广晟有色	289,482.73	2.22
25	601872	招商轮船	279,682.91	2.15

26	600031	三一重工	279,586.02	2.15
27	000952	广济药业	268,700.04	2.06

9.4.3 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	9189626.70
卖出股票的收入（成交）总额	10296139.23

9.5 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券		-
	其中：政策性金融债		-
4	企业债券	18777588.80	6.03
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	681271.50	0.22
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	19,458,860.30	6.25

9.6 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	122825	11 景德镇	67,640	6,980,448.00	2.24
2	122051	10 石化 01	50,000	4,999,500.00	1.60
3	126018	08 江铜债	50,000	4,819,500.00	1.55

4	122214	12 大秦债	19,640	1,978,140.80	0.63
5	113007	吉视转债	4,550	681,271.50	0.22

9.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金 2015 年 5 月 5 日未持有资产支持证券。

9.8 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 2015 年 5 月 5 日无贵金属投资。

9.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金 2015 年 5 月 5 日未持有权证。

9.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未进行股指期货投资。

9.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

9.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

9.11.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

9.11.2 本期国债期货投资评价

无。

9.12 投资组合报告附注

9.12.1 本报告期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。

9.12.2 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。

9.12.3 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	14,983.85

2	应收证券清算款	4,999,458.58
3	应收股利	-
4	应收利息	254,747.70
5	应收申购款	300,752,406.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	306,021,596.79

9.12.4 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金 2015 年 5 月 5 日前十名股票中未存在流通受限证券

9.12.5 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。

§10 投资组合报告（转型后）

10.1 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	39,732,077.93	3.44
	其中：股票	39,732,077.93	3.44
2	固定收益投资	353,991,000.00	30.65
	其中：债券	353,991,000.00	30.65
	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	700,001,120.00	60.61

	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	55,907,890.24	4.84
7	其他各项资产	5,383,521.26	0.47
8	合计	1,155,015,609.43	100.00

10.2 期末按行业分类的股票投资组合

10.2.1 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	24,264,535.35	2.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	11,896,610.00	1.08
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	2,588,208.18	0.23
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	982,724.40	0.09

S	综合	-	-
	合计	39,732,077.93	3.60

10.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600873	梅花生物	2,403,422	23,553,535.60	2.14
2	000628	高新发展	684,500	11,896,610.00	1.08
3	603508	思维列控	14,605	1,136,853.20	0.10
4	603999	读者传媒	16,713	982,724.40	0.09
5	300496	中科创达	6,560	918,465.60	0.08
6	603398	邦宝益智	6,343	586,220.06	0.05
7	300493	润欣科技	7,248	299,632.32	0.03
8	300494	盛天网络	6,251	162,901.06	0.01
9	603299	井神股份	23,499	124,779.69	0.01
10	002777	久远银海	4,264	70,356.00	0.01

10.4 报告期内股票投资组合的重大变动

10.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600489	中金黄金	71914595.62	6.52
2	601398	工商银行	71236127.24	6.46
3	601607	上海医药	69841476.49	6.34
4	601600	中国铝业	69484054.85	6.30
5	600050	中国联通	67575000.37	6.13
6	601668	中国建筑	60410398.84	5.48
7	600048	保利地产	59071282.88	5.36
8	000751	锌业股份	57681186.80	5.23
9	002236	大华股份	56343654.50	5.11
10	000157	中联重科	50306885.56	4.56
11	600547	山东黄金	44673130.65	4.05
12	600873	梅花生物	29199808.50	2.65
13	000002	万科 A	29183454.48	2.65
14	600028	中国石化	28738252.77	2.61

15	601985	中国核电	28529155.20	2.59
16	601588	北辰实业	27861979.59	2.53
17	601857	中国石油	24256671.14	2.20
18	601336	新华保险	23604732.96	2.14
19	600961	株冶集团	22965660.92	2.08
20	000060	中金岭南	21958242.00	1.99

10.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601985	中国核电	113130224.50	10.26
2	600489	中金黄金	73904761.14	6.70
3	601600	中国铝业	72092665.40	6.54
4	601607	上海医药	70051990.80	6.35
5	601398	工商银行	68796796.34	6.24
6	600050	中国联通	65910737.45	5.98
7	600048	保利地产	62893142.83	5.71
8	601668	中国建筑	60300693.01	5.47
9	000751	锌业股份	58402694.54	5.30
10	002236	大华股份	55034312.37	4.99
11	000157	中联重科	50238592.44	4.56
12	600547	山东黄金	48369506.18	4.39
13	600028	中国石化	29414918.99	2.67
14	601588	北辰实业	28212428.90	2.56
15	600961	株冶集团	27445950.18	2.49
16	000002	万科 A	26354122.47	2.39
17	601857	中国石油	24967569.00	2.26
18	601336	新华保险	24372789.66	2.21
19	000060	中金岭南	24086932.71	2.18
20	601288	农业银行	20215000.00	1.83

10.4.3 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	1379583382.69
卖出股票的收入（成交）总额	1,468,923,653.21

10.5 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	100,070,000.00	9.08
	其中：政策性金融债	100,070,000.00	9.08
4	企业债券	162,275,000.00	14.72
5	企业短期融资券	29,412,000.00	2.67
6	中期票据	61,582,000.00	5.59
7	可转债（可交换债）	652,000.00	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	353,991,000.00	32.11

10.6 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	150222	15 国开 22	1,000,000.00	100,070,000.00	9.08
2	1380386	13 武清国投债 01	500,000.00	55,705,000.00	5.05
3	1480502	14 胶州发展债	500,000.00	54,130,000.00	4.91
4	1080104	10 常德城投债	500,000.00	52,440,000.00	4.76
5	101375001	13 长经联 MTN001	500,000.00	51,590,000.00	4.68

10.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

10.8 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

本报告期本基金无贵金属投资。

10.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

10.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

10.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未进行股指期货投资。

10.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

10.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.11.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

10.11.2 本期国债期货投资评价

无。

10.12 投资组合报告附注

10.12.1 本报告期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。

10.12.2 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。

10.12.3 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	701,092.25
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,666,200.84
5	应收申购款	16,228.17

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,383,521.26

10.12.4 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	600873	梅花生物	23,553,535.60	2.14	重大事项

10.12.5 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。

§11 基金份额持有人信息（转型前）

11.1 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
金鹰元泰信用债 A 类	275	21002.17	-	-	5775597.78	1
金鹰元泰信用债 C 类	213	1435661.03	299955100.13	0.9809	5840699.78	0.0191
合计	488	638465.98	299955100.13	0.9627	11616297.56	0.0373

11.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	金鹰元泰信用债 A 类	0.00	0.00%
	金鹰元泰信用债 C 类	0.00	0.00%
	合计	0.00	0.00%

注：无

11.3 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

无

§12 基金份额持有人信息（转型后）

12.1 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
金鹰灵活配置混合 A 类	2,492	3,623.44	0.00	0.00%	9,029,605.16	100.00%
金鹰灵活配置混合 C 类	210	5,188,067.25	1,080,953,304.71	99.22%	8,540,818.33	0.78%
合计	2,702	406,559.48	1,080,953,304.71	98.40%	17,570,423.49	1.60%

12.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无

12.3 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

无

12.4 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金非发起式基金。

§13 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	金鹰元泰信用债 A 类	金鹰元泰信用债 C 类
基金合同生效日（2012 年 11 月 29 日）基金份额总额	461,420,757.34	1,322,096,868.77
本报告期期初基金份额总额	5,813,068.26	6,057,728.34
本报告期基金总申购份额	2786396.97	268373868.03
减：本报告期基金总赎回份额	3827678.25	19742719.61
本报告期基金拆分变动份额	1,003,810.80	51,106,923.15
本报告期期末基金份额总额	5,775,597.78	305,795,799.91

注：2015 年 4 月 29 日经持有人大会表决通过了《关于金鹰元泰精选信用债债券型证券投资转型相关事项的议案》，2015 年 5 月 5 日对本基金进行了折算。自 2015 年 5 月 6 日起，原《金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金基金合同》、《金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金托管协议》失效，《金鹰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《金鹰灵活配置混合型证券投资基金托管协议》生效。

§14 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

项目	金鹰灵活配置混合 A 类	金鹰灵活配置混合 C 类
基金合同生效日（2015 年 5 月 6 日）基金份额总额	5,775,597.78	305,795,799.91
本报告期期初基金份额总额	5,775,597.78	305,795,799.91
本报告期基金总申购份额	3,574,549,119.14	5,861,183,214.74
减：本报告期基金总赎回份额	3,571,295,111.76	5,077,484,891.61

本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	9,029,605.16	1,089,494,123.04

注：2015 年 4 月 29 日经持有人大会表决通过了《关于金鹰元泰精选信用债债券型证券投资转型相关事项的议案》，2015 年 5 月 5 日对本基金进行了折算。自 2015 年 5 月 6 日起，原《金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金基金合同》、《金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金托管协议》失效，《金鹰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《金鹰灵活配置混合型证券投资基金托管协议》生效。

§15 重大事件揭示

15.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内以通讯方式召开基金份额持有人大会，并决议将金鹰元泰精选信用债债券型证券投资基金转变为金鹰灵活配置混合型证券投资基金，相关决议履行法定程序后于 2015 年 5 月 6 日生效。

15.2 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

1、报告期内，本基金管理人的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。

2、报告期内，本基金托管人交通银行股份有限公司(以下简称“本行”)因工作需要，刘树军先生不再担任本行资产托管业务中心总裁，任命袁庆伟女士为本行资产托管业务中心总裁。袁庆伟女士的基金行业高级管理人员任职资格已在中国证券投资基金业协会备案。

15.3 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、基金财产的诉讼。

本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项

15.4 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。

15.5 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 42000 元。

15.6 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及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

15.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

15.7.1 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（转型前）

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	
中信证券	1	8,725,536.86	44.78%	7,721.23	44.57%	-
国信证券	1	10,760,229.07	55.22%	9,600.22	55.43%	-

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；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。

15.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况（转型前）

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	30,660,095.90	92.96%	627,200,000.00	100.00%	-	-
中信证券	2,323,500.00	7.04%	0.00	0.00%	-	-

15.7.3 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（转型后）

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	135,865,672.77	4.84%	125,045.10	5.00%	-
安信证券	1	58,586,751.43	2.09%	53,390.11	2.14%	-
财达证券	1	123,883,501.87	4.41%	114,785.00	4.59%	-
财通证券	1	0.00	0.00%	0.00		-
东兴证券	1	6,315,974.70	0.22%	5,755.73	0.23%	-
国信证券	1	423,497,307.20	15.08%	370,600.34	14.82%	-
海通证券	1	141,810,181.67	5.05%	132,068.21	5.28%	-
华创证券	2	640,925,164.10	22.82%	584,073.29	23.36%	-
华林证券	1	89,969,388.59	3.20%	63,995.46	2.56%	-
金元证券	1	19,946,073.72	0.71%	18,176.87	0.73%	-
信达证券	1	771,251,859.09	27.46%	677,508.67	27.10%	-
英大证券	1	100,023,163.84	3.56%	91,151.14	3.65%	-
中金公司	1	6,493,970.60	0.23%	6,047.86	0.24%	-
中信建投证券	1	216,409,064.86	7.71%	191,501.53	7.66%	-
中信证券	1	45,256,941.49	1.61%	40,048.05	1.60%	-
中银国际	1	28,212,428.90	1.00%	25,710.46	1.03%	-

注：本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元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；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。

15.7.4 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况（转型后）

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
爱建证券	7,083,170.60	1.08%	0.00	0.00%	-	-
安信证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-	-
财达证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-	-
财通证券	639,542,798.76	97.60%	0.00	0.00%	-	-
东兴证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-	-
国信证券	1,119,329.90	0.17%	530,000,000.00	4.53%	-	-
海通证券	3,452,496.00	0.53%	290,000,000.00	2.48%	-	-
华创证券	0.00	0.00%	1,560,000,000.00	13.33%	-	-
华林证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-	-
金元证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-	-
信达证券	2,013,576.00	0.31%	8,695,700,000.00	74.29%	-	-
英大证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-	-
中金公司	0.00	0.00%	330,000,000.00	2.82%	-	-
中信建投证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-	-
中信证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-	-
中银国际	2,032,285.10	0.31%	300,000,000.00	2.56%	-	-

§16 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