

# 金鹰技术领先灵活配置混合型证券投资基金

## 2017 年半年度报告

### 2017 年 6 月 30 日

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年八月二十六日

## 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。本半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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 25 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>2 基金简介</b> .....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>4 管理人报告</b> .....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 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.....	12
<b>5 托管人报告</b> .....	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	12
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.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
<b>7 投资组合报告</b> .....	41
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
7.3 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.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
7.6 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.....	50
7.7 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.....	50
7.8 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.....	50
7.9 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.....	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
7.12 投资组合报告附注.....	51
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52

8.2 期末上市基金前十名持有人.....	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
8.4 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.....	52
<b>9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>53</b>
<b>10 重大事件揭示.....</b>	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
10.2 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.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....	53
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>55</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
<b>12 备查文件目录.....</b>	<b>55</b>
12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	金鹰技术领先灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	金鹰技术领先灵活配置混合	
基金主代码	210007	
交易代码	210007	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 7 月 9 日	
基金管理人	金鹰基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	16,940,142.87 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	金鹰技术领先混合 A	金鹰技术领先混合 C
下属分级基金的交易代码	210007	002196
报告期末下属分级基金的份额总额	15,736,413.04 份	1,203,729.83 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制风险并保持良好流动性的前提下，投资于技术领先相关主题的上市公司，通过对股票、固定收益和现金类等资产的积极配置，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	本基金将从宏观经济、宏观政策、证券市场和行业因素等维度进行综合分析，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。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准：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。

### 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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	苏文锋	王永民
	联系电话	020-83282627	010-66594896
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	fcid@bank-of-china.com
客户服务电话		4006135888,020-83936180	95566
传真		020-83282856	010-66594942

注册地址	广东省珠海市香洲区水湾路 246号3栋2单元3D房	北京西城区复兴门内大街1号
办公地址	广州市天河区珠江东路28号越 秀金融大厦30层	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码	510623	100818
法定代表人	刘岩	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.gefund.com.cn">http://www.gefund.com.cn</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	金鹰基金管理有限公司	广东省广州市天河区珠江新城珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 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	报告期（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日）	
	金鹰技术领先混合 A	金鹰技术领先混合 C
本期已实现收益	-1,806,348.74	-131,181.04
本期利润	-1,531,838.72	-165,109.06
加权平均基金份额本期利润	-0.0898	-0.1257
本期加权平均净值利润率	-8.03%	-11.23%
本期基金份额净值增长率	-7.69%	-7.50%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
	金鹰技术领先混合 A	金鹰技术领先混合 C
期末可供分配利润	5,808,717.08	72,813.29
期末可供分配基金份额利润	0.3691	0.0605
期末基金资产净值	16,631,839.99	1,276,543.12
期末基金份额净值	1.057	1.060
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
	金鹰技术领先混合 A	金鹰技术领先混合 C
基金份额累计净值增长率	5.70%	6.00%

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

金鹰技术领先混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.96%	0.73%	3.09%	0.34%	-2.13%	0.39%
过去三个月	-6.54%	0.84%	3.10%	0.32%	-9.64%	0.52%
过去六个月	-7.69%	0.85%	5.20%	0.29%	-12.89%	0.56%
过去一年	-9.35%	0.60%	8.06%	0.35%	-17.41%	0.25%
自基金合同生效起至今	5.70%	0.63%	5.01%	0.82%	0.69%	-0.19%

金鹰技术领先混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.95%	0.72%	3.09%	0.34%	-2.14%	0.38%
过去三个月	-6.53%	0.84%	3.10%	0.32%	-9.63%	0.52%
过去六个月	-7.50%	0.86%	5.20%	0.29%	-12.70%	0.57%
过去一年	6.00%	1.23%	8.06%	0.35%	-2.06%	0.88%
自基金合同生效起至今	6.00%	1.15%	9.61%	0.37%	-3.61%	0.78%

注：c 类份额为 2016 年 5 月 13 日成立。

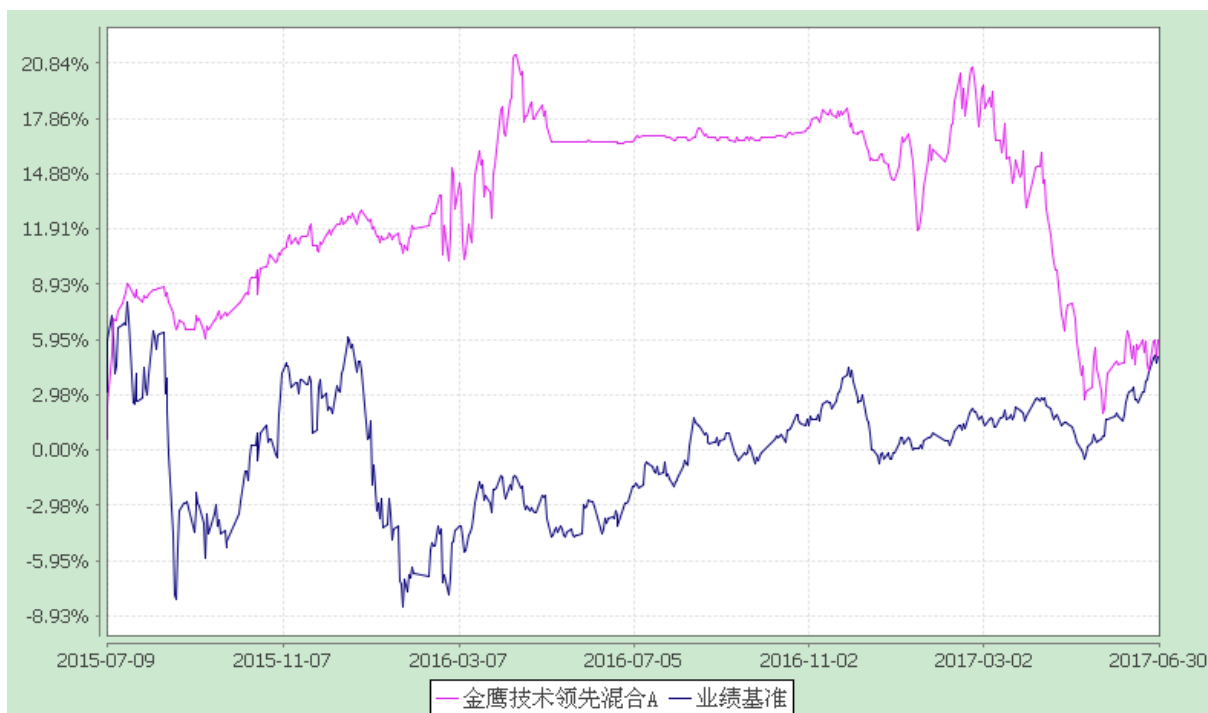
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

金鹰技术领先灵活配置混合型证券投资基金

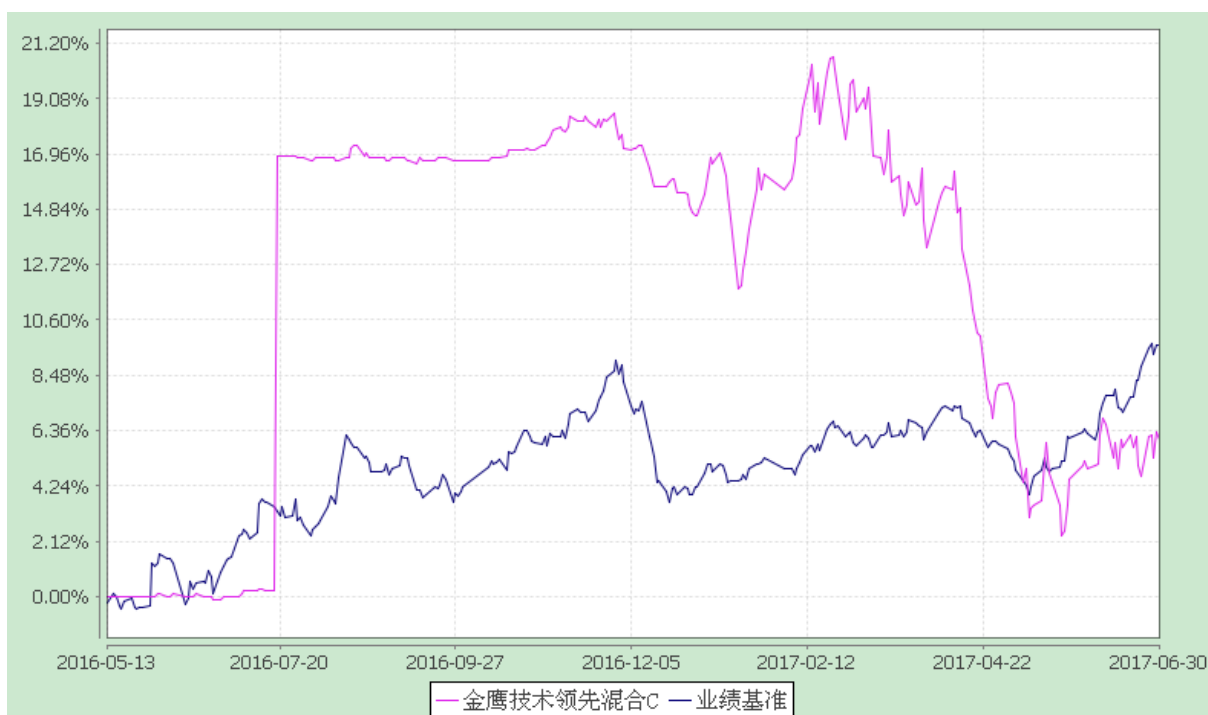
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015 年 7 月 9 日至 2017 年 6 月 30 日)

金鹰技术领先混合 A



金鹰技术领先混合 C



注：c 类份额为 2016 年 5 月 13 日成立。

(1) 报告期末，本基金各项投资比例符合基金合同约定。(2) 本基金的业绩比较基准是：沪深 300 指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。



## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

金鹰基金管理有限公司经中国证监会证监基字[2002]97 号文批准，于 2002 年 12 月 25 日成立，总部设在广州，目前注册资本 2.5 亿元人民币。2011 年 12 月公司获得特定客户资产管理计划业务资格，2013 年 7 月子公司-深圳前海金鹰资产管理有限公司成立。

“以人为本、互信协作；创新谋变、挑战超越”是金鹰人的核心价值观，在经营管理班子的带领下，公司追求以更高的标准为投资者提供贴心专业的财富管理服务，赢得市场认可。通过全体员工的奋发努力，公司各方面都发生了积极的蜕变，业绩和规模都有了较大的提升。

截至 2017 年 6 月 30 日，公司下设权益投资部等 18 个一级职能部门及北京、广州、上海、深圳、成都共五个分公司和一个子公司（深圳前海金鹰资产管理有限公司），管理公募基金 38 只，管理资产规模 401.63 亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王喆	权益投资部总监、基金经理	2015-08-13	-	18	王喆先生，工商管理硕士。历任沈阳商品交易所分析员、宏源研究发展中心高级行业研究员、宏源证券资产管理部高级投资经理。2010 年加入广州证券，担任投资管理部助理投资总监、广州证券红棉 1 号投资主办等职。2014 年 11 月加入金鹰基金管理有限公司，现任权益投资部总监、金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金、金鹰成份股优选证券投资基金、金鹰技术领先灵活配置混合型证券投资基金、金鹰民族新兴灵活配置混合型证券投资基金及金鹰改革红利灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
吴德瑄	基金经理	2016-12-27	-	5	吴德瑄先生，硕士研究生，历任广州证券股份有限公司资产管理部行业研究员，2015 年 1 月加入金鹰基金管理有限公司，担任行业研

					究员, 现任金鹰技术领先灵活配置混合型证券投资基金基金经理及多个基金的基金经理助理。
--	--	--	--	--	--

注：1、任职日期和离任日期指公司公告聘任或解聘日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，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中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，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。

##### 4.3.2 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

2017 年上半年，宏观经济整体平稳，由于基数原因，企业盈利保持较快增长。虽然流动性整体仍较宽松，但利率上行，流动性边际有所收紧。而且金融从严监管导致市场风险偏好明显回落。因此上半年 A 股市场整体出现明显分化，市场热点主要集中在确定性增长的板块。确定性增长的蓝筹

白马股领涨市场，而成长股及题材股出现明显回落。同时，受益于政策刺激，相关题材股阶段性表现良好，例如一带一路、雄安新区、人工智能等等。上半年上证综指上涨 3.76%，创业板指数下跌 6.14%。

上半年我们采取了相对稳健的操作策略，保持股票持仓的弹性，由于对于流动性边际及宏观的不确定的考虑，积极布局业绩增长较为确定的行业。但在操作中由于对于蓝筹股行情准备不充分，同时也未能把握到主题性机会，业绩表现落后于基准。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金 A 份额净值为 1.057，本报告期份额净值增长率为-7.69%，同期业绩比较基准增长率为 5.20%；C 份额净值为 1.060，本报告期份额净值增长率为-7.50%，同期业绩比较基准增长率为 5.20%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于三季度，我们认为宏观情况主要可以概括为以下几点：1、从宏观数据来看，整体经济复苏的态势有望持续，三季度可能会面临一个相对较好的宏观环境；2、从流动性角度来看，流动性边际有望得到改善；3、从全球情况来看，发达国家经济复苏趋势相对明显；4、政策层面来看，二季度监管政策明显加强，三季度边际或有所改善，同时改革有望继续推进。这些都有利于市场的风险偏好回升。

综上所述，我们认为三季度随着市场风险偏好的回升，市场整体的表现会相对乐观，存在阶段性反弹的机会。重点配置业绩快速向好同时估值合理的行业。另外，整个三季度的宏观及流动的边际改善，同时伴随着十九大的临近，相关板块也有存在一定的机会。

#### 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、分管领导、权益投资部负责人、固定收益部负责人、研究部负责人、基金事务部负责人、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**

本基金本报告期没有实施利润分配。

#### **4.8 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**

报告期内，本基金资产净值发生过已连续超过 60 个工作日低于 5000 万元的情形，本基金管理人已按法规要求向证监会报送解决方案。

### **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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在金鹰技术领先灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### **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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### **5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见**

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：金鹰技术领先灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	1,509,917.08	10,633,509.05
结算备付金		276,300.44	1,448,918.70
存出保证金		25,143.86	4,993.86
交易性金融资产	6.4.7.2	16,961,693.18	8,019,300.00
其中：股票投资		16,961,693.18	8,019,300.00
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	374.98	1,693.39
应收股利		-	-
应收申购款		6,701.15	494,999.97
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		18,780,130.69	20,603,414.97
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		-	-
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		36,882.28	-
应付赎回款		169,511.91	19,647.32
应付管理人报酬		23,122.56	25,274.50
应付托管费		3,853.76	4,212.43
应付销售服务费		114.10	44.81
应付交易费用	6.4.7.6	95,852.22	13,302.78
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	542,410.75	605,000.00
负债合计		871,747.58	667,481.84
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.8	12,026,852.74	12,101,319.63
未分配利润	6.4.7.9	5,881,530.37	7,834,613.50
所有者权益合计		17,908,383.11	19,935,933.13
负债和所有者权益总计		18,780,130.69	20,603,414.97

注：截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日，基金份额总额 16,940,142.87 份。其中，A 类基金份额基金份额净值 1.057 元，A 类份额总额 15,736,413.04 份；C 类基金份额基金份额净值 1.060 元，C 类份额总额 1,203,729.83 份。

## 6.2 利润表

会计主体：金鹰技术领先灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>-1,084,376.04</b>	<b>1,982,709.48</b>
1.利息收入		32,691.31	343,643.88
其中：存款利息收入	6.4.7.10	11,133.56	65,004.12
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		21,557.75	278,639.76
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,397,583.04	2,104,734.76
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-1,447,575.44	2,104,552.90
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	49,992.40	181.86
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	240,582.00	-561,374.46
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	39,933.69	95,705.30

<b>减：二、费用</b>		<b>612,571.74</b>	<b>691,102.70</b>
1. 管理人报酬		152,916.81	384,592.04
2. 托管费		25,486.15	64,098.69
3. 销售服务费		724.79	983.78
4. 交易费用	6.4.7.19	395,046.30	106,723.27
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	38,397.69	134,704.92
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-1,696,947.78</b>	<b>1,291,606.78</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-1,696,947.78</b>	<b>1,291,606.78</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金鹰技术领先灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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）	12,101,319.63	7,834,613.50	19,935,933.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,696,947.78	-1,696,947.78
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）	-74,466.89	-256,135.35	-330,602.24
其中：1.基金申购款	6,676,371.33	2,498,995.31	9,175,366.64
2.基金赎回款	-6,750,838.22	-2,755,130.66	-9,505,968.88
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）	12,026,852.74	5,881,530.37	17,908,383.11
项目	上年度可比期间		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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）	41,110,002.60	26,353,542.47	67,463,545.07
二、本期经营活动产生的	-	1,291,606.78	1,291,606.78

基金净值变动数（本期利润）			
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）	-9,255,123.45	-11,080,908.64	-20,336,032.09
其中：1.基金申购款	12,733,153.74	3,074,158.04	15,807,311.78
2.基金赎回款	-21,988,277.19	-14,155,066.68	-36,143,343.87
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）	31,854,879.15	16,564,240.61	48,419,119.76

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金(简称"本基金")，经中国证券监督管理委员会（简称"中国证监会"）证监基金字[2011]342 号文《关于同意金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金备案确认的函》批准，于 2011 年 6 月 1 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 431,551,810.02 份基金份额。本基金募集期间自 2011 年 4 月 26 日起至 2011 年 5 月 27 日止，净认购额 431,530,928.80 元，认购资金在认购期间的银行利息 20,881.22 元折算成基金资产。上述资金已于 2011 年 6 月 1 日全额划入本基金在基金托管人中国银行开立的本基金托管专户。验资机构为立信羊城会计师事务所。本基金的基金管理人为金鹰基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司（简称："中国银行"）

### 6.4.2 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。



### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则和《证券投资基金会计核算业务指引》的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日期间的经营成果和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。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。

#### 6.4.4.2 记账本位币

基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成一个单位的金融资产（负债），并形成其他单位的金融负债（资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

金融资产应当在初始确认时划分为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项，以及可供出售金融资产。金融资产分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。

本基金将持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）于初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金将持有的其他金融资产划分为贷款和应收款项，包括银行存款和各类应收款项等。

##### (2) 金融负债分类

金融负债应当在初始确认时划分为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债两类。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

基金初始确认金融资产或金融负债，应当按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票投资、债券投资等，以及不作为有效套期工具的衍生金融工具，相关的交易费用在发生时计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，相关交易费用在发生时计入初始确认金额。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量。

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，其中包括同时结转的公允价值变动收益。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）。本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账。

因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价，于股权分置改革方案实施后的股票复牌日，冲减股票投资成本。

卖出股票于成交日确认股票投资收益，出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

#### (2) 债券投资

买入证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本。

买入未上市债券和银行间同业市场交易的债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交总额扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本。

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限计算应收利息，按上述会计处理方法核算。

卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券投资收益。

卖出未上市债券和银行间同业市场交易的债券于成交日确认债券投资收益。

卖出债券的成本按移动加权平均法结转。

### (3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账。

配股权证及由股权分置改革而被动获得的权证，在确认日记录所获分配的权证数量，该类权证初始成本为零。

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，出售权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

### (4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本。

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算。

### (5) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购）以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

## 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金目前金融资产和金融负债的估值原则和方法如下：

### 1、股票估值原则和方法

#### (1) 上市流通股票的估值

上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

#### (2) 未上市股票的估值

送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。

### （3）长期停牌股票的估值

已停牌股票且潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，本基金根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

### （4）有明确锁定期股票的估值

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的收盘价估值；非公开发行且处于明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

## 2、固定收益证券的估值原则和方法

（1）交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

（2）交易所市场上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息后得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

（3）交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

（4）交易所市场发行未上市或未挂牌转让的固定收益品种，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

（5）银行间市场交易的固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。

（6）对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的固定收益品种，按成本估值。

（7）同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

### 3、权证估值原则和方法

认沽/认购权证的估值，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的认沽/认购权证按估值日的最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。未上市交易的认沽/认购权证采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值；停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

### 4、股指期货估值原则和方法

股指期货合约，一般以估值当日股指期货的结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。当日结算价及结算规则以《中国金融期货交易所结算细则》为准。如法律法规今后另有规定的，从其规定。

### 5、其他资产的估值原则和方法

其他资产按照国家有关规定或行业约定进行估值。

6、在任何情况下，基金管理人采用上述 1-5 项规定的方法对基金财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人有着充足的理由认为按上述方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素的基础上与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

7、国家有最新规定的，按其规定进行估值。

#### **6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### **6.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **6.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申

购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在"损益平准金"科目中核算，并于期末全额转入"未分配利润/(累计亏损)"。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在"损益平准金"科目中核算，并于期末全额转入"未分配利润/(累计亏损)"。

#### 6.4.4.9收入/(损失)的确认和计量

1、存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

2、债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

3、资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，在证券实际持有期内逐日计提；

4、买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

5、股票投资收益于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额入账；

6、债券投资收益于卖出债券成交日确认，并按卖出债券成交金额与其成本、应收利息的差额入账；

7、衍生工具投资收益于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交总额与其成本的差额入账；

8、股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

9、公允价值变动收益系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

10、其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 6.4.4.10费用的确认和计量

1、基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50%的年费率逐日计提；

- 2、基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率逐日计提；
- 3、基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.1% 年费率计提，本基金 A 类基金份额不收取销售服务费；
- 4、卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；
- 5、其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第五位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

- 1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- 2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- 3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- 4、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权；
- 5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《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》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过

交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 在银行间同业市场交易的债券品种,根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值,具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4) 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),按照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》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无差错更正。

## 6.4.6 税项

### 1、印花税

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

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

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

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

### 2、营业税、增值税、企业所得税



根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》，自 2016 年 5 月 1 日起，证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征营业税或增值税。对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	1,509,917.08
定期存款	-
其他存款	-
合计	1,509,917.08

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	17,196,745.40	16,961,693.18	-235,052.22
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	17,196,745.40	16,961,693.18	-235,052.22

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

**6.4.7.4 买入返售金融资产****6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

注：本基金本报告期末无买入返售金融资产。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	252.93
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	111.88
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	10.17
合计	374.98

**6.4.7.6 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	95,852.22
银行间市场应付交易费用	-
合计	95,852.22

**6.4.7.7 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	54.66
预提审计费	37,396.69
预提信息披露费	504,959.40
合计	542,410.75

**6.4.7.8 实收基金**

金鹰技术领先混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	16,990,288.29	11,685,469.71
本期申购	4,056,098.49	2,789,803.47
本期赎回（以“-”号填列）	-5,309,973.74	-3,652,150.27
本期末	15,736,413.04	10,823,122.91

金鹰技术领先混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	415,849.92	415,849.92
本期申购	3,886,567.86	3,886,567.86
本期赎回（以“-”号填列）	-3,098,687.95	-3,098,687.95
本期末	1,203,729.83	1,203,729.83

**6.4.7.9 未分配利润**

金鹰技术领先混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	15,025,902.90	-7,252,065.51	7,773,837.39
本期利润	-1,806,348.74	274,510.02	-1,531,838.72
本期基金份额交易产生的变动数	-991,274.85	557,993.26	-433,281.59
其中：基金申购款	3,460,307.11	-1,547,379.53	1,912,927.58
基金赎回款	-4,451,581.96	2,105,372.79	-2,346,209.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,228,279.31	-6,419,562.23	5,808,717.08

金鹰技术领先混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	71,833.76	-11,057.65	60,776.11
本期利润	-131,181.04	-33,928.02	-165,109.06
本期基金份额交易产生的变动数	141,487.68	35,658.56	177,146.24
其中：基金申购款	554,562.07	31,505.66	586,067.73
基金赎回款	-413,074.39	4,152.90	-408,921.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	82,140.40	-9,327.11	72,813.29

**6.4.7.10 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	6,435.71
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	4,534.59
其他	163.26
合计	11,133.56

**6.4.7.11 股票投资收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	127,798,807.24
减：卖出股票成本总额	129,246,382.68
买卖股票差价收入	-1,447,575.44

**6.4.7.12 债券投资收益**

本基金本报告期无债券投资收益。

**6.4.7.13 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

本基金本报告均无贵金属投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	49,992.40
基金投资产生的股利收益	-
合计	49,992.40

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1.交易性金融资产	240,582.00
——股票投资	240,582.00
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	240,582.00

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	31,741.47
转换费收入	8,192.22
合计	39,933.69

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	395,046.30
银行间市场交易费用	-
合计	395,046.30

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	12,396.69
信息披露费	4,959.40
银行汇划费	3,041.60
银行间账户维护费	18,000.00
合计	38,397.69

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金没有须作披露的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截止本财务报告批准报出日，本基金没有重大须作披露的资产负债表日后事项。

**6.4.9 关联方关系****6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

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
金鹰基金管理有限公司	基金发起人、管理人、销售机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期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。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	152,916.81	384,592.04
其中：支付销售机构的客户维护费	75,441.23	93,701.07

注：1、基金管理费按前一日基金资产净值的 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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	25,486.15	64,098.69

注：1、基金托管人的基金托管费按基金财产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金财产净值

2、基金托管费每日计提，按月支付。基金管理人应于次月首日起 5 个工作日内做出划付指令；基金托管人应在次月首日起 10 个工作日内完成复核，并从该基金财产中一次性支付托管费给该基金托管人。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	金鹰技术领先混合 A	金鹰技术领先混合 C	合计
金鹰基金管理有限公司	-	-	-
广州证券股份有限公司	-	-	-
中国银行	-	-	-
合计	-	-	-
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	金鹰技术领先混合 A	金鹰技术领先混合 C	合计
金鹰基金管理有限公司	-	983.78	983.78
广州证券股份有限公司	-	-	-
中国银行	-	-	-
合计	-	983.78	983.78

注：1、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，本基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.1% 年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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



销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人并由基金管理人代付给各基金销售机构。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

1、本基金本报告期及上年度可比期间均无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

截至本报告末本基金管理人未持有本基金。

##### 6.4.10.4.2 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

本基金本报告期无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.10.5 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	
	2017年1月1日至2017年6月30日		2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	1,509,917.08	6,435.71	3,412,793.27	58,027.13

注：1、本基金清算备付金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算公司等结算账户，本度期末余额 276,300.44 元，清算备付金利息收入 4,534.59 元；2016 年 6 月 30 日余额 2,877,030.92 元，清算备付金利息收入 6,976.03 元。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

1、本基金本报告期及上年度可比期间均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

#### 6.4.12.2 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
000662	天夏智慧	2017-06-05	重大事项停牌	17.34	-	-	55,138.00	1,038,196.36	956,092.92	重大事项

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日，本基金报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日，本基金报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险等。基金成立以来，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，致力于内控机制的建立和完善，公司内部管理制度及业务规范流程的制定和完善，加强内部风险的控制与有效防范，以保证各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

为保证公司规范化运作，有效地防范和化解经营风险，确保基金和公司财务和其他信息真实、准确、完整、及时，从而最大程度地保护基金持有人的合法权益，本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了科学合理、控制严密、运行高效的各项管理制度：

###### 1、风险管理控制制度

风险控制制度由总则、风险控制的目标和原则、风险控制的机构设置、风险控制的程序、风险类型的界定、风险控制的主要措施、风险控制的具体制度、风险控制制度的监督与评价等部分组成。

风险控制的具体制度主要包括投资风险管理制度、交易风险控制制度、财务风险控制制度、公司资产管理制度等业务风险控制制度，以及岗位分离制度、业务空间隔离制度、作业规则、岗位职责、反馈制度、资料保全制度、保密制度、员工行为守则等程序性风险管理制度。

## 2、投资管理制度

投资管理制度包括研究业务管理制度、投资决策管理制度、基金交易管理制度等。

制订研究业务管理制度的目的是保持研究工作的独立、客观。研究业务管理制度包括：建立严密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法；根据基金合同要求，在充分研究的基础上建立和维护投资对象备选库；建立研究与投资的业务交流制度，保持通畅的交流渠道；建立研究报告质量评价体系。

制订投资决策业务管理制度的目的是严格遵守法律法规的有关规定，确保基金的投资符合基金合同所规定的投资目标、投资范围、投资策略、投资组合和投资限制等要求。投资决策业务管理制度包括投资决策授权制度；投资决策支持制度，重要投资要有详细的研究报告和风险分析支持；投资风险评估与管理制度，在设定的风险权限额度内进行投资决策；投资管理业绩评价制度等。

制订基金交易管理制度的目的是保证基金投资交易的安全、有效、公平。基金交易管理制度包括基金交易的集中交易制度；交易监测、预警、反馈机制；投资指令审核制度；投资指令公平分配制度；交易记录保管制度；交易绩效评价制度等。

## 3、监察稽核制度

监察稽核制度包括检查公司各业务部门和工作人员是否遵守法律、法规、规章的有关规定；检查公司各业务部门和工作人员对公司内部控制制度、各项管理制度、业务规章的执行情况；对公司各部门作业流程的遵守合规性和有效性的检查、监督、评价及建议等。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

**6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017年6月30日	上年末 2016年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本统计数据未包含国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债、同业存单。

**6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017年6月30日	上年末 2016年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本统计数据未包含国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债、同业存单。

**6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

**6.4.13.4 市场风险**

市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。

**6.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月 30日	1个月 以内	1-3 个月	6个月 以内	3个月 -1年	6个月 -1年	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产										
银行存款	1,509,917.08	-	-	-	-	-	-	-	-	1,509,917.08
结算备付金	276,300.44	-	-	-	-	-	-	-	-	276,300.44
存出保证金	25,143.86	-	-	-	-	-	-	-	-	25,143.86
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	16,961,693.18	16,961,693.18
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	374.98	374.98
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	6,701.15	6,701.15
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,811,361.38	-	-	-	-	-	-	-	16,968,769.31	18,780,130.69
负债										
短期借款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	36,882.28	36,882.28
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	169,511.91	169,511.91
应付管理人	-	-	-	-	-	-	-	-	23,122.56	23,122.56

报酬										56
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	3,853.76	3,853.76
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-	-	114.10	114.10
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	95,852.22	95,852.22
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	542,410.75	542,410.75
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	871,747.58	871,747.58
利率敏感缺口	1,811,361.38	-	-	-	-	-	-	-	16,097,021.73	17,908,383.11
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 个月 以内	1-3 个月	6 个月 以内	3 个月 -1 年	6 个月 -1 年	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产										
银行存款	10,633,509.05	-	-	-	-	-	-	-	-	10,633,509.05
结算备付金	1,448,918.70	-	-	-	-	-	-	-	-	1,448,918.70
存出保证金	4,993.86	-	-	-	-	-	-	-	-	4,993.86
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	8,019,300.00	8,019,300.00
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	1,693.39	1,693.39
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	494,999.97	494,999.97
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	12,087,421.61	-	-	-	-	-	-	-	8,515,993.36	20,603,414.97
负债										

短期借款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融 负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金 融资产款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清 算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	19,647.32	19,647.32
应付管理人 报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	25,274.50	25,274.50
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	4,212.43	4,212.43
应付销售服 务费	-	-	-	-	-	-	-	-	44.81	44.81
应付交易费 用	-	-	-	-	-	-	-	-	13,302.78	13,302.78
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	605,000.00	605,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	667,481.84	667,481.84
利率敏感 度缺口	12,087,421.61	-	-	-	-	-	-	-	7,848,511.52	19,935,933.13

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金报告期末未持有债券投资组合，不存在利率变动风险。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

## 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	16,961,693.18	94.71	8,019,300.00	40.23
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	16,961,693.18	94.71	8,019,300.00	40.23

注：本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险,并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

## 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

金鹰技术领先混合 A

假设	市场其他变量保持不变，只有业绩比较基准所对应的市场组合价格发生合理、可能的变动；		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	业绩比较基准变动+5%	1,537,323.98	430,971.77
	业绩比较基准变动-5%	-1,537,323.98	-430,971.77

金鹰技术领先混合 C

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	业绩比较基准变动+5%	117,295.76	10,556.00



	业绩比较基准变动-5%	-117,295.76	-10,556.00
--	-------------	-------------	------------

#### 6.4.14 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。

## 7 投资组合报告

### 7.1 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	16,961,693.18	90.32
	其中：股票	16,961,693.18	90.32
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	1,786,217.52	9.51
7	其他各项资产	32,219.99	0.17
8	合计	18,780,130.69	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 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	273,131.00	1.53
C	制造业	5,917,145.13	33.04
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	8,840,026.85	49.36
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,648,151.80	9.20
J	金融业	283,238.40	1.58
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	16,961,693.18	94.71

## 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末无港股通股票投资组合。

## 7.3 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	600961	株冶集团	213,914	1,848,216.96	10.32
2	600115	东方航空	264,633	1,799,504.40	10.05
3	600029	南方航空	205,351	1,786,553.70	9.98
4	601111	中国国航	182,801	1,782,309.75	9.95
5	600221	海航控股	374,300	1,205,246.00	6.73
6	601021	春秋航空	33,900	1,140,057.00	6.37
7	603885	吉祥航空	74,200	1,126,356.00	6.29
8	000662	天夏智慧	55,138	956,092.92	5.34
9	002174	游族网络	25,680	815,596.80	4.55
10	002185	华天科技	95,900	694,316.00	3.88
11	600408	安泰集团	176,875	684,506.25	3.82
12	000636	风华高科	75,016	638,386.16	3.56
13	002138	顺络电子	33,748	627,037.84	3.50
14	600406	国电南瑞	31,400	554,210.00	3.09
15	600015	华夏银行	30,720	283,238.40	1.58
16	600718	东软集团	17,900	278,345.00	1.55
17	600135	乐凯胶片	17,500	272,825.00	1.52
18	603993	洛阳钼业	46,600	235,796.00	1.32
19	000400	许继电气	10,900	195,764.00	1.09
20	600497	驰宏锌锗	5,700	37,335.00	0.21

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 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	600497	驰宏锌锗	3,259,782.00	16.35
2	601111	中国国航	2,668,575.00	13.39
3	600029	南方航空	2,441,000.00	12.24
4	000060	中金岭南	2,230,062.00	11.19
5	601179	中国西电	2,048,109.00	10.27
6	600408	安泰集团	2,044,195.00	10.25

7	000751	锌业股份	1,984,956.00	9.96
8	601919	中远海控	1,945,750.48	9.76
9	600115	东方航空	1,915,304.00	9.61
10	600961	株冶集团	1,887,533.02	9.47
11	002145	中核钛白	1,834,761.00	9.20
12	002114	罗平锌电	1,713,546.00	8.60
13	000807	云铝股份	1,626,040.00	8.16
14	000426	兴业矿业	1,579,823.00	7.92
15	002847	盐津铺子	1,527,414.34	7.66
16	600881	亚泰集团	1,474,467.00	7.40
17	000636	风华高科	1,406,142.00	7.05
18	000600	建投能源	1,315,139.00	6.60
19	002174	游族网络	1,310,075.00	6.57
20	603039	泛微网络	1,297,171.00	6.51
21	600221	海航控股	1,289,299.00	6.47
22	000662	天夏智慧	1,255,897.88	6.30
23	601866	中远海发	1,227,526.27	6.16
24	600026	中远海能	1,226,115.00	6.15
25	603885	吉祥航空	1,218,505.00	6.11
26	601021	春秋航空	1,182,834.00	5.93
27	600299	安迪苏	1,178,622.00	5.91
28	601328	交通银行	1,165,475.00	5.85
29	300310	宜通世纪	1,124,283.00	5.64
30	002032	苏泊尔	1,118,514.84	5.61
31	601333	广深铁路	1,110,933.00	5.57
32	000597	东北制药	1,104,799.01	5.54
33	600428	中远海特	1,098,618.00	5.51
34	600135	乐凯胶片	1,082,248.00	5.43
35	601377	兴业证券	1,051,189.00	5.27
36	000520	长航凤凰	1,034,786.73	5.19
37	600030	中信证券	1,023,252.82	5.13
38	601989	中国重工	1,004,300.00	5.04
39	002542	中化岩土	998,706.00	5.01
40	000735	罗牛山	992,272.00	4.98
41	600362	江西铜业	972,932.99	4.88
42	600406	国电南瑞	971,663.00	4.87
43	000878	云南铜业	970,970.00	4.87
44	601166	兴业银行	969,497.00	4.86
45	603133	碳元科技	968,388.00	4.86
46	000401	冀东水泥	956,998.00	4.80
47	600667	太极实业	951,116.00	4.77
48	002655	共达电声	921,494.00	4.62
49	300379	东方通	900,447.00	4.52
50	601766	中国中车	891,900.00	4.47

51	300610	晨化股份	884,116.76	4.43
52	300616	尚品宅配	881,057.00	4.42
53	000800	一汽轿车	872,877.00	4.38
54	600015	华夏银行	871,117.00	4.37
55	600731	湖南海利	850,165.20	4.26
56	600018	上港集团	802,032.00	4.02
57	601788	光大证券	801,930.00	4.02
58	000692	惠天热电	793,200.00	3.98
59	002828	贝肯能源	792,000.00	3.97
60	002138	顺络电子	788,564.00	3.96
61	002466	天齐锂业	778,557.00	3.91
62	000688	建新矿业	773,252.00	3.88
63	002616	长青集团	766,130.00	3.84
64	300152	科融环境	760,921.13	3.82
65	000630	铜陵有色	753,900.00	3.78
66	600095	哈高科	751,365.00	3.77
67	600787	中储股份	749,475.00	3.76
68	600218	全柴动力	745,239.00	3.74
69	600199	金种子酒	740,855.14	3.72
70	000895	双汇发展	739,148.00	3.71
71	000860	顺鑫农业	731,703.23	3.67
72	300613	富瀚微	726,575.00	3.64
73	300615	欣天科技	717,500.00	3.60
74	603589	口子窖	715,905.00	3.59
75	002023	海特高新	714,913.00	3.59
76	300609	汇纳科技	709,673.00	3.56
77	601020	华钰矿业	708,001.00	3.55
78	600317	营口港	705,075.00	3.54
79	600720	祁连山	704,700.00	3.53
80	600583	海油工程	702,841.00	3.53
81	000877	天山股份	701,699.40	3.52
82	601636	旗滨集团	692,370.00	3.47
83	002233	塔牌集团	685,624.00	3.44
84	600801	华新水泥	681,189.00	3.42
85	002185	华天科技	677,800.00	3.40
86	000410	*ST 沈机	677,035.00	3.40
87	300604	长川科技	667,652.00	3.35
88	000965	天保基建	657,141.00	3.30
89	600578	京能电力	650,808.00	3.26
90	600118	中国卫星	629,370.00	3.16
91	601555	东吴证券	626,189.00	3.14
92	603993	洛阳钼业	618,054.00	3.10
93	000596	古井贡酒	613,434.00	3.08
94	600495	晋西车轴	613,221.00	3.08

95	000534	万泽股份	610,663.00	3.06
96	601126	四方股份	606,348.00	3.04
97	002845	同兴达	589,097.42	2.95
98	601857	中国石油	583,943.00	2.93
99	300376	易事特	583,660.00	2.93
100	601998	中信银行	582,374.00	2.92
101	600016	民生银行	582,307.00	2.92
102	601601	中国太保	581,694.00	2.92
103	601818	光大银行	581,383.00	2.92
104	601169	北京银行	579,736.00	2.91
105	300327	中颖电子	563,256.32	2.83
106	600425	青松建化	560,208.00	2.81
107	603919	金徽酒	558,580.55	2.80
108	603799	华友钴业	557,415.00	2.80
109	600429	三元股份	549,434.00	2.76
110	600217	中再资环	549,315.00	2.76
111	600109	国金证券	542,010.00	2.72
112	603198	迎驾贡酒	534,870.00	2.68
113	002334	英威腾	531,648.00	2.67
114	603929	亚翔集成	530,384.00	2.66
115	002601	龙麟佰利	500,233.00	2.51
116	002027	分众传媒	493,229.00	2.47
117	002842	翔鹭钨业	478,610.92	2.40
118	000762	西藏矿业	476,399.00	2.39
119	600584	长电科技	469,293.00	2.35
120	002155	湖南黄金	466,616.00	2.34
121	600579	天华院	464,916.00	2.33
122	000799	酒鬼酒	462,080.00	2.32
123	600285	羚锐制药	459,405.00	2.30
124	600201	生物股份	458,337.00	2.30
125	603089	正裕工业	453,628.00	2.28
126	601000	唐山港	448,184.00	2.25
127	002392	北京利尔	444,626.00	2.23
128	300593	新雷能	441,450.00	2.21
129	002736	国信证券	407,030.00	2.04
130	002246	北化股份	403,992.00	2.03
131	603903	中持股份	400,048.00	2.01

## 7.4.2 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	600497	驰宏锌锗	3,174,783.62	15.92
2	000060	中金岭南	2,218,909.63	11.13
3	000751	锌业股份	2,027,133.65	10.17
4	601919	中远海控	1,978,987.32	9.93
5	601179	中国西电	1,978,080.77	9.92
6	002145	中核钛白	1,820,369.00	9.13
7	000807	云铝股份	1,722,248.61	8.64
8	002114	罗平锌电	1,695,389.23	8.50
9	600299	安迪苏	1,614,391.00	8.10
10	000426	兴业矿业	1,529,398.20	7.67
11	600881	亚泰集团	1,520,480.50	7.63
12	000735	罗牛山	1,425,060.00	7.15
13	002847	盐津铺子	1,402,614.00	7.04
14	603039	泛微网络	1,323,965.00	6.64
15	000600	建投能源	1,303,814.86	6.54
16	601111	中国国航	1,236,897.91	6.20
17	300310	宜通世纪	1,212,402.00	6.08
18	600408	安泰集团	1,208,245.06	6.06
19	601866	中远海发	1,178,593.63	5.91
20	600026	中远海能	1,176,856.74	5.90
21	601328	交通银行	1,166,957.00	5.85
22	600428	中远海特	1,161,461.22	5.83
23	002032	苏泊尔	1,136,469.00	5.70
24	601377	兴业证券	1,054,797.00	5.29
25	000520	长航凤凰	1,042,579.00	5.23
26	603133	碳元科技	1,040,401.30	5.22
27	000597	东北制药	1,029,486.00	5.16
28	000401	冀东水泥	1,025,306.00	5.14
29	600030	中信证券	1,019,934.00	5.12
30	600667	太极实业	987,448.56	4.95
31	601166	兴业银行	970,763.00	4.87
32	601989	中国重工	967,200.00	4.85
33	600029	南方航空	965,267.91	4.84
34	000731	四川美丰	963,281.00	4.83
35	000878	云南铜业	962,217.54	4.83
36	002542	中化岩土	956,148.30	4.80
37	600010	包钢股份	943,000.00	4.73
38	601333	广深铁路	935,446.65	4.69
39	600362	江西铜业	932,634.50	4.68
40	300379	东方通	931,363.68	4.67
41	600731	湖南海利	901,069.56	4.52
42	601766	中国中车	900,000.00	4.51
43	002655	共达电声	876,773.22	4.40
44	600871	石化油服	842,000.00	4.22

45	300616	尚品宅配	835,568.00	4.19
46	600801	华新水泥	827,103.00	4.15
47	600359	新农开发	826,439.00	4.15
48	000800	一汽轿车	811,906.00	4.07
49	601788	光大证券	807,356.00	4.05
50	300610	晨化股份	806,028.60	4.04
51	000636	风华高科	796,926.45	4.00
52	002828	贝肯能源	792,280.00	3.97
53	002466	天齐锂业	786,099.00	3.94
54	000692	惠天热电	770,622.13	3.87
55	600018	上港集团	769,296.00	3.86
56	002233	塔牌集团	765,050.00	3.84
57	600787	中储股份	764,159.00	3.83
58	600135	乐凯胶片	759,591.32	3.81
59	000895	双汇发展	756,371.00	3.79
60	000877	天山股份	752,148.00	3.77
61	600720	祁连山	751,832.00	3.77
62	300152	科融环境	749,605.00	3.76
63	600218	全柴动力	736,666.00	3.70
64	002616	长青集团	717,393.13	3.60
65	601636	旗滨集团	715,820.00	3.59
66	600583	海油工程	714,600.00	3.58
67	000688	建新矿业	714,274.76	3.58
68	000860	顺鑫农业	702,396.74	3.52
69	600199	金种子酒	701,097.00	3.52
70	600095	哈高科	700,782.00	3.52
71	603589	口子窖	700,598.00	3.51
72	002023	海特高新	700,068.00	3.51
73	000630	铜陵有色	695,087.00	3.49
74	600578	京能电力	687,342.36	3.45
75	600317	营口港	687,300.00	3.45
76	600251	冠农股份	687,226.00	3.45
77	601020	华钰矿业	686,797.87	3.45
78	000972	*ST 中基	676,706.00	3.39
79	300613	富瀚微	662,407.00	3.32
80	000410	*ST 沈机	660,508.00	3.31
81	000965	天保基建	657,011.00	3.30
82	300615	欣天科技	656,091.00	3.29
83	300604	长川科技	647,288.00	3.25
84	601555	东吴证券	632,642.00	3.17
85	600118	中国卫星	630,488.00	3.16
86	000534	万泽股份	630,434.00	3.16
87	600259	广晟有色	620,217.00	3.11
88	300609	汇纳科技	619,020.00	3.11



89	000596	古井贡酒	615,311.50	3.09
90	300376	易事特	596,750.00	2.99
91	601126	四方股份	590,138.00	2.96
92	600015	华夏银行	587,230.00	2.95
93	600495	晋西车轴	586,131.00	2.94
94	600718	东软集团	585,763.00	2.94
95	002174	游族网络	584,023.13	2.93
96	601818	光大银行	579,958.00	2.91
97	600016	民生银行	579,427.00	2.91
98	601857	中国石油	578,700.00	2.90
99	601601	中国太保	576,866.00	2.89
100	601169	北京银行	576,620.00	2.89
101	601998	中信银行	575,445.00	2.89
102	600109	国金证券	552,566.00	2.77
103	603799	华友钴业	545,900.00	2.74
104	600429	三元股份	542,040.00	2.72
105	002334	英威腾	541,233.00	2.71
106	603919	金徽酒	539,580.51	2.71
107	600425	青松建化	535,805.00	2.69
108	300327	中颖电子	528,125.00	2.65
109	603198	迎驾贡酒	527,143.00	2.64
110	603929	亚翔集成	511,761.37	2.57
111	002845	同兴达	510,888.80	2.56
112	002842	翔鹭钨业	506,416.00	2.54
113	002601	龙麟佰利	494,908.00	2.48
114	002027	分众传媒	490,633.00	2.46
115	000762	西藏矿业	482,661.00	2.42
116	601000	唐山港	472,416.00	2.37
117	300593	新雷能	470,353.00	2.36
118	600579	天华院	469,261.00	2.35
119	000799	酒鬼酒	464,801.00	2.33
120	002155	湖南黄金	460,233.00	2.31
121	600285	羚锐制药	455,962.32	2.29
122	600961	株冶集团	438,038.33	2.20
123	002392	北京利尔	436,706.00	2.19
124	600201	生物股份	434,324.00	2.18
125	600549	厦门钨业	426,398.00	2.14
126	603903	中持股份	423,166.00	2.12
127	600217	中再资环	417,483.28	2.09
128	600406	国电南瑞	412,726.00	2.07
129	002736	国信证券	411,545.00	2.06
130	603089	正裕工业	409,640.00	2.05
131	603993	洛阳钼业	408,792.00	2.05
132	600480	凌云股份	405,600.00	2.03

133	600584	长电科技	405,309.00	2.03
134	600027	华电国际	402,488.00	2.02

#### 7.4.3 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	137,948,193.86
卖出股票的收入（成交）总额	127,798,807.24

#### 7.5 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投资。

#### 7.6 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投资。

#### 7.7 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。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

#### 7.9 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

本基金本报告期末无权证投资。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

##### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

##### 7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券之一的游族网络因信披违规，于 2016 年 12 月 7 日被福建证监局采取责令改正的行政监管措施。

7.12.2 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。

### 7.12.3 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	25,143.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	374.98
5	应收申购款	6,701.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,219.99

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末无处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 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	000662	天夏智慧	956,092.92	5.34	重大事项停牌

### 7.12.6 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。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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
金鹰技术领先混合 A	1,087	14,476.92	0.00	0.00%	15,736,413.04	100.00%
金鹰技术领先混合 C	517	2,328.30	0.00	0.00%	1,203,729.83	100.00%
合计	1,604	10,561.19	0.00	0.00%	16,940,142.87	100.00%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

本基金非上市交易型基金。

### 8.3 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	金鹰技术领先混合 A	-	-
	金鹰技术领先混合 C	8.56	0.00%
	合计	8.56	0.00%

### 8.4 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	金鹰技术领先混合 A	0
	金鹰技术领先混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	金鹰技术领先混合 A	0
	金鹰技术领先混合 C	0
	合计	0

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	金鹰技术领先混合 A	金鹰技术领先混合 C
基金合同生效日（2015 年 7 月 9 日）基金份额总额	20,695,477.24	-
本报告期期初基金份额总额	16,990,288.29	415,849.92
本报告期基金总申购份额	4,056,098.49	3,886,567.86
减：本报告期基金总赎回份额	5,309,973.74	3,098,687.95
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	15,736,413.04	1,203,729.83

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会，无会议决议。

### 10.2 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、经本基金管理人第五届董事会第 40 次会议审议通过，报中国证券投资基金业协会备案，并于 2017 年 6 月 29 日在证监会指定媒体披露，陈瀚同志从 2017 年 6 月 28 日起担任本基金管理人的副总经理。

2、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。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 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。

### 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期未改聘会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易	股票交易	应支付该券商的佣金	备注

	单元数量	成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	1	38,084,154.44	14.33%	34,706.73	14.24%	-
光大证券	1	25,374,933.87	9.55%	23,124.16	9.49%	-
中金公司	1	70,922,478.96	26.69%	66,049.86	27.11%	-
平安证券	2	32,667,333.88	12.29%	29,769.89	12.22%	-
民生证券	1	25,322,728.21	9.53%	23,076.48	9.47%	-
国金证券	1	19,691,296.41	7.41%	17,944.76	7.36%	-
华泰联合证券	1	44,749,742.15	16.84%	40,780.28	16.74%	-
英大证券	1	4,212,609.48	1.59%	3,923.24	1.61%	-
中银国际证券	1	4,717,653.70	1.78%	4,299.12	1.76%	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字[1998]29号）的有关规定要求及金鹰技术领先灵活配置混合型证券投资基金基金合同规定的选择券商的标准，选择券商租用其席位。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元。本基金专用交易单元的选择标准如下：

(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。

#### 10.7.2 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
安信证券	-	-	2,800,000.00	2.02%	-	-
光大证券	-	-	20,300,000.00	14.65%	-	-
中金公司	-	-	113,900,000.00	82.18%	-	-

平安证券	-	-	600,000.0 0	0.43%	-	-
英大证券	-	-	1,000,000. 00	0.72%	-	-

注：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 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

本基金本报告期无投资者持有的基金份额占比达到或者超过20%。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无影响投资者决策的其它重大信息。

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。
- 2、《金鹰技术领先灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、《金鹰技术领先灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。
- 4、金鹰基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程。
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照。
- 6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、季度报告、半年度报告、更新的招募说明书及其他临时公告。

### 12.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅或按工本费购买复印件，也可登录本基金管理人网站查阅，本基金管理人网址：<http://www.gefund.com.cn>。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人客户服务中心，客户服务中心电话：  
4006-135-888 或 020-83936180。

金鹰基金管理有限公司  
二〇一七年八月二十六日