

金鹰技术领先灵活配置混合型证券投资基金

2017 年年度报告摘要

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇一八年三月二十八日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

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

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|-----------------|-----------------|
| 基金简称 | 金鹰技术领先灵活配置混合 | |
| 基金主代码 | 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 | 70,654,653.06 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 | 41,377,663.54 份 | 29,276,989.52 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。本基金投资组合中股票资产占基金资产的比例为 0-95%，投资于技术领先相关主题证券比例不低于非现金资产的 80%。 |
| 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 | 李云亮 | 王永民 |
| | 联系电话 | 010-59944986 | 010-66594896 |
| | 电子邮箱 | csmail@gefund.com.cn | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话 | 4006135888,020-83936180 | | 95566 |
| 传真 | 020-83282856 | | 010-66594942 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.gefund.com.cn |
| 基金年度报告备置地点 | 广州市天河区珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层 |

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间 数据和指 标 | 2017 年 | | 2016 年 | | 2015 年 7 月 9 日（基金合同 生效日）至 2015 年 12 月 31 日 | |
|-----------------------|---------------|---------------|--------------|------------|--|------------|
| | 金鹰技术领先混合 A | 金鹰技术领先混合 C | 金鹰技术领先混合 A | 金鹰技术领先混合 C | 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 | -4,594,711.11 | -2,979,583.17 | 2,008,203.57 | 37,630.11 | 6,038,702.85 | - |
| 本期利润 | -4,524,790.84 | -2,322,870.74 | 1,004,817.01 | 7,558.99 | 4,157,633.90 | - |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.2024 | -0.2582 | 0.0319 | 0.0032 | 0.1017 | - |
| 本期基金份额净值增长率 | -13.97% | -12.91% | 1.42% | 14.60% | 12.90% | - |
| 3.1.2 期末 数据和指 标 | 2017 年末 | | 2016 年末 | | 2015 年末 | |
| 期末可 | 金鹰技术领先混合 A | 金鹰技术领先混合 C | 金鹰技术领先混合 A | 金鹰技术领先混合 C | 金鹰技术领先混合 A | 金鹰技术领先混合 C |
| | 0.2975 | -0.0019 | 0.4575 | 0.1461 | 0.1837 | - |

| | | | | | | |
|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|------------|-------------------|---|
| 供分配 基金份额 利润 | | | | | | |
| 期末基 金资产 净值 | 40,766,807. 52 | 29,220,202.9 4 | 19,459,307.1 0 | 476,626.03 | 67,463,545.0 7 | - |
| 期末基 金份额 净值 | 0.985 | 0.998 | 1.145 | 1.146 | 1.129 | - |

注：1、本基金由金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金自 2015 年 7 月 8 日转型而来，故本基金 A 级份额上上年度可比期间的数据为 2015 年 7 月 9 日至 2015 年 12 月 31 日的财务数据。

2、本基金 C 级份额为 2016 年 5 月 16 日确认申购，故 C 级上年度可比期间数据为 2016 年 5 月 16 日至 2016 年 12 月 31 日的财务数据，C 级无上上年度可比期间数据。

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 |
|----------------|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|---------|-------|
| 过去三个月 | -8.37% | 1.68% | 2.19% | 0.41% | -10.56% | 1.27% |
| 过去六个月 | -6.81% | 1.78% | 4.86% | 0.35% | -11.67% | 1.43% |
| 过去一年 | -13.97% | 1.40% | 10.30% | 0.32% | -24.27% | 1.08% |
| 自基金合同生 效起至今 | -1.50% | 0.98% | 10.11% | 0.75% | -11.61% | 0.23% |

注：

1、本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%

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 |
|----------------|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|---------|-------|
| 过去三个月 | -8.19% | 1.68% | 2.19% | 0.41% | -10.38% | 1.27% |
| 过去六个月 | -5.85% | 1.78% | 4.86% | 0.35% | -10.71% | 1.43% |
| 过去一年 | -12.91% | 1.41% | 10.30% | 0.32% | -23.21% | 1.09% |
| 自基金合同生 效起至今 | -0.20% | 1.38% | 14.94% | 0.36% | -15.14% | 1.02% |

注：

1、本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%

3.2.2 自基金转型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 12 月 31 日)

金鹰技术领先混合 A

(2015 年 7 月 9 日至 2017 年 12 月 31 日)

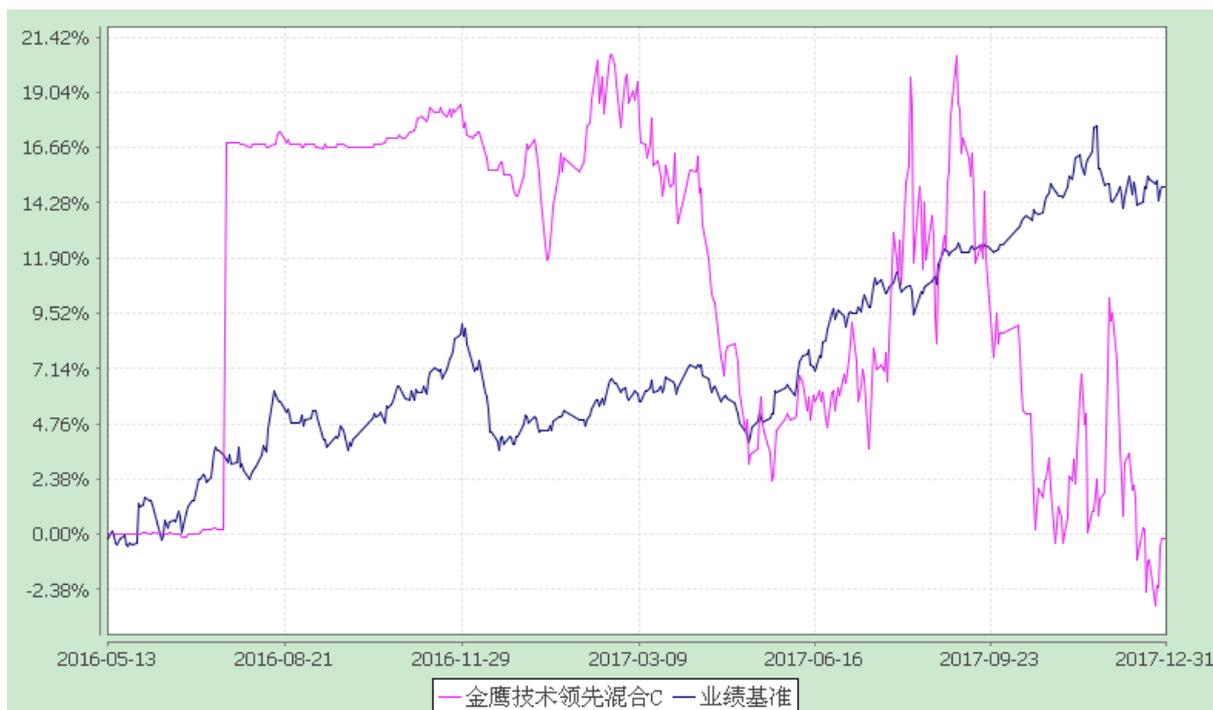


注：

1、本基金 A 类份额 2015 年 7 月 9 日合同生效。

金鹰技术领先混合 C

(2015 年 7 月 9 日至 2017 年 12 月 31 日)



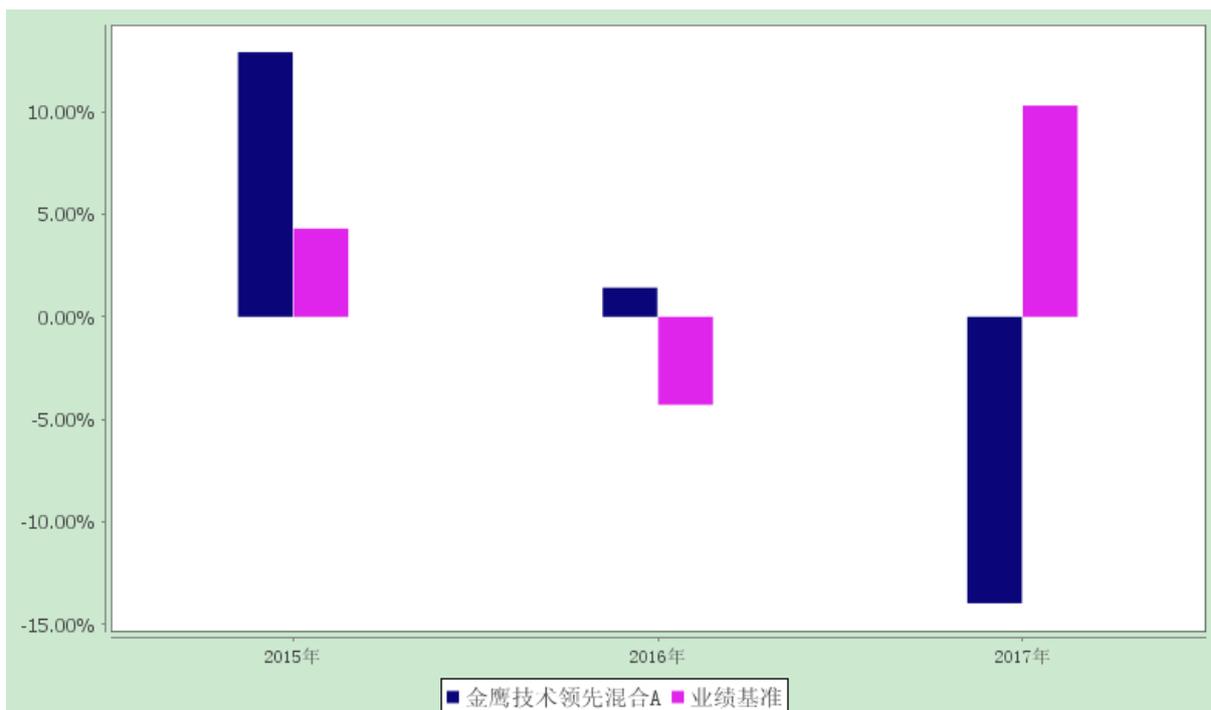
- 注：1、本基金 C 类份额 2016 年 5 月 13 日设立。
- 2、本基金各类资产比例符合基金合同规定。
- 3、本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%

3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

金鹰技术领先灵活配置混合型证券投资基金

自基金转型以来基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图

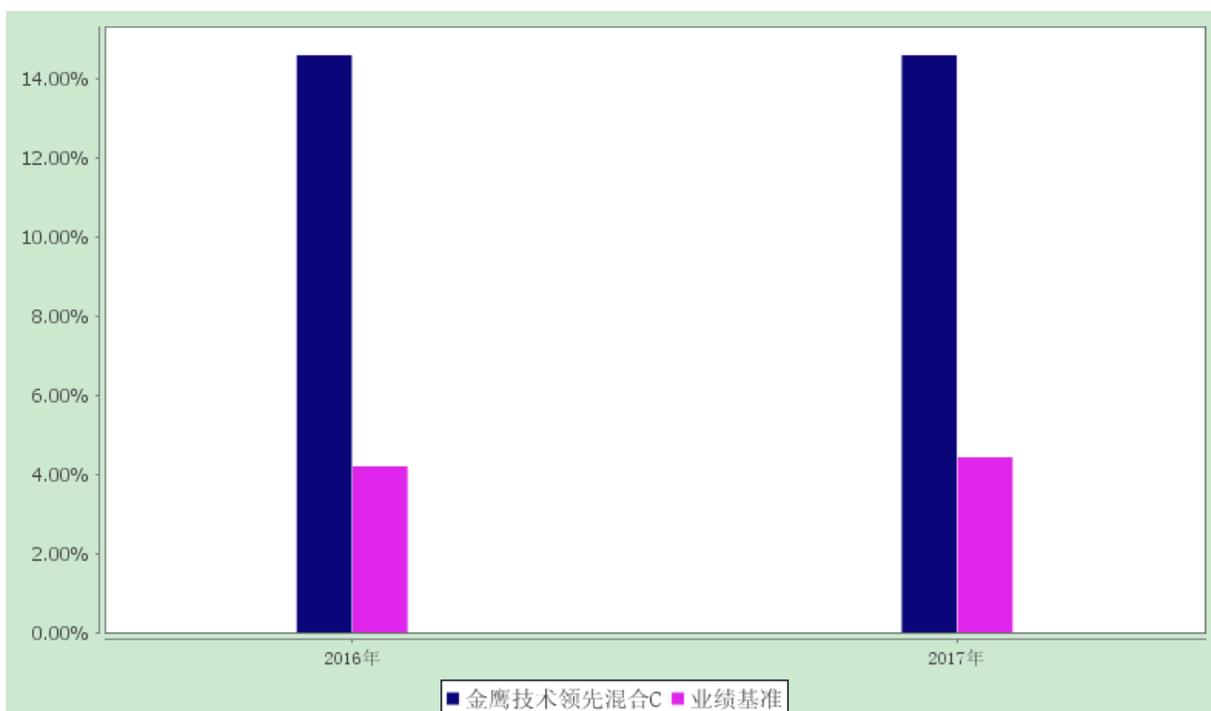
金鹰技术领先混合 A



注：

1、本基金 A 类份额 2015 年 7 月 9 日合同生效。

金鹰技术领先混合 C



注：

1、本基金 C 类份额 2016 年 5 月 13 日设立。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基字[2002]97 号文批准，金鹰基金管理有限公司于 2002 年 12 月 25 日成立，总部设在广州。2011 年 12 月公司获得特定客户资产管理计划业务资格，2013 年 7 月子公司——深圳前海金鹰资产管理有限公司成立。公司下设权益投资部等 18 个一级职能部门以及北京、广州、上海、深圳、成都等 5 个分公司。

“以人为本、互信协作；创新谋变、挑战超越”是金鹰人的核心价值观，在新经营团队的带领下，公司回归投资本源，坚持价值投资为导向，资产规模结构持续优化，不断为投资者创造稳健收益。截至 2017 年 12 月 31 日，公司公募基金规模 447.64 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的 基金经理（助 理）期限 | | 证券 从业 年限 | 说明 |
|----|--------------|-------------------------|------------|----------------|---|
| | | 任职 日期 | 离任 日期 | | |
| 王喆 | 权益投资部总监、基金经理 | 2015-08-13 | 2018-01-24 | 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、金鹰民族新兴混合型证券投资基金、金鹰改革红利混合型证券投资基金及金鹰转型动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |
| 吴 | 基金经理 | 2016- | - | 5 | 吴德瑄先生，曾任广州证券股份有限 |

| | | | | |
|----|--|-------|--|---|
| 德瑄 | | 12-27 | | 公司研究员。2015 年 1 月加入金鹰基金管理有限公司，任研究部研究员、基金经理助理、基金经理职务。现任金鹰技术领先灵活配置混合型证券投资基金、金鹰元禧混合型证券投资基金、金鹰元丰债券型证券投资基金、金鹰元安混合型证券投资基金基金经理，金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金等基金的基金经理助理。 |
|----|--|-------|--|---|

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、王喆先生因公司内部工作安排变动于2018年1月24日离任本基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》和其他有关法律法规及其各项实施准则，严格遵守本基金的基金合同、托管协议、招募说明书等法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，基金运作合法合规，无出现重大违法违规或违反基金合同的行为，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了保证本基金管理人管理的不同投资组合得到公平对待，本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，以及公司内控大纲的要求，制定了《金鹰基金管理有限公司公平交易管理规定》并严格执行，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。本基金管理人通过投资交易系统公平交易功能，对不同投资组合进行公平交易事前控制。同时，本基金管理人引入公平交易分析系统，定期或不定期对公司旗下投资组合在一定期间内买卖相同证券的情况进行监控和分析。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流

程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现。同时通过投资交易系统内的公平交易功能执行交易，以尽可能确保公平对待各投资组合。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年度，宏观经济出现小幅回落，企业盈利继续改善，但是幅度明显收窄。同时货币政策保持稳健偏紧，流动性略显紧张。

A 股市场全年小幅上涨，上证综指上涨 6.56%；创业板呈现单边下行状态，下跌 10.67%。市场整体结构分化明显。市场偏好于业绩确定性的投资品种，并且在政策推动、龙头集中度提升等因素推动下，消费、金融等板块存在较明显的超额收益。

本年度，我们重点配置了有色、钢铁、银行等盈利大幅改善的行业，另外，同时配置了通信、电子等领域。组合整体表现不佳，波动率相对较高。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值为 0.985 元，本报告期份额净值增长率为-13.97%，同期业绩比较基准增长率为 10.30%；C 类基金份额净值为 0.998 元，本报告期份额净值增长率为-12.91%，同期业绩比较基准增长率为 10.30%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018 年，宏观经济仍以平稳为主，略有回落。市场整体仍会保持震荡，大幅波动的概率不大。市场仍会以结构性机会为主。同时，金融监管政策仍将持续对 A 股市场构成较大影响。因此我们判断 2018 年市场整体震荡为主，存阶段性回落的风险。四季度企业盈利实际情况在一季度逐渐明朗，我们认为盈利与估值匹配仍会成为上半年行业配置的重要主线。而上游周期型行业全年盈利确定性高增长，具备较好的配置价值。因此上半年我们将重点配置盈利高增长，且估值较低的周期型品种。同时随着十九大召开，改革预期有望提升，改革等相关板块也值得关注。同时，伴随着成长股估值的回落，部分品种逐渐具备配置价值，逐渐增加成长性行业的配置比例。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会由基金估值业务分管领导、督察长、基金事务部负责人、基金会计、合规风控部人员及相关投研人员等组成。在特殊情况下，公司召集估值委员会会议，讨论和决策特殊估值事项，估值委员会集体决策，需到会的三分之二估值委员会成员表决通过。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理、投资经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行，一切以维护基金持有人利益为准则。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场债券品种的估值数据及交易所交易的债券品种的估值数据、流通受限股票流动性折扣。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截至报告期末，本基金可分配利润为 12,253,490.94 元，本报告期内未实施利润分配。

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

报告期内，本基金资产净值发生过连续超过 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（原金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金）（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的复核，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 审计报告

中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）审计了 2017 年 12 月 31 日的资产负债表、2017 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注，并出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：金鹰技术领先灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产 | 本期末 2017 年 12 月 31 日 | 上年度末 2016 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 资 产： | | |
| 银行存款 | 5,707,784.79 | 10,633,509.05 |
| 结算备付金 | 601,150.20 | 1,448,918.70 |
| 存出保证金 | 51,903.67 | 4,993.86 |
| 交易性金融资产 | 65,812,609.51 | 8,019,300.00 |
| 其中：股票投资 | 65,812,609.51 | 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 | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - |
| 应收证券清算款 | 1,794,568.61 | - |
| 应收利息 | 1,522.00 | 1,693.39 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 447,267.98 | 494,999.97 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 74,416,806.76 | 20,603,414.97 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 | 上年度末 |
| | 2017 年 12 月 31 日 | 2016 年 12 月 31 日 |
| 负 债: | | |
| 短期借款 | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - |
| 应付证券清算款 | - | - |
| 应付赎回款 | 3,650,718.17 | 19,647.32 |
| 应付管理人报酬 | 88,726.17 | 25,274.50 |
| 应付托管费 | 14,787.72 | 4,212.43 |
| 应付销售服务费 | 2,294.90 | 44.81 |
| 应付交易费用 | 338,027.51 | 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 | 335,241.83 | 605,000.00 |
| 负债合计 | 4,429,796.30 | 667,481.84 |
| 所有者权益: | | |

| | | |
|-------------------|----------------------|----------------------|
| 实收基金 | 57,733,519.52 | 12,101,319.63 |
| 未分配利润 | 12,253,490.94 | 7,834,613.50 |
| 所有者权益合计 | 69,987,010.46 | 19,935,933.13 |
| 负债和所有者权益总计 | 74,416,806.76 | 20,603,414.97 |

注：截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日，本基金 A 级份额净值为 0.985 元，A 级基金份额总额为 41,377,663.54 份；本基金 C 级份额净值为 0.998 元，C 级基金份额总额为 29,276,989.52 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|---------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 |
| 一、收入 | -4,843,461.52 | 2,098,865.76 |
| 1.利息收入 | 56,538.21 | 617,455.54 |
| 其中：存款利息收入 | 31,286.47 | 97,260.07 |
| 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 | 25,251.74 | 520,195.47 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | -6,254,010.21 | 2,402,400.02 |
| 其中：股票投资收益 | -6,325,525.61 | 2,394,298.16 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 贵金属投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | 71,515.40 | 8,101.86 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填 | 726,632.70 | -1,033,457.68 |

| | | |
|----------------------------|----------------------|---------------------|
| 列) | | |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 627,377.78 | 112,467.88 |
| 减：二、费用 | 2,004,200.06 | 1,086,489.76 |
| 1. 管理人报酬 | 495,288.16 | 576,263.01 |
| 2. 托管费 | 82,548.10 | 96,043.92 |
| 3. 销售服务费 | 9,224.47 | 1,513.18 |
| 4. 交易费用 | 1,347,296.31 | 142,875.31 |
| 5. 利息支出 | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | - | - |
| 6. 其他费用 | 69,843.02 | 269,794.34 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | -6,847,661.58 | 1,012,376.00 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | -6,847,661.58 | 1,012,376.00 |

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | | |
|---------------------------------|----------------------------------|---------------|---------------|
| | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 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） | - | -6,847,661.58 | -6,847,661.58 |
| 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 | 45,632,199.89 | 11,266,539.02 | 56,898,738.91 |

| | | | |
|--|-----------------------|----------------|-----------------|
| 列) | | | |
| 其中：1.基金申购款 | 159,408,263.74 | 34,041,271.45 | 193,449,535.19 |
| 2.基金赎回款 | -113,776,063.85 | -22,774,732.43 | -136,550,796.28 |
| 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） | 57,733,519.52 | 12,253,490.94 | 69,987,010.46 |
| 项目 | 上年度可比期间 | | |
| | 2016年1月1日至2016年12月31日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 41,110,002.60 | 26,353,542.47 | 67,463,545.07 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 1,012,376.00 | 1,012,376.00 |
| 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） | -29,008,682.97 | -19,531,304.97 | -48,539,987.94 |
| 其中：1.基金申购款 | 14,621,554.41 | 4,032,910.90 | 18,654,465.31 |
| 2.基金赎回款 | -43,630,237.38 | -23,564,215.87 | -67,194,453.25 |
| 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） | 12,101,319.63 | 7,834,613.50 | 19,935,933.13 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 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"）

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布并于 2014 年 7 月修改的《企业会计准则—基本准则》和 41 项具体会计准则及其应用指南、解释及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”），中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》和中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则和《证券投资基金会计核算业务指引》的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日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。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

1、印花税

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

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

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

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

2、营业税、增值税、企业所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》，自 2016 年 5 月 1 日起，证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《财政部 税务总局关于资管产品增值税有关问题的通知》，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

3、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

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

根据财政部、国家税务总局财税字【2012】85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》以及财政部、国家税务总局、证监会财税字[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

7.4.7 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|-----------------|----------------|
| 广州证券股份有限公司 | 基金管理人股东 |
| 广州白云山医药集团股份有限公司 | 基金管理人股东 |
| 美的集团股份有限公司 | 基金管理人股东 |
| 东亚联丰投资管理有限公司 | 基金管理人股东 |
| 金鹰基金管理有限公司 | 基金发起人、管理人、销售机构 |
| 中国银行股份有限公司 | 基金托管人、基金代销机构 |
| 深圳前海金鹰资产管理有限公司 | 基金管理人子公司 |

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告及上年度可比期间均无通过关联方进行股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告及上年度可比期间均无通过关联方进行权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告及上年度可比期间均无通过关联方进行债券交易。

7.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告及上年度可比期间均无通过关联方进行债券回购交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年12 月31日 | 上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12 月31日 |
|-----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 495,288.16 | 576,263.01 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 230,032.18 | 173,744.63 |

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。

3、本基金由金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金自 2015 年 7 月 8 日转型而来，转型前管理费年费率为 1.0%，转型后管理费年费率为 1.5%。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年12 月31日 | 上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12 月31日 |
|----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 82,548.10 | 96,043.92 |

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。

3、本基金由金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金自 2015 年 7 月 8 日转型而来，转型前托管费年费率为 0.15%，转型后托管费年费率为 0.25%。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各 关联方名称 | 本期 2017年1月1日至2017年12月31日 | | |
|--------------------|----------------------------------|------------|----------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 金鹰技术领先混合 A | 金鹰技术领先混合 C | 合计 |
| 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12月31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 | - | 1,399.73 | 1,399.73 |
| 合计 | - | 1,399.73 | 1,399.73 |

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。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未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

金鹰技术领先混合 A

本基金本报告期末及上年度末其他关联方未投资本基金。

金鹰技术领先混合 C

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 2017年1月1日至2017年12月31日 | | 上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日 | |
|------------|-----------------------------|-----------|----------------------------------|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国银行股份有限公司 | 5,707,784.79 | 21,728.41 | 10,633,509.05 | 71,448.82 |

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 601,150.20 元，清算备付金利息收入 9,145.69 元，上一年度期末余额 1,448,918.70 元，清算备付金利息收入 25,743.48 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。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

7.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.8.7.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

本基金本报告期及上年度可比期间未投资本基金。

7.4.9 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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/增发而流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量(股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|--------|------|------------|--------|--------|------------|--------|------------|--------------|--------------|------|
| 000688 | 建新矿业 | 2017-09-06 | 重大事项停牌 | 10.13 | 2018-02-07 | 9.86 | 151,400.00 | 1,527,038.08 | 1,533,682.00 | 重大事项 |
| 601003 | 柳钢股份 | 2017-10-17 | 重大事项 | 7.98 | 2018-01-18 | 7.50 | 257,227.00 | 1,983,105.36 | 2,052,671.46 | 重 |

| | | | | | | | | | | |
|--|--|--|----|--|--|--|---|--|--|-------------|
| | | | 停牌 | | | | 0 | | | 大 事 项 |
|--|--|--|----|--|--|--|---|--|--|-------------|

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 2017 年 12 月 31 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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次, 由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次: 相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次: 相关资产或负债的不可观察输入值。

对于证券交易所上市的股票, 若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况, 本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次; 并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度, 确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的不含权固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外), 采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值, 相关债券的公允价值属第二层次。

除公允价值外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|------|---------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 65,812,609.51 | 88.44 |

| | | | |
|---|-------------------|---------------|--------|
| | 其中：股票 | 65,812,609.51 | 88.44 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 6,308,934.99 | 8.48 |
| 8 | 其他各项资产 | 2,295,262.26 | 3.08 |
| 9 | 合计 | 74,416,806.76 | 100.00 |

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 10,134,144.00 | 14.48 |
| C | 制造业 | 37,726,299.51 | 53.90 |
| 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 | 1,041,903.00 | 1.49 |
| 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 | 16,910,263.00 | 24.16 |
| 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 | 65,812,609.51 | 94.04 |

8.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

8.2.2.1 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|--------------|--------------|
| 1 | 600961 | 株冶集团 | 511,602 | 4,363,965.06 | 6.24 |
| 2 | 601939 | 建设银行 | 556,800 | 4,276,224.00 | 6.11 |
| 3 | 601398 | 工商银行 | 686,325 | 4,255,215.00 | 6.08 |
| 4 | 000717 | 韶钢松山 | 476,900 | 4,225,334.00 | 6.04 |
| 5 | 300473 | 德尔股份 | 106,400 | 4,224,080.00 | 6.04 |
| 6 | 600019 | 宝钢股份 | 488,343 | 4,219,283.52 | 6.03 |
| 7 | 601288 | 农业银行 | 1,101,500 | 4,218,745.00 | 6.03 |
| 8 | 600782 | 新钢股份 | 640,309 | 4,213,233.22 | 6.02 |
| 9 | 600507 | 方大特钢 | 330,125 | 4,189,286.25 | 5.99 |
| 10 | 601328 | 交通银行 | 669,900 | 4,160,079.00 | 5.94 |

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1 | 000761 | 本钢板材 | 11,461,871.00 | 57.49 |
| 2 | 600497 | 驰宏锌锗 | 9,902,571.60 | 49.67 |
| 3 | 600282 | 南钢股份 | 9,617,455.00 | 48.24 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|-------|
| 4 | 601111 | 中国国航 | 8,515,330.75 | 42.71 |
| 5 | 600782 | 新钢股份 | 8,281,658.00 | 41.54 |
| 6 | 600569 | 安阳钢铁 | 8,026,333.94 | 40.26 |
| 7 | 600029 | 南方航空 | 7,886,764.00 | 39.56 |
| 8 | 600808 | 马钢股份 | 7,758,429.00 | 38.92 |
| 9 | 600115 | 东方航空 | 7,666,948.00 | 38.46 |
| 10 | 000807 | 云铝股份 | 7,242,476.86 | 36.33 |
| 11 | 000060 | 中金岭南 | 7,041,294.51 | 35.32 |
| 12 | 600019 | 宝钢股份 | 6,751,484.34 | 33.87 |
| 13 | 603885 | 吉祥航空 | 6,076,149.00 | 30.48 |
| 14 | 601021 | 春秋航空 | 6,009,038.08 | 30.14 |
| 15 | 600058 | 五矿发展 | 5,948,334.00 | 29.84 |
| 16 | 600507 | 方大特钢 | 5,762,543.00 | 28.91 |
| 17 | 000751 | 锌业股份 | 5,511,637.79 | 27.65 |
| 18 | 000717 | 韶钢松山 | 5,320,067.99 | 26.69 |
| 19 | 601328 | 交通银行 | 5,318,855.00 | 26.68 |
| 20 | 600581 | 八一钢铁 | 5,311,139.00 | 26.64 |
| 21 | 600231 | 凌钢股份 | 5,252,800.00 | 26.35 |
| 22 | 600961 | 株冶集团 | 5,166,519.20 | 25.92 |
| 23 | 000426 | 兴业矿业 | 5,038,358.00 | 25.27 |
| 24 | 300473 | 德尔股份 | 4,966,713.00 | 24.91 |
| 25 | 000898 | 鞍钢股份 | 4,939,087.00 | 24.77 |
| 26 | 600050 | 中国联通 | 4,888,282.00 | 24.52 |
| 27 | 000878 | 云南铜业 | 4,826,534.22 | 24.21 |
| 28 | 000825 | 太钢不锈 | 4,518,420.00 | 22.66 |
| 29 | 600126 | 杭钢股份 | 4,515,989.40 | 22.65 |
| 30 | 600362 | 江西铜业 | 4,410,506.22 | 22.12 |
| 31 | 601398 | 工商银行 | 4,152,867.25 | 20.83 |
| 32 | 601288 | 农业银行 | 4,152,655.00 | 20.83 |
| 33 | 601939 | 建设银行 | 4,149,388.21 | 20.81 |
| 34 | 000799 | 酒鬼酒 | 3,926,417.70 | 19.70 |
| 35 | 601919 | 中远海控 | 3,808,983.47 | 19.11 |
| 36 | 600111 | 北方稀土 | 3,805,618.00 | 19.09 |
| 37 | 002114 | 罗平锌电 | 3,804,074.00 | 19.08 |
| 38 | 600392 | 盛和资源 | 3,783,392.00 | 18.98 |
| 39 | 601336 | 新华保险 | 3,699,393.50 | 18.56 |
| 40 | 603993 | 洛阳钼业 | 3,652,066.00 | 18.32 |
| 41 | 601003 | 柳钢股份 | 3,651,442.36 | 18.32 |
| 42 | 601899 | 紫金矿业 | 3,608,012.49 | 18.10 |
| 43 | 000401 | 冀东水泥 | 3,552,162.00 | 17.82 |
| 44 | 600549 | 厦门钨业 | 3,378,195.00 | 16.95 |
| 45 | 600516 | 方大炭素 | 3,209,931.00 | 16.10 |
| 46 | 300059 | 东方财富 | 3,206,966.84 | 16.09 |
| 47 | 000688 | 建新矿业 | 3,138,354.77 | 15.74 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|-------|
| 48 | 000831 | 五矿稀土 | 3,095,638.97 | 15.53 |
| 49 | 601600 | 中国铝业 | 2,878,820.00 | 14.44 |
| 50 | 300224 | 正海磁材 | 2,817,422.50 | 14.13 |
| 51 | 601699 | 潞安环能 | 2,812,480.00 | 14.11 |
| 52 | 601666 | 平煤股份 | 2,812,422.68 | 14.11 |
| 53 | 000657 | 中钨高新 | 2,803,327.00 | 14.06 |
| 54 | 600595 | 中孚实业 | 2,755,486.86 | 13.82 |
| 55 | 601099 | 太平洋 | 2,665,854.00 | 13.37 |
| 56 | 000933 | 神火股份 | 2,640,804.00 | 13.25 |
| 57 | 002434 | 万里扬 | 2,622,385.00 | 13.15 |
| 58 | 600219 | 南山铝业 | 2,560,660.00 | 12.84 |
| 59 | 600428 | 中远海特 | 2,475,767.00 | 12.42 |
| 60 | 000959 | 首钢股份 | 2,442,214.00 | 12.25 |
| 61 | 600408 | 安泰集团 | 2,422,565.00 | 12.15 |
| 62 | 600307 | 酒钢宏兴 | 2,321,705.00 | 11.65 |
| 63 | 600022 | 山东钢铁 | 2,318,486.00 | 11.63 |
| 64 | 000709 | 河钢股份 | 2,286,565.00 | 11.47 |
| 65 | 601168 | 西部矿业 | 2,239,934.00 | 11.24 |
| 66 | 000783 | 长江证券 | 2,222,019.00 | 11.15 |
| 67 | 002110 | 三钢闽光 | 2,160,369.00 | 10.84 |
| 68 | 300070 | 碧水源 | 2,067,563.00 | 10.37 |
| 69 | 601179 | 中国西电 | 2,048,109.00 | 10.27 |
| 70 | 600221 | 海航控股 | 1,966,195.00 | 9.86 |
| 71 | 000983 | 西山煤电 | 1,932,762.00 | 9.69 |
| 72 | 600801 | 华新水泥 | 1,921,272.00 | 9.64 |
| 73 | 000877 | 天山股份 | 1,917,035.40 | 9.62 |
| 74 | 002233 | 塔牌集团 | 1,901,098.00 | 9.54 |
| 75 | 000591 | 太阳能 | 1,852,008.80 | 9.29 |
| 76 | 002145 | 中核钛白 | 1,834,761.00 | 9.20 |
| 77 | 600266 | 北京城建 | 1,753,206.00 | 8.79 |
| 78 | 300447 | 全信股份 | 1,723,786.40 | 8.65 |
| 79 | 600406 | 国电南瑞 | 1,713,087.00 | 8.59 |
| 80 | 002392 | 北京利尔 | 1,692,537.00 | 8.49 |
| 81 | 300199 | 翰宇药业 | 1,674,458.00 | 8.40 |
| 82 | 600259 | 广晟有色 | 1,656,378.00 | 8.31 |
| 83 | 600369 | 西南证券 | 1,579,628.00 | 7.92 |
| 84 | 600598 | 北大荒 | 1,575,328.00 | 7.90 |
| 85 | 601333 | 广深铁路 | 1,569,729.00 | 7.87 |
| 86 | 300529 | 健帆生物 | 1,528,438.00 | 7.67 |
| 87 | 002847 | 盐津铺子 | 1,527,414.34 | 7.66 |
| 88 | 600117 | 西宁特钢 | 1,507,155.00 | 7.56 |
| 89 | 000726 | 鲁泰 A | 1,494,615.90 | 7.50 |
| 90 | 600881 | 亚泰集团 | 1,474,467.00 | 7.40 |
| 91 | 600711 | 盛屯矿业 | 1,462,442.00 | 7.34 |

| | | | | |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 92 | 000970 | 中科三环 | 1,457,112.00 | 7.31 |
| 93 | 600160 | 巨化股份 | 1,446,943.00 | 7.26 |
| 94 | 601788 | 光大证券 | 1,441,597.00 | 7.23 |
| 95 | 600366 | 宁波韵升 | 1,407,114.00 | 7.06 |
| 96 | 000636 | 风华高科 | 1,406,142.00 | 7.05 |
| 97 | 002041 | 登海种业 | 1,392,124.00 | 6.98 |
| 98 | 600490 | 鹏欣资源 | 1,391,694.00 | 6.98 |
| 99 | 002124 | 天邦股份 | 1,391,174.00 | 6.98 |
| 100 | 002128 | 露天煤业 | 1,389,586.00 | 6.97 |
| 101 | 600108 | 亚盛集团 | 1,389,492.00 | 6.97 |
| 102 | 601222 | 林洋能源 | 1,389,096.00 | 6.97 |
| 103 | 601198 | 东兴证券 | 1,364,013.00 | 6.84 |
| 104 | 000826 | 启迪桑德 | 1,360,723.00 | 6.83 |
| 105 | 002057 | 中钢天源 | 1,338,458.00 | 6.71 |
| 106 | 600076 | 康欣新材 | 1,330,766.00 | 6.68 |
| 107 | 000600 | 建投能源 | 1,315,139.00 | 6.60 |
| 108 | 002174 | 游族网络 | 1,310,075.00 | 6.57 |
| 109 | 603039 | 泛微网络 | 1,297,171.00 | 6.51 |
| 110 | 603612 | 索通发展 | 1,285,947.00 | 6.45 |
| 111 | 000662 | 天夏智慧 | 1,255,897.88 | 6.30 |
| 112 | 603200 | 上海洗霸 | 1,234,129.00 | 6.19 |
| 113 | 000581 | 威孚高科 | 1,234,015.00 | 6.19 |
| 114 | 601866 | 中远海发 | 1,227,526.27 | 6.16 |
| 115 | 600026 | 中远海能 | 1,226,115.00 | 6.15 |
| 116 | 601211 | 国泰君安 | 1,219,985.16 | 6.12 |
| 117 | 600888 | 新疆众和 | 1,219,577.70 | 6.12 |
| 118 | 000951 | 中国重汽 | 1,201,533.00 | 6.03 |
| 119 | 000885 | 同力水泥 | 1,180,893.00 | 5.92 |
| 120 | 600299 | 安迪苏 | 1,178,622.00 | 5.91 |
| 121 | 000615 | 京汉股份 | 1,178,260.00 | 5.91 |
| 122 | 300310 | 宜通世纪 | 1,124,283.00 | 5.64 |
| 123 | 002032 | 苏泊尔 | 1,118,514.84 | 5.61 |
| 124 | 000597 | 东北制药 | 1,104,799.01 | 5.54 |
| 125 | 600135 | 乐凯胶片 | 1,082,248.00 | 5.43 |
| 126 | 603260 | 合盛硅业 | 1,081,705.00 | 5.43 |
| 127 | 601006 | 大秦铁路 | 1,079,612.00 | 5.42 |
| 128 | 601169 | 北京银行 | 1,068,628.00 | 5.36 |
| 129 | 002405 | 四维图新 | 1,051,610.00 | 5.27 |
| 130 | 601377 | 兴业证券 | 1,051,189.00 | 5.27 |
| 131 | 002736 | 国信证券 | 1,044,866.00 | 5.24 |
| 132 | 000520 | 长航凤凰 | 1,034,786.73 | 5.19 |
| 133 | 600030 | 中信证券 | 1,023,252.82 | 5.13 |
| 134 | 601989 | 中国重工 | 1,004,300.00 | 5.04 |
| 135 | 002542 | 中化岩土 | 998,706.00 | 5.01 |

| | | | | |
|-----|--------|------|------------|------|
| 136 | 600998 | 九州通 | 992,347.00 | 4.98 |
| 137 | 000735 | 罗牛山 | 992,272.00 | 4.98 |
| 138 | 600010 | 包钢股份 | 972,631.00 | 4.88 |
| 139 | 601166 | 兴业银行 | 969,497.00 | 4.86 |
| 140 | 603133 | 碳元科技 | 968,388.00 | 4.86 |
| 141 | 600958 | 东方证券 | 967,212.00 | 4.85 |
| 142 | 000839 | 中信国安 | 965,796.00 | 4.84 |
| 143 | 600667 | 太极实业 | 951,116.00 | 4.77 |
| 144 | 603602 | 纵横通信 | 942,406.00 | 4.73 |
| 145 | 002655 | 共达电声 | 921,494.00 | 4.62 |
| 146 | 002829 | 星网宇达 | 906,394.87 | 4.55 |
| 147 | 300379 | 东方通 | 900,447.00 | 4.52 |
| 148 | 601020 | 华钰矿业 | 895,501.00 | 4.49 |
| 149 | 601766 | 中国中车 | 891,900.00 | 4.47 |
| 150 | 300610 | 晨化股份 | 884,116.76 | 4.43 |
| 151 | 300616 | 尚品宅配 | 881,057.00 | 4.42 |
| 152 | 000800 | 一汽轿车 | 872,877.00 | 4.38 |
| 153 | 600015 | 华夏银行 | 871,117.00 | 4.37 |
| 154 | 601952 | 苏垦农发 | 867,799.00 | 4.35 |
| 155 | 600731 | 湖南海利 | 850,165.20 | 4.26 |
| 156 | 000686 | 东北证券 | 831,329.00 | 4.17 |
| 157 | 002378 | 章源钨业 | 815,175.96 | 4.09 |
| 158 | 002288 | 超华科技 | 809,588.00 | 4.06 |
| 159 | 600018 | 上港集团 | 802,032.00 | 4.02 |
| 160 | 000692 | 惠天热电 | 793,200.00 | 3.98 |
| 161 | 002828 | 贝肯能源 | 792,000.00 | 3.97 |
| 162 | 002138 | 顺络电子 | 788,564.00 | 3.96 |
| 163 | 002466 | 天齐锂业 | 778,557.00 | 3.91 |
| 164 | 002616 | 长青集团 | 766,130.00 | 3.84 |
| 165 | 300152 | 科融环境 | 760,921.13 | 3.82 |
| 166 | 000630 | 铜陵有色 | 753,900.00 | 3.78 |
| 167 | 600095 | 哈高科 | 751,365.00 | 3.77 |
| 168 | 600787 | 中储股份 | 749,475.00 | 3.76 |
| 169 | 600218 | 全柴动力 | 745,239.00 | 3.74 |
| 170 | 600199 | 金种子酒 | 740,855.14 | 3.72 |
| 171 | 000895 | 双汇发展 | 739,148.00 | 3.71 |
| 172 | 000860 | 顺鑫农业 | 731,703.23 | 3.67 |
| 173 | 002642 | 荣之联 | 727,413.00 | 3.65 |
| 174 | 300613 | 富瀚微 | 726,575.00 | 3.64 |
| 175 | 300615 | 欣天科技 | 717,500.00 | 3.60 |
| 176 | 603589 | 口子窖 | 715,905.00 | 3.59 |
| 177 | 002023 | 海特高新 | 714,913.00 | 3.59 |
| 178 | 300609 | 汇纳科技 | 709,673.00 | 3.56 |
| 179 | 002446 | 盛路通信 | 707,040.00 | 3.55 |

| | | | | |
|-----|--------|--------|------------|------|
| 180 | 600317 | 营口港 | 705,075.00 | 3.54 |
| 181 | 600720 | 祁连山 | 704,700.00 | 3.53 |
| 182 | 600583 | 海油工程 | 702,841.00 | 3.53 |
| 183 | 601636 | 旗滨集团 | 692,370.00 | 3.47 |
| 184 | 002185 | 华天科技 | 677,800.00 | 3.40 |
| 185 | 000410 | *ST 沈机 | 677,035.00 | 3.40 |
| 186 | 603160 | 汇顶科技 | 673,937.00 | 3.38 |
| 187 | 300604 | 长川科技 | 667,652.00 | 3.35 |
| 188 | 000965 | 天保基建 | 657,141.00 | 3.30 |
| 189 | 600702 | 沱牌舍得 | 653,141.00 | 3.28 |
| 190 | 600578 | 京能电力 | 650,808.00 | 3.26 |
| 191 | 600745 | 闻泰科技 | 644,324.00 | 3.23 |
| 192 | 300563 | 神宇股份 | 630,892.00 | 3.16 |
| 193 | 600118 | 中国卫星 | 629,370.00 | 3.16 |
| 194 | 601555 | 东吴证券 | 626,189.00 | 3.14 |
| 195 | 000596 | 古井贡酒 | 613,434.00 | 3.08 |
| 196 | 600495 | 晋西车轴 | 613,221.00 | 3.08 |
| 197 | 000534 | 万泽股份 | 610,663.00 | 3.06 |
| 198 | 300367 | 东方网力 | 607,570.00 | 3.05 |
| 199 | 601126 | 四方股份 | 606,348.00 | 3.04 |
| 200 | 002845 | 同兴达 | 589,097.42 | 2.95 |
| 201 | 601857 | 中国石油 | 583,943.00 | 2.93 |
| 202 | 300376 | 易事特 | 583,660.00 | 2.93 |
| 203 | 601998 | 中信银行 | 582,374.00 | 2.92 |
| 204 | 600016 | 民生银行 | 582,307.00 | 2.92 |
| 205 | 601601 | 中国太保 | 581,694.00 | 2.92 |
| 206 | 601818 | 光大银行 | 581,383.00 | 2.92 |
| 207 | 600693 | 东百集团 | 568,571.00 | 2.85 |
| 208 | 300327 | 中颖电子 | 563,256.32 | 2.83 |
| 209 | 600425 | *ST 青松 | 560,208.00 | 2.81 |
| 210 | 603919 | 金徽酒 | 558,580.55 | 2.80 |
| 211 | 603799 | 华友钴业 | 557,415.00 | 2.80 |
| 212 | 600429 | 三元股份 | 549,434.00 | 2.76 |
| 213 | 600217 | 中再资环 | 549,315.00 | 2.76 |
| 214 | 600109 | 国金证券 | 542,010.00 | 2.72 |
| 215 | 300127 | 银河磁体 | 536,257.00 | 2.69 |
| 216 | 603198 | 迎驾贡酒 | 534,870.00 | 2.68 |
| 217 | 002334 | 英威腾 | 531,648.00 | 2.67 |
| 218 | 603929 | 亚翔集成 | 530,384.00 | 2.66 |
| 219 | 002601 | 龙麟佰利 | 500,233.00 | 2.51 |
| 220 | 002027 | 分众传媒 | 493,229.00 | 2.47 |
| 221 | 600809 | 山西汾酒 | 484,066.00 | 2.43 |
| 222 | 002842 | 翔鹭钨业 | 478,610.92 | 2.40 |
| 223 | 000762 | 西藏矿业 | 476,399.00 | 2.39 |

| | | | | |
|-----|--------|------|------------|------|
| 224 | 600584 | 长电科技 | 469,293.00 | 2.35 |
| 225 | 002753 | 永东股份 | 467,914.00 | 2.35 |
| 226 | 002155 | 湖南黄金 | 466,616.00 | 2.34 |
| 227 | 600579 | 天华院 | 464,916.00 | 2.33 |
| 228 | 600285 | 羚锐制药 | 459,405.00 | 2.30 |
| 229 | 600201 | 生物股份 | 458,337.00 | 2.30 |
| 230 | 603089 | 正裕工业 | 453,628.00 | 2.28 |
| 231 | 601000 | 唐山港 | 448,184.00 | 2.25 |
| 232 | 300593 | 新雷能 | 441,450.00 | 2.21 |
| 233 | 002497 | 雅化集团 | 426,767.00 | 2.14 |
| 234 | 002246 | 北化股份 | 403,992.00 | 2.03 |
| 235 | 603903 | 中持股份 | 400,048.00 | 2.01 |

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1 | 000761 | 本钢板材 | 10,790,099.84 | 54.12 |
| 2 | 600282 | 南钢股份 | 9,411,008.22 | 47.21 |
| 3 | 601111 | 中国国航 | 8,892,997.07 | 44.61 |
| 4 | 600029 | 南方航空 | 8,232,512.62 | 41.29 |
| 5 | 600569 | 安阳钢铁 | 8,005,027.90 | 40.15 |
| 6 | 600808 | 马钢股份 | 7,579,466.00 | 38.02 |
| 7 | 600115 | 东方航空 | 7,470,798.92 | 37.47 |
| 8 | 000807 | 云铝股份 | 7,166,314.13 | 35.95 |
| 9 | 600497 | 驰宏锌锗 | 7,082,804.62 | 35.53 |
| 10 | 601021 | 春秋航空 | 5,764,845.94 | 28.92 |
| 11 | 603885 | 吉祥航空 | 5,743,797.60 | 28.81 |
| 12 | 600058 | 五矿发展 | 5,533,816.00 | 27.76 |
| 13 | 000751 | 锌业股份 | 5,527,566.65 | 27.73 |
| 14 | 000426 | 兴业矿业 | 5,079,714.60 | 25.48 |
| 15 | 600050 | 中国联通 | 4,995,754.00 | 25.06 |
| 16 | 000898 | 鞍钢股份 | 4,815,743.91 | 24.16 |
| 17 | 000878 | 云南铜业 | 4,696,845.54 | 23.56 |
| 18 | 600231 | 凌钢股份 | 4,684,865.96 | 23.50 |
| 19 | 600782 | 新钢股份 | 4,640,580.43 | 23.28 |
| 20 | 600362 | 江西铜业 | 4,345,368.50 | 21.80 |
| 21 | 000825 | 太钢不锈 | 4,338,430.64 | 21.76 |
| 22 | 000060 | 中金岭南 | 4,270,564.22 | 21.42 |
| 23 | 600126 | 杭钢股份 | 4,163,937.78 | 20.89 |
| 24 | 000799 | 酒鬼酒 | 4,029,167.94 | 20.21 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|-------|
| 25 | 600549 | 厦门钨业 | 3,833,604.95 | 19.23 |
| 26 | 603993 | 洛阳钼业 | 3,806,354.00 | 19.09 |
| 27 | 601336 | 新华保险 | 3,790,695.00 | 19.01 |
| 28 | 002114 | 罗平锌电 | 3,784,320.23 | 18.98 |
| 29 | 600111 | 北方稀土 | 3,744,336.00 | 18.78 |
| 30 | 600392 | 盛和资源 | 3,634,877.00 | 18.23 |
| 31 | 000401 | 冀东水泥 | 3,583,877.00 | 17.98 |
| 32 | 601899 | 紫金矿业 | 3,514,898.74 | 17.63 |
| 33 | 300059 | 东方财富 | 3,180,403.00 | 15.95 |
| 34 | 601600 | 中国铝业 | 3,155,754.95 | 15.83 |
| 35 | 600019 | 宝钢股份 | 3,089,336.03 | 15.50 |
| 36 | 600516 | 方大炭素 | 2,939,927.00 | 14.75 |
| 37 | 601919 | 中远海控 | 2,852,094.32 | 14.31 |
| 38 | 000831 | 五矿稀土 | 2,851,538.00 | 14.30 |
| 39 | 000657 | 中钨高新 | 2,768,024.00 | 13.88 |
| 40 | 601099 | 太平洋 | 2,651,199.00 | 13.30 |
| 41 | 002434 | 万里扬 | 2,559,158.00 | 12.84 |
| 42 | 600428 | 中远海特 | 2,535,299.22 | 12.72 |
| 43 | 600595 | 中孚实业 | 2,490,724.00 | 12.49 |
| 44 | 600219 | 南山铝业 | 2,398,616.00 | 12.03 |
| 45 | 300224 | 正海磁材 | 2,381,467.00 | 11.95 |
| 46 | 000933 | 神火股份 | 2,371,931.00 | 11.90 |
| 47 | 000959 | 首钢股份 | 2,286,804.00 | 11.47 |
| 48 | 600408 | 安泰集团 | 2,263,301.76 | 11.35 |
| 49 | 601168 | 西部矿业 | 2,230,162.52 | 11.19 |
| 50 | 000783 | 长江证券 | 2,227,938.54 | 11.18 |
| 51 | 600022 | 山东钢铁 | 2,193,510.00 | 11.00 |
| 52 | 600259 | 广晟有色 | 2,186,620.00 | 10.97 |
| 53 | 000709 | 河钢股份 | 2,167,538.00 | 10.87 |
| 54 | 002110 | 三钢闽光 | 2,125,479.00 | 10.66 |
| 55 | 600801 | 华新水泥 | 2,098,044.00 | 10.52 |
| 56 | 600307 | 酒钢宏兴 | 2,080,039.00 | 10.43 |
| 57 | 300070 | 碧水源 | 2,062,092.46 | 10.34 |
| 58 | 002233 | 塔牌集团 | 2,024,880.00 | 10.16 |
| 59 | 601179 | 中国西电 | 1,978,080.77 | 9.92 |
| 60 | 000877 | 天山股份 | 1,941,308.00 | 9.74 |
| 61 | 600221 | 海航控股 | 1,899,172.00 | 9.53 |
| 62 | 600010 | 包钢股份 | 1,891,366.00 | 9.49 |
| 63 | 000983 | 西山煤电 | 1,869,548.01 | 9.38 |
| 64 | 002145 | 中核钛白 | 1,820,369.00 | 9.13 |
| 65 | 000591 | 太阳能 | 1,803,779.96 | 9.05 |
| 66 | 000717 | 韶钢松山 | 1,763,634.00 | 8.85 |
| 67 | 600266 | 北京城建 | 1,727,188.00 | 8.66 |
| 68 | 600406 | 国电南瑞 | 1,703,315.84 | 8.54 |

| | | | | |
|-----|--------|-------|--------------|------|
| 69 | 600507 | 方大特钢 | 1,667,493.00 | 8.36 |
| 70 | 601003 | 柳钢股份 | 1,659,657.20 | 8.32 |
| 71 | 000688 | 建新矿业 | 1,616,793.70 | 8.11 |
| 72 | 600299 | 安迪苏 | 1,614,391.00 | 8.10 |
| 73 | 002392 | 北京利尔 | 1,603,336.00 | 8.04 |
| 74 | 300447 | 全信股份 | 1,590,929.70 | 7.98 |
| 75 | 600598 | 北大荒 | 1,569,858.00 | 7.87 |
| 76 | 600369 | 西南证券 | 1,541,118.00 | 7.73 |
| 77 | 600881 | 亚泰集团 | 1,520,480.50 | 7.63 |
| 78 | 600490 | 鹏欣资源 | 1,498,980.00 | 7.52 |
| 79 | 000726 | 鲁 泰 A | 1,488,519.20 | 7.47 |
| 80 | 600711 | 盛屯矿业 | 1,482,575.00 | 7.44 |
| 81 | 601788 | 光大证券 | 1,468,436.00 | 7.37 |
| 82 | 000636 | 风华高科 | 1,465,879.55 | 7.35 |
| 83 | 000735 | 罗 牛 山 | 1,425,060.00 | 7.15 |
| 84 | 601333 | 广深铁路 | 1,410,045.15 | 7.07 |
| 85 | 002847 | 盐津铺子 | 1,402,614.00 | 7.04 |
| 86 | 600160 | 巨化股份 | 1,390,038.00 | 6.97 |
| 87 | 600108 | 亚盛集团 | 1,389,492.00 | 6.97 |
| 88 | 002041 | 登海种业 | 1,387,214.00 | 6.96 |
| 89 | 002174 | 游族网络 | 1,384,766.97 | 6.95 |
| 90 | 000826 | 启迪桑德 | 1,374,609.00 | 6.90 |
| 91 | 002124 | 天邦股份 | 1,372,542.00 | 6.88 |
| 92 | 601222 | 林洋能源 | 1,362,603.76 | 6.83 |
| 93 | 603612 | 索通发展 | 1,353,592.00 | 6.79 |
| 94 | 002057 | 中钢天源 | 1,343,007.00 | 6.74 |
| 95 | 000970 | 中科三环 | 1,342,790.00 | 6.74 |
| 96 | 600117 | 西宁特钢 | 1,332,081.00 | 6.68 |
| 97 | 603039 | 泛微网络 | 1,323,965.00 | 6.64 |
| 98 | 600366 | 宁波韵升 | 1,308,964.00 | 6.57 |
| 99 | 601198 | 东兴证券 | 1,307,333.98 | 6.56 |
| 100 | 600076 | 康欣新材 | 1,306,903.00 | 6.56 |
| 101 | 000600 | 建投能源 | 1,303,814.86 | 6.54 |
| 102 | 600888 | 新疆众和 | 1,285,907.49 | 6.45 |
| 103 | 000615 | 京汉股份 | 1,281,772.00 | 6.43 |
| 104 | 601211 | 国泰君安 | 1,246,077.32 | 6.25 |
| 105 | 000951 | 中国重汽 | 1,232,418.80 | 6.18 |
| 106 | 002128 | 露天煤业 | 1,225,622.00 | 6.15 |
| 107 | 603200 | 上海洗霸 | 1,218,928.00 | 6.11 |
| 108 | 300310 | 宜通世纪 | 1,212,402.00 | 6.08 |
| 109 | 000581 | 威孚高科 | 1,197,336.00 | 6.01 |
| 110 | 000885 | 同力水泥 | 1,195,777.00 | 6.00 |
| 111 | 601866 | 中远海发 | 1,178,593.63 | 5.91 |
| 112 | 600026 | 中远海能 | 1,176,856.74 | 5.90 |

| | | | | |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 113 | 600581 | 八一钢铁 | 1,171,453.00 | 5.88 |
| 114 | 601328 | 交通银行 | 1,166,957.00 | 5.85 |
| 115 | 000731 | 四川美丰 | 1,160,673.00 | 5.82 |
| 116 | 000662 | 天夏智慧 | 1,145,050.72 | 5.74 |
| 117 | 002032 | 苏泊尔 | 1,136,469.00 | 5.70 |
| 118 | 603260 | 合盛硅业 | 1,115,020.00 | 5.59 |
| 119 | 601006 | 大秦铁路 | 1,090,301.00 | 5.47 |
| 120 | 002405 | 四维图新 | 1,068,251.00 | 5.36 |
| 121 | 601169 | 北京银行 | 1,067,803.98 | 5.36 |
| 122 | 002736 | 国信证券 | 1,059,038.00 | 5.31 |
| 123 | 601377 | 兴业证券 | 1,054,797.00 | 5.29 |
| 124 | 000520 | 长航凤凰 | 1,042,579.00 | 5.23 |
| 125 | 603133 | 碳元科技 | 1,040,401.30 | 5.22 |
| 126 | 600135 | 乐凯胶片 | 1,033,037.32 | 5.18 |
| 127 | 000597 | 东北制药 | 1,029,486.00 | 5.16 |
| 128 | 600030 | 中信证券 | 1,019,934.00 | 5.12 |
| 129 | 600998 | 九州通 | 999,557.00 | 5.01 |
| 130 | 600667 | 太极实业 | 987,448.56 | 4.95 |
| 131 | 600958 | 东方证券 | 974,448.00 | 4.89 |
| 132 | 601166 | 兴业银行 | 970,763.00 | 4.87 |
| 133 | 601989 | 中国重工 | 967,200.00 | 4.85 |
| 134 | 000839 | 中信国安 | 957,950.00 | 4.81 |
| 135 | 002542 | 中化岩土 | 956,148.30 | 4.80 |
| 136 | 600718 | 东软集团 | 955,170.00 | 4.79 |
| 137 | 603602 | 纵横通信 | 944,260.00 | 4.74 |
| 138 | 300379 | 东方通 | 931,363.68 | 4.67 |
| 139 | 600731 | 湖南海利 | 901,069.56 | 4.52 |
| 140 | 601766 | 中国中车 | 900,000.00 | 4.51 |
| 141 | 600961 | 株冶集团 | 889,776.17 | 4.46 |
| 142 | 002655 | 共达电声 | 876,773.22 | 4.40 |
| 143 | 600015 | 华夏银行 | 869,853.00 | 4.36 |
| 144 | 601952 | 苏垦农发 | 867,065.00 | 4.35 |
| 145 | 601020 | 华钰矿业 | 863,063.87 | 4.33 |
| 146 | 000686 | 东北证券 | 855,255.84 | 4.29 |
| 147 | 600871 | 石化油服 | 842,000.00 | 4.22 |
| 148 | 300616 | 尚品宅配 | 835,568.00 | 4.19 |
| 149 | 002829 | 星网宇达 | 833,325.00 | 4.18 |
| 150 | 002378 | 章源钨业 | 828,109.00 | 4.15 |
| 151 | 600359 | 新农开发 | 826,439.00 | 4.15 |
| 152 | 002138 | 顺络电子 | 821,764.76 | 4.12 |
| 153 | 000800 | 一汽轿车 | 811,906.00 | 4.07 |
| 154 | 300610 | 晨化股份 | 806,028.60 | 4.04 |
| 155 | 002288 | 超华科技 | 802,482.00 | 4.03 |
| 156 | 002828 | 贝肯能源 | 792,280.00 | 3.97 |

| | | | | |
|-----|--------|--------|------------|------|
| 157 | 002466 | 天齐锂业 | 786,099.00 | 3.94 |
| 158 | 000692 | 惠天热电 | 770,622.13 | 3.87 |
| 159 | 600018 | 上港集团 | 769,296.00 | 3.86 |
| 160 | 600787 | 中储股份 | 764,159.00 | 3.83 |
| 161 | 000895 | 双汇发展 | 756,371.00 | 3.79 |
| 162 | 600720 | 祁连山 | 751,832.00 | 3.77 |
| 163 | 300152 | 科融环境 | 749,605.00 | 3.76 |
| 164 | 002185 | 华天科技 | 746,549.37 | 3.74 |
| 165 | 600218 | 全柴动力 | 736,666.00 | 3.70 |
| 166 | 002616 | 长青集团 | 717,393.13 | 3.60 |
| 167 | 601636 | 旗滨集团 | 715,820.00 | 3.59 |
| 168 | 600583 | 海油工程 | 714,600.00 | 3.58 |
| 169 | 000860 | 顺鑫农业 | 702,396.74 | 3.52 |
| 170 | 600199 | 金种子酒 | 701,097.00 | 3.52 |
| 171 | 600095 | 哈高科 | 700,782.00 | 3.52 |
| 172 | 603589 | 口子窖 | 700,598.00 | 3.51 |
| 173 | 002023 | 海特高新 | 700,068.00 | 3.51 |
| 174 | 600745 | 闻泰科技 | 698,426.84 | 3.50 |
| 175 | 000630 | 铜陵有色 | 695,087.00 | 3.49 |
| 176 | 002446 | 盛路通信 | 692,311.00 | 3.47 |
| 177 | 600578 | 京能电力 | 687,342.36 | 3.45 |
| 178 | 600317 | 营口港 | 687,300.00 | 3.45 |
| 179 | 600251 | 冠农股份 | 687,226.00 | 3.45 |
| 180 | 002642 | 荣之联 | 682,953.00 | 3.43 |
| 181 | 000972 | *ST 中基 | 676,706.00 | 3.39 |
| 182 | 600702 | 沱牌舍得 | 670,398.00 | 3.36 |
| 183 | 300613 | 富瀚微 | 662,407.00 | 3.32 |
| 184 | 000410 | *ST 沈机 | 660,508.00 | 3.31 |
| 185 | 603160 | 汇顶科技 | 658,194.00 | 3.30 |
| 186 | 000965 | 天保基建 | 657,011.00 | 3.30 |
| 187 | 300615 | 欣天科技 | 656,091.00 | 3.29 |
| 188 | 300604 | 长川科技 | 647,288.00 | 3.25 |
| 189 | 601555 | 东吴证券 | 632,642.00 | 3.17 |
| 190 | 600118 | 中国卫星 | 630,488.00 | 3.16 |
| 191 | 000534 | 万泽股份 | 630,434.00 | 3.16 |
| 192 | 300563 | 神宇股份 | 620,863.00 | 3.11 |
| 193 | 300609 | 汇纳科技 | 619,020.00 | 3.11 |
| 194 | 300367 | 东方网力 | 616,807.69 | 3.09 |
| 195 | 000596 | 古井贡酒 | 615,311.50 | 3.09 |
| 196 | 300376 | 易事特 | 596,750.00 | 2.99 |
| 197 | 601126 | 四方股份 | 590,138.00 | 2.96 |
| 198 | 300127 | 银河磁体 | 586,929.00 | 2.94 |
| 199 | 600495 | 晋西车轴 | 586,131.00 | 2.94 |
| 200 | 601818 | 光大银行 | 579,958.00 | 2.91 |

| | | | | |
|-----|--------|--------|------------|------|
| 201 | 600016 | 民生银行 | 579,427.00 | 2.91 |
| 202 | 601857 | 中国石油 | 578,700.00 | 2.90 |
| 203 | 601601 | 中国太保 | 576,866.00 | 2.89 |
| 204 | 601998 | 中信银行 | 575,445.00 | 2.89 |
| 205 | 600693 | 东百集团 | 555,331.00 | 2.79 |
| 206 | 600109 | 国金证券 | 552,566.00 | 2.77 |
| 207 | 603799 | 华友钴业 | 545,900.00 | 2.74 |
| 208 | 600429 | 三元股份 | 542,040.00 | 2.72 |
| 209 | 002334 | 英威腾 | 541,233.00 | 2.71 |
| 210 | 603919 | 金徽酒 | 539,580.51 | 2.71 |
| 211 | 600425 | *ST 青松 | 535,805.00 | 2.69 |
| 212 | 300327 | 中颖电子 | 528,125.00 | 2.65 |
| 213 | 603198 | 迎驾贡酒 | 527,143.00 | 2.64 |
| 214 | 603929 | 亚翔集成 | 511,761.37 | 2.57 |
| 215 | 002845 | 同兴达 | 510,888.80 | 2.56 |
| 216 | 600809 | 山西汾酒 | 507,207.00 | 2.54 |
| 217 | 002842 | 翔鹭钨业 | 506,416.00 | 2.54 |
| 218 | 002601 | 龙麟佰利 | 494,908.00 | 2.48 |
| 219 | 002027 | 分众传媒 | 490,633.00 | 2.46 |
| 220 | 000762 | 西藏矿业 | 482,661.00 | 2.42 |
| 221 | 601000 | 唐山港 | 472,416.00 | 2.37 |
| 222 | 300593 | 新雷能 | 470,353.00 | 2.36 |
| 223 | 600579 | 天华院 | 469,261.00 | 2.35 |
| 224 | 002155 | 湖南黄金 | 460,233.00 | 2.31 |
| 225 | 600285 | 羚锐制药 | 455,962.32 | 2.29 |
| 226 | 600201 | 生物股份 | 434,324.00 | 2.18 |
| 227 | 002753 | 永东股份 | 434,254.00 | 2.18 |
| 228 | 603903 | 中持股份 | 423,166.00 | 2.12 |
| 229 | 002497 | 雅化集团 | 420,660.00 | 2.11 |
| 230 | 600217 | 中再资环 | 417,483.28 | 2.09 |
| 231 | 603089 | 正裕工业 | 409,640.00 | 2.05 |
| 232 | 600480 | 凌云股份 | 405,600.00 | 2.03 |
| 233 | 600584 | 长电科技 | 405,309.00 | 2.03 |
| 234 | 600027 | 华电国际 | 402,488.00 | 2.02 |
| 235 | 600727 | 鲁北化工 | 400,786.00 | 2.01 |

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|----------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 493,818,057.66 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 430,425,855.24 |

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

8.12 本报告期投资基金情况

8.12.1 投资政策及风险说明

本基金本报告期内未投资基金。

8.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

本基金本报告期内未投资基金。

8.13 投资组合报告附注

8.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.13.2 本基金转型前基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 51,903.67 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,794,568.61 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,522.00 |
| 5 | 应收申购款 | 447,267.98 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,295,262.26 |

8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

8.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别 | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|------------|----------|-----------|-------|--------|---------------|---------|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 金鹰技术领先混合 A | 4,152 | 9,965.72 | 0.00 | 0.00% | 41,377,663.54 | 100.00% |
| 金鹰技术领先混 | 4,746 | 6,168.77 | 0.00 | 0.00% | 29,276,989.52 | 100.00 |

| | | | | | | |
|-----|-------|----------|------|-------|---------------|-------------|
| 合 C | | | | | | % |
| 合计 | 8,898 | 7,940.51 | 0.00 | 0.00% | 70,654,653.06 | 100.00 % |

9.2 期末上市基金前十名持有人

金鹰技术领先混合 A

本基金非上市基金。

金鹰技术领先混合 C

本基金非上市基金。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 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% |

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 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 |

9.5 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金非发起式基金。

§ 10 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 | 71,288,635.48 | 110,383,733.72 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 46,901,260.23 | 81,522,594.12 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 41,377,663.54 | 29,276,989.52 |

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金管理人增聘陈瀚先生为公司副总经理，该事项已于 2017 年 6 月 29 日在《证券时报》等媒体进行了披露。

报告期内基金管理人免去苏文锋先生督察长职务，免去李云亮先生副总经理职务，聘请李云亮先生担任公司督察长，该事项已于 2017 年 9 月 13 日在《证券时报》等媒体进行了披露。

2017 年 8 月，陈四清先生担任基金托管人中国银行股份有限公司董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本基金报告期内没有改变基金投资策略。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

1、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）。

2、本报告期内实际应支付会计师事务所的审计费为 25000 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易 | 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 | 118,653,395.30 | 12.84% | 108,129.96 | 12.95% | - |
| 广发证券 | 1 | 22,728,416.13 | 2.46% | 20,712.39 | 2.48% | - |
| 光大证券 | 1 | 25,374,933.87 | 2.75% | 23,124.16 | 2.77% | - |
| 中信证券 | 1 | 19,706,212.00 | 2.13% | 17,957.80 | 2.15% | - |
| 中金公司 | 1 | 74,436,948.96 | 8.05% | 69,322.93 | 8.30% | - |
| 招商证券 | 1 | 41,017,268.52 | 4.44% | 37,378.93 | 4.48% | - |
| 平安证券 | 2 | 164,734,347.98 | 17.82% | 150,121.53 | 17.98% | - |
| 民生证券 | 1 | 33,566,676.65 | 3.63% | 30,589.14 | 3.66% | - |
| 东北证券 | 1 | 58,862,402.90 | 6.37% | 41,868.03 | 5.01% | - |
| 东吴证券 | 1 | 33,806,339.29 | 3.66% | 30,807.73 | 3.69% | - |
| 国金证券 | 1 | 36,369,801.65 | 3.94% | 33,143.78 | 3.97% | - |
| 国泰君安证券 | 1 | 4,242,383.00 | 0.46% | 3,950.93 | 0.47% | - |
| 华泰联合证券 | 1 | 44,749,742.15 | 4.84% | 40,780.28 | 4.88% | - |
| 英大证券 | 1 | 142,315,215.91 | 15.40% | 132,537.41 | 15.87% | - |
| 中银国际证券 | 1 | 103,652,828.59 | 11.22% | 94,458.50 | 11.31% | - |

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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|------|------|--------|------|------|------|
| | 成交金额 | 占当期债 | 成交金额 | 占当期债 | 成交金额 | 占当期权 |
| | | | | | | |

| | | 券成交总 额的比例 | | 券回购成 交总额的 比例 | | 证成交总 额的比例 |
|--------|---|--------------|----------------|--------------------|---|--------------|
| 安信证券 | - | - | 2,800,000.00 | 1.62% | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | 20,300,000.00 | 11.73% | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | 113,900,000.00 | 65.80% | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | - | - | 1,200,000.00 | 0.69% | - | - |
| 民生证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | - | - | 30,900,000.00 | 17.85% | - | - |
| 东吴证券 | - | - | 1,400,000.00 | 0.81% | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰联合证券 | - | - | - | - | - | - |
| 英大证券 | - | - | 2,600,000.00 | 1.50% | - | - |
| 中银国际证券 | - | - | - | - | - | - |

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 影响投资者决策的其他重要信息

经基金管理人第六届董事会第八次会议审议通过，免去凌富华先生董事长职务，聘请李兆廷先生担任公司董事长，该事项已于 2018 年 1 月 18 日在证监会指定媒体披露。

经基金管理人 2016 年第三次临时股东会审议通过，并经中国证券监督管理委员会批复核准（证监许可[2017]2135），公司原股东美的集团股份有限公司、东亚联丰投资管理有限公司分别将其持有的本公司 20%和 11%股权转让给东旭集团有限公司。公司股东东旭集团有限公司向本公司增资人民币 260,200,000 元。本次股权转让及增资后，公司股权结构变更为：东旭集团有限公司 66.19%，广州证券股份有限公司 24.01%，广州白云山医药集团股份有限公司 9.80%，本公司注册资本由人民币 250,000,000 元增加至人民币 510,200,000 元。公司《公司章程》的有关条款已根据本次股权变更情

况进行了相应修改。本公司已完成注册资本及股权变更事项的工商变更登记。上述事项已于 2018 年 1 月 30 日在证监会指定媒体披露。

金鹰基金管理有限公司

二〇一八年三月二十八日