金鹰保本混合型证券投资基金

【2015】年度报告摘要

基金管理人:金鹰基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年三月三十日

§1 重要提示

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

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

本报告期自2015年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	金鹰保本混合
基金主代码	210006
交易代码	210006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年5月17日
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	50,886,869.47份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	采用改进的固定比例组合保险策略(CPPI),引入收益锁定机制,在严格控制投资风险、保证本金安全的基础上,力争在保本期结束时,实现基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金的保本策略为改进的固定比例组合保险策略(CPPI),是本基金投资运作过程中的核心策略;投资策略采用"自上而下"的投资视角,根据宏观经济与资本市场运行状况、固定收益类与权益类资产风险收益特性、基金净资产、价值底线、定性分析与定量分析并用,灵活动态地选取适当的风险乘数,以期对固定收益类与权益类资产之间的配置额进行优化调节,力争在确保本金安全的前提下,获取投资收益。 本基金的股票、权证占基金资产净值的比例为0%~40%,其中,权证投资的比例否围占基金资产净值的0%~3%;债券、资产支持证券、货币市场工具、现金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产净值的60%~100%,其中,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;此外,在基金合同和法律法规的允许范围内,本基金将积极参与一级市场新股、新债的申购。
业绩比较基准	3年期银行定期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为积极配置的保本混合型基金,属于证券投资基金中的中低风险品种,其长期平均风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金,但高于货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		金鹰基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	苏文锋	蒋松云
	联系电话	020-83282627	010-66105799
	电子邮箱	csmai@gefund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006135888,020-83936180	95588
传真		020-83282256	010-66105798

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015年	2014年	2013年
本期已实现收益	-413,565.32	2,194,249.36	29,642,634.15
本期利润	469,455.23	12,906,619.43	19,824,221.73
加权平均基金份额本期利润	0.0058	0.0604	0.0479
本期基金份额净值增长率	12.32%	4.99%	3.67%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	0.1965	0.1375	0.1007
期末基金资产净值	58,482,120.10	109,797,650.54	377,570,777.03
期末基金份额净值	1.149	1.023	1.101

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额;

2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;

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

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

3.2 基金净值表现

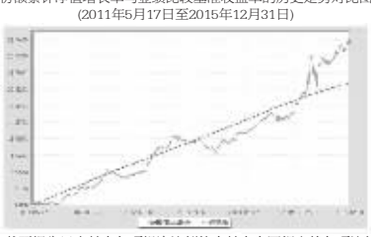
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.05%	0.25%	0.72%	0.01%	2.33%	0.24%
过去六个月	4.26%	0.29%	1.54%	0.01%	2.72%	0.28%
过去一年	12.32%	0.32%	3.47%	0.01%	8.85%	0.31%
过去三年	22.26%	0.22%	12.75%	0.01%	9.51%	0.21%
成立至今	29.84%	0.19%	21.93%	0.01%	7.91%	0.18%

注:本基金的业绩比较基准为3年期银行定期存款利率(税后)。

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

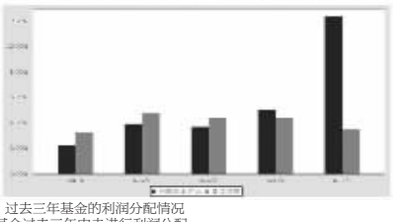
金鹰保本混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2011年5月17日至2015年12月31日)



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

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

金鹰保本混合型证券投资基金
自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年内未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

金鹰基金管理有限公司经中国证监会证监基字[2002]97号文批准,于2002年12月26日成立,是自律制度下中国证监会批准设立的首批基金管理公司之一。公司注册资本2.5亿元人民币,股东包括广州证券股份有限公司、广州白云山医药集团股份有限公司、美的集团股份有限公司和东亚联丰投资管理有限公司,分别持有49%、20%、20%和11%的股份。

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

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

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

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

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
倪超	基金经理	2015-08-13	-	7	倪超先生,厦门大学硕士研究生。2009年6月加盟金鹰基金管理有限公司,先后任行业研究员,消费品研究小组组长、基金经理助理,现任金鹰行业优势混合型证券投资基金、金鹰保本混合型证券投资基金基金经理。
李涛	固定收益部副总监、基金经理	2015-01-09	-	11	李涛先生,北京大学金融学硕士。历任光大银行总行资金部货币市场自营投资业务主管、中银国际证券研究部宏观研究员、广州证券资产管理总部投研总监。2014年11月加入金鹰基金管理有限公司,现任金鹰保本混合型证券投资基金、金鹰持久增利债券型证券投资基金(LOF)、金鹰元安保本混合型证券投资基金、金鹰灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
洪利平	基金经理	2013-04-12	2015-08-13	7	洪利平女士,西南财经大学硕士,证券从业年限4年,曾任职于生命人寿保险股份有限公司,任债券交易员;2010年7月加入金鹰基金管理有限公司,先后担任研究员和基金经理。

注:1、任职日期和离任日期指公司公告聘任或解聘日期;

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定;

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作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。

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2015年经济增速低位企稳,GDP全年6.9%,四个季度环比分别为1.3%,1.9%,1.8%,1.6%,其中2季度环比改善明显受到金融行业贡献较多,而工业增加值基本上在6%附近上下波动;CPI全年均值1.45%,季调环比来看,除6-8月份略有回升之外,其余多数月份都表现出通缩迹象;PPI从2014年1月份开始已经连续24个月环比下滑,工业去库存持续。央行年内进行五次降准降息,一年期基准存款利率从2.75%下调至1.5%,大型存款类金融机构法定存款准备金率从20%下降至17%。

债券市场,全年市场走势可以分为三个阶段:1、上半年国债利率整体呈现上行趋势,由于股票市场行情火爆,各种分层配资的资金收益率水平大致在6%-8%水平,拉高了整体的债券收益率水平,10年期国开利率从年初的3.8%附近最高上探4.2%,6月初仍在4%以上;但在央行4月份大幅降准并降息后,资金面明显宽松,出现一波利率下行行情,约50bp;2、下半年随着IPO的暂停,各种配资回流债券市场,同时地产销售、汽车销售等在7,8月份也出现了明显的下滑,工业生产的新一轮去库存展开,利率水平持续下行,10年期国开利率最低下探3.4%,下行60bp。但随着IPO在11月初的重启,大约有6000-8000亿的资金重回流入打新市场,引起利率的短期回升,幅度约20bp;3、12月份之后,随着中央对去产能的态度逐渐明朗,市场对经济下滑的预期进一步增强,利率展开新一轮下行,至2016年1月,国开利率跌至3%,下行幅度超过50bp。

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

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

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日,基金份额净值1.149元,本报告期份额净值增长率为12.32%,同期业绩比较基准增长率为3.47%,基金业绩表现超越比较基准8.85%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

债券市场方面:作为十三五开局之年,财政支出仍将成为稳定经济增长的主要力量,预计16年全年债券发行将以政府信用为主,国债、地方债和金融债、专项金融债等发行规模有望达到10-12万亿;同时随着去产能加速和信用事件的频繁发生,低等级信用利差则会进一步扩大。但从债券配置需求来说,一方面股市的波动性提高,导致居民风险偏好下降;另一方面大量非标资产到期和资本回报率的持续下降,固定收益类理财产品利率水平仍将在16年1季度加速下行;虽然债券收益率水平处于低位,但居民资产配置回流固定收益类资产的过程并未结束,配置需求仍然将追逐安全债券的稳定收益,中高等级信用利差仍将保持历史低位。债市投资在2016年1季度仍可获得稳定的收益。

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

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守2006年2月15日颁布的《企业会计准则》、2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》(证监会计字[2007]15号)与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的的指导意见》(证监会公告[2008]38号等相关规和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行,基金份额净值由本基金管理人完成估值后,经本基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

为确保公司估值程序的正常进行,本公司还成立了资产估值委员会。资产估值委员会由公司总经理、分管总经理助理、权益投资部总监、固定收益部总监、研究发展部总监、基金事务部总监、基金经理、投资经理、基金会计和相关人员组成。在特殊情况下,公司召集估值委员会会议,讨论和决策特殊估值事项,估值委员会集体决策,需到会的三分之二估值委员会成员表决通过。

本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

报告期内,本基金未签约与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

4.8 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

本报告期,会计师事务所未对本基金出具非标准审计报告。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内无应当说明的预警事项。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,本基金托管人在对金鹰保本混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,金鹰保本混合型证券投资基金的管理人——金鹰基金管理有限公司在金鹰保本混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,金鹰保本混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对金鹰基金管理有限公司编制和披露的金鹰保本混合型证券投资基金本年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经中审众环会计师事务所(特殊普通合伙)审计,出具了众环审字(2016)050126号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:金鹰保本混合型证券投资基金
报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资产:	-	-
银行存款	1,848,660.53	353,539.78
结算备付金	130,347.56	935,851.58
存出保证金	59,438.81	8,873.45
交易性金融资产	56,180,793.82	111,459,193.00
其中:股票投资	8,869,291.82	13,870,045.00
基金投资	-	-
债券投资	47,311,502.00	97,589,148.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	3,251,071.04
应收利息	1,168,904.22	1,893,347.32
应收股利	-	-
应收申购款	90,425.08	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	59,478,570.02	117,901,876.17
负债和所有者权益	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
负债:	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	3,600,000.00
应付证券清算款	24,203.02	3,190,082.47
应付赎回款	51,657.02	481,402.82
应付管理人报酬	59,027.81	116,690.10
应付托管费	9,837.97	19,448.36
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	55,732.94	36,541.96
应交税费	203,866.10	203,866.10
应付利息	-	1,054.56
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	592,125.06	455,139.26
负债合计	996,449.92	8,104,225.63
所有者权益:	-	-
实收基金	45,032,336.57	95,019,178.52
未分配利润	13,449,783.53	14,778,472.02
所有者权益合计	58,482,120.10	109,797,650.54
负债和所有者权益总计	59,478,570.02	117,901,876.17

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

7.2 利润表

会计主体:金鹰保本混合型证券投资基金
本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

资产	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入	2,704,852.29	17,254,828.17
1.利息收入	3,605,141.99	10,812,303.78
其中:存款利息收入	129,527.19	271,760.62
债券利息收入	3,376,226.55	8,499,316.89
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	99,388.25	2,041,226.27
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-2,754,134.75	-4,411,577.63
其中:股票投资收益	-3,721,352.03	-1,215,603.08
基金投资收益	-	-
债券投资收益	953,105.28	-3,357,959.43
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	14,112.00	161,984.88
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	883,020.55	10,711,370.07
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	970,824.50	142,731.95
减:二、费用	2,235,397.06	4,349,208.74
1. 管理人报酬	1,055,832.22	2,566,780.65
2. 托管费	175,972.07	427,796.68
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	558,030.20	168,077.36
5. 利息支出	112,836.78	780,070.48
其中:卖出回购金融资产支出	112,836.78	780,070.48
6. 其他费用	332,725.79	406,483.57
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	469,455.23	12,905,619.43
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	469,455.23	12,905,619.43

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:金鹰保本混合型证券投资基金
本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	95,019,178.52	14,778,472.02	109,797,650.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	469,455.23	469,455.23
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-49,986,841.95	-1,798,143.72	-51,784,985.67
其中:1.基金申购款	216,021,223.22	54,439,766.09	270,460,989.31
2.基金赎回款	-266,008,065.17	-56,237,909.81	-322,245,974.98
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	45,032,336.57	13,449,783.53	58,482,120.10
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	343,035,958.74	34,534,818.29	377,570,777.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	12,905,619.43	12,905,619.43
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-248,016,780.22	-32,661,965.70	-280,678,745.92
其中:1.基金申购款	3,652,262.67	490,671.46	4,142,934.13
2.基金赎回款	-251,669,042.89	-33,152,637.16	-284,821,680.05
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	95,019,178.52	14,778,472.02	109,797,650.54

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从7.1至7.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:刘岩,主管会计工作负责人:曾长兴,会计机构负责人:谢文君

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《金鹰保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金可投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。股票、权证占基金净资产的比例为0%-40%,其中,权证投资的比例否围占基金资产净值的0%-3%;债券、资产支持证券、货币市场工具、现金、以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金净资产的60%-100%,其中,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。此外,在基金合同和法律法规的允许范围内,本基金将积极参与一级市场新股、新债的申购。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2015年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策不变,会计估计与最近一期年度报告相比有调整。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本年度无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息,本基金本报告期内改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本年度无差错更正。

7.4.6 税项

1、印花税

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

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

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

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

2、营业税、企业所得税

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

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

3、个人所得税

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

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

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

根据财政部、国家税务总局、证监会财税字[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限超过1年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。(上市公司派发股息红利,股权登记日在2015年9月8日之后的,股息红利所得按照本通知的规定执行。)

7.4.7 关联方关系

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

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本年度及上年度可比期间均没有通过关联方交易单元进