金鹰策略配置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：中信银行股份有限公司
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。

基金托管人中信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	金鹰策略配置混合
基金主代码	210008
交易代码	210008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年9月1日
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	242,091,066.90份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在对基本面进行深入分析的基础上，制定适当的投资策略，以策略指导投资运作，在充分控制风险的前提下，分享中国经济快速发展的成果以及企业经营绩效提升所带来的股权溢价，力争实现基金资产的长期可持续稳健增值。
投资策略	防御”与“进取”的权衡与取舍是本基金进行大类资产配置、行业配置过程中的重要决策依据。通过对宏观经济所处投资时钟象限的判断、对股票市场与资金市场之间套利空间的测度，综合考察国内外宏观经济、财政政策与货币政策新动向、资本市场运行状况，对“防御”与“进取”目标适时、适度地有所侧重，将是本基金在投资策略上的现实选择。 本基金股票资产占基金资产净值的比例为６０％～９５％；债券、货币市场工具、现金、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占基金资产净值的５％～４０％，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％，权证投资的比例范围占基金资产净值的０％～３％。
业绩比较基准	沪深300指数增长率×75%＋中证全债指数增长率×25%
风险收益特征	本基金为主动操作的混合型证券投资基金，属于证券投资基金中的预期收益与风险较高的品种。一般情形下，其风险和预期收益均高于货币型基金和债券型基金。

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	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	苏文锋	方韡
	联系电话	020-83282627	010-89936330
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	fangwei@citicbank.com
客户服务电话		4006135888，020-83936180	95558
传真		020-83282856	010-65550832

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	58,494,944.10	28,759,366.17	49,081,904.80
本期利润	57,605,067.39	29,340,197.52	36,814,717.60
加权平均基金份额本期利润	0.4538	0.3001	0.1669
本期基金份额净值增长率	43.96%	38.06%	12.45%
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	0.2989	0.3731	-0.0054
期末基金资产净值	333,422,350.42	118,486,687.27	130,294,082.42
期末基金份额净值	1.3773	1.3731	0.9946

注：1、本基金于2011年9月1日成立；
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；
3、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；
4、期末可供分配利润，指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

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

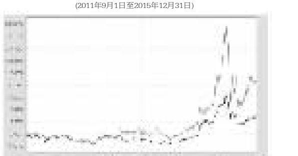
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	28.52%	2.28%	13.07%	1.25%	15.45%	1.03%
过去六个月	-13.28%	3.41%	-11.61%	2.01%	-1.67%	1.40%
过去一年	43.96%	3.10%	6.77%	1.86%	37.19%	1.24%
过去三年	123.48%	2.15%	40.90%	1.34%	82.58%	0.81%
成立至今	97.67%	1.87%	31.10%	1.24%	66.57%	0.63%

注：本基金的原业绩比较基准为：沪深300指数收益率×75%＋中信标普国债指数收益率×25%；2015年9月28日变更为：

沪深300指数收益率×75%＋中证全债指数收益率×25%。并对基金合同等法律文件进行了相应修改，该事项已与托管人协商一致并报监管部门备案，变更业绩比较基准公告已于2015年9月23日在指定媒体披露。

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

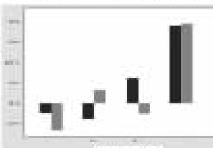
金鹰策略配置混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2011年9月1日至2015年12月31日)



注：1、本基金合同于2011年9月1日正式生效；2、截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同规定的各项比例。本基金投资范围：股票资产占基金资产净值的比例为60%～95%；债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券等其他金融工具占基金资产净值的5%～40%；3、本基金业绩比较基准为：沪深300指数增长率×75%＋中证全债指数增长率×25%。

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

金鹰策略配置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

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015年	6.000	2,710,949,375.94	7,532,791.79	2,718,482,167.73	-
合计	6.000	2,710,949,375.94	7,532,791.79	2,718,482,167.73	-

注：本基金过去三年仅2015年度进行了利润分配。

§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25日成立，是自律制度下中国证监会批准设立的首批基金管理公司之一。公司注册资本2.5亿元人民币，股东包括广州证券股份有限公司、广州白云山医药集团股份有限公司、美的集团股份有限公司和东亚联丰投资管理有限公司，分别持有49%、20%、20%和11%的股份。

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

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

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

截至2015年12月31日，公司共管理二十一只开放式基金：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		
方超	基金经理	2014-09-30	-	7	方超先生，经济学硕士。 曾任职于朗讯科技有限公司、北方电讯科技有限公司。2009年5月加入金鹰基金管理有限公司，先后任TMT研究员、非周期组组长、金鹰中小盘精选证券投资基金基金经理助理、专户投资部投资经理，现任金鹰策略配置混合型证券投资基金、金鹰科技创新型股票基金基金经理。

注：1、任职日期和离任日期指公司公告聘任或解聘日期；
2、证券从业的含义遵从行业协会颁布的《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。
3、本基金现由方超先生单独管理。

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

15年上半年，主要围绕成长股的投资主线，在年中的股灾之后，高估的市场的系统性风险显现，市场连续下挫，本基金大幅减仓，在10－11月的反弹中，抓住优质成长股的反弹机会，全年收益率43.96%。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截止2015年12月31日，基金份额净值为1.3773元，本报告期份额净值增长率为43.96%，同期业绩比较基准增长率为6.77%。

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年的宏观经济，经济增长的压力还比较大，过剩产能并没有出清，供给侧改革将带来较大的增速下滑压力，但这是必经之路，只有以科技、服务、消费为核心的新的经济发展动力逐渐壮大，中国经济才能走上持续发展的道路，随着国内改革措施的展开，预计经济将逐渐企稳，经济结构调整取得一定进展。

同时，不确定因素也还存在，人民币还有贬值的压力，美国加息周期开始，国内的货币政策的宽松边际效应在递减，这些都将对资本市场有潜在的影响。

在2016年的投资中，本基金将注意安全边际，增加对景气度高的行业、增速和估值比较匹配的龙头公司的配置。关注供给侧改革，国企改革和原油价格、大宗商品价格可能触底反弹带来的投资机会，规避高估值公司。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金未签约与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内共发放现金红利2,710,949,375.94元，再投资形式发放红利7,532,791.79元，合计分配利润2,718,482,167.73元。

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

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

本报告期，金鹰基金管理有限公司在本基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，由金鹰基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关本基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

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）050128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：金鹰策略配置混合型证券投资基金
报告截止日：2015年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资 产：	-	-
银行存款	80,078,034.15	10,881,660.05
结算备付金	1,078,836.75	1,623,827.36
存出保证金	405,228.76	190,226.06
交易性金融资产	282,034,755.40	109,927,221.01
其中：股票投资	282,034,755.40	109,927,221.01
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	8,057,838.52	3,607,773.89
应收利息	1,278,427.62	7,969.91
应收股利	-	-
应收申购款	83,494.78	181,012.20
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	373,016,615.98	126,419,690.48
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	-	-
应付证券清算款	5,071,811.65	1,030,595.07
应付赎回款	30,404,780.64	4,529,218.07
应付管理人报酬	1,788,889.98	162,342.70
应付托管费	298,148.32	27,057.14
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	789,568.82	1,152,509.86
应交税费	75,000.00	75,000.00
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,166,066.15	956,280.37
负债合计	39,594,265.56	7,933,003.21
所有者权益：	-	-
实收基金	242,091,066.90	86,292,875.87
未分配利润	91,331,283.52	32,193,811.40
所有者权益合计	333,422,350.42	118,486,687.27
负债和所有者权益总计	373,016,615.98	126,419,690.48

注：报告截止日2015年12月31日，基金份额净值1.3773元，基金份额总额242,091,066.90份。

7.2 利润表

会计主体：金鹰策略配置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	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入	68,693,989.43	34,237,022.47
1.利息收入	2,124,887.01	523,835.92
其中：存款利息收入	2,124,887.01	183,681.68
债券利息收入	-	204.82
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	339,949.42
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	59,350,060.91	33,069,465.33
其中：股票投资收益	58,756,382.19	32,318,119.63
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	136,145.98
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	593,678.72	615,199.72
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-889,876.71	580,831.35
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	8,108,918.22	62,889.87
减：二、费用	11,088,922.04	4,896,824.95
1． 管理人报酬	3,748,342.68	1,548,479.44
2． 托管费	624,723.77	258,079.91
3． 销售服务费	-	-
4． 交易费用	6,422,098.19	2,714,794.00
5． 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6． 其他费用	293,757.40	375,471.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	57,605,067.39	29,340,197.52
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	57,605,067.39	29,340,197.52

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金鹰策略配置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）	86,292,875.87	32,193,811.40	118,486,687.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	57,605,067.39	57,605,067.39
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）	155,798,191.03	2,720,014,572.46	2,875,812,763.49
其中：1.基金申购款	4,754,842,112.94	4,662,215,311.49	9,417,057,424.43
2.基金赎回款	-4,599,043,921.91	-1,942,200,739.03	-6,541,244,660.94
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）	-	-2,718,482,167.73	-2,718,482,167.73
五、期末所有者权益（基金净值）	242,091,066.90	91,331,283.52	333,422,350.42
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）	130,996,651.63	-702,569.21	130,294,082.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	29,340,197.52	29,340,197.52
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）	-44,703,775.76	3,556,183.09	-41,147,592.67
其中：1.基金申购款	75,478,015.82	26,168,172.95	101,646,188.77
2.基金赎回款	-120,181,791.58	-22,611,989.86	-142,793,781.44
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）	86,292,875.87	32,193,811.40	118,486,687.27

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

金鹰策略配置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”）证监许可[2011]970号文《关于核准金鹰策略配置股票型证券投资基金募集的批复》、基金部函[2011]691号文《关于金鹰策略配置股票型证券投资基金备案确认的函》批准，于2011年9月1日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金募集期间自2011年7月20日起至2011年8月26日止，认购金额及认购期银行利息合计805,601,019.15元，于2011年9月1日划至托管银行账户，首次设立募集规模为805,601,019.15份基金份额。验资机构为立信会计师事务所。本基金的基金管理人为金鹰基金管理有限公司，基金托管人为中信银行股份有限公司。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

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

本基金本报告期无会计政策变更。

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

本基金本报告期无会计差错更正。

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

7.4.7 关联方关系

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

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广州证券股份有限公司	178,108,451.80	4.13%	16,734,301.01	0.94%

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广州证券股份有限公司	157,608.05	4.07%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广州证券股份有限公司	14,808.25	0.92%	-	-

注：1、股票交易佣金的计提标准：支付佣金=股票成交金额*佣金比例-证管费-经手费-结算风险金（含债券交易）。

2、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

3、本基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,748,342.68	1,548,479.44
其中：支付销售机构的客户维护费	1,059,965.81	718,717.12

注：1、基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提，计算方法如下：
H=E×1.5%/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；由基金管理人向基金托管人发送基金管理人报酬划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇节假日、休息日等，支付日期顺延。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	624,723.77	258,079.91

注：1、基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：
H=E×0.25%/当年天数
H为每日应支付的基金托管费
E为前一日的基金资产净值
2、基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性支付，若遇节假日、休息日等，支付日期顺延。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
金鹰直销	0.00
广州证券	0.00
中信银行	0.00
合计	0.00
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
中信银行	0.00
广州证券	0.00
金鹰直销	0.00
合计	0.00

注：本基金本报告期及上年度可比期间内均没有应支付关联方的销售服务费。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用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

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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行股份有限公司	80,078,034.15	2,090,785.89	10,881,660.05	157,848.24

注：本基金用于证券交易结算的资金通过“中信银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率或约定利率计息，在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示。结算备付金本年度期末余额1,078,836.75元，结算备付金利息收入34,101.12元；上年度可比期间结算备付金期末余额1,623,827.36元，结算备付金利息收入25,833.44元。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.9 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600781	辅仁药业	2015-09-22	重大事项	19.36	2016-01-06	21.30	47,400.00	805,800.00	917,664.00	-
300238	冠昊生物	2015-11-12	重大事项	55.14	-	-	74,826.00	2,196,442.22	4,125,905.64	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购，故不存在作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购，故不存在作为抵押的债券。

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)，本基金于2015年3月25日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	282,034,755.40	75.61
	其中：股票	282,034,755.40	75.61
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	81,156,870.90	21.76
7	其他各项资产	9,824,989.68	2.63
8	合计	373,016,615.98	100.00

注：其他各项资产包括：交易保证金、应收利息、应收证券清算款、其他应收款、应收申购款、买入返售证券。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	191,979,801.32	57.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	22,610,573.75	6.78
F	批发和零售业	16,763,506.00	5.03
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,271,401.36	9.08
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	12,056,290.40	3.62
N	水利、环境和公共设施管理业	4,750,284.57	1.42
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	3,602,898.00	1.08
S	综合	-	-
	合计	282,034,755.40	84.59

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	002594	比亚迪	362,985	23,376,234.00	7.01
2	300097	智云股份	320,900	14,905,805.00	4.47
3	002096	南岭民爆	504,618	13,125,114.18	3.94
4	300147	香雪制药	488,900	12,227,389.00	3.67
5	300008	上海佳豪	453,244	12,056,290.40	3.62
6	000638	万方发展	385,200	11,767,860.00	3.53
7	002551	尚荣医疗	335,860	11,073,304.20	3.32
8	002572	索菲亚	253,400	10,921,540.00	3.28
9	002335	科华恒盛	226,845	10,888,560.00	3.27
10	600536	中国软件	271,700	9,802,936.00	2.94

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	002594	比亚迪	36,047,053.37	30.42
2	601318	中国平安	34,436,301.07	29.06
3	300147	香雪制药	32,248,240.80	27.22
4	300291	华录百纳	28,541,479.86	24.09
5	300295	三六五网	27,428,807.62	23.15
6	002657	中科金财	26,485,382.08	22.35
7	300155	安居宝	24,022,390.58	20.27
8	300329	海伦钢琴	22,157,381.44	18.70
9	300178	腾邦国际	21,712,845.23	18.33
10	000776	广发证券	20,352,402.00	17.18
11	300146	汤臣倍健	20,194,103.32	17.04
12	300274	阳光电源	20,123,897.44	16.98
13	600406	国电南瑞	20,070,765.79	16.94
14	002236	大华股份	18,999,390.17	16.04
15	300238	冠昊生物	17,996,091.41	15.19
16	000024	招商地产	17,866,352.29	15.08
17	300226	上海钢联	17,774,017.95	15.00
18	600446	金证股份	17,181,451.90	14.50
19	300170	汉得信息	16,978,862.17	14.33
20	600048	保利地产	16,117,422.00	13.60
21	600015	华夏银行	15,931,997.16	13.45
22	002335	科华恒盛	15,743,740.07	13.29
23	300335	迪森股份	15,661,271.60	13.22
24	002572	索菲亚	15,597,346.70	13.16
25	002709	天赐材料	15,151,991.51	12.79
26	600536	中国软件	14,981,824.41	12.64
27	000678	襄阳轴承	14,858,130.55	12.54
28	002332	仙琚制药	14,668,335.66	12.38
29	300221	银禧科技	14,459,154.00	12.20
30	300097	智云股份	14,438,559.46	12.19
31	601788	光大证券	14,175,062.16	11.96
32	300008	上海佳豪	14,049,247.96	11.86
33	002551	尚荣医疗	14,012,450.44	11.83
34	300086	康芝药业	13,696,945.52	11.56
35	002096	南岭民爆	13,580,712.03	11.46
36	002318	久立特材	12,839,577.22	10.84
37	600703	三安光电	12,612,441.68	10.64
38	300103	达刚路机	12,443,836.06	10.50
39	601377	兴业证券	12,391,867.00	10.46
40	002482	广田股份	12,271,761.15	10.36
41	002276	万马股份	11,855,959.60	10.01
42	603456	九洲药业	11,855,774.00	10.01
43	600850	华东电脑	11,805,971.30	9.96
44	601169	北京银行	11,624,108.92	9.81
45	002030	达安基因	11,621,752.00	9.81
46	601939	建设银行	11,610,247.90	9.80
47	002312	三泰控股	11,480,300.15	9.69
48	002698	博实股份	11,472,251.30	9.68
49	603588	高能环境	11,457,102.90	9.67
50	600572	康恩贝	11,283,928.42	9.52
51	600000	浦发银行	11,021,481.29	9.30
52	002142	宁波银行	11,007,370.48	9.29
53	600999	招商证券	11,005,485.00	9.29
54	000001	平安银行	10,934,717.90	9.23
55	300059	东方财富	10,859,446.74	9.17
56	002410	广联达	10,728,381.93	9.05
57	300364	中文在线	10,604,076.80	8.95
58	300263	隆华节能	10,275,939.85	8.67
59	300002	神州泰岳	10,266,856.32	8.66
60	600520	中发科技	10,265,278.21	8.66
61	000936	华西股份	10,261,646.20	8.66
62	000558	莱茵体育	10,223,953.63	8.63
63	601800	中国交建	10,163,228.89	8.58
64	002713	东易日盛	10,158,539.96	8.57
65	000638	万方发展	10,046,418.50	8.48
66	002659	中泰桥梁	10,042,715.07	8.48
67	300249	依米康	10,032,791.50	8.47
68	002251	步 步 高	9,953,661.99	8.40
69	601688	华泰证券	9,795,474.96	8.27
70	600958	东方证券	9,726,884.27	8.21
71	600050	中国联通	9,687,736.00	8.18
72	000858	五 粮 液	9,674,950.12	8.17
73	002614	蒙发利	9,658,910.00	8.15
74	600029	南方航空	9,625,363.00	8.12
75	002013	中航机电	9,602,360.22	8.10
76	000400	许继电气	9,204,898.83	7.77
77	601668	中国建筑	9,104,294.00	7.68
78	300409	道氏技术	8,808,119.00	7.43
79	000961	中南建设	8,528,541.63	7.20
80	300133	华策影视	8,513,485.16	7.19
81	002717	岭南园林	8,407,483.28	7.10
82	002227	奥 特 迅	8,269,716.77	6.98
83	002339	积成电子	8,258,200.57	6.97
84	601222	林洋能源	8,091,110.99	6.83
85	300045	华力创通	8,050,487.03	6.79
86	300035	中科电气	8,019,142.10	6.77
87	600410	华胜天成	7,890,520.91	6.66
88	300352	北信源	7,552,413.99	6.37
89	601186	中国铁建	7,531,259.00	6.36
90	600143	金发科技	7,428,293.00	6.27
91	002522	浙江众成	7,358,143.60	6.21
92	600730	中国高科	7,324,766.00	6.18
93	600436	片仔癀	7,161,234.16	6.04
94	300244	迪安诊断	7,075,218.00	5.97
95	300005	探路者	7,050,251.00	5.95
96	300351	永贵电器	7,002,703.42	5.91
97	000002	万 科A	6,979,182.00	5.89
98	600711	盛屯矿业	6,965,688.66	5.88
99	002215	诺 普 信	6,903,362.20	5.83
100	600016	民生银行	6,899,182.00	5.82
101	002699	美盛文化	6,840,032.25	5.77
102	300203	聚光科技	6,785,058.29	5.73
103	000078	海王生物	6,750,781.83	5.70
104	002228	合兴包装	6,609,180.36	5.58
105	000062	深圳华强	6,598,915.40	5.57
106	000407	胜利股份	6,472,938.05	5.46
107	002273	水晶光电	6,360,763.70	5.37
108	002076	雪 莱 特	6,344,887.94	5.35
109	600511	国药股份	6,270,179.00	5.29
110	300183	东软载波	6,203,141.88	5.24
111	002322	理工监测	6,008,386.33	5.07
112	600426	华鲁恒升	6,004,601.42	5.07
113	000673	当代东方	5,999,480.68	5.06
114	600960	渤海活塞	5,897,379.08	4.98
115	300378	鼎捷软件	5,887,685.80	4.97
116	600579	天华院	5,884,569.00	4.97
117	000957	中通客车	5,858,523.00	4.94
118	002249	大洋电机	5,829,872.53	4.92
119	601166	兴业银行	5,684,149.00	4.80
120	002445	中南重工	5,663,788.96	4.78
121	000547	航天发展	5,655,346.31	4.77
122	002124	天邦股份	5,546,138.90	4.68
123	002157	正邦科技	5,532,554.00	4.67
124	300468	四方精创	5,326,470.00	4.50
125	000401	冀东水泥	5,309,450.09	4.48
126	300186	大华农	5,296,143.10	4.47
127	000801	四川九洲	5,290,317.00	4.46
128	002407	多氟多	5,283,094.36	4.46
129	600115	东方航空	5,231,496.10	4.42
130	601111	中国国航	5,230,500.00	4.41
131	300024	机器人	5,213,243.62	4.40
132	300207	欣旺达	5,204,332.08	4.39
133	300058	蓝色光标	5,189,124.84	4.38
134	600158	中体产业	5,177,318.69	4.37
135	300212	易华录	5,170,446.07	4.36
136	600760	中航黑豹	5,165,212.00	4.36
137	300037	新宙邦	5,165,026.24	4.36
138	002325	洪涛股份	5,126,689.15	4.33
139	601333	广深铁路	5,120,839.00	4.32
140	002299	圣农发展	5,100,951.00	4.31
141	601628	中国人寿	5,097,489.00	4.30
142	601988	中国银行	5,084,530.00	4.29
143	603108	润达医疗	5,077,404.00	4.29
144	600986	科达股份	5,047,383.00	4.26
145	600060	海信电器	5,026,649.20	4.24
146	600378	天科股份	4,999,017.25	4.22
147	000926	福星股份	4,918,280.23	4.15
148	300101	振芯科技	4,903,481.94	4.14
149	000893	东凌粮油	4,886,507.00	4.12
150	002364	中恒电气	4,883,492.00	4.12
151	000810	创维数字	4,833,936.00	4.08
152	300241	瑞丰光电	4,830,333.30	4.08
153	000793	华闻传媒	4,830,044.00	4.08
154	300073	当升科技	4,763,105.27	4.02
155	002439	启明星辰	4,691,373.00	3.96
156	300088	长信科技	4,665,307.19	3.94
157	300162	雷曼股份	4,660,706.00	3.93
158	600038	中直股份	4,658,963.50	3.93
159	300009	安科生物	4,632,267.00	3.91
160	601398	工商银行	4,631,398.00	3.91
161	300450	先导智能	4,619,042.00	3.90
162	600079	人福医药	4,597,291.00	3.88
163	300142	沃森生物	4,597,019.00	3.88
164	600397	安源煤业	4,596,992.00	3.88
165	002285	世联行	4,586,972.52	3.87
166	000796	凯撒旅游	4,581,858.00	3.87
167	600376	首开股份	4,547,130.00	3.84
168	300322	硕贝德	4,432,385.00	3.74
169	002740	爱迪尔	4,398,728.84	3.71
170	601328	交通银行	4,323,037.10	3.65
171	002035	华帝股份	4,300,405.06	3.63
172	002400	省广股份	4,263,799.15	3.60
173	300182	捷成股份	4,237,237.75	3.58
174	300420	五洋科技	4,198,375.00	3.54
175	002568	百润股份	4,092,375.00	3.45
176	300210	森远股份	4,079,200.00	3.44
177	300140	启源装备	4,063,056.34	3.43
178	002296	辉煌科技	4,003,283.00	3.38
179	000732	泰禾集团	3,957,625.22	3.34
180	000540	中天城投	3,921,778.00	3.31
181	000056	皇庭国际	3,847,522.00	3.25
182	300392	腾信股份	3,799,713.50	3.21
183	000042	中洲控股	3,714,952.38	3.14
184	002004	华邦健康	3,646,866.33	3.08
185	002084	海鸥卫浴	3,640,385.00	3.07
186	603555	贵人鸟	3,635,814.34	3.07
187	002098	浔兴股份	3,624,858.00	3.06
188	600552	方兴科技	3,623,231.01	3.06
189	002751	易尚展示	3,529,230.00	2.98
190	002311	海大集团	3,507,901.40	2.96
191	002366	台海核电	3,340,782.00	2.82
192	603308	应流股份	3,325,491.89	2.81
193	601919	中国远洋	3,278,412.20	2.77
194	300303	聚飞光电	3,277,101.47	2.77
195	300166	东方国信	3,274,137.95	2.76
196	600699	均胜电子	3,270,443.27	2.76
197	000559	万向钱潮	3,215,583.93	2.71
198	300251	光线传媒	3,210,307.00	2.71
199	002074	国轩高科	3,199,639.00	2.70
200	002714	牧原股份	3,198,941.58	2.70
201	002327	富安娜	3,193,507.00	2.70
202	000777	中核科技	3,185,984.08	2.69
203	300026	红日药业	3,119,110.10	2.63
204	002108	沧州明珠	3,102,345.25	2.62
205	600535	天士力	3,086,295.56	2.60
206	002669	康达新材	3,081,600.00	2.60
207	300048	合康变频	3,067,218.40	2.59
208	002456	欧菲光	3,057,451.20	2.58
209	600261	阳光照明	3,055,906.99	2.58
210	002036	汉麻产业	3,054,480.00	2.58
211	603001	奥康国际	3,049,502.00	2.57
212	002065	东华软件	3,048,261.87	2.57
213	002466	天齐锂业	3,040,311.00	2.57
214	300288	朗玛信息	3,038,062.36	2.56
215	002639	雪人股份	3,033,502.70	2.56
216	000800	一汽轿车	3,023,738.00	2.55
217	000910	大亚科技	3,022,779.00	2.55
218	002290	禾盛新材	3,005,130.00	2.54
219	300192	科斯伍德	3,004,930.00	2.54
220	300451	创业软件	2,994,740.00	2.53
221	000709	河北钢铁	2,982,789.00	2.52
222	002175	东方网络	2,979,600.26	2.51
223	600687	刚泰控股	2,978,990.00	2.51
224	600820	隧道股份	2,977,983.00	2.51
225	600283	钱江水利	2,957,756.43	2.50
226	601000	唐山港	2,957,463.99	2.50
227	002583	海能达	2,951,766.00	2.49
228	002177	御银股份	2,949,689.63	2.49
229	300479	神思电子	2,947,888.10	2.49
230	600277	亿利洁能	2,945,010.00	2.49
231	000539	粤电力A	2,943,720.00	2.48
232	300284	苏交科	2,942,700.00	2.48
233	300257	开山股份	2,924,995.99	2.47
234	000063	中兴通讯	2,903,890.80	2.45
235	002474	榕基软件	2,871,258.00	2.42
236	002350	北京科锐	2,859,472.00	2.41
237	600588	用友网络	2,857,268.16	2.41
238	000712	锦龙股份	2,849,674.00	2.41
239	002736	国信证券	2,849,200.00	2.40
240	600373	中文传媒	2,843,684.00	2.40
241	000762	西藏矿业	2,838,380.90	2.40
242	300020	银江股份	2,831,913.50	2.39
243	600208	新湖中宝	2,830,825.00	2.39
244	603368	柳州医药	2,817,100.00	2.38
245	601901	方正证券	2,811,120.00	2.37
246	603989	艾华传媒	2,802,574.00	2.37
247	300070	碧水源	2,797,910.00	2.36
248	600570	恒生电子	2,792,984.37	2.36
249	000651	格力电器	2,786,700.00	2.35
250	603338	股票投资-上海-浙江鼎力	2,775,972.50	2.34
251	601601	中国太保	2,772,894.34	2.34
252	300427	红相电力	2,764,378.00	2.33
253	002610	爱康科技	2,739,970.00	2.31
254	603019	中科曙光	2,725,115.50	2.30
255	600387	海越股份	2,717,946.00	2.29
256	002425	凯撒股份	2,715,964.00	2.29
257	000049	德赛电池	2,715,322.00	2.29
258	300308	中际装备	2,699,586.68	2.28
259	000953	河池化工	2,693,310.00	2.27
260	300399	京天利	2,686,696.00	2.27
261	002216	三全食品	2,671,914.85	2.26
262	600875	东方电气	2,659,278.62	2.24
263	002454	松芝股份	2,658,828.00	2.24
264	002532	新界泵业	2,649,673.00	2.24
265	002368	太极股份	2,642,730.00	2.23
266	002329	皇氏集团	2,606,751.97	2.20
267	002086	东方海洋	2,600,009.00	2.19
268	000524	岭南控股	2,583,459.92	2.18
269	300488	恒锋工具	2,554,488.00	2.16
270	002191	劲嘉股份	2,537,482.75	2.14
271	002671	龙泉股份	2,510,252.00	2.12
272	300261	雅本化学	2,495,199.40	2.11
273	300159	新研股份	2,487,546.00	2.10
274	600491	龙元建设	2,479,422.00	2.09
275	300224	正海磁材	2,470,820.84	2.09
276	600685	中船防务	2,435,901.00	2.06
277	600372	中航电子	2,432,763.00	2.05
278	002373	千方科技	2,431,944.00	2.05
279	600837	海通证券	2,431,808.01	2.05
280	600893	中航动力	2,429,821.00	2.05
281	601555	东吴证券	2,421,422.00	2.04
282	000971	高升控股	2,417,018.51	2.04
283	002023	海特高新	2,407,277.00	2.03
284	603799	华友钴业	2,405,553.00	2.03
285	600056	中国医药	2,404,674.29	2.03
286	300286	安科瑞	2,400,994.00	2.03
287	300001	特锐德	2,387,137.50	2.01
288	600031	三一重工	2,369,893.00	2.00

注：该表的累计买入金额按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，未考虑相关交易费用。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	601318	中国平安	47,809,666.65	40.35
2	300178	腾邦国际	35,897,827.71	30.30
3	002657	中科金财	30,364,602.50	25.63
4	300291	华录百纳	30,195,843.37	25.48
5	300155	安居宝	29,543,436.81	24.93
6	300295	三六五网	24,023,317.70	20.28
7	000024	招商地产	23,993,592.91	20.25
8	600048	保利地产	23,290,498.00	19.66
9	002276	万马股份	21,955,577.73	18.53
10	300329	海伦钢琴	21,890,314.24	18.47
11	300146	汤臣倍健	21,599,375.82	18.23
12	600446	金证股份	19,998,121.91	16.88
13	600015	华夏银行	19,745,748.18	16.66
14	300226	上海钢联	19,488,841.75	16.45
15	300274	阳光电源	19,349,679.05	16.33
16	000776	广发证券	19,275,970.96	16.27
17	002236	大华股份	17,082,162.58	14.42
18	600406	国电南瑞	16,965,745.88	14.32
19	002332	仙琚制药	16,435,482.11	13.87
20	300170	汉得信息	16,392,082.91	13.83
21	300221	银禧科技	16,341,045.20	13.79
22	300238	冠昊生物	16,259,513.61	13.72
23	300335	迪森股份	16,073,472.36	13.57
24	601377	兴业证券	15,486,702.76	13.07
25	002709	天赐材料	15,415,716.08	13.01
26	002482	广田股份	15,304,276.15	12.92
27	603456	九洲药业	15,284,611.00	12.90
28	300147	香雪制药	14,698,532.47	12.41
29	300086	康芝药业	14,438,976.14	12.19
30	002594	比亚迪	14,285,866.22	12.06
31	002030	达安基因	14,184,697.36	11.97
32	601688	华泰证券	13,972,510.23	11.79
33	002318	久立特材	13,391,967.60	11.30
34	600572	康恩贝	13,087,419.19	11.05
35	601788	光大证券	13,020,375.50	10.99
36	600999	招商证券	12,964,783.60	10.94
37	300059	东方财富	12,507,761.59	10.56
38	002251	步 步 高	12,394,808.18	10.46
39	600703	三安光电	12,187,701.56	10.29
40	000001	平安银行	11,806,723.20	9.96
41	000002	万 科A	11,700,132.68	9.87
42	601169	北京银行	11,638,268.00	9.82
43	600000	浦发银行	11,629,404.19	9.81
44	601939	建设银行	11,593,030.00	9.78
45	002410	广联达	11,554,338.26	9.75
46	601668	中国建筑	11,501,979.00	9.71
47	000678	襄阳轴承	11,487,602.83	9.70
48	601166	兴业银行	11,481,562.31	9.69
49	600016	民生银行	11,456,987.87	9.67
50	600436	片仔癀	10,943,415.27	9.24
51	002698	博实股份	10,722,598.52	9.05
52	002013	中航机电	10,630,854.20	8.97
53	002142	宁波银行	10,519,182.10	8.88
54	000961	中南建设	10,399,017.03	8.78
55	600850	华东电脑	10,186,748.57	8.60
56	601800	中国交建	10,065,749.42	8.50
57	300364	中文在线	9,928,803.00	8.38
58	000651	格力电器	9,920,300.37	8.37
59	002614	蒙发利	9,868,361.65	8.33
60	600958	东方证券	9,793,330.00	8.27
61	600050	中国联通	9,714,811.27	8.20
62	000558	莱茵体育	9,323,898.52	7.87
63	600029	南方航空	9,256,049.61	7.81
64	601328	交通银行	9,243,784.00	7.80
65	601222	林洋能源	9,140,846.22	7.71
66	300249	依米康	9,007,933.56	7.60
67	600730	中国高科	8,868,567.89	7.48
68	000400	许继电气	8,823,458.50	7.45
69	300045	华力创通	8,820,847.30	7.44
70	002699	美盛文化	8,435,704.20	7.12
71	002522	浙江众成	8,064,627.77	6.81
72	300133	华策影视	8,012,089.44	6.76
73	002339	积成电子	7,960,583.58	6.72
74	600711	盛屯矿业	7,870,128.63	6.64
75	002273	水晶光电	7,571,773.87	6.39
76	000858	五 粮 液	7,548,375.84	6.37
77	300159	新研股份	7,370,064.20	6.22
78	601186	中国铁建	7,279,989.00	6.14
79	002227	奥 特 迅	7,275,875.50	6.14
80	600143	金发科技	7,220,959.00	6.09
81	000926	福星股份	7,178,906.49	6.06
82	300244	迪安诊断	7,149,517.45	6.03
83	002445	中南重工	7,055,114.26	5.95
84	300351	永贵电器	6,987,248.04	5.90
85	300378	鼎捷软件	6,844,364.89	5.78
86	603588	高能环境	6,773,053.08	5.72
87	000540	中天城投	6,710,522.03	5.66
88	000401	冀东水泥	6,673,870.00	5.63
89	002717	岭南园林	6,555,061.68	5.53
90	002407	多氟多	6,276,068.58	5.30
91	002551	尚荣医疗	6,215,997.16	5.25
92	300101	振芯科技	6,213,738.99	5.24
93	600158	中体产业	6,174,618.28	5.21
94	000801	四川九洲	6,139,518.50	5.18
95	000547	航天发展	6,065,129.90	5.12
96	300183	东软载波	6,063,691.40	5.12
97	002157	正邦科技	6,045,522.04	5.10
98	002439	启明星辰	6,022,735.20	5.08
99	300207	欣旺达	5,890,192.87	4.97
100	300352	北信源	5,854,716.80	4.94
101	600376	首开股份	5,833,803.00	4.92
102	000957	中通客车	5,796,130.57	4.89
103	000407	胜利股份	5,703,867.38	4.81
104	002215	诺 普 信	5,689,686.67	4.80
105	000673	当代东方	5,513,398.51	4.65
106	600960	渤海活塞	5,510,321.76	4.65
107	600511	国药股份	5,460,781.24	4.61
108	300024	机器人	5,437,544.12	4.59
109	002285	世联行	5,433,994.36	4.59
110	300212	易华录	5,383,192.63	4.54
111	600060	海信电器	5,358,771.42	4.52
112	000893	东凌粮油	5,331,509.56	4.50
113	600410	华胜天成	5,303,852.10	4.48
114	002335	科华恒盛	5,283,492.45	4.46
115	300037	新宙邦	5,265,776.15	4.44
116	002364	中恒电气	5,230,796.94	4.41
117	002249	大洋电机	5,227,549.02	4.41
118	000078	海王生物	5,170,619.00	4.36
119	600986	科达股份	5,020,337.00	4.24
120	601988	中国银行	5,011,071.00	4.23
121	600760	中航黑豹	4,968,648.71	4.19
122	600536	中国软件	4,924,886.60	4.16
123	300005	探 路 者	4,912,259.00	4.15
124	600378	天科股份	4,895,112.39	4.13
125	300088	长信科技	4,889,644.32	4.13
126	000793	华闻传媒	4,881,273.78	4.12
127	601628	中国人寿	4,879,177.00	4.12
128	300468	四方精创	4,866,014.31	4.11
129	601111	中国国航	4,810,071.00	4.06
130	002568	百润股份	4,763,865.56	4.02
131	300241	瑞丰光电	4,712,991.14	3.98
132	300322	硕贝德	4,697,062.79	3.96
133	601333	广深铁路	4,695,845.49	3.96
134	600038	中直股份	4,688,985.96	3.96
135	300399	京天利	4,688,151.81	3.96
136	600426	华鲁恒升	4,687,328.96	3.96
137	000810	创维数字	4,681,139.00	3.95
138	300058	蓝色光标	4,679,381.74	3.95
139	300009	安科生物	4,626,643.00	3.90
140	300162	雷曼股份	4,606,578.20	3.89
141	601398	工商银行	4,550,008.00	3.84
142	000796	凯撒旅游	4,545,039.00	3.84
143	600115	东方航空	4,488,392.82	3.79
144	300450	先导智能	4,479,592.80	3.78
145	300142	沃森生物	4,418,400.00	3.73
146	600079	人福医药	4,384,494.00	3.70
147	002035	华帝股份	4,346,511.90	3.67
148	002572	索菲亚	4,340,848.04	3.66
149	300186	大华农	4,236,704.20	3.58
150	000709	河北钢铁	4,225,961.36	3.57
151	300182	捷成股份	4,204,351.48	3.55
152	000762	西藏矿业	4,181,824.00	3.53
153	600428	中远航运	4,153,246.90	3.51
154	300420	五洋科技	4,138,057.00	3.49
155	000732	泰禾集团	4,107,192.62	3.47
156	002400	省广股份	4,063,094.80	3.43
157	300140	启源装备	4,055,388.21	3.42
158	002740	爱迪尔	4,012,855.40	3.39
159	002366	台海核电	3,987,603.10	3.37
160	300210	森远股份	3,985,965.24	3.36
161	002191	劲嘉股份	3,977,245.08	3.36
162	002228	合兴包装	3,965,502.00	3.35
163	600397	安源煤业	3,929,703.00	3.32
164	002084	海鸥卫浴	3,916,139.84	3.31
165	000042	中洲控股	3,887,277.87	3.28
166	002004	华邦健康	3,883,944.08	3.28
167	002131	利欧股份	3,817,278.11	3.22
168	000777	中核科技	3,740,222.15	3.16
169	300392	腾信股份	3,718,320.41	3.14
170	002312	三泰控股	3,718,249.25	3.14
171	000056	皇庭国际	3,669,082.28	3.10
172	601000	唐山港	3,628,185.07	3.06
173	000062	深圳华强	3,594,786.00	3.03
174	002076	雪 莱 特	3,527,142.00	2.98
175	002175	东方网络	3,501,372.36	2.96
176	603001	奥康国际	3,461,714.64	2.92
177	002098	浔兴股份	3,428,594.40	2.89
178	300203	聚光科技	3,419,965.00	2.89
179	002177	御银股份	3,411,274.48	2.88
180	002074	国轩高科	3,402,872.90	2.87
181	002713	东易日盛	3,363,805.90	2.84
182	002311	海大集团	3,363,352.16	2.84
183	603308	应流股份	3,327,088.00	2.81
184	002108	沧州明珠	3,324,389.75	2.81
185	002124	天邦股份	3,296,371.40	2.78
186	002327	富安娜	3,295,432.00	2.78
187	300288	朗玛信息	3,286,589.80	2.77
188	601919	中国远洋	3,283,029.20	2.77
189	300048	合康变频	3,260,219.45	2.75
190	000800	一汽轿车	3,257,000.28	2.75
191	000910	大亚科技	3,222,265.52	2.72
192	600801	华新水泥	3,220,974.00	2.72
193	000559	万向钱潮	3,133,430.44	2.64
194	600570	恒生电子	3,096,240.68	2.61
195	300303	聚飞光电	3,060,024.90	2.58
196	600552	方兴科技	3,044,136.57	2.57
197	603555	贵人鸟	3,040,675.00	2.57
198	002299	圣农发展	3,033,864.00	2.56
199	002065	东华软件	3,019,123.00	2.55
200	300451	创业软件	3,008,501.00	2.54
201	600277	亿利洁能	3,004,378.00	2.54
202	600261	阳光照明	3,000,601.00	2.53
203	002583	海能达	2,992,887.46	2.53
204	600893	中航动力	2,987,868.60	2.52
205	000712	锦龙股份	2,977,032.55	2.51
206	300308	中际装备	2,976,453.00	2.51
207	600535	天士力	2,955,546.74	2.49
208	600687	刚泰控股	2,953,780.00	2.49
209	000063	中兴通讯	2,951,019.08	2.49
210	300090	盛运环保	2,945,774.80	2.49
211	002639	雪人股份	2,941,105.00	2.48
212	300251	光线传媒	2,937,319.95	2.48
213	300314	戴维医疗	2,933,994.00	2.48
214	300479	神思电子	2,933,620.40	2.48
215	002456	欧菲光	2,930,899.56	2.47
216	002610	爱康科技	2,927,838.90	2.47
217	300030	阳普医疗	2,924,038.00	2.47
218	002325	洪涛股份	2,920,318.00	2.46
219	300257	开山股份	2,908,825.04	2.45
220	600571	信雅达	2,885,336.16	2.44
221	600283	钱江水利	2,880,448.49	2.43
222	300070	碧水源	2,871,616.85	2.42
223	002350	北京科锐	2,860,706.58	2.41
224	600208	新湖中宝	2,852,000.00	2.41
225	603338	股票投资-上海-浙江鼎力	2,835,119.45	2.39
226	002669	康达新材	2,830,754.00	2.39
227	600373	中文传媒	2,829,924.52	2.39
228	603368	柳州医药	2,828,207.00	2.39
229	300001	特锐德	2,822,519.77	2.38
230	002373	千方科技	2,817,496.99	2.38
231	000738	中航动控	2,813,229.28	2.37
232	300232	洲明科技	2,812,656.00	2.37
233	600588	用友网络	2,807,741.37	2.37
234	002736	国信证券	2,782,092.00	2.35
235	000539	粤电力A	2,774,334.00	2.34
236	000026	飞亚达A	2,764,369.34	2.33
237	002036	汉麻产业	2,761,884.00	2.33
238	002532	新界泵业	2,734,810.00	2.31
239	002466	天齐锂业	2,733,697.00	2.31
240	300166	东方国信	2,733,036.00	2.31
241	300020	银江股份	2,729,985.00	2.30
242	601601	中国太保	2,717,252.16	2.29
243	600387	海越股份	2,704,713.36	2.28
244	002474	榕基软件	2,702,565.12	2.28
245	002425	凯撒股份	2,669,878.80	2.25
246	002673	西部证券	2,643,300.00	2.23
247	601901	方正证券	2,627,960.00	2.22
248	002290	禾盛新材	2,614,920.60	2.21
249	002714	牧原股份	2,601,802.50	2.20
250	300284	苏交科	2,593,616.00	2.19
251	002368	太极股份	2,592,344.72	2.19
252	002216	三全食品	2,587,377.48	2.18
253	603019	中科曙光	2,586,668.55	2.18
254	000524	岭南控股	2,566,041.26	2.17
255	002671	龙泉股份	2,561,826.40	2.16
256	000953	河池化工	2,560,828.00	2.16
257	000049	德赛电池	2,559,593.16	2.16
258	600875	东方电气	2,544,760.00	2.15
259	002454	松芝股份	2,538,653.00	2.14
260	002146	荣盛发展	2,534,959.00	2.14
261	603989	艾华传媒	2,513,541.00	2.12
262	002584	西陇科学	2,510,894.00	2.12
263	000997	新 大 陆	2,483,189.00	2.10
264	600674	川投能源	2,464,121.49	2.08
265	300413	快乐购	2,456,571.02	2.07
266	300488	恒锋工具	2,455,507.00	2.07
267	002086	东方海洋	2,449,651.00	2.07
268	600837	海通证券	2,440,160.00	2.06
269	300261	雅本化学	2,439,381.18	2.06
270	300026	红日药业	2,426,211.56	2.05
271	603799	华友钴业	2,419,303.00	2.04
272	002083	孚日股份	2,418,398.00	2.04
273	600483	福能股份	2,411,127.80	2.03
274	600056	中国医药	2,406,601.89	2.03
275	300427	红相电力	2,390,798.00	2.02
276	300275	梅安森	2,384,586.00	2.01
277	300333	兆日科技	2,384,195.06	2.01
278	601555	东吴证券	2,371,948.98	2.00

注：该表的累计卖出金额按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，未考虑相关交易费用。8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	2,211,294,360.16
卖出股票的收入（成交）总额	2,097,053,331.25

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

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。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金报告期末未持有贵金属投资。

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。

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

报告期本基金无投资股指期货。

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

报告期本基金无投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2本基金报告期内基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	405,228.76
2	应收证券清算款	8,057,838.52
3	应收股利	-
4	应收利息	1,278,427.62
5	应收申购款	83,494.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,824,989.68

8.12.4 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

8.12.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
3,649	66,344.50	185,811,029.97	76.75%	56,280,036.93	23.25%

9.2 期末上市基金前十名持有人

本基金非上市基金

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,569.00	0.00%

9.4期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9.5发起式基金发起资金持有份额情况

本基金非发起式基金，本公司未持有基金份额。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2011年9月1日)基金份额总额	805,601,019.15
本报告期期初基金份额总额	86,292,875.87
本报告期基金总申购份额	4,754,842,112.94
减：本报告期基金总赎回份额	4,599,043,921.91
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	242,091,066.90

§11 重大事件揭示

11.1基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金管理人董事长由刘东先生变更为凌富华先生，相关事项已于2015年1月10日进行了信息披露。

基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动.

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本基金报告期内没有改变基金投资策略。

11.5为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金审计的会计师事务所为中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）。

本报告期内实际应支付会计师事务所的审计费为32000元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	875,806,119.74	20.33%	800,397.69	20.66%	-
西南证券	1	422,480,767.79	9.81%	380,435.26	9.82%	-
广发证券	1	2,831,952,153.34	65.73%	2,534,997.63	65.45%	-
广州证券	1	178,108,451.80	4.13%	157,608.05	4.07%	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-

注：本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单位作为本基金的专用交易单位。本基金专用交易单位的选择标准如下：

（1）经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

（2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

（3）具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展、投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

本基金专用交易单位的选择程序如下：

（1）本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单位的证券经营机构。

（2）基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单位租用协议。

§12 影响投资者决策的其他重要信息

1、根据相关法规及监管部门要求，本基金由股票型变更为混合型，并对本基金全称、简称、类型及基金合同作了相应变更。该变更已于2015年8月3日在证券时报等指定媒体上公告。

2、由于中信标普国债指数即将停止发布，本基金的业绩比较基准由“沪深300指数收益率X75%+中信标普国债指数收益率X25%”变更为“沪深300指数收益率X75%+中证全债指数收益率X25%”，故对基金合同等法律文件作了相应修改并依法履行了备案及公告手续。

3、本报告期，本基金原审计机构中审亚太会计师事务所（特殊普通合伙）广东分所已与众环海华会计师事务所（特殊普通合伙）合并为中审众环会计师事务所（特殊普通合伙），经公司第五届董事会第20次会议决议通过，旗下相关基金的审计机构由“中审亚太会计师事务所（特殊普通合伙）”相应变更为“中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）”，此项变更已于2015年12月31日在证券时报等指定媒体公告，并按规定向证监会备案。

金鹰基金管理有限公司
二〇一六年三月三十日