

金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金

基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一七年三月二十九日

1.1 重要提示
基金管理人、基金托管人、基金销售机构不存在虚假记载、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。
基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017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。
本报告自2016年1月1日起至12月31日止。

2.1 基金基本情况

基金名称	金鹰红利价值混合
基金代码	210002
交易代码	210002
基金运作方式	契约型开放式
基金存续日期	2008年12月4日
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	188,682,079.30元
报告期末基金份额净值	不定期

2.2 基金产品说明
投资目标：本基金通过资产配置和权益类资产择时，为基金资产增值，为基金份额持有人提供长期稳定的投资回报。
投资策略：本基金采用“自上而下”和“自下而上”相结合的投资策略。在资产配置方面，本基金根据宏观经济形势、政策环境、市场估值等因素，对股票、债券、货币市场工具等资产类别进行配置。在权益类资产配置方面，本基金采用“行业轮动”和“个股精选”相结合的策略。在固定收益资产配置方面，本基金采用“久期匹配”和“信用精选”相结合的策略。
业绩比较基准：中证红利指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。
风险收益特征：本基金为混合型证券投资基金，其风险与预期收益高于货币市场基金和债券基金，低于股票基金。

项目	基金管理人	基金托管人
名称	金鹰基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
姓名	王芳	陈金
联系电话	020-83282627	96969
电子邮箱	cmf@cmf-fund.com	ttz@交通银行
客户服务热线	4006138888, 020-83283185	95555
传真	020-83283956	021-42791165

2.3 基金管理人、基金托管人、基金销售机构
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司
基金销售机构：各大商业银行、证券公司、基金销售机构等。

2.4 信息披露方式
基金年度报告摘要刊登在基金管理人网站（http://www.gmcfund.com）
基金年度报告全文刊登在基金管理人网站（http://www.gmcfund.com）

2.5 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况
主要会计数据和财务指标
金额单位：人民币元

项目	2016年	2015年	2014年
本期已实现收益	15,462,196.91	69,040,762.63	25,174,790.28
本期公允价值变动损益	11,111,006.74	62,892,324.01	49,374,936.69
本期基金净值增长率	9.25%	40.26%	40.14%
1.2 期末基金份额净值	2016年末	2015年末	2014年末
期末基金份额净值	2016年末	2015年末	2014年末
期末基金份额净值	2016年末	2015年末	2014年末

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。本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2.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。
3.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

项目	2016年	2015年	2014年
本期已实现收益	15,462,196.91	69,040,762.63	25,174,790.28
本期公允价值变动损益	11,111,006.74	62,892,324.01	49,374,936.69
本期基金净值增长率	9.25%	40.26%	40.14%
1.2 期末基金份额净值	2016年末	2015年末	2014年末
期末基金份额净值	2016年末	2015年末	2014年末
期末基金份额净值	2016年末	2015年末	2014年末

注：1.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。股票资产占基金资产比例为20%—80%，现金、债券资产占基金资产比例不超过20%。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%；权证投资占基金资产净值的比例不超过2%。2.本基金的业绩比较基准是：中证红利指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。

3.2.2 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

项目	2016年	2015年	2014年
本期已实现收益	15,462,196.91	69,040,762.63	25,174,790.28
本期公允价值变动损益	11,111,006.74	62,892,324.01	49,374,936.69
本期基金净值增长率	9.25%	40.26%	40.14%
1.2 期末基金份额净值	2016年末	2015年末	2014年末
期末基金份额净值	2016年末	2015年末	2014年末
期末基金份额净值	2016年末	2015年末	2014年末

注：1.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。股票资产占基金资产比例为20%—80%，现金、债券资产占基金资产比例不超过20%。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%；权证投资占基金资产净值的比例不超过2%。2.本基金的业绩比较基准是：中证红利指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。

3.2.3 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

项目	2016年	2015年	2014年
本期已实现收益	15,462,196.91	69,040,762.63	25,174,790.28
本期公允价值变动损益	11,111,006.74	62,892,324.01	49,374,936.69
本期基金净值增长率	9.25%	40.26%	40.14%
1.2 期末基金份额净值	2016年末	2015年末	2014年末
期末基金份额净值	2016年末	2015年末	2014年末
期末基金份额净值	2016年末	2015年末	2014年末

注：1.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。股票资产占基金资产比例为20%—80%，现金、债券资产占基金资产比例不超过20%。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%；权证投资占基金资产净值的比例不超过2%。2.本基金的业绩比较基准是：中证红利指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。

3.2.4 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

项目	2016年	2015年	2014年
本期已实现收益	15,462,196.91	69,040,762.63	25,174,790.28
本期公允价值变动损益	11,111,006.74	62,892,324.01	49,374,936.69
本期基金净值增长率	9.25%	40.26%	40.14%
1.2 期末基金份额净值	2016年末	2015年末	2014年末
期末基金份额净值	2016年末	2015年末	2014年末
期末基金份额净值	2016年末	2015年末	2014年末

注：1.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。股票资产占基金资产比例为20%—80%，现金、债券资产占基金资产比例不超过20%。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%；权证投资占基金资产净值的比例不超过2%。2.本基金的业绩比较基准是：中证红利指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。

3.2.5 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

项目	2016年	2015年	2014年
本期已实现收益	15,462,196.91	69,040,762.63	25,174,790.28
本期公允价值变动损益	11,111,006.74	62,892,324.01	49,374,936.69
本期基金净值增长率	9.25%	40.26%	40.14%
1.2 期末基金份额净值	2016年末	2015年末	2014年末
期末基金份额净值	2016年末	2015年末	2014年末
期末基金份额净值	2016年末	2015年末	2014年末

注：1.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。股票资产占基金资产比例为20%—80%，现金、债券资产占基金资产比例不超过20%。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%；权证投资占基金资产净值的比例不超过2%。2.本基金的业绩比较基准是：中证红利指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。

3.2.6 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

项目	2016年	2015年	2014年
本期已实现收益	15,462,196.91	69,040,762.63	25,174,790.28
本期公允价值变动损益	11,111,006.74	62,892,324.01	49,374,936.69
本期基金净值增长率	9.25%	40.26%	40.14%
1.2 期末基金份额净值	2016年末	2015年末	2014年末
期末基金份额净值	2016年末	2015年末	2014年末
期末基金份额净值	2016年末	2015年末	2014年末

注：1.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。股票资产占基金资产比例为20%—80%，现金、债券资产占基金资产比例不超过20%。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%；权证投资占基金资产净值的比例不超过2%。2.本基金的业绩比较基准是：中证红利指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。

3.2.7 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

项目	2016年	2015年	2014年
本期已实现收益	15,462,196.91	69,040,762.63	25,174,790.28
本期公允价值变动损益	11,111,006.74	62,892,324.01	49,374,936.69
本期基金净值增长率	9.25%	40.26%	40.14%
1.2 期末基金份额净值	2016年末	2015年末	2014年末
期末基金份额净值	2016年末	2015年末	2014年末
期末基金份额净值	2016年末	2015年末	2014年末

注：1.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。股票资产占基金资产比例为20%—80%，现金、债券资产占基金资产比例不超过20%。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%；权证投资占基金资产净值的比例不超过2%。2.本基金的业绩比较基准是：中证红利指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。

3.2.8 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

项目	2016年	2015年	2014年
本期已实现收益	15,462,196.91	69,040,762.63	25,174,790.28
本期公允价值变动损益	11,111,006.74	62,892,324.01	49,374,936.69
本期基金净值增长率	9.25%	40.26%	40.14%
1.2 期末基金份额净值	2016年末	2015年末	2014年末
期末基金份额净值	2016年末	2015年末	2014年末
期末基金份额净值	2016年末	2015年末	2014年末

注：1.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。股票资产占基金资产比例为20%—80%，现金、债券资产占基金资产比例不超过20%。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%；权证投资占基金资产净值的比例不超过2%。2.本基金的业绩比较基准是：中证红利指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。

3.2.9 过去三年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

项目	2016年	2015年	2014年
本期已实现收益	15,462,196.91	69,040,762.63	25,174,790.28
本期公允价值变动损益	11,111,006.74	62,892,324.01	49,374,936.69
本期基金净值增长率	9.25%	40.26%	40.14%
1.2 期末基金份额净值	2016年末	2015年末	2014年末
期末基金份额净值	2016年末	2015年末	2014年末
期末基金份额净值	2016年末	2015年末	2014年末

注：1.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。股票资产占基金资产比例为20%—80%，现金、债券资产占基金资产比例不超过20%。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%；权证投资占基金资产净值的比例不超过2%。2.本基金的业绩比较基准是：中证红利指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

项目	2016年	2015年	2014年
本期已实现收益	15,462,196.91	69,040,762.63	25,174,790.28
本期公允价值变动损益	11,111,006.74	62,892,324.01	49,374,936.69
本期基金净值增长率	9.25%	40.26%	40.14%
1.2 期末基金份额净值	2016年末	2015年末	2014年末
期末基金份额净值	2016年末	2015年末	2014年末
期末基金份额净值	2016年末	2015年末	2014年末

注：1.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。股票资产占基金资产比例为20%—80%，现金、债券资产占基金资产比例不超过20%。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%；权证投资占基金资产净值的比例不超过2%。2.本基金的业绩比较基准是：中证红利指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。

3.4 管理人报告

4.1 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.2 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.3 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.4 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.5 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.6 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.7 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.8 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.9 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.10 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.11 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.12 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.13 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.14 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.15 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.16 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.17 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.18 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.19 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.20 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.21 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.22 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.23 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.24 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.25 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.26 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.27 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.28 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.29 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.30 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.31 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.32 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.33 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.34 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.35 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.36 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.37 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.38 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.39 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.40 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.41 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.42 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.43 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.44 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.45 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.46 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.47 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.48 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.49 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.50 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.51 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.52 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.53 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.54 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.55 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.56 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.57 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.58 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.59 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.60 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.61 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.62 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.63 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.64 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.65 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.66 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

4.67 基金管理人及其基金经理的简介
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司