金鹰策略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：中信银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年三月二十八日

§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 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	48, 547, 940.34 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较权益的，力争实现基金资产的长期可持续稳健增值。
投资策略	均衡"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的动向、资本市场运行状况、IPO 扮演"与"进取"目标追时、适度地有所侧重，同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	李云亮	李静滨
	联系电话	010- 59944986	4006800000
	电子邮箱	csmal@gefund.com.cn	lixiubin@citicbank.com
客户服务电话		4006135888, 020- 83936180	95558
传真		020- 83282856	010- 85230024

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	2017年	2016年	2015年
本期已实现收益	8, 548, 428.82	- 66, 035, 598.18	58, 494, 944.10
本期利润	8, 981, 780.36	- 72, 931, 975.03	57, 605, 067.39
加权平均基金份额本期利润	0.1199	- 0.3885	0.4538
本期基金份额净值增长率	10.65%	- 21.96%	43.96%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	2016年末	2015年末
期末可供分配基金份额利润	0.1340	0.0332	0.2989
期末基金资产净值	57, 743, 338.91	88, 452, 719.79	333, 422, 350.42
期末基金份额净值	1.1894	1.0749	1.3773

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	- 2.21%	1.05%	3.63%	0.60%	- 5.84%	0.45%
过去六个月	13.98%	1.27%	7.38%	0.52%	6.60%	0.75%
过去一年	10.65%	1.10%	15.93%	0.48%	- 5.28%	0.62%
过去三年	24.32%	2.18%	14.23%	1.26%	10.09%	0.92%
过去五年	92.99%	1.93%	50.75%	1.16%	42.24%	0.77%
自基金合同生效起至今	70.70%	1.77%	40.27%	1.12%	30.43%	0.65%

注：

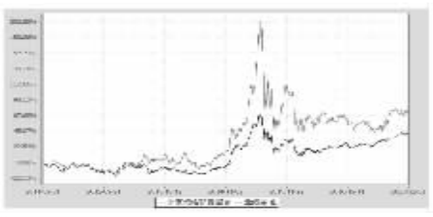
1、本基金的原业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率× 75%＋中信标普国债指数收益率× 25%，2015 年 9 月 28 日变更为：沪深 300 指数收益率× 75%＋中证全债指数收益率× 25%。

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 2017 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 过去五年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

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

注：

1、本基金合同于 2011 年 9 月 1 日正式生效。

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	2017- 10- 23	8	方超先生，中山大学工商管理硕士。曾任职于明讯科技有限公司、北方电讯科技有限公司，2006 年 5 月加入金鹰基金管理有限公司，历任 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、基金经理。
陈颖	基金经理	2017- 09- 19	-	7	陈颖先生，武汉大学学士，中山大学工商管理硕士，曾任职于广东省电信规划设计院、中国惠普有限公司，历任深圳市前信资产管理有限公司研究主管等职，2012 年 9 月加入金鹰基金管理有限公司，先后任研究员、研究小组组长、基金经理助理等。现任金鹰稳健或长混分类证券投资基金、金鹰策略配置混合型证券投资基金基金经理。

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。

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（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 管理人对报告期内投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内本基金投资策略和运作分析

2017 年 A 股市场呈现剧烈分化的结构性行情。以上证 50 为代表的传统产业，在供给侧改革和经济复苏的背景下，盈利能力得以恢复，同时行业集中度比现明显提升，受到市场认可，迎来一轮系统性估值修复。而以新兴产业为主的中小创，受到高估值以及严厉的监管政策压制，出现较大幅度的下跌。

2017 年上半年强力的供给侧改革执行力度，使得石化、钢铁、煤炭、建材、造纸等行业均出现产业价格大幅上涨的现象，叠加中下游补库存周期，宏观经济呈现明显的复苏迹象。同时销售渠道下沉以及居民收入增长带来的消费升级，使得下游家电和白酒等传统消费类行业出现明显的投资机会，而伴随着传统消费类行业品牌意识崛起和行业竞争格局的变化，企业利润也呈现较大幅度的增长。在业绩增长和估值提升的双重刺激下，消费行业的公司股价出现较大幅度的上涨。周期行业的盈利翻转和消费行业的盈利估值双提升，成为贯穿 2017 年的上涨主线。成长股方面，受到国家扶持的半导体产业以及新能源汽车上游原材料行业，也出现一定的阶段性机会。

2017 年也是金融监管政策日渐严厉的一年，并带来的市场风格的巨大变化。随着监管政策频出，创指金融业监管窒息，自 2012 年以来，以金融创新、影子银行、资管理财为代表的金融体系资产负债表扩张迎来沉重打击。以中小创为主的个股在利率上升以及流动性紧缩的压力下出现了较大幅度的调整。

2017 年全球经济近乎同步复苏，欧美经济体经济数据表现较好，美联储实施了加息措施，年底美国在减税政策上取得重大进展。大宗商品表现方面，铜、锌等金属、油价相比去年均有不同程度的上涨。

2017 年 IPO 的快速发行逐步进入常态化，同时并购重组、再融资等行为受到较为严厉的监管，市场呈现一级市场和二级市场冰火两重天的现象。

2017 年全年的市场表现看，上证综指上涨 6.6%，深成指上涨 8.5%，中小板指数上涨 16.7%，创业板指数则下跌 10.7%。行业表现上，食品饮料上涨 54.6%，家电上涨 44.9%，板块涨幅居前，且贯穿全年。其它涨幅居前板块分别是煤炭、非银金融、电子，纺织服装、传媒、计算机、军工、农业板块全年跌幅居前。

本基金在 2017 年维持了高仓位运作，重点配置以商贸零售、TMT、化工医药为主的行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值为 1.1894 元，本报告期份额净值增长率为 10.65%，同期业绩比较基准增长率为 15.93%。

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：整体判断指数呈现震荡格局；传统监筹高位盘整，以业绩增长消化估值；个股以筑底为主，优质的成长股将走出趋势性行情。

中国经济预计在 2018 年维持合理的增长区间，经济增长的质量得以提升，新旧经济动能转化将初露端倪。金融去杠杆、供给侧改革、脱虚向实等政策的实施在带来虚拟经济流动性的紧缩的同时，也就更多的流动性赋予实体经济。在美国多次加息的预期下，预计国内存贷利率保持相对稳定，但金融市场利率出现一定上行压力。同时预计 2018 年服务和基数效应将推动 CPI 小幅上升，而供给侧改革和限产对工业品价格的支撑环比将趋弱，叠加基数效应，预计 PPI 同比增速放缓，阶段性出现同比下降。为了有效控制宏观杠杆率，预计货币政策短期仍保持"稳健中性"的偏紧状态。

海外经济方面，美国经济数据持续靓丽，预计在减税措施的支持下仍将维持较高增速，同时引发市场对美联储年内多次加息的担忧，给处于高位的美股带来较大的调整压力。如果美联储加息速度和幅度高于市场预期，将可能导致全球央行被动加息，收紧流动性，从而给全球风险资产配置带来较大压力。

对于股票市场而言，传统的周期和消费行业在 2017 年估值大幅提高，叠加 2018 年的国内外流动性压力，使得这类公司投资吸引力下降。而以中小创为主的成长股在历经两年多的下跌后，估值逐步趋于合理，这类公司的投资吸引力正逐步上升。本基金仍将延续前期的操作思路和风格，在 2018 年以挖掘成长股的潜在投资机会为主。

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

本基金本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

在本报告期内，本基金未出现持有人数或资产净值达到或低于预警线的情形。

§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，基金托管人在金鹰策略配置混合型证券投资基金的托管过程中，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金鹰策略配置混合型证券投资基金投资运作、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金鹰策略配置混合型证券投资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，注册会计师 王兵 赵会娜签字出具了众环审字（2018）050148 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：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	6, 379, 667.60	37, 234, 886.15
结算备付金	119, 801.00	945, 541.93
存出保证金	147, 547.91	362, 384.10
交易性金融资产	54, 140, 071.20	69, 422, 650.63
其中：股票投资	54, 140, 071.20	69, 422, 650.63
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	-	9, 379, 908.25
应收利息	2, 729.08	13, 645.73
应收股利	-	-
应收申购款	23, 065.73	4, 011.71
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	60, 812, 882.52	117, 363, 028.50
负债和所有者权益	本期末 2017年 12 月 31 日	上年度末 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	1, 026, 816.84	-
应付赎回款	1, 095, 892.32	27, 093, 042.93
应付管理人报酬	73, 084.74	160, 544.54
应付托管费	12, 180.79	26, 757.43
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	142, 688.48	531, 782.00
应交税费	-	75, 000.00
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	718, 880.44	1, 023, 181.81
负债合计	3, 069, 543.61	28, 910, 308.71
所有者权益：	-	-
实收基金	48, 547, 940.34	82, 289, 218.59
未分配利润	9, 195, 398.57	6, 163, 501.20
所有者权益合计	57, 743, 338.91	88, 452, 719.79
负债和所有者权益总计	60, 812, 882.52	117, 363, 028.50

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，本基金份额净值 1.1894 元，份额 48, 547, 940.34 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：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	上年度可比期间 2016年 1 月 1 日至 2016年 12 月 31 日
一、收入	12, 738, 862.82	- 63, 123, 122.21
1.利息收入	345, 063.04	777, 077.34
其中：存款利息收入	259, 542.48	770, 175.92
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	85, 520.56	6, 901.42
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以"-"填列）	11, 906, 090.14	- 57, 298, 691.54
其中：股票投资收益	11, 210, 110.10	- 58, 350, 027.40
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	695, 980.04	1, 051, 335.86
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	433, 351.54	- 6, 896, 376.85
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）	-	-
5.其他收入（损失以"-"号填列）	54, 358.10	294, 868.84
减：二、费用	3, 757, 082.46	9, 808, 852.82
1、管理人报酬	1, 246, 498.73	3, 160, 354.20
2、托管费	207, 749.73	526, 725.69
3、销售服务费	-	-
4、交易费用	1, 983, 971.93	5, 804, 671.17
5、利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6、其他费用	318, 862.07	317, 101.76
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	8, 981, 780.36	- 72, 931, 975.03
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	8, 981, 780.36	- 72, 931, 975.03

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：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）	82, 289, 218.59	6, 163, 501.20	88, 452, 719.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8, 981, 780.36	8, 981, 780.36
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）	- 33, 741, 278.25	- 5, 949, 882.99	- 39, 691, 161.24
其中：1.基金申购款	22, 961, 965.89	3, 524, 874.24	26, 486, 840.13
2.基金赎回款	- 56, 703, 244.14	- 9, 474, 757.23	- 66, 178, 001.37
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）	48, 547, 940.34	9, 195, 398.57	57, 743, 338.91
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）	242, 091, 066.90	91, 331, 283.52	333, 422, 350.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	- 72, 931, 975.03	- 72, 931, 975.03
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）	- 159, 801, 848.31	- 12, 235, 807.29	- 172, 037, 655.60
其中：1.基金申购款	65, 001, 813.28	12, 942, 442.87	77, 944, 256.15
2.基金赎回款	- 224, 803, 661.59	- 25, 178, 250.16	- 249, 981, 911.75
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）	82, 289, 218.59	6, 163, 501.20	88, 452, 719.79

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

金鹰策略配置股票型证券投资基金（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 年度的经营成果和基金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 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

本基金报告期内无需说明的重要会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

为确保证券投资基金估值的合理性和公允性，根据中国证监会《证监会公告[2017]13 号》（中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国证券投资基金业协会中基协发[2017]6 号《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》的相关规定，本基金自 2017 年 12 月 20 日起，对所持有的流通受限股票的估值技术进行变更。新的估值技术为市价折扣法，考虑了估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值以及该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣的影响，其中剩余限售期对应的流动性折扣为关键输入值，流动性折扣越高，对应流通受限股票的公允价值越低。上述流通受限股票是指在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东开发售份、通过大宗交易取得的带限售期股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票。

7.4.5.3 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、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
东证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 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	
	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	-	-	394, 189, 531.54	10.36%

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 2017年 1 月 1 日至 2017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
-	-	-	-	-
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	359, 225.14	10.28%	97, 757.72	18.40%

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（含佣券交易）。

2、本基金与关联方交易为按照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 2017年 1