
金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）
（金鹰中证 500 指数分级证券投资基金）

2016 年 9 月 30 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
报告送出日期：二〇一六年十月二十五日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 2016 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）

基金简称	金鹰量化精选股票（LOF）
场内简称	金鹰量化
基金主代码	162107
交易代码	162107
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年8月25日
报告期末基金份额总额	18,724,159.01份
投资目标	本基金运用多种量化模型方法，精选股票进行投资，力争有效控制风险的基础上，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金主要采用多种量化模型进行股票的选择。基于模型结果，基金管理人结合市场环境和股票特性，精选个股构建投资组合，以追求超越业绩比较基准表现的业绩水平。本基金采用的量化投资策略主要有：（1）多因子选股模型（2）事件驱动模型（3）行业轮动模型（4）评级反转策略 本基金投资于股票的资产占基金资产净值的比例为 80%-95%，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%~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指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于证券投资基金中较高预期收益、较高预期风险的品种，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。
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

注：根据《关于准予金鹰中证500指数分级证券投资基金变更注册的批复》[证监许可(2016)984号]，本基金以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会。根据持有人大会决议公告，自金鹰中证500指数分级证券投资基金基金份额转换基准日的次日起，即2016年8月25日，《金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）基金合同》生效，《金鹰中证500指数分级证券投资基金基金合同》同时失效。

本基金转型后报告期末指 2016年9月30日，本期期间指2016年8月25日至2016年9月30日。（下同）

2.2 金鹰中证 500 指数分级证券投资基金

基金简称	金鹰中证500指数分级
基金主代码	162107
交易代码	162107
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月5日
报告期末基金份额总额	19,288,947.39份
投资目标	本基金为股票型指数基金，以跟踪指数为目标，力求将基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在0.35%以下、年跟踪误差控制在4%以下。
投资策略	本基金以中证500指数成分股在其指数中的基准权重为基础，在综合考察指数成分股的行业构成与市值占比、各行业成分股权重的构成与分散程度、成分股流动性与贝塔值等因素的基础上，采用重点抽样与分层抽样相结合的策略以构建指数化投资组合；若抽样组合内的股票停牌或出现流动性不足等情形时，本基金将根据变化了的新情况，对于抽样组合进行再调整。

	<p>本基金投资于股票的资产占基金资产净值的比例为90%~95%，其中，中证500指数成分股和备选成分股占基金资产净值的比例不低于90%；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%~10%，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%。</p>		
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%		
风险收益特征	<p>本基金为被动跟踪指数的指数型证券投资基金，属于证券投资基金当中收益、风险较高的品种。一般情形下，其风险和预期收益高于混合型、债券型、货币市场基金。从本基金拆分的两级基金来看，金鹰500A具有低风险、预期收益相对稳定的特征，金鹰500B具有高风险、高预期收益的特征。</p>		
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		
下属分级基金的基金简称	金鹰 500A	金鹰 500B	金鹰 500
下属分级基金的场内简称	金鹰 500A	金鹰 500B	-
下属分级基金的交易代码	150088	150089	162107
报告期末下属分级基金的份额总额	2,962,615.00 份	3,425,161.00 份	12,901,171.39 份
风险收益特征	<p>本级基金具有低风险、预期收益相对稳定的特征。</p>	<p>本级基金具有高风险、高预期收益的特征</p>	<p>本级基金为被动跟踪指数的指数型证券投资基金，属于证券投资基金当中收益、风险较高的品种。一般情形下，其风险和预期收益高于混合型、债券型、货币市场基金。</p>

注：根据《关于准予金鹰中证500指数分级证券投资基金变更注册的批复》[证监许可(2016)984号]，本基金以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会。根据持有人大会决议公告，自金鹰中证500指数分级证券投资基金基金份额转换基准日的次日起，即2016年8月25日，《金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）基金合同》生效，《金鹰中证500指数分级证券投资基金基金合同》同时失效。

本基金转型前报告期末指 2016年8月24日，本期期间指2016年7月1日至2016年8月24日。（下同）

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2016年8月25日-2016年9月30日)	报告期 (2016年7月1日-2016年8月24日)
1.本期已实现收益	-259,097.89	-111,202.39
2.本期利润	-101,527.46	979,244.50
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0053	0.0540
4.期末基金资产净值	18,607,892.11	19,288,949.39
5.期末基金份额净值	0.9938	1.0000

3.2 基金净值表现

3.2.1 金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）

（报告期：2016年8月25日-2016年9月30日）

3.2.1.1 本报告期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	净值增长率①	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	-0.62%	0.92%	-1.73%	0.53%	1.11%	0.39%

3.2.1.2 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

金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）

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

(2016年8月25日-2016年9月30日)



3.2.2 金鹰中证 500 指数分级证券投资基金

(报告期: 2016年7月1日-2016年8月24日)

3.2.2.2 本报告期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	净值增长率①	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	4.54%	1.00%	4.84%	1.02%	-0.30%	-0.02%

3.2.2.2 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

金鹰中证 500 指数分级证券投资基金
 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
 (2016年7月1日-2016年8月24日)



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黄艳芳	基金经理	2016-08-25	-	9	黄艳芳女士，清华大学硕士研究生，证券从业经历9年。历任天相投资顾问有限公司分析师，中航证券资产管理分公司投资主办，量化投资负责人，广州证券股份有限公司资产管理部投资主办。2015年5月加入金鹰基金管理有限公司，任指数及量化投资部数量策略研究员，现任金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）及金鹰持久增利债券型证券投资基金（LOF）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，严格遵守本基金基金合同等法律文件的规定，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 公平交易专项说明

4.3.1 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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期，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。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，本基金由指数型基金转型为主动量化型 LOF 基金，转型前跟踪中证 500 指数，转型后采用多因子选股模型以及事件驱动选股模型等量化策略精选股票进行投资。本基金转型时平稳过渡，投资组合较转型前相对集中，但仍然以一篮子的组合分散风险，获取超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016 年，7 月 1 日至 8 月 24 日，本基金转型前，份额净值增长率为 4.54%，同期业绩比较基准净值增长率为 4.84%，落后基准的收益率为 0.3%。

8 月 25 日至 9 月 30 日，转型后截至报告期末的基金份额净值为 0.9938 元，份额净值增长率-0.62%，同期业绩比较基准增长率为-1.73%，超越基准的收益率为 1.11%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

三季度市场窄幅震荡，上证指数整体上涨 2.56%，创业板指数下跌 3.5%，市场分化较为显著。宏观经济方面，稳增长压力依然较大，人民币汇率大幅贬值，进口数据却仍不及预期，这些都构成市场潜在的下行风险。未来，PPP 项目的对冲能否有效平滑房地产调控带来的冲

击，需要经历一定的时间检验。从市场角度看，目前市场处于系统性风险与结构性机会并存阶段，国企改革、债转股等政策对市场热点的提高有一定的作用，但整体性的机会仍来源于经济结构转型中行业基本面的改善，这也需要观察和等待。

本基金四季度将充分利用量化模型的客观性，参与市场的结构性机会，在适当承担风险的前提下，获取超越市场的收益。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金 2016 年 8 月 25 日由金鹰中证 500 指数分级证券投资基金转型而来，期末资产净值为 1861 万元，自转型后基金合同生效日起已连续 25 个交易日低于 5000 万元。

§5 投资组合报告

5.1 金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）

（报告期：2016年8月25日-2016年9月30日）

5.1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	16,828,063.07	88.64
	其中：股票	16,828,063.07	88.64
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	2,004,631.27	10.56
7	其他各项资产	151,562.72	0.80
8	合计	18,984,257.06	100.00

注：其他资产包括：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。

5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.1.2.1 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	817,487.00	4.39
B	采矿业	692,273.21	3.72
C	制造业	8,749,328.18	47.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	409,641.00	2.20
E	建筑业	1,547,443.06	8.32
F	批发和零售业	425,263.58	2.29
G	交通运输、仓储和邮政业	247,665.00	1.33
H	住宿和餐饮业	285,088.00	1.53
I	信息传输、软件和信息技术服务业	594,480.00	3.19
J	金融业	293,047.00	1.57
K	房地产业	459,052.90	2.47
L	租赁和商务服务业	266,700.00	1.43
M	科学研究和技术服务业	528,904.00	2.84
N	水利、环境和公共设施管理业	317,026.00	1.70
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	128,400.00	0.69
R	文化、体育和娱乐业	1,066,132.14	5.73
S	综合	132.00	0.00
	合计	16,828,063.07	90.44

5.1.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期内未通过沪港通投资股票。

5.1.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300119	瑞普生物	15,600	309,660.00	1.66
2	600051	宁波联合	25,700	282,186.00	1.52
3	000673	当代东方	21,500	281,650.00	1.51
4	002582	好想你	7,000	272,440.00	1.46
5	600706	曲江文旅	14,300	271,414.00	1.46
6	000681	视觉中国	11,300	269,957.00	1.45
7	002677	浙江美大	23,000	268,640.00	1.44
8	600562	国睿科技	7,800	268,164.00	1.44

9	600629	华建集团	13,400	266,928.00	1.43
10	300071	华谊嘉信	25,400	266,700.00	1.43

5.1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期内未投资债券。

5.1.5 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债券投资明细

本基金本报告期内未投资债券。

5.1.6 报告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

本基金本报告期内未投资资产支持证券。

5.1.7 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

5.1.8 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权证投资明细

本基金本报告期内未投资权证。

5.1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.1.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.1.10.1 本期国债期货投资政策

无

5.1.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.1.10.3 本期国债期货投资评价

无

5.1.11 投资组合报告附注

5.1.11.1 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。

5.1.11.2报告期内基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.1.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	42,587.74
2	应收证券清算款	96,446.96
3	应收股利	-
4	应收利息	2,999.18
5	应收申购款	4,063.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	5,464.90
8	其他	-
9	合计	151,562.72

5.1.11.4报告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处于转股期的可转换债券。

5.1.11.5报告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中不存在流通受限情况。

5.1.11.6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。

5.2 金鹰中证 500 指数分级证券投资基金

(报告期：2016年7月1日-2016年8月24日)

5.2.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	18,291,137.53	93.04
	其中：股票	18,291,137.53	93.04
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	1,249,786.65	6.36
7	其他各项资产	117,689.51	0.60
8	合计	19,658,613.69	100.00

注：其他资产包括：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。

5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.1 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	358,053.78	1.86
B	采矿业	795,380.85	4.12
C	制造业	10,911,271.98	56.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	561,162.83	2.91
E	建筑业	673,108.96	3.49
F	批发和零售业	1,046,964.70	5.43
G	交通运输、仓储和邮政业	525,321.20	2.72
H	住宿和餐饮业	14,228.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,178,686.97	6.11
J	金融业	107,326.88	0.56
K	房地产业	1,236,887.38	6.41
L	租赁和商务服务业	205,387.83	1.06
M	科学研究和技术服务业	79,616.32	0.41
N	水利、环境和公共设施管理业	81,655.70	0.42
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	56,236.00	0.29
R	文化、体育和娱乐业	283,362.86	1.47
S	综合	176,485.29	0.91
	合计	18,291,137.53	94.83

5.1.2.2 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

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	358,053.78	1.86
B	采矿业	780,380.85	4.05
C	制造业	10,690,072.86	55.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	561,162.83	2.91
E	建筑业	673,108.96	3.49
F	批发和零售业	1,033,626.54	5.36
G	交通运输、仓储和邮政业	518,793.20	2.69
H	住宿和餐饮业	14,228.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,138,024.67	5.90
J	金融业	107,326.88	0.56
K	房地产业	1,236,887.38	6.41
L	租赁和商务服务业	205,387.83	1.06
M	科学研究和技术服务业	79,616.32	0.41
N	水利、环境和公共设施管理业	81,655.70	0.42
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	56,236.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	283,362.86	1.47
S	综合	176,485.29	0.91
	合计	17,994,409.95	93.29

5.2.2.3 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

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	15,000.00	0.08
C	制造业	221,199.12	1.15
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	13,338.16	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	6,528.00	0.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	40,662.30	0.21
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	-	-
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	296,727.58	1.54

注：积极投资股票是因中证500指数成份股调整及股票停牌，未及时卖出而被动持有的股票。

5.2.2.4 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期内未通过沪港通投资股票。

5.2.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

5.2.3.1 期末指数投资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	002190	成飞集成	4,500	173,385.00	0.90
2	002466	天齐锂业	2,960	116,357.60	0.60
3	600584	长电科技	6,376	111,452.48	0.58
4	300072	三聚环保	2,777	108,025.30	0.56
5	600967	北方创业	9,000	105,480.00	0.55
6	600614	鼎立股份	12,552	102,173.28	0.53
7	002405	四维图新	3,989	94,858.42	0.49
8	002310	东方园林	6,650	89,509.00	0.46
9	002663	普邦园林	11,830	87,068.80	0.45
10	600219	南山铝业	10,300	84,563.00	0.44

5.2.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	000511	烯碳新材	22,436.00	200,129.12	1.04
2	600654	中安消	2,010.00	40,662.30	0.21
3	000959	首钢股份	4,300.00	21,070.00	0.11
4	000693	华泽钴镍	1,200.00	15,000.00	0.08
5	600704	物产中大	1,318.00	13,338.16	0.07

注：积极投资股票是因中证500指数成份股调整及股票停牌，未及时卖出而被动持有的股票。

5.2.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期内未投资债券。

5.2.5 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债券投资明细

本基金本报告期内未投资债券。

5.2.6 报告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

本基金本报告期内未投资资产支持证券。

5.2.7 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

5.2.8 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权证投资明 细

本基金本报告期内未投资权证。

5.2.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.2.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.2.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.2.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.2.10.1 本期国债期货投资政策

无

5.2.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.2.10.3 本期国债期货投资评价

无

5.2.11 投资组合报告附注

5.2.11.1 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。

5.2.11.2 报告期内基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.2.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	44,685.23
2	应收证券清算款	32,697.20
3	应收股利	-
4	应收利息	7,140.72

5	应收申购款	25,503.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	7,663.07
8	其他	-
9	合计	117,689.51

5.2.11.4 报告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处于转股期的可转换债券。

5.2.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600614	鼎立股份	102,173.28	0.53	重大事项
2	002663	普邦园林	87,068.80	0.45	重大事项

5.2.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

6.1 金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）

单位：份

本报告期初基金份额总额	19,288,947.39
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,211,137.31
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,775,925.69
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	18,724,159.01

6.2 金鹰中证 500 指数分级证券投资基金

单位：份

项目	金鹰500A	金鹰500B	金鹰500
----	--------	--------	-------

本报告期期初基金份额总额	4,279,005.00	4,279,005.00	12,210,482.05
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-	1,363,596.24
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-	4,801,004.23
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-1,316,390.00	-853,844.00	4,128,097.33
本报告期期末基金份额总额	2,962,615.00	3,425,161.00	12,901,171.39

注：1、本基金本报告期内因份额拆分合并业务：金鹰500A和金鹰500B分别减少份额1,409,302.00份，金鹰500增加份额2,818,604.00份。

2、根据《关于准予金鹰中证500指数分级证券投资基金变更注册的批复》[证监许可(2016)984号]，本基金以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会。根据持有人大会决议公告，定于2016年8月24日为本基金份额转换基准日，金鹰500A增加份额92,912.00份，金鹰500B增加份额555,458.00份,金鹰500增加份额1,309,493.33份

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

7.2.1 金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）

无

7.2.2 金鹰中证500指数分级证券投资基金

无

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准金鹰量化精选股票型证券投资基金发行及募集的文件。
- 2、《金鹰量化精选股票型证券投资基金基金合同》。
- 3、《金鹰量化精选股票型证券投资基金托管协议》。
- 4、金鹰基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程。。
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照。
- 6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、季度报告、半年度报告、更新的招募说明书及其他临时公告。

9.2 存放地点

广东省广州市天河区珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅或按工本费购买复印件，也可登录本基金管理人网站查阅，本基金管理人网址：<http://www.gefund.com.cn>。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人客户服务中心，客户服务中心电话：4006-135-888 或 020-83936180。

金鹰基金管理有限公司
二〇一六年十月二十五日