

**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 年年度报告摘要**

**2016 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：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 重要提示及目录

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。

本报告期自 2016 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（转型前）

基金名称	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		
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	19,288,947.39 份		
基金合同存续期	不定期		
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

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 1 月 1 日至 2016 年 8 月 24 日。

（下同）

## 2.2 基金基本情况（转型后）

基金名称	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

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	16,890,846.57 份
基金合同存续期	不定期
下属分级基金的基金简称	金鹰量化精选股票（LOF）
下属分级基金的场内简称	金鹰量化
下属分级基金的交易代码	162107
报告期末下属分级基金的份额总额	16,890,846.57 份

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 12 月 31 日，本期期间指 2016 年 8 月 25 日至 2016 年 12 月 31 日。（下同）

### 2.3 基金产品说明（转型前）

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	<p>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> <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	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。		
下属分级基金的风险收益特征	本级基金具有低风险、预期收益相对稳定的特征。	本级基金具有高风险、高预期收益的特征	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。

## 2.4 基金产品说明（转型后）

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	<p>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</p> <p>本基金投资组合中股票资产占基金资产的 80%-95%；权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；股指期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。</p> <p>当法律法规的相关规定变更时，基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。</p>
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。
下属分级基金的风险	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

收益特征	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。
------	-------------------------------------

## 2.5 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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	苏文锋	陆志俊
	联系电话	020-83282627	95559
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		4006135888,020-83936180	95559
传真		020-83282856	021-62701216
注册地址		广东省珠海市吉大九洲大道东 段商业银行大厦7楼	上海市浦东新区银城中路188号
办公地址		广州市天河区珠江东路28号越 秀金融大厦30层	上海市浦东新区银城中路188号
邮政编码		510623	200120
法定代表人		凌富华	牛锡明

## 2.6 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.gefund.com.cn">http://www.gefund.com.cn</a>
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

#### 3.1.1 金鹰中证500指数分级证券投资基金

金额单位：人民币元

3.1.1.1 期间数	2016年1月1日-2016年8	2015年末	2014年末
-------------	------------------	--------	--------

据和指标	月 24 日		
	金鹰中证 500 指数分级	金鹰中证 500 指数分级	金鹰中证 500 指数分级
本期已实现收益	-8,870,327.04	-6,097,328.71	4,131,281.25
本期利润	-6,114,577.73	-11,558,357.94	4,399,481.50
加权平均基金份额本期利润	-0.2617	-0.2592	0.2794
本期基金份额净值增长率	-13.61%	-2.21%	30.44%
<b>3.1.1.2 期末数</b>	<b>2016 年 8 月 24 日</b>	<b>2015 年末</b>	<b>2014 年末</b>
<b>据和指标</b>	金鹰中证 500 指数分级	金鹰中证 500 指数分级	金鹰中证 500 指数分级
期末可供分配基金份额利润	-0.5550	0.0884	0.3786
期末基金资产净值	19,288,949.39	21,880,134.99	17,675,175.91
期末基金份额净值	1.0000	1.2982	1.3275

注：1、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。

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）。

## 3.1.2 金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）

金额单位：人民币元

3.1.2.1 期间数据和指标	报告期 2016 年 8 月 25 日至 2016 年 12 月 31 日
本期已实现收益	833,296.63
本期利润	467,433.98
加权平均基金份额本期利润	0.0263
本期基金份额净值增长率	2.05%
3.1.2.2 期末数据和指标	2016 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.5059
期末基金资产净值	17,237,386.11
期末基金份额净值	1.0205

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）。

4、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。无上年度及上上年度可比期间数据（下同）。

### 3.2 基金净值表现（转型前）

#### 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	11.74%	1.05%	11.45%	1.23%	0.29%	-0.18%
过去六个月	7.17%	1.65%	5.15%	1.74%	2.02%	-0.09%
过去一年	-4.01%	2.35%	-7.42%	2.31%	3.41%	0.04%
过去三年	55.76%	2.04%	73.84%	2.01%	-18.08%	0.03%
自基金合同生效起至今	61.33%	1.83%	74.43%	1.85%	-13.10%	-0.02%

注：1、金鹰中证 500 指数型证券投资基金于 2012 年 6 月 5 日成立,存续期截止日为 2016 年 8 月 24 日，2016 年 8 月 25 日起转型为新基金。

2、过去三个月为存续期截止日 2016 年 8 月 24 日前推 3 个月，即 2016 年 5 月 25 日至 2016 年 8 月 24 日期间，其余以此类推。

#### 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的历史走势对比图

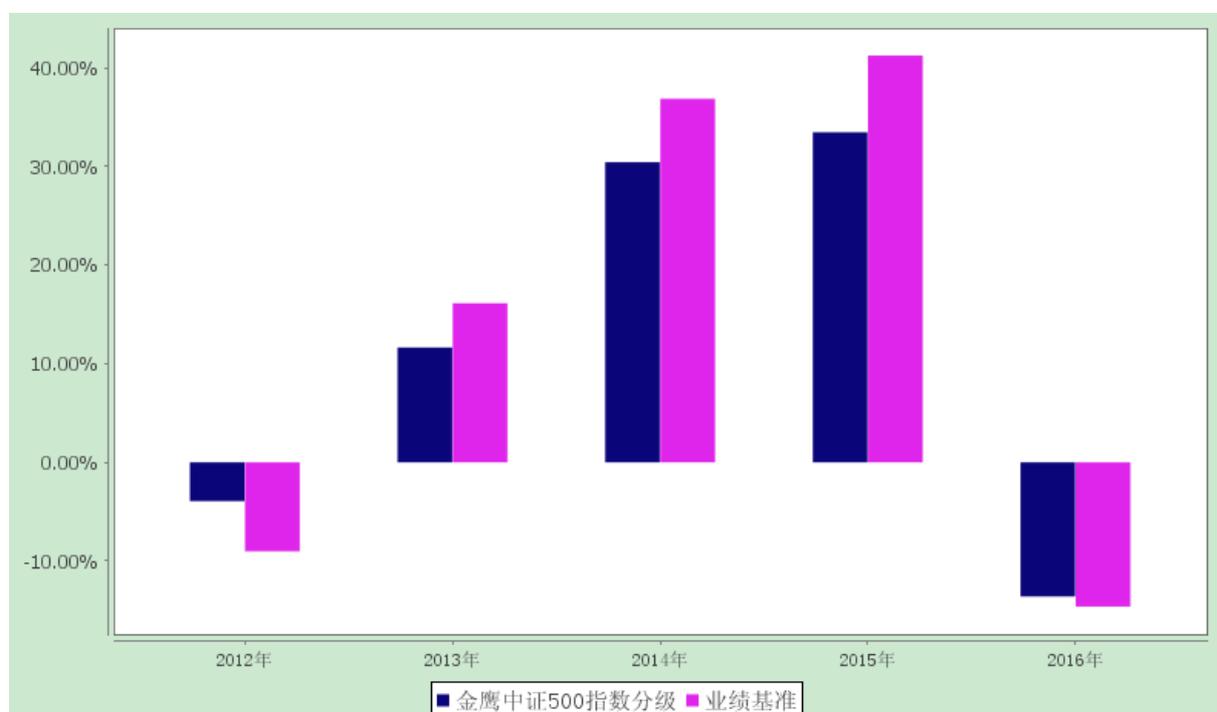
(2012 年 6 月 5 日至 2016 年 8 月 24 日)



### 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

金鹰中证 500 指数分级证券投资基金

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



注：1、本基金于 2012 年 6 月 5 日成立,2016 年 8 月 25 日转型。

2、本基金转型前业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%。

### 3.3 基金净值表现（转型后）

#### 3.3.1 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	2.69%	1.01%	1.05%	0.58%	1.64%	0.43%
自基金合同生效起至今	2.05%	0.98%	-0.70%	0.56%	2.75%	0.42%

注：金鹰中证 500 指数增强型证券投资基金自 2016 年 8 月 25 日起转型为金鹰量化精选股票型证券投资基金，转型后基金合同生效未满一年。

#### 3.3.2 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）

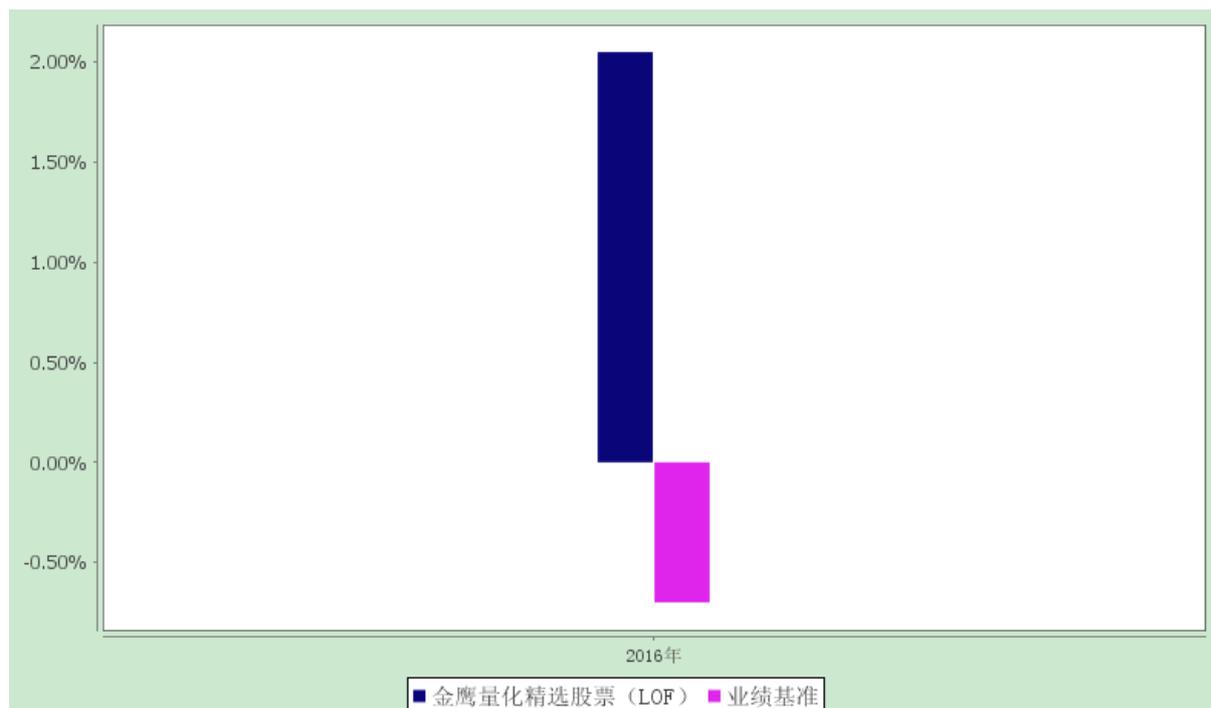
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2016 年 8 月 25 日至 2016 年 12 月 31 日)



#### 3.3.3 自基金转型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

金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）

自基金转型以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：1、本基金于 2016 年 8 月 25 日转型为新基金。

2、转型后业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率  $\times$ 80% + 中证全债指数收益率  $\times$ 20%。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况（转型前）

本基金本报告期内未实施利润分配。

### 3.5 过去三年基金的利润分配情况（转型后）

本基金本报告期内未实施利润分配。

## §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，总部设在广州，目前注册资本 2.5 亿元人民币。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。

“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，通过全体员工的奋发努力，公司近两年各方面都发生了积极的蜕变，追求以更高的标准为投资者提供贴心专业的财富管理服务，赢得市场认可。

截至 2016 年 12 月末，公司下设权益投资部等 17 个一级职能部门、北京、广州、上海、深圳、

成都分公司以及一个子公司—深圳前海金鹰资产管理有限公司。截至 2016 年 12 月末，公司旗下管理公募基金 30 只以及特定客户资产管理计划 101 个、子公司专项资产管理计划 195 个，资产管理总规模约 1800 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		
黄艳芳	基金经理	2015-07-22	-	10	黄艳芳女士，清华大学硕士研究生。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）、金鹰持久增利债券型证券投资基金（LOF）、金鹰多元策略灵活配置混合型证券投资基金、金鹰添富纯债债券型证券投资基金、金鹰鑫益灵活配置混合型证券投资基金、金鹰鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金、金鹰添裕纯债债券型证券投资基金、金鹰添盈纯债债券型证券投资基金、金鹰添润纯债债券型证券投资基金基金经理。
何晓春	-	2015-03-06	2016-06-25	17	何晓春先生，产业经济学博士，17 年金融行业从业经验，曾任世纪证券有限责任公司江西分公司筹办组负责人等职，2011 年 4 月加入金鹰基金管理有限公司，曾任公司权益投资部总监、金鹰中证 500 指数分级证券投资基金、金鹰稳健成长混合型证券投资基金、金鹰行业优势混合型证券投资基金、金鹰民族新兴灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注：1、本基金 2016 年 8 月 25 日成立（由金鹰中证 500 指数分级证券投资基金转型而来）。

2、任职日期和离任日期指公司公告聘任或解聘日期；

3、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、本基金转型前，从 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 25 日，由何晓春先生、黄艳芳女士共同担任金鹰中证 500 指数分级证券投资基金基金经理，在何晓春先生离任后由黄艳芳女士单独管理该基金至转型前。转型后由黄艳芳女士单独管理金鹰量化股票型证券投资基金。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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内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。

## 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

本基金原来为中证 500 指数分级基金，2016 年 8 月 25 日转型为主动量化基金。

在报告期内，转型前，本基金采取全复制成分股的方法跟踪中证 500 指数。转型后，本基金运用量化策略进行投资，追求组合的弹性，主要选择相对低估并且偏成长个股，投资组合较为分散。基金在转型后基本保持了 90% 以上仓位运作，主要通过换股来获取超额收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，基金单位份额净值为 1.0205 元，2016 年转型前基金净值增长-13.61%，业绩比较基准增长为-14.63%，转型后新基金净值增长率 2.05%，业绩比较基准增长-0.70%，转型前后表现均好于业绩比较基准。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年，全球政治形势较为复杂，经济面临较高的不确定性；国内深化改革的政策驱动下，将给经济带来一定的驱动力；稳经济和防风险双重目标下流动性预计较为中性；市场经过一年半的调整，已经重新回到了风险收益比相对可接受区间。我们认为 2017 年市场整体表现为震荡市，部分个股或进入价值投资区域，局部性机会仍然存在。因此，未来一年我们将采取相对主动的策略，仍然保持较高的仓位，在市场震荡过程中精选个股，并逢低提高投资组合的弹性，以期在市场反弹过程中获取较好的收益。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，监察稽核工作根据独立、客观、公正的原则，按照规定的权限和程序独立开展本基金运作的合规性监察，认真履行职责，通过材料审阅、监督监控、覆盖检查、重点抽查等多种方法开展工作，督促各项业务的合规运作，发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告，定期向公司董事会和监管部门出具监察稽核报告。

本报告期有关本基金的监察稽核内容包括投资、交易、研究、市场营销、信息披露等各项业务的每个环节以及信息技术、运营保障、行政管理等后台支持工作。监察结果显示，本报告期内公司

对本基金的管理始终都能按照法律法规、基金合同、基金招募说明书的要求和公司制度的规定进行。本基金的投资决策、投资交易程序、投资权限等各方面均符合规定的要求；交易行为合法合规，未出现异常交易、操纵市场的现象；未发现内幕交易的情况；基金持有的证券符合规定的比例要求；基金专用交易席位年度交易量比例符合证监会的有关规定；相关的信息披露真实、完整、准确、及时；销售工作合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

#### 4.9 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。

#### 4.10 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

报告期内，本基金资产净值发生过已连续超过 60 个工作日低于 5000 万元的情形，本基金管理人已按法规要求向证监会报送解决方案。

### §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

2016 年度，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

2016 年度，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

2016 年度，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

#### 6.1 金鹰中证 500 指数分级证券投资基金

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（2017）050086 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。

#### 6.2 金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）

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（2017）050053 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 金鹰中证 500 指数分级证券投资基金

## 7.1.1 资产负债表（转型前）

会计主体：金鹰中证 500 指数分级证券投资基金

报告截止日：2016 年 8 月 24 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 8 月 24 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.1.4.7.1	53,536.24	183,742.34
结算备付金		1,196,250.41	1,415,217.54
存出保证金		44,685.23	86,205.86
交易性金融资产	7.1.4.7.2	18,291,137.53	20,693,713.14
其中：股票投资		18,291,137.53	20,693,713.14
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	7.1.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.1.4.7.4	-	-
应收证券清算款		32,697.20	198,990.28
应收利息	7.1.4.7.5	7,140.72	3,031.54
应收股利		-	-
应收申购款		25,503.29	1,543.27
递延所得税资产		-	-
其他资产		7,663.07	-
<b>资产总计</b>		<b>19,658,613.69</b>	<b>22,582,443.97</b>
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 8 月 24 日	上年度末 2015 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		-	67,185.14
应付赎回款		97,409.82	237,683.24
应付管理人报酬		12,771.38	19,724.95
应付托管费		2,809.71	4,339.50
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.1.4.7.6	3,809.97	17,480.39
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.1.4.7.7	252,863.42	355,895.76
<b>负债合计</b>		<b>369,664.30</b>	<b>702,308.98</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	7.1.4.7.8	11,957,531.85	11,716,929.71
未分配利润	7.1.4.7.9	7,331,417.54	10,163,205.28
<b>所有者权益合计</b>		<b>19,288,949.39</b>	<b>21,880,134.99</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>19,658,613.69</b>	<b>22,582,443.97</b>

注：2016年8月25日起，金鹰中证500指数分级证券投资基金转型为金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF），后附报表附注为本财务报表组成部分。

### 7.1.2 利润表

会计主体：金鹰中证500指数分级证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年8月24日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
----	-----	----

		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 8 月 24 日
<b>一、收入</b>		<b>-5,504,472.76</b>
1.利息收入		29,092.41
其中：存款利息收入	7.1.4.7.10	28,993.52
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		98.89
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-8,420,967.09
其中：股票投资收益	7.1.4.7.11	-8,579,703.94
基金投资收益		-
债券投资收益	7.1.4.7.12	-
资产支持证券投资收益	7.1.4.7.13	-
贵金属投资收益	7.1.4.7.14	-
衍生工具收益	7.1.4.7.15	-
股利收益	7.1.4.7.16	158,736.85
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.1.4.7.17	2,755,749.31
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.1.4.7.18	131,652.61
<b>减：二、费用</b>		<b>610,104.97</b>
1. 管理人报酬		157,620.82
2. 托管费		34,676.51
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.1.4.7.19	214,790.23
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.1.4.7.20	203,017.41
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填</b>		<b>-6,114,577.73</b>

列)		
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-6,114,577.73</b>

注：2016年8月25日起，金鹰中证500指数分级证券投资基金转型为金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF），后附报表附注为本财务报表组成部分。

### 7.1.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金鹰中证500指数分级证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年8月24日

单位：人民币元

项目	本期		
	2016年1月1日至2016年8月24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）	11,716,929.71	10,163,205.28	21,880,134.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-6,114,577.73	-6,114,577.73
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）	7,572,019.68	3,282,789.99	10,854,809.67
其中：1.基金申购款	77,852,407.20	39,098,776.67	116,951,183.87
2.基金赎回款	-70,280,387.52	-35,815,986.68	-106,096,374.20
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）	-	-7,331,417.54	-7,331,417.54
五、期末所有者权益（基金净值）	19,288,949.39	-	19,288,949.39

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，2016 年 8 月 24 日为金鹰中证 500 指数分级证券投资基金基金份额转换基准日，原金鹰中证 500 指数分级证券投资基金基金份额 17,331,084.06 份转换为 19,288,947.39 份金鹰量化精选股票型证券投资基金(LOF)基金份额。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1.1 至 7.1.4，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

## 7.1.4 报表附注

### 7.1.4.1 基金基本情况

金鹰中证 500 指数分级证券投资基金(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[2012]247 号文《关于核准金鹰中证 500 指数分级证券投资基金募集的批复》、基金部函[2012]458 号文《关于金鹰中证 500 指数分级证券投资基金备案确认的函》批准，于 2012 年 6 月 5 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 2012 年 4 月 23 日起至 2012 年 5 月 29 日止，认购金额及认购期银行利息合计 393,471,186.50 元，于 2012 年 6 月 5 日划至托管银行账户。首次设立募集规模为 393,471,186.50 份，根据《基金合同》约定，其中场外募集资金及其利息确认金鹰 500 份额 341,051,468.50 份，场内募集资金及其利息按 1：1 的比例确认金鹰 500A 份额 26,209,859.00 份和金鹰 500B 份额 26,209,859.00 份。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，基金托管人为交通银行股份有限公司（简称"交通银行"）。

根据《基金合同》约定，每 2 份金鹰中证 500 指数基金场内份额（初始面值为 1 元）按照 1:1 的比例，分拆成预期收益与风险特性不同的两种份额，即：优先获得收益分配权的优先级（称为金鹰 500A，初始面值为 1 元），获得剩余收益分配权的进取级（称为金鹰 500B，初始面值为 1 元）金鹰 500、金鹰 500A、金鹰 500B 三类基金份额的基金资产合并运作。

根据基金合同的约定，每 2 份金鹰 500 场内份额分拆为 1 份金鹰 500A 份额与 1 份金鹰 500B 份额，每 1 份金鹰 500A 份额与 1 份金鹰 500B 份额进行配对，可申请转换成 2 份金鹰 500 份额的场内份额。金鹰 500A 份额与金鹰 500B 份额在深交所上市交易，不可单独申赎。

本基金份额的折算包括定期折算与不定期折算。定期折算为金鹰中证 500 指数分级基金存续期内每个会计年度第一个工作日。不定期折算，当金鹰 500B 份额的基金份额参考净值小于 0.2500（不

含 0.2500) 元, 或金鹰 500 份额净值大于 2.0000 (不含 2.0000) 时, 基金管理人即可确定基金份额折算日。

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。依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。

#### **7.1.4.2 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编制。

#### **7.1.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金本年度报告中财务报表的编制遵守了企业会计准则及其他有关规定, 真实、完整地反映了本基金于 2016 年 8 月 24 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 8 月 24 日的经营成果和净值变动情况。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### **7.1.4.4 重要会计政策和会计估计**

##### **7.1.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度采用公历年度, 即每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。

##### **7.1.4.4.2 记账本位币**

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外, 均以人民币元为单位表示。

##### **7.1.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

###### **(1) 金融资产分类**

金融资产应当在初始确认时划分为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有

至到期投资、贷款和应收款项，以及可供出售金融资产。金融资产分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。

本基金将持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）于初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金将持有的其他金融资产划分为贷款和应收款项，包括银行存款和各类应收款项等。

## (2)金融负债分类

金融负债应当在初始确认时划分为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债两类。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

### 7.1.4.4.4金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

基金初始确认金融资产或金融负债，应当按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票投资、债券投资等，以及不作为有效套期工具的衍生金融工具，相关的交易费用在发生时计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，相关交易费用在发生时计入初始确认金额。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量。

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，其中包括同时结转的公允价值变动收益。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）。本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，

终止确认该金融资产；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账。

因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价，于股权分置改革方案实施后的股票复牌日，冲减股票投资成本。

卖出股票于成交日确认股票投资收益，出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

#### (2) 债券投资

买入证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本。

买入未上市债券和银行间同业市场交易的债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交总额扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本。

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限计算应收利息，按上述会计处理方法核算。

卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券投资收益。

卖出未上市债券和银行间同业市场交易的债券于成交日确认债券投资收益。

卖出债券的成本按移动加权平均法结转。

#### (3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账。

配股权证及由股权分置改革而被动获得的权证，在确认日记录所获分配的权证数量，该类权证初始成本为零。

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，出售权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

#### (4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本。

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算。

#### (5) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购）以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

#### 7.1.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金目前金融资产和金融负债的估值原则和方法如下：

##### 1、股票估值原则和方法

###### (1) 上市流通股票的估值

上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

###### (2) 未上市股票的估值

送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。

###### (3) 长期停牌股票的估值

已停牌股票且潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，本基金根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

###### (4) 有明确锁定期股票的估值

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的收盘价估值；非公开发行且处于明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

##### 2、固定收益证券的估值原则和方法

(1) 交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

(2) 交易所市场上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应

收利息后得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(3) 交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(4) 交易所市场发行未上市或未挂牌转让的固定收益品种，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

(5) 对银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资者回售权的固定收益品种，回售登记截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。

(6) 对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的固定收益品种，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

(7) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

### 3、权证估值原则和方法

认沽/认购权证的估值，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的认沽/认购权证按估值日的最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。未上市交易的认沽/认购权证采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值；停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

### 4、股指期货估值原则和方法

股指期货合约，一般以估值当日股指期货的结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。当日结算价及结算规则以《中国金融期货交易所结算细则》为准。如法律法规今后另有规定的，从其规定。

### 5、其他资产的估值原则和方法

其他资产按照国家有关规定或行业约定进行估值。

6、在任何情况下，基金管理人采用上述 1-5 项规定的方法对基金财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人具有充足的理由认为按上述方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线

等多种因素的基础上与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

7、国家有最新规定的，按其规定进行估值。

#### 7.1.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.1.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.1.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

#### 7.1.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

1、存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

2、债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

3、资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，在证券实际持有期内逐日计提；

4、买入返售金融资产收入，2007 年 7 月 1 日前，按协议金额及约定利率，在回购期内采用直线法逐日计提；2007 年 7 月 1 日后，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

5、股票投资收益于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额入账；

6、债券投资收益于卖出债券成交日确认，并按卖出债券成交金额与其成本、应收利息的差额入账；

7、衍生工具投资收益于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交总额与其成本的差额入账；

8、股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

9、公允价值变动收益系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

10、其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### **7.1.4.4.10 费用的确认和计量**

1、基金管理费按前一日基金资产净值的 1.0% 的年费率逐日计提；

2、基金托管费按前一日基金资产净值的 0.22% 的年费率逐日计提；

3、基金指数使用费按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率逐日计提，收取下限为每季度 5 万元整，不足 5 万元按 5 万元收取；

4、卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

5、其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第五位的，则采用待摊或预提的方法。

#### **7.1.4.4.11 基金的收益分配政策**

根据本基金合同约定，存续期内，本基金（包括金鹰中证 500 份额、金鹰中证 500A 份额、金鹰中证 500B 份额）不进行收益分配。

#### **7.1.4.4.12 分部报告**

本基金本年度无分部报告。

#### **7.1.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票

投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《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》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4) 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)，按照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》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

#### **7.1.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **7.1.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期无会计政策变更。

##### **7.1.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期无会计变更说明。

##### **7.1.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在报告期间不存在重大会计差错。

#### **7.1.4.6 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）交易印花税率调整为单边征税,由出让方按证券(股票)交易印花税率缴纳印花税,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、国家税务总局财税字[2016]36 号文《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、债券免征营业税或增值税。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。

## 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。）

#### 7.1.4.7 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
交通银行股份有限公司	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

#### 7.1.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.1.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.1.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年8月24日	
	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	0.00	0.00%

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

##### 7.1.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年8月24日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广州证券股份有限公司	0.00	0.00%

注：本基金本年度及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 7.1.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年8月24日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
广州证券股份有限公司	0.00	0.00%

注：本基金本年度及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 7.1.4.8.1.4 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年8月24日	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例
广州证券股份有限公司	0.00	0.00%

注：本基金本年度及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.1.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本年度无应支付关联方的佣金。

#### 7.1.4.8.2 关联方报酬

##### 7.1.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期

	2016年1月1日至2016年8月24日
当期发生的基金应支付的管理费	157,620.82
其中：支付销售机构的客户维护费	36,960.22

注：1、基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.0% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H=E \times 1.0\% / \text{当年天数}$$

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。

#### 7.1.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年8月24日
当期发生的基金应支付的托管费	34,676.51

注：1、基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.22% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.22\% / \text{当年天数}$$

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。

#### 7.1.4.8.2.3 销售服务费

本基金本报告期内及上年度可比期间内没有应支付关联方的销售服务费。

#### 7.1.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（回购）交易。

#### 7.1.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

**7.1.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

报告期内，基金管理人未持有本基金份额。

**7.1.4.8.4.2 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**

报告期内，关联方未持有本基金份额。

**7.1.4.8.5 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 2016年1月1日至2016年8月24日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	53,536.24	13,112.62

注：1、本基金用于证券交易结算的资金通过"交通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，按银行同业利率计息，在资产负债表中的"结算备付金"科目中单独列示。本期末结算备付金余额 1,196,250.41 元,当期结算备付金存款利息收入 15,586.66 元。2015 年年末结算备付金余额 1,415,217.54 元,当期结算备付金存款利息收入 42,454.67 元。

**7.1.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

报告期内，本基金管理人未参与关联方证券承销期内的证券交易。

**7.1.4.9 期末（2016 年 8 月 24 日）本基金持有的流通受限证券****7.1.4.9.1 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/增发证券而持有的流通受限证券。

**7.1.4.9.2 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	复牌开盘价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600079	人福医药	2016-08-23	重大事项停牌	21.21	2016-09-01	21.55	3,000.00	52,465.56	63,630.00	重大事项

600397	安源煤业	2016-07-12	重大事项停牌	4.67	2016-09-30	4.90	3,597.00	20,379.79	16,797.99	重大事项
600500	中化国际	2016-07-27	重大事项停牌	10.43	2016-08-29	10.01	5,300.00	60,402.61	55,279.00	重大事项
600545	新疆城建	2016-05-31	重大事项停牌	6.86	2016-11-18	7.55	3,826.00	34,675.83	26,246.36	重大事项
600614	鹏起科技	2016-04-26	重大事项停牌	8.14	2016-10-10	8.95	12,552.00	106,436.68	102,173.28	重大事项
600687	刚泰控股	2016-07-25	重大事项停牌	16.42	2017-01-18	16.38	2,900.00	45,826.62	47,618.00	重大事项
600773	西藏城投	2016-06-30	重大事项停牌	15.67	2016-12-13	15.10	2,362.00	36,452.60	37,012.54	重大事项
600884	杉杉股份	2016-08-19	重大事项停牌	17.77	2016-08-31	16.50	2,556.00	40,568.30	45,420.12	重大事项
601005	重庆钢铁	2016-06-02	重大事项停牌	2.52	-	-	13,500.00	43,239.83	34,020.00	重大事项
603883	老百姓	2016-08-18	重大事项停牌	50.32	2016-10-18	49.99	100.00	5,000.00	5,032.00	重大事项
000511	*ST 烯碳	2016-04-26	重大事项停牌	8.92	2016-11-22	8.47	22,436.00	219,295.82	200,129.12	重大事项
000547	航天发展	2016-04-19	重大事项停牌	15.36	2017-01-03	16.90	3,700.00	114,972.68	56,832.00	重大事项
000582	北部湾港	2016-02-29	重大事项停牌	16.32	2016-09-08	17.95	400.00	11,391.65	6,528.00	重大事项
000693	ST 华泽	2016-03-01	重大事项停牌	12.50	-	-	1,200.00	30,482.52	15,000.00	重大事项
000975	银泰资源	2016-04-19	重大事项停牌	15.00	2016-11-24	16.50	2,898.00	50,915.04	43,470.00	重大事项
002266	浙富控股	2016-05-25	重大事项停牌	5.34	2016-09-30	5.87	10,500.00	71,762.51	56,070.00	重大事项
002624	完美世界	2016-07-05	重大事项停牌	36.98	2016-10-10	38.00	1,100.00	39,858.00	40,678.00	重大事项
002663	普邦园林	2016-04-28	重大事项停牌	7.36	2016-09-27	7.80	11,830.00	92,946.14	87,068.80	重大事项
002745	木林森	2016-07-18	重大事项停牌	36.49	-	-	100.00	3,199.42	3,649.00	重大事项

#### 7.1.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购。

#### 7.1.4.10 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。

## 7.2 金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）

### 7.2.1 资产负债表（转型后）

会计主体：金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末
		2016 年 12 月 31 日
资产：		-
银行存款	7.2.4.7.1	932,516.27
结算备付金		643,105.87
存出保证金		12,222.10
交易性金融资产	7.2.4.7.2	16,007,084.40
其中：股票投资		16,007,084.40
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	7.2.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.2.4.7.4	-
应收证券清算款		86,647.53
应收利息	7.2.4.7.5	654.75
应收股利		-
应收申购款		7,116.31
递延所得税资产		-
其他资产		-
<b>资产总计</b>		<b>17,689,347.23</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 12 月 31 日</b>
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		21,246.87
应付赎回款		141,544.31
应付管理人报酬		21,653.95
应付托管费		3,609.01
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.2.4.7.6	93,425.42
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-

其他负债	7.2.4.7.7	170,481.56
<b>负债合计</b>		<b>451,961.12</b>
<b>所有者权益：</b>		<b>-</b>
实收基金	7.2.4.7.8	16,890,846.57
未分配利润	7.2.4.7.9	346,539.54
<b>所有者权益合计</b>		<b>17,237,386.11</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>17,689,347.23</b>

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。无上年度可比期间数据。后附报表附注为本财务报表组成部分。

## 7.2.2 利润表

会计主体：金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）

本报告期：2016 年 8 月 25 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>776,210.57</b>
1.利息收入		9,329.04
其中：存款利息收入	7.2.4.7.10	9,329.04
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		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,123,969.55
其中：股票投资收益	7.2.4.7.11	1,133,946.05
基金投资收益		-
债券投资收益	7.2.4.7.12	-
资产支持证券投资收益	7.2.4.7.13	-

贵金属投资收益	7.2.4.7.14	-
衍生工具收益	7.2.4.7.15	-
股利收益	7.2.4.7.16	-9,976.50
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.2.4.7.17	-365,862.65
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.2.4.7.18	8,774.63
<b>减：二、费用</b>		<b>308,776.59</b>
1. 管理人报酬		96,489.52
2. 托管费		16,081.64
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.2.4.7.19	245,101.23
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.2.4.7.20	-48,895.80
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>467,433.98</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>467,433.98</b>

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。无上年度及上上年度数据可比期间数据（下同）。后附报表附注为本财务报表组成部分。

### 7.2.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）

本报告期：2016 年 8 月 25 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2016 年 8 月 25 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）	19,288,949.39	-	19,288,949.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	467,433.98	467,433.98
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）	-2,398,102.82	-120,894.44	-2,518,997.26
其中：1.基金申购款	4,684,487.91	143,890.25	4,828,378.16
2.基金赎回款	-7,082,590.73	-264,784.69	-7,347,375.42
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）	16,890,846.57	346,539.54	17,237,386.11

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.2.1 至 7.2.4，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

## 7.2.4 报表附注

### 7.2.4.1 基金基本情况

金鹰中证 500 指数分级证券投资基金(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[2012]247 号文《关于核准金鹰中证 500 指数分级证券投资基金募集的批复》、基金部函[2012]458 号文《关于金鹰中证 500 指数分级证券投资基金备案确认的函》批准，于 2012 年 6 月 5 日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定。首次设立募集规模为 393,471,186.50 份，

根据《基金合同》约定，其中场外募集资金及其利息确认金鹰 500 份额 341,051,468.50 份，场内募集资金及其利息按 1: 1 的比例确认金鹰 500A 份额 26,209,859.00 份和金鹰 500B 份额 26,209,859.00 份。

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。依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。

本基金的基金管理人为金鹰基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

#### **7.2.4.2 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编制。

#### **7.2.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金本年度报告中财务报表的编制遵守了企业会计准则及其他有关规定,真实、完整地反映了本基金于 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 8 月 25 日至 12 月 31 日的经营成果和净值变动情况。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### **7.2.4.4 重要会计政策和会计估计**

##### **7.2.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。

##### **7.2.4.4.2 记账本位币**

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### **7.2.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

###### **(1) 金融资产分类**

金融资产应当在初始确认时划分为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项，以及可供出售金融资产。金融资产分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。

本基金将持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）于初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金将持有的其他金融资产划分为贷款和应收款项，包括银行存款和各类应收款项等。

## (2)金融负债分类

金融负债应当在初始确认时划分为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债两类。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

### 7.2.4.4.4金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

基金初始确认金融资产或金融负债，应当按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票投资、债券投资等，以及不作为有效套期工具的衍生金融工具，相关的交易费用在发生时计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，相关交易费用在发生时计入初始确认金额。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量。

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，其中包括同时结转的公允价值变动收益。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）。本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。本基金既没有转移也没有

保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账。

因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价，于股权分置改革方案实施后的股票复牌日，冲减股票投资成本。

卖出股票于成交日确认股票投资收益，出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

#### (2) 债券投资

买入证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本。

买入未上市债券和银行间同业市场交易的债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交总额扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本。

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限计算应收利息，按上述会计处理方法核算。

卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券投资收益。

卖出未上市债券和银行间同业市场交易的债券于成交日确认债券投资收益。

卖出债券的成本按移动加权平均法结转。

#### (3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账。

配股权证及由股权分置改革而被动获得的权证，在确认日记录所获分配的权证数量，该类权证初始成本为零。

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，出售权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

#### (4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本。

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算。

#### (5) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购）以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

### 7.2.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金目前金融资产和金融负债的估值原则和方法如下：

#### 1、股票估值原则和方法

##### (1) 上市流通股票的估值

上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

##### (2) 未上市股票的估值

送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。

##### (3) 长期停牌股票的估值

已停牌股票且潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，本基金根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

##### (4) 有明确锁定期股票的估值

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的收盘价估值；非公开发行且处于明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

#### 2、固定收益证券的估值原则和方法

(1) 交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

(2) 交易所市场上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息后得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(3) 交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(4) 交易所市场发行未上市或未挂牌转让的固定收益品种，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

(5) 对银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资者回售权的固定收益品种，回售登记截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。

(6) 对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的固定收益品种，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

(7) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

### 3、权证估值原则和方法

认沽/认购权证的估值，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的认沽/认购权证按估值日的最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。未上市交易的认沽/认购权证采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值；停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

### 4、股指期货估值原则和方法

股指期货合约，一般以估值当日股指期货的结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。当日结算价及结算规则以《中国金融期货交易所结算细则》为准。如法律法规今后另有规定的，从其规定。

### 5、其他资产的估值原则和方法

其他资产按照国家有关规定或行业约定进行估值。

6、在任何情况下，基金管理人采用上述 1-5 项规定的方法对基金财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人有着充足的理由认为按上述方法对基金财产进行估值不

能客观反映其公允价值的，基金管理人可在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素的基础上与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

7、国家有最新规定的，按其规定进行估值。

#### 7.2.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.2.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.2.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。

损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现平准金与已实现平准金均在"损益平准金"科目中核算，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.2.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

1、存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

2、债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

3、资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，在证券实际持有期内逐日计提；

4、买入返售金融资产收入,按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

5、股票投资收益于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额入账；

6、债券投资收益于卖出债券成交日确认，并按卖出债券成交金额与其成本、应收利息的差额入账；

7、衍生工具投资收益于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交总额与其成本的差额入账；

8、股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

9、公允价值变动收益系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

10、其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### **7.2.4.4.10 费用的确认和计量**

1、基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 的年费率逐日计提；

2、基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率逐日计提；

3、卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

4、其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第五位的，则采用待摊或预提的方法。

#### **7.2.4.4.11 基金的收益分配政策**

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

2、本基金场外份额的收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金场外份额默认的收益分配方式是现金分红；本基金场内份额的收益分配方式仅能为现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每

单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

- 4、每一基金份额享有同等分配权；
- 5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.2.4.4.12分部报告

本基金本年度无分部报告。

#### 7.2.4.4.13其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《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》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4) 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)，按照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》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

#### 7.2.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.2.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期会计政策无变更。

#### 7.2.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期会计估计变更说明。

#### 7.2.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期间不存在重大会计差错。

#### 7.2.4.6 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、国家税务总局财税字[2016]36 号文《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、债券免征营业税或增值税。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。

##### 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。

#### 7.2.4.7 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
交通银行股份有限公司	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

#### 7.2.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.2.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.2.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2016年8月25日至2016年12月31日	
	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	15,223,288.23	8.60%

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。依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。无上年度可比期间数据。

#### 7.2.4.8.1.2 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年8月25日至2016年12月31日	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例
广州证券股份有限公司	0.00	0.00%

注：1、本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

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。依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。无上年度可比期间数据。

#### 7.2.4.8.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年8月25日至2016年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广州证券股份有限公司	0.00	0.00%

注：1、本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

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。依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。无上年度可比期间数据。

#### 7.2.4.8.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年8月25日至2016年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
广州证券股份有限公司	0.00	0.00%

注：1、本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

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。依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。无上年度可比期间数据。

#### 7.2.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年8月25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	13,873.02	9.96%	-	-

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。依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。无上年度可比期间数据。

#### 7.2.4.8.2 关联方报酬

##### 7.2.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年8月25日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	96,489.52
其中：支付销售机构的客户维护费	22,733.30

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

3、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。依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。无上年度可比期间数据。

#### 7.2.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年8月25日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	16,081.64

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

3、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。依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。无上年度可比期间数据。

#### 7.2.4.8.2.3 销售服务费

1、本基金本报告期内没有应支付关联方的销售服务费。

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。依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。无上年度可比期间数据。

#### 7.2.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

- 1、本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（回购）交易。
- 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。依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。无上年度可比期间数据。

#### 7.2.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.2.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内，基金管理人未持有本基金份额。

##### 7.2.4.8.4.2 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

报告期内，关联方未持有本基金份额。

#### 7.2.4.8.5 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 2016年8月25日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	932,516.27	1,916.97

注：1、本基金用于证券交易结算的资金通过“交通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，按银行同业利率计息，在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示。本期末结算备付金余额 643,105.87 元,当期结算备付金存款利息收入 7,240.18 元。

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。依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。无上年度可比期间数据。

#### 7.2.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

报告期内，本基金管理人未参与关联方证券承销期内的证券交易。

#### 7.2.4.9 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.2.4.9.1 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/增发证券而持有的流通受限证券。

##### 7.2.4.9.2 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
600892	大晟文化	2016-11-16	重大事项停牌	78.31	2017-02-21	70.48	200.00	15,570.00	15,662.00	重大事项
002745	木林森	2016-07-15	重大事项停牌	36.49	-	-	100.00	3,199.42	3,649.00	重大事项
000711	京蓝科技	2016-10-20	重大事项停牌	32.54	2017-03-13	29.29	1,500.00	48,915.00	48,810.00	重大事项
600687	刚泰控股	2016-07-25	重大事项停牌	16.42	2017-01-18	16.38	2,900.00	45,826.62	47,618.00	重大事项
000547	航天发展	2016-04-19	重大事项停牌	15.36	2017-01-03	16.90	3,700.00	114,972.68	56,832.00	重大事项
002567	唐人神	2016-12-22	重大事项停牌	12.64	2017-01-03	12.75	23,000.00	300,944.57	290,720.00	重大事项
000693	ST 华泽	2016-03-01	重大事项停牌	12.50	-	-	1,200.00	30,482.52	15,000.00	重大事项
601005	重庆钢铁	2016-06-02	重大事项停牌	2.52	-	-	13,500.00	43,239.83	34,020.00	重大事项

##### 7.2.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购。

### 7.2.4.10 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 金鹰中证 500 指数分级证券投资基金

#### 8.1.1 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	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

### 8.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.1.2.1 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	0.29

R	文化、体育和娱乐业	283,362.86	1.47
S	综合	176,485.29	0.91
	合计	17,994,409.95	93.29

## 8.1.2.2 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。

### 8.1.2.3 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。

### 8.1.3 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

#### 8.1.3.1 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

#### 8.1.3.2 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。

### 8.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.1.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资
----	------	------	----------	--------

				产净值比例 (%)
1	002466	天齐锂业	755,815.00	3.45
2	600201	生物股份	402,087.44	1.84
3	600654	中安消	394,967.00	1.81
4	300072	三聚环保	350,472.22	1.60
5	600694	大商股份	344,586.00	1.57
6	600699	均胜电子	340,430.00	1.56
7	600482	风帆股份	335,421.00	1.53
8	000887	中鼎股份	334,906.00	1.53
9	600498	烽火通信	333,986.00	1.53
10	002174	游族网络	333,132.00	1.52
11	002085	万丰奥威	321,645.00	1.47
12	002179	中航光电	318,565.00	1.46
13	600816	安信信托	318,160.00	1.45
14	600079	人福医药	317,252.00	1.45
15	603019	中科曙光	313,271.00	1.43
16	002701	奥瑞金	312,925.00	1.43
17	002030	达安基因	307,582.00	1.41
18	600525	长园集团	307,186.00	1.40
19	000748	长城信息	304,223.00	1.39
20	002276	万马股份	300,966.00	1.38

## 8.1.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资 产净值比例 (%)
1	002466	天齐锂业	697,850.00	3.61
2	000748	长城信息	631,853.00	3.27
3	600978	宜华生活	414,786.00	2.15
4	000066	长城电脑	390,208.40	2.02
5	600694	大商股份	381,912.00	1.98
6	600816	安信信托	374,555.75	1.94
7	600201	生物股份	368,714.73	1.91
8	600654	中安消	366,071.00	1.90
9	002174	游族网络	360,656.00	1.87
10	300072	三聚环保	343,621.00	1.78
11	600074	保千里	335,598.41	1.74
12	000887	中鼎股份	326,465.39	1.69

13	600079	人福医药	325,917.00	1.69
14	002179	中航光电	319,446.00	1.65
15	600498	烽火通信	313,872.00	1.63
16	002085	万丰奥威	308,473.30	1.60
17	600699	均胜电子	308,159.65	1.60
18	600482	中国动力	303,475.76	1.57
19	600376	首开股份	302,213.08	1.57
20	300267	尔康制药	296,052.00	1.53

#### 8.1.4.3 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	77,796,670.26
卖出股票的收入（成交）总额	74,375,291.24

#### 8.1.5 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。

#### 8.1.6 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。

#### 8.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

#### 8.1.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8.1.9 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。

#### 8.1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.1.10.1 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。

##### 8.1.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

**8.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****8.1.11.1 本期国债期货投资政策**

无。

**8.1.11.2 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。

8.1.12 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。

8.1.13 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。

**8.1.13.1 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	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

**8.1.13.2 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。

**8.1.13.3 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明****8.1.13.3.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	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
---	--------	------	-----------	------	------

### 8.1.13.3.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000511	烯碳新材	200,129.12	1.04	重大事项
2	600654	中安消	40,662.30	0.21	重大事项
3	000959	首钢股份	21,070.00	0.11	重大事项
4	000693	华泽钴镍	15,000.00	0.08	重大事项
5	600704	物产中大	13,338.16	0.07	重大事项

### 8.1.13.4 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。

## 8.2 金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）

### 8.2.1 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	16,007,084.40	90.49
	其中：股票	16,007,084.40	90.49
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	1,575,622.14	8.91
7	其他各项资产	106,640.69	0.60
8	合计	17,689,347.23	100.00

## 8.2.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.2.1 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	677,430.00	3.93
B	采矿业	15,000.00	0.09
C	制造业	9,373,934.40	54.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,819.00	0.11
E	建筑业	3,131,202.00	18.17
F	批发和零售业	813,660.00	4.72
G	交通运输、仓储和邮政业	443,232.00	2.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	444,053.00	2.58
J	金融业	702,974.00	4.08
K	房地产业	150,190.00	0.87
L	租赁和商务服务业	47,520.00	0.28
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	189,070.00	1.10
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

	合计	16,007,084.40	92.86
--	----	---------------	-------

### 8.2.2.2 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。

### 8.2.3 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	000429	粤高速 A	64,800	443,232.00	2.57
2	002323	雅百特	29,000	439,060.00	2.55
3	002504	弘高创意	55,200	436,632.00	2.53
4	002088	鲁阳节能	22,200	431,790.00	2.50
5	300474	景嘉微	8,000	430,960.00	2.50
6	300117	嘉寓股份	65,000	430,950.00	2.50
7	002752	昇兴股份	24,800	428,296.00	2.48
8	002641	永高股份	50,600	425,546.00	2.47
9	002043	兔宝宝	36,400	421,148.00	2.44
10	000546	金圆股份	37,200	421,104.00	2.44

### 8.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.2.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	002752	昇兴股份	852,802.52	4.95
2	300119	瑞普生物	782,384.00	4.54
3	600891	秋林集团	765,234.90	4.44
4	600030	中信证券	734,480.00	4.26
5	600327	大东方	733,789.00	4.26
6	002548	金新农	710,916.00	4.12
7	000885	同力水泥	690,756.05	4.01
8	002641	永高股份	687,068.96	3.99
9	002746	仙坛股份	685,486.02	3.98
10	002323	雅百特	680,192.00	3.95
11	600562	国睿科技	664,905.00	3.86
12	300527	华舟应急	660,645.98	3.83

13	600990	四创电子	649,921.48	3.77
14	300138	晨光生物	643,710.70	3.73
15	002504	弘高创意	642,429.97	3.73
16	300495	美尚生态	639,828.00	3.71
17	002032	苏泊尔	635,403.75	3.69
18	300474	景嘉微	627,002.00	3.64
19	600975	新五丰	621,853.00	3.61
20	000810	创维数字	615,645.00	3.57
21	600419	天润乳业	613,261.22	3.56
22	600291	西水股份	603,653.00	3.50
23	600295	鄂尔多斯	603,343.00	3.50
24	002190	成飞集成	585,548.00	3.40
25	601886	江河集团	577,043.00	3.35
26	300347	泰格医药	566,271.86	3.29
27	002567	唐人神	560,730.57	3.25
28	002542	中化岩土	551,541.50	3.20
29	002062	宏润建设	525,111.45	3.05
30	000619	海螺型材	515,181.23	2.99
31	300021	大禹节水	505,886.00	2.93
32	000993	闽东电力	505,592.11	2.93
33	002772	众兴菌业	504,805.59	2.93
34	002043	兔宝宝	503,101.00	2.92
35	000068	华控赛格	502,598.00	2.92
36	300436	广生堂	483,685.00	2.81
37	600522	中天科技	476,807.50	2.77
38	002615	哈尔斯	465,220.46	2.70
39	600828	茂业商业	462,029.00	2.68
40	601633	长城汽车	452,792.00	2.63
41	300448	浩云科技	451,244.15	2.62
42	002124	天邦股份	449,439.00	2.61
43	000546	金圆股份	447,421.00	2.60
44	002088	鲁阳节能	445,933.14	2.59
45	000429	粤高速 A	444,657.00	2.58
46	300117	嘉寓股份	444,278.09	2.58
47	002620	瑞和股份	443,563.00	2.57
48	600180	瑞茂通	431,000.00	2.50
49	002775	文科园林	430,863.45	2.50
50	002302	西部建设	430,122.00	2.50
51	002787	华源控股	429,512.00	2.49
52	002713	东易日盛	421,410.00	2.44
53	002743	富煌钢构	421,134.00	2.44
54	002688	金河生物	420,375.00	2.44
55	002718	友邦吊顶	418,059.00	2.43
56	603007	花王股份	412,052.00	2.39

57	000921	海信科龙	408,416.00	2.37
58	300008	天海防务	408,012.11	2.37
59	603355	莱克电气	406,611.00	2.36
60	300520	科大国创	405,768.00	2.35
61	002519	银河电子	402,424.00	2.33
62	600629	华建集团	381,447.00	2.21
63	603017	中衡设计	376,469.00	2.18
64	002403	爱仕达	373,764.00	2.17
65	000010	美丽生态	370,788.00	2.15
66	002586	围海股份	370,331.00	2.15
67	603828	柯利达	362,195.00	2.10
68	603366	日出东方	361,855.00	2.10
69	000428	华天酒店	359,845.00	2.09
70	603818	曲美家居	353,660.00	2.05
71	000789	万年青	353,270.00	2.05
72	601339	百隆东方	353,120.00	2.05
73	600782	新钢股份	351,159.00	2.04
74	600510	黑牡丹	350,419.00	2.03
75	603600	永艺股份	348,384.00	2.02
76	002717	岭南园林	346,037.00	2.01
77	603030	全筑股份	345,950.00	2.01

#### 8.2.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000885	同力水泥	782,692.00	4.54
2	600891	秋林集团	701,353.00	4.07
3	600419	天润乳业	675,552.76	3.92
4	600990	四创电子	634,871.00	3.68
5	002032	苏泊尔	628,852.56	3.65
6	600975	新五丰	618,275.00	3.59
7	000810	创维数字	605,141.09	3.51
8	601886	江河集团	597,761.00	3.47
9	002542	中化岩土	552,306.03	3.20
10	600522	中天科技	550,252.52	3.19
11	300021	大禹节水	518,161.00	3.01
12	000619	海螺型材	517,272.42	3.00
13	000993	闽东电力	517,258.00	3.00
14	600828	茂业商业	517,197.00	3.00

15	002062	宏润建设	506,086.40	2.94
16	002752	昇兴股份	498,502.00	2.89
17	600030	中信证券	494,845.00	2.87
18	002772	众兴菌业	486,863.00	2.82
19	300448	浩云科技	461,239.00	2.68
20	300436	广生堂	457,519.00	2.65
21	601633	长城汽车	448,056.00	2.60
22	603355	莱克电气	435,264.00	2.53
23	603007	花王股份	426,406.00	2.47
24	603616	韩建河山	407,379.00	2.36
25	600629	华建集团	405,694.00	2.35
26	002403	爱仕达	399,191.00	2.32
27	600782	新钢股份	397,154.00	2.30
28	300008	天海防务	397,104.00	2.30
29	603828	柯利达	395,640.36	2.30
30	000789	万年青	395,044.00	2.29
31	603017	中衡设计	392,306.00	2.28
32	000921	海信科龙	389,897.00	2.26
33	300355	蒙草生态	387,500.00	2.25
34	300119	瑞普生物	379,099.05	2.20
35	002519	银河电子	371,837.95	2.16
36	603366	日出东方	368,492.08	2.14
37	000428	华天酒店	367,026.00	2.13
38	002586	围海股份	364,500.00	2.11
39	300403	地尔汉宇	363,002.00	2.11
40	600258	首旅酒店	357,726.96	2.08
41	600327	大东方	355,810.00	2.06
42	600510	黑牡丹	351,065.08	2.04
43	002264	新华都	350,848.00	2.04
44	603030	全筑股份	348,473.00	2.02
45	601339	百隆东方	347,987.00	2.02
46	603868	飞科电器	347,656.00	2.02
47	300347	泰格医药	347,090.00	2.01
48	603600	永艺股份	344,224.00	2.00

#### 8.2.4.3 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	87,019,079.20
卖出股票的收入（成交）总额	90,071,215.73

### 8.2.5 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。

### 8.2.6 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。

### 8.2.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

### 8.2.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.2.9 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。

### 8.2.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.2.10.1 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。

#### 8.2.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

### 8.2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.2.11.1 本期国债期货投资政策

无。

#### 8.2.11.2 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。

8.2.12 本基金期末持有的前十大重仓股之一嘉寓股份（代码：300117），由于财务会计报告违规和未及时披露信息，被中国证监会警示、对公司罚款 60 万元。该事项已于 2016 年 12 月 30 日在指定媒体公开披露。

8.2.13 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。

#### 8.2.13.1 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	12,222.10
2	应收证券清算款	86,647.53
3	应收股利	-
4	应收利息	654.75
5	应收申购款	7,116.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	106,640.69

#### 8.2.13.2 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。

#### 8.2.13.3 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002567	唐人神	290,720.00	1.69	重大事项
2	000547	航天发展	56,832.00	0.33	重大事项
3	000711	京蓝科技	48,810.00	0.28	重大事项
4	600687	刚泰控股	47,618.00	0.28	重大事项
5	601005	重庆钢铁	34,020.00	0.20	重大事项

#### 8.2.13.4 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 金鹰中证 500 指数分级证券投资基金

#### 9.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
金鹰 500A	309	9,587.75	1,175,026.58	39.66%	1,787,588.42	60.34%
金鹰 500B	730	4,692.00	106,925.02	3.12%	3,318,235.98	96.88%
金鹰 500	2,163	5,964.48	8.90	0.00%	12,901,162.49	100.00%
合计	3,202	6,024.03	1,281,960.50	6.65%	18,006,986.89	93.35%

注：2016 年 8 月 25 日起，金鹰中证 500 指数分级证券投资基金转型为金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）。

### 9.1.2 期末上市基金前十名持有人

#### 金鹰 500A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	上海明泮投资管理有限公司—明泮 CTA 一号基金	1,116,876.00	38.92%
2	黄松友	285,124.00	9.94%
3	魏国强	155,400.00	5.42%
4	方春娣	136,587.00	4.76%
5	章宇军	124,000.00	4.32%
6	梁继才	122,276.00	4.26%
7	郭增光	102,285.00	3.56%
8	刘云政	72,200.00	2.52%
9	余德元	60,300.00	2.10%
10	沈文媛	60,000.00	2.09%

注：该类份额指金鹰500A份额

#### 金鹰500B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	上海明泮投资管理有限公司—明泮多策略对冲 1 号基金	89,485.00	3.12%
2	高翔凌	86,212.00	3.00%
3	张新然	84,000.00	2.93%

4	王清	80,074.00	2.79%
5	娄华训	63,300.00	2.21%
6	陈跃磊	63,246.00	2.20%
7	王鸿云	61,937.00	2.16%
8	黄瑞华	60,823.00	2.12%
9	李盛开	60,000.00	2.09%
10	施双林	59,666.00	2.08%

注：该类份额指金鹰500B份额

#### 金鹰500

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	杨志明	144,961.00	12.58%
2	贺敬	111,364.00	9.67%
3	刘金云	73,800.00	6.41%
4	谢晓虹	58,031.00	5.04%
5	杨远明	29,697.00	2.58%
6	刘振祥	27,462.00	2.38%
7	李冬华	25,647.00	2.23%
8	奚勃	25,345.00	2.20%
9	刘国辉	21,623.00	1.88%
10	黄连定	16,122.00	1.40%

注：该类份额指金鹰500母基金的场内份额

#### 9.1.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	金鹰 500A	0.00	0.00%
	金鹰 500B	0.00	0.00%
	金鹰 500	0.00	0.00%
	合计	0.00	0.00%

#### 9.1.4 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	份额级别	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	金鹰 500A	0
	金鹰 500B	0
	金鹰 500	0
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	金鹰 500A	0
	金鹰 500B	0
	金鹰 500	0
	合计	0

### 9.1.5 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金非发起式基金

## 9.2 金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）

### 9.2.1 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
3,077	5,489.39	10,840.00	0.06%	16,880,006.57	99.94%

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。无上年度可比期间数据。后附报表附注为本财务报表组成部分。

### 9.2.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	黄松友	294,355.00	7.13%
2	贺敬	123,945.00	3.00%
3	郭增光	105,597.00	2.56%
4	王清	95,573.00	2.32%
5	谢晓虹	80,683.00	1.96%
6	娄华训	75,552.00	1.83%
7	黄瑞华	72,596.00	1.76%
8	施双林	71,215.00	1.73%
9	邵兵	70,126.00	1.70%
10	王鸿云	62,705.00	1.52%

### 9.2.3 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	0.00	0.00%

**9.2.4 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

**9.2.5 发起式基金发起资金持有份额情况**

本基金非发起式基金

**§10 开放式基金份额变动****10.1 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
基金合同生效日基金份额总额	26,209,859.00	26,209,859.00	341,051,468.50
本报告期期初基金份额总额	2,625,743.00	2,625,743.00	11,602,601.68
基金合同生效日起至报告期期末 基金总申购份额	-	-	101,729,505.80
减：基金合同生效日起至报告期期 末基金总赎回份额	-	-	101,869,429.78
基金合同生效日起至报告期期末 基金拆分变动份额	243,960.00	243,960.00	129,000.36
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：根据本基金的基金合同、招募说明书及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的规定：

1、本基金以2016年1月4日为份额折算基准日，对金鹰500场外、场内份额以及金鹰500A份额实施定期份额折算，

2、本基金三级份额之间转换拆分产生份额变化。

综上，本基金本报告期内，金鹰500A和金鹰500B分别增加份额243,960份，金鹰500增加份额129,000.36份。

**10.2 金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）**

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	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	4,684,489.91
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	7,082,590.73
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	16,890,846.57

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。依据持有人大会决议公告，2016年8月24日为金鹰中证500指数分级证券投资基金基金份额转换基准日，原金鹰中证500指数分级证券投资基金基金份额17,331,084.06份转换为19,288,947.39份金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）基金份额。

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内以通讯方式召开了基金份额持有人大会，决定将原金鹰中证 500 指数分级证券投资基金转型为金鹰量化精选股票型证券投资基金。

### 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增聘曾长兴先生为公司副总经理，相关事项已于 2016 年 5 月 13 日进行了信息披露。

本报告期内，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事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内没有改变了基金投资策略。

### 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 25000 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 金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）

## 11.7.1.1 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	
广州证券	1	15,223,288.23	8.60%	13,873.02	8.60%	-
光大证券	1	42,910,590.60	24.24%	30,522.74	21.91%	-
海通证券	1	21,725,345.76	12.27%	19,798.63	14.21%	-
华创证券	1	27,916,593.99	15.77%	25,440.42	18.26%	-
湘财证券	1	67,227,027.32	37.97%	47,818.79	34.32%	-
中信建投证券	1	2,050,154.03	1.16%	1,868.26	1.34%	-

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；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。

## 11.7.2 金鹰中证500指数分级证券投资基金

## 11.7.2.1 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	
中银国际证券	1	1,224,910.83	0.80%	1,116.90	0.88%	-

华林证券	1	57,533,732.03	37.81%	40,924.74	32.25%	-
海通证券	1	5,533,213.32	3.64%	5,154.68	4.06%	-
中信证券	1	14,969,778.50	9.84%	13,642.53	10.75%	-
信达证券	1	3,901,186.74	2.56%	3,555.94	2.80%	-
华创证券	2	65,182,518.16	42.83%	59,406.03	46.81%	-
爱建证券	1	1,760,839.92	1.16%	1,640.02	1.29%	-
湘财证券	1	2,065,782.00	1.36%	1,469.81	1.16%	-

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。

#### 11.7.2.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华创证券	-	-	2,000,000.00	100.00%	-	-

#### 11.8 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	金鹰基金管理有限公司关于原金鹰中证 500	证券时报等	2016-08-26

	指数分级证券投资基金基金份额转换结果暨金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）基金合同生效的公告		
2	【半年报】金鹰中证 500 指数分级证券投资基金 2016 年半年度报告（摘要）	证券时报等	2016-08-27
3	金鹰基金管理有限公司关于新增北京汇成基金销售有限公司为本公司旗下基金代销机构的公告	证券时报等	2016-09-02
4	金鹰基金管理有限公司关于新增北京格上富信投资顾问有限公司为本公司旗下基金代销机构的公告	证券时报等	2016-09-09
5	金鹰基金管理有限公司关于开展直销渠道转换费率优惠活动的公告	证券时报等	2016-09-09
6	金鹰基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新已过期身份证件的公告	证券时报等	2016-09-10
7	金鹰基金管理有限公司关于新增微众银行为本公司旗下基金代销机构并开通定投业务的公告	证券时报等	2016-09-13
8	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	证券时报等	2016-09-20
9	金鹰基金管理有限公司关于提醒投资者谨防虚假客服电话、防范金融诈骗的提示性公告	证券时报等	2016-09-21
10	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京钱景财富投资管理有限公司为代销机构的公告	证券时报等	2016-09-22
11	金鹰基金管理有限公司关于新增北京肯特瑞财富投资管理有限公司为本公司旗下基金代销机构的公告	证券时报等	2016-09-23
12	金鹰基金管理有限公司关于新增深圳前海凯恩斯基金销售有限公司为本公司旗下部分基金代销机构的公告	证券时报等	2016-09-29
13	金鹰基金管理有限公司关于增加上海天天基金销售有限公司为本公司旗下部分基金代销机构的公告	证券时报等	2016-09-30
14	金鹰基金管理有限公司关于新增北京新浪仓石基金销售有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务的公告	证券时报等	2016-10-14
15	金鹰基金管理有限公司关于新增厦门市鑫鼎盛控股有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务的公告	证券时报等	2016-10-14
16	金鹰基金管理有限公司关于新增上海万得投资顾问有限公司为本公司旗下部分基金代销	证券时报等	2016-10-21

	机构并开通基金转换、基金定投业务的公告		
17	金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF） 2016 年第 3 季度报告	证券时报等	2016-10-25
18	金鹰基金管理有限公司关于新增凤凰金信（银川）投资管理有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务的公告	证券时报等	2016-10-26
19	金鹰基金管理有限公司关于新增奕丰金融服务（深圳）有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务的公告	证券时报等	2016-11-02
20	金鹰基金管理有限公司关于增加深圳前海微众银行股份有限公司为本公司旗下部分基金代销机构的公告	证券时报等	2016-11-08
21	金鹰基金管理有限公司关于在广发证券股份有限公司开通本公司旗下部分基金定投及转换业务的公告	证券时报等	2016-11-09
22	金鹰基金管理有限公司关于开展网上直销渠道费率优惠活动的公告	证券时报等	2016-11-09
23	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增民生证券股份有限公司为代销机构的公告	证券时报等	2016-11-11
24	关于金鹰基金管理有限公司新增中邮证券为代销机构并代销旗下部分基金的公告	证券时报等	2016-11-11
25	金鹰基金管理有限公司关于安信证券股份有限公司代销旗下部分基金开通定投及转换业务的公告	证券时报等	2016-11-11
26	金鹰基金管理有限公司关于广州证券股份有限公司代销旗下部分基金开通定投及转换业务的公告	证券时报等	2016-11-11
27	金鹰基金管理有限公司关于新增天津国美基金销售有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务的公告	证券时报等	2016-11-16
28	金鹰基金管理有限公司关于增加北京肯特瑞财富投资管理有限公司为本公司旗下部分基金代销机构的公告	证券时报等	2016-11-17
29	金鹰基金管理有限公司关于新增北京微动利投资管理有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务的公告	证券时报等	2016-11-22
30	金鹰基金管理有限公司关于新增北京蛋卷基金销售有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务的公告	证券时报等	2016-11-25
31	金鹰基金管理有限公司关于新增上海云湾投资管理有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务的公告	证券时报等	2016-11-29
32	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参	证券时报等	2016-11-29

	加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告		
33	金鹰基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金申购赎回下限及最低转换份额限制的公告	证券时报等	2016-12-06
34	金鹰基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金直销柜台申购赎回下限及最低转换份额限制的公告	证券时报等	2016-12-07
35	金鹰基金管理有限公司关于增加上海好买基金销售有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务的公告	证券时报等	2016-12-08
36	金鹰基金管理有限公司关于新增北京唐鼎耀华投资咨询有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务的公告	证券时报等	2016-12-08
37	金鹰基金管理有限公司关于新增北京创金启富投资管理有限公司为代销机构并代销旗下部分基金的公告	证券时报等	2016-12-09
38	金鹰基金管理有限公司关于增加北京新浪仓石基金销售有限公司为本公司旗下部分基金代销机构的公告	证券时报等	2016-12-12
39	金鹰基金管理有限公司关于新增南京途牛金融信息服务有限公司为本公司旗下部分基金代销机构的公告	证券时报等	2016-12-21
40	金鹰基金管理有限公司关于新增南京苏宁基金销售有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换业务的公告	证券时报等	2016-12-22
41	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	证券时报等	2016-12-22
42	金鹰基金管理有限公司关于增加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、定投业务的公告	证券时报等	2016-12-23
43	金鹰基金管理有限公司关于新增中证金牛（北京）投资咨询有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务的公告	证券时报等	2016-12-28
44	金鹰基金管理有限公司关于新增河南和信证券投资顾问股份有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务的公告	证券时报等	2016-12-28
45	金鹰基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新已过期身份证件的公告	证券时报等	2016-12-28
46	金鹰基金管理有限公司关于调整开户证件类	证券时报等	2016-12-29

	型的再次提示公告		
47	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金参加中国工商银行“2017 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	证券时报等	2016-12-29
48	金鹰基金管理有限公司关于新增杭州科地瑞富基金销售有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务的公告	证券时报等	2016-12-29
49	金鹰基金管理有限公司关于新增浙江金观诚财富管理有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务的公告	证券时报等	2016-12-29
50	金鹰基金管理有限公司关于提醒投资者谨防虚假客服电话、防范金融诈骗的提示性公告	证券时报等	2016-12-30
51	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金参加中国光大银行股份有限公司费率优惠活动的公告	证券时报等	2016-12-30

注：相关信息披露文件请登录本基金管理人网站查询。

### 11.9 其他重大事件（转型前）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于指数熔断期间场内基金申购赎回业务安排的公告	证券时报等	2016-01-04
2	金鹰基金管理有限公司关于指数熔断实施后调整旗下基金开放时间的公告	证券时报等	2016-01-04
3	金鹰中证 500 指数分级证券投资基金定期份额折算期间金鹰中证 500A 份额停复牌的公告	证券时报等	2016-01-05
4	关于金鹰中证 500 指数分级证券投资基金之金鹰中证 500A 份额第五个运作周年约定年基准收益率的公告	证券时报等	2016-01-06
5	金鹰中证 500A 定期份额折算后前收盘价调整的公告	证券时报等	2016-01-06
6	金鹰中证 500 指数分级证券投资基金定期份额折算结果公告	证券时报等	2016-01-06
7	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与深圳市新兰德证券投资咨询有限公司费率优惠活动的公告	证券时报等	2016-01-06
8	金鹰基金管理有限公司关于指数熔断实施后调整旗下基金开放时间的公告	证券时报等	2016-01-07
9	金鹰基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新已过期身份证件的公告	证券时报等	2016-01-08
10	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京钱景财富投资管理有限公司费率优惠	证券时报等	2016-01-13

	并开通定投业务的公告		
11	金鹰中证 500 指数分级基金更新招募说明书摘要 2015 年第 2 号	证券时报等	2016-01-16
12	金鹰基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新已过期身份证件的公告	证券时报等	2016-01-18
13	关于金鹰基金新增东兴证券为代销机构并开通转换的公告	证券时报等	2016-01-19
14	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金参加包商银行股份有限公司费率优惠活动的公告	证券时报等	2016-01-19
15	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与申万宏源费率优惠活动的公告	证券时报等	2016-01-19
16	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠的公告	证券时报等	2016-01-20
17	金鹰中证 500 指数分级证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	证券时报等	2016-01-21
18	关于安信证券新增为我司旗下部分基金的代销机构并开通基金定投、转换及参与费率优惠活动的公告	证券时报等	2016-01-26
19	金鹰基金管理有限公司关于增加上海凯石财富基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	证券时报等	2016-01-28
20	金鹰基金管理有限公司关于增加华金证券股份有限公司为代销机构的公告	证券时报等	2016-01-28
21	金鹰基金管理有限公司关于直销渠道转换费率优惠活动的公告	证券时报等	2016-01-28
22	关于金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增钱景财富为代销机构并开通基金定投及参与费率优惠活动的公告	证券时报等	2016-01-29
23	关于金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增金元证券为代销机构并开通基金转换业务的公告	证券时报等	2016-02-02
24	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与平安证券定投及费率优惠活动的公告	证券时报等	2016-02-17
25	金鹰基金管理有限公司关于新增上海证券为旗下部分基金代销机构的公告	证券时报等	2016-02-23
26	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京恒宇天泽投资管理有限公司为代销机构并开通定投、转换业务的公告	证券时报等	2016-03-01
27	关于金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增广发证券股份有限公司为代销机构并开通费率优惠、定投及转换业务的公告	证券时报等	2016-03-04
28	金鹰基金管理有限公司关于新增渤海证券为代销机构并开通转换业务的公告	证券时报等	2016-03-08

29	金鹰基金管理有限公司关于暂停旗下部分基金参与北京君德汇富投资咨询有限公司费率优惠活动的公告	证券时报等	2016-03-08
30	金鹰基金管理有限公司关于在顺德农商行开通旗下部分基金转换业务的公告	证券时报等	2016-03-11
31	金鹰基金管理有限公司关于增加上海中正达广投资管理有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	证券时报等	2016-03-15
32	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中航证券为代销机构并开通转换业务的公告	证券时报等	2016-03-15
33	金鹰基金管理有限公司关于增加中国邮政储蓄银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构及开通基金定投和转换业务的公告	证券时报等	2016-03-17
34	金鹰基金管理有限公司关于增加中经北证(北京)资产管理有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定投、转换业务及费率优惠的公告	证券时报等	2016-03-23
35	金鹰基金管理有限公司关于中国邮政储蓄银行股份有限公司代销旗下部分基金定投费率优惠的公告	证券时报等	2016-03-23
36	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中信建投证券股份有限公司费率优惠活动并开通定投、转换业务的公告	证券时报等	2016-03-25
37	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京钱景财富投资管理有限公司为代销机构并参与费率优惠的公告	证券时报等	2016-03-25
38	金鹰基金管理有限公司关于大同证券有限责任公司代理销售旗下部分基金并开通定投及转换业务的公告	证券时报等	2016-03-30
39	金鹰基金管理有限公司关于新增华融证券股份有限公司为代销机构并开通费率优惠、定投及转换业务的公告	证券时报等	2016-03-30
40	【年报】金鹰中证 500 指数分级证券投资基金 2015 年年度报告（摘要）	证券时报等	2016-03-30
41	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金参加中国工商银行股份有限公司费率优惠活动的公告	证券时报等	2016-04-01
42	金鹰中证 500 指数分级证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	证券时报等	2016-04-20
43	金鹰基金管理有限公司 关于旗下基金参与深圳市新兰德证券投资咨询有限公司费率优惠活动的公告	证券时报等	2016-04-23
44	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京晟视天下投资管理有限公司为代销机	证券时报等	2016-04-23

	构并开通转换业务的公告		
45	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增珠海盈米财富管理有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	证券时报等	2016-04-28
46	关于金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增开源证券股份有限公司为代销机构并开通定投、转换业务的公告	证券时报等	2016-04-29
47	金鹰基金管理有限公司关于直销渠道转换费率优惠活动的公告	证券时报等	2016-05-03
48	金鹰基金管理有限公司关于增加上海攀赢金融信息服务有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	证券时报等	2016-05-05
49	金鹰基金管理有限公司关于网上交易关闭支付宝服务的公告	证券时报等	2016-05-05
50	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增首创证券有限责任公司为代销机构并开通定投及转换业务的公告	证券时报等	2016-05-06
51	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京懒猫金融信息服务有限公司为代销机构的公告	证券时报等	2016-05-10
52	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国光大银行股份有限公司开通定投及转换业务的公告	证券时报等	2016-05-11
53	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加民生银行直销银行费率优惠活动的公告	证券时报等	2016-05-13
54	金鹰基金管理有限公司关于以通讯方式召开金鹰中证 500 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告	证券时报等	2016-05-18
55	金鹰基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新已过期身份证件的公告	证券时报等	2016-05-19
56	金鹰基金管理有限公司关于以通讯方式召开金鹰中证 500 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	证券时报等	2016-05-24
57	金鹰基金管理有限公司关于以通讯方式召开金鹰中证 500 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	证券时报等	2016-05-25
58	金鹰基金管理有限公司关于增加招商银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定投和转换业务的公告	证券时报等	2016-05-25
59	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金费率优惠活动的公告	证券时报等	2016-05-27
60	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增深圳市金斧子投资咨询有限公司为代销机构并开通定投以及参加其费率优惠活动的公	证券时报等	2016-06-02

	告		
61	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国中投证券有限责任公司为代销机构并开通定投及转换业务的公告	证券时报等	2016-06-07
62	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中信证券(山东)有限责任公司为代销机构的公告	证券时报等	2016-06-15
63	金鹰基金管理有限公司关于调整开户证件类型公告	证券时报等	2016-06-16
64	金鹰基金管理有限公司关于中国工商银行股份有限公司代销旗下部分基金开通定投并进行定投费率优惠的公告	证券时报等	2016-06-21
65	金鹰基金管理有限公司关于变更分红方式业务规则的公告	证券时报等	2016-06-23
66	金鹰基金管理有限公司关于金鹰中证 500 指数分级证券投资基金基金经理变更公告	证券时报等	2016-06-25
67	金鹰基金管理有限公司关于金鹰中证 500 指数分级证券投资基金停复牌的提示性公告	证券时报等	2016-06-28
68	金鹰中证 500 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	证券时报等	2016-06-29
69	关于金鹰中证 500 指数分级证券投资基金实施转型的提示性公告	证券时报等	2016-06-29
70	金鹰基金管理有限公司关于增加武汉市伯嘉基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	证券时报等	2016-07-06
71	金鹰中证 500 指数分级基金更新招募说明书摘要 2016 年第 1 号	证券时报等	2016-07-14
72	金鹰基金管理有限公司关于增加和耕传承基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	证券时报等	2016-07-15
73	金鹰中证 500 指数分级证券投资基金 2016 年第 2 季度报告	证券时报等	2016-07-21
74	金鹰基金管理有限公司关于增加乾道金融信息服务(北京)有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	证券时报等	2016-07-22
75	金鹰基金管理有限公司关于增加南充市商业银行股份有限公司 为旗下部分基金代销机构并开通定投和转换业务的公告	证券时报等	2016-07-22
76	金鹰基金管理有限公司关于新增泰诚财富基金销售(大连)有限公司为我司旗下部分基金代销机构的公告	证券时报等	2016-07-25
77	金鹰基金管理有限公司关于招商证券股份有限公司开通金鹰旗下部分基金定投及转换业务的公告	证券时报等	2016-08-04

78	金鹰基金管理有限公司关于新增上海基煜基金销售有限公司为本公司旗下基金代销机构的公告	证券时报等	2016-08-16
79	金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）基金合同	证券时报等	2016-08-18
80	金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）招募说明书	证券时报等	2016-08-18
81	金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）托管协议	证券时报等	2016-08-18
82	关于金鹰中证 500 指数分级证券投资基金暂停申购赎回等相关业务的公告	证券时报等	2016-08-18
83	金鹰中证 500 指数分级证券投资基金之金鹰 500A 份额、金鹰 500B 份额终止上市及后续事项公告	证券时报等	2016-08-18

注：相关信息披露文件请登录本基金管理人网站查询。

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

无

金鹰基金管理有限公司

二〇一七年三月二十九日