# 金鹰持久增利债券型证券投资基金(LOF) 2018年半年度报告摘要

2018年6月30日
基金管理人：金鹰基金管理有限公司
基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一八年八月二十五日

## 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。本半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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年8月24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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至6月30日止。

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 金鹰持久增利债券 | |
| 基金主代码 | 162105 | |
| 交易代码 | 162105 | |
| 基金运作方式 | 契约型 | |
| 基金合同生效日 | 2015年3月10日 | |
| 基金管理人 | 金鹰基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国邮政储蓄银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 49,986,237.15份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 金鹰持久增利债券(LOF)C | 金鹰持久增利债券(LOF)E |
| 下属分级基金的交易代码 | 162105 | 004267 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 49,972,482.97份 | 13,754.18份 |

注：本基金于2017年1月20日增加E类份额。

### 2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 在严格控制投资风险的前提下，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金借鉴投资时钟的分析框架，结合国内外政治经济环境、政策形势、未来利率的变化趋势、股票市场估值状况与未来可能的运行区间，确定债券类、权益类、货币类资产配置比例的目标区间。<br>本基金对固定收益类品种的投资比例不低于基金资产净值的80%；对股票、权证等其它金融工具的投资比例不超过基金资产净值的20%，其中，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 | 基金合同生效之日起3年内：中国债券综合指数(财富)增长率<br>基金合同生效后3年期届满：中国债券综合指数(财富)增长率×95%+沪深300指数增长率×5%。 |
| 风险收益特征 | 本基金转型为上市开放式基金(LOF)，为积极配置的债券型基金，属于证券投资基金当中风险较低的品种，其长期平均风险与预期收益率低于股票型基金、混合型基金，但高于货币市场基金。 |

注：本基金于2017年1月20日增加E类份额。

### 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 | 中国邮政储蓄银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 李云亮 | 田东辉 |
| | 联系电话 | 010-59944986 | 010-68858113 |
| | 电子邮箱 | csmail@gefund.com.cn | tiandonghui@psbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 4006135888,020-83936180 | 95580 |
| 传真 | | 020-83282856 | 010-68858120 |

### 2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金半年度报告摘要的管理人互联网网址 | http://www.gefund.com.cn |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人及基金托管人住所 |

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 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 | 报告期(2018年1月1日至2018年6月30日) | |
|---|---|---|
| | 金鹰持久增利债券(LOF)C | 金鹰持久增利债券(LOF)E |
| 本期已实现收益 | -1,423,100.52 | -136.14 |
| 本期利润 | -979,669.09 | -362.85 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0194 | -0.0484 |
| 本期基金份额净值增长率 | -1.90% | -1.58% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2018年6月30日) | |
| | 金鹰持久增利债券(LOF)C | 金鹰持久增利债券(LOF)E |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.3008 | 0.0371 |
| 期末基金资产净值 | 51,518,810.78 | 14,264.26 |
| 期末基金份额净值 | 1.0309 | 1.0371 |

注：1、本基金于2017年1月20日公告增加E份额。

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

金鹰持久增利债券(LOF)C

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | -2.02% | 0.38% | 0.19% | 0.08% | -2.21% | 0.30% |
| 过去三个月 | -2.70% | 0.31% | 1.34% | 0.11% | -4.04% | 0.20% |
| 过去六个月 | -1.90% | 0.33% | 3.00% | 0.09% | -4.90% | 0.24% |
| 过去一年 | -3.61% | 0.27% | 3.86% | 0.07% | -7.47% | 0.20% |
| 过去三年 | -0.48% | 0.24% | 9.75% | 0.11% | -10.23% | 0.13% |
| 自基金合同生效起至今 | 3.09% | 0.26% | 12.83% | 0.11% | -9.74% | 0.15% |

金鹰持久增利债券(LOF)E

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | -1.97% | 0.38% | 0.19% | 0.08% | -2.16% | 0.30% |
| 过去三个月 | -2.57% | 0.31% | 1.34% | 0.11% | -3.91% | 0.20% |
| 过去六个月 | -1.58% | 0.33% | 3.00% | 0.09% | -4.58% | 0.24% |
| 自基金合同生效起至今 | -5.02% | 0.28% | 3.42% | 0.08% | -8.44% | 0.20% |

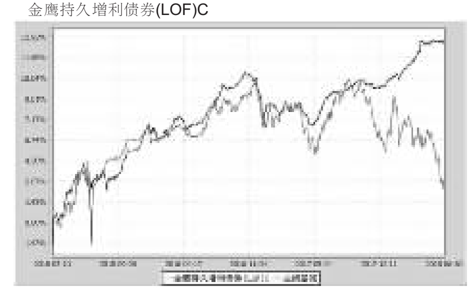
注：金鹰持久增利E类份额于2017年1月20日新增，自2017年8月3日起有申购资金进入。

本基金业绩比较基准为：中国债券综合指数(财富)增长率×95%+沪深300指数增长率×5%。

3.2.2 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

金鹰持久增利债券型证券投资基金(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
(2015年3月10日至2018年6月30日)

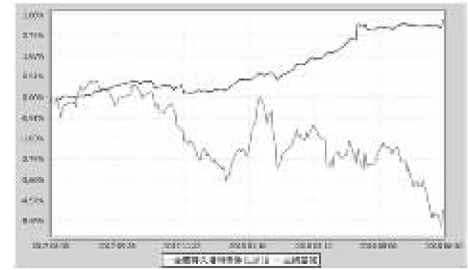
金鹰持久增利债券(LOF)C



注：1、截至本报告期末，本基金的各项投资比例已符合基金合同约定。

2、本基金业绩比较基准为：中国债券综合指数(财富)增长率×95%+沪深300指数增长率×5%。

金鹰持久增利债券(LOF)E



注：金鹰持久增利E类份额于2017年1月20日新增，自2017年8月3日起有申购资金进入。

## 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5.102亿元人民币。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月设立全资子公司广州金鹰资产管理有限公司。近年来，公司秉承"以人为本、互信协作；创新谋变、挑战超越"的核心价值观，始终追求以更高的标准为投资者提供专业、贴心的财富管理服务，获得了越来越多投资者的认可。

截至2018年6月30日，公司下设17个一级职能部门及北京、广州、上海、深圳、成都共五个分公司，旗下公募基金42只，管理资产规模476.38亿元。

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 | 2016-03-12 | 2018-07-11 | 11 | 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)、金鹰科技创新股票型证券投资基金基金经理。 |
| 林龙军 | 基金经理 | 2018-05-17 | - | 10 | 林龙军先生，曾任兴全基金管理有限公司产品经理、研究员、基金经理助理、投资经理兼固收投委会委员等职务。2018年3月加入金鹰基金管理有限公司，现任金鹰持久增利债券型证券投资基金(LOF)、金鹰民丰回报定期开放混合型证券投资基金、金鹰添裕纯债债券型证券投资基金、金鹰鑫益灵活配置混合型证券投资基金、金鹰元安混合型证券投资基金、金鹰元丰债券型证券投资基金、金鹰元祺信用债债券型证券投资基金基金经理。 |
| 戴骏 | 基金经理 | 2016-10-22 | 2018-07-07 | 7 | 戴骏先生，美国密歇根大学金融工程硕士研究生，历任国泰基金管理有限公司基金经理助理、东兴证券股份有限公司债券交易员等职务，2016年7月加入金鹰基金管理有限公司，现任金鹰元禧混合型证券投资基金、金鹰添瑞中短债债券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《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、基金合同的规定，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，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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年的政策面组合可以归结为"紧货币、严监管、宽信贷"，在2018年上半年这三个方面都发生了明显变化：货币边际放松、监管日渐落地、信贷自发收缩。映射到资本市场表现为，利率品在上半年震荡走好，权益市场震荡走低。这期间有贸易战带来的巨大外部扰动，但核心还是在于国内市场货币与信用之间的淤塞。从全社会资产负债表的维度，如果在去杠杆的大背景下，我们短时间很难找到加杠杆的主体，反而是在本轮去杠杆中，一个不好的现象在发生，无效杠杆没去掉，一些仍具备活力的融资主体被挤掉。反映到股票层面是股权质押的负反馈，反映到债券层面是民企融资的举步维艰。庆幸的是，尽管政策腾挪的空间有限，但我们也看到事情正在发生一些改变。

本组合在上半年坚守绝对收益的基本思路，同时追求较大波动前提下的更高回报，整个运作期保持较高的权益仓位，通过精选股票增强预期回报。同时从当期的表现来看，组合净值呈现出较大的波动特性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2018年6月30日，本基金C份额净值1.0309元，本报告期份额净值增长-1.90%，同期业绩比较基准增长率为3.00%；E份额净值1.0371，本报告期份额净值增长-1.58%，同期业绩比较基准增长率为3.00%。

### 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下半年，我们需要紧密关注两大主要矛盾的变化，内部信用派生，外部贸易纷争。融资需求的持续下滑，已经逐渐反馈到经济层面，而汇率的大幅度波动也会改变当前资产定价的方式。从积极的角度看，我们看到财政在发力，而去杠杆、严监管的局面在发生微调，我们倾向于在下半年能看到权益市场的底部，而债券市场无疑仍处在相对舒适的阶段，对于当期绝对收益的实现我们仍有把握。

### 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实施利润分配。

### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内无应当说明的预警事项。

## 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国邮政储蓄银行股份有限公司(以下称"本托管人")在金鹰持久增利债券型证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## 6 半年度财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：金鹰持久增利债券型证券投资基金(LOF)
报告截止日：2018年6月30日

单位：人民币元

| 资产 | 本期末 2018年6月30日 | 上年度末 2017年12月31日 |
|---|---|---|
| 资产： | - | - |
| 银行存款 | 274,523.24 | 186,412.50 |
| 结算备付金 | 186,696.95 | 283,810.34 |
| 存出保证金 | 22,147.94 | 16,688.75 |
| 交易性金融资产 | 54,172,103.67 | 54,991,841.06 |
| 其中：股票投资 | 4,837,635.00 | 10,666,165.70 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 49,334,468.67 | 44,325,675.36 |
| 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 | - | - |
| 应收利息 | 455,901.72 | 478,775.22 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | - | 9,999.54 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 55,111,373.52 | 55,967,527.41 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2018年6月30日 | 上年度末 2017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 | 3,000,000.00 | 1,600,000.00 |
| 应付证券清算款 | - | 6,562.24 |
| 应付赎回款 | - | 61,420.23 |
| 应付管理人报酬 | 29,884.46 | 32,301.65 |
| 应付托管费 | 8,538.42 | 9,229.05 |
| 应付销售服务费 | 14,942.22 | 16,150.85 |
| 应付交易费用 | 25,721.08 | 14,447.28 |
| 应交税费 | 1,622.44 | - |
| 应付利息 | 1,786.47 | -2,347.11 |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 495,803.39 | 456,921.71 |
| 负债合计 | 3,578,298.48 | 2,194,685.90 |
| 所有者权益： | - | - |
| 实收基金 | 36,500,546.41 | 37,362,834.51 |
| 未分配利润 | 15,032,528.63 | 16,410,007.00 |
| 所有者权益合计 | 51,533,075.04 | 53,772,841.51 |
| 负债和所有者权益总计 | 55,111,373.52 | 55,967,527.41 |

注：1、截至本报告期末2018年6月30日，本基金C类基金份额净值为1.0309元，C类基金份额为49,972,482.97份；本基金E类基金份额净值为1.0371元，E类基金份额为13,754.18份。

2、本基金于2017年1月20日公告增加E类基金份额。

### 6.2 利润表

会计主体：金鹰持久增利债券型证券投资基金(LOF)
本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | -338,577.99 | 879,209.01 |
| 1.利息收入 | | 732,558.17 | 975,862.22 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.10 | 6,775.31 | 15,395.90 |
| 债券利息收入 | | 724,069.85 | 734,197.65 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 1,713.01 | 226,268.67 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | | -1,514,428.63 | 1,266.23 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.11 | -1,870,190.66 | -116,606.23 |
| 基金投资收益 | 6.4.7.12 | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | 281,876.93 | 10,694.57 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.16 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.17 | 73,885.10 | 107,177.89 |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | 6.4.7.18 | 443,204.72 | -98,461.31 |
| 4.汇兑收益(损失以"—"号填列) | | - | - |
| 5.其他收入(损失以"-"号填列) | 6.4.7.19 | 87.75 | 541.87 |
| 减：二、费用 | | 641,453.95 | 832,474.23 |
| 1. 管理人报酬 | | 185,466.12 | 196,586.42 |
| 2. 托管费 | | 52,990.28 | 56,167.54 |
| 3. 销售服务费 | | 92,733.07 | 98,293.22 |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.20 | 103,466.65 | 121,488.34 |
| 5. 利息支出 | | 52,716.68 | 234,524.28 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 52,716.68 | 234,524.28 |
| 6. 税金及附加 | | 1,393.64 | - |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.21 | 152,687.51 | 125,414.43 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | | -980,031.94 | 46,734.78 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | | -980,031.94 | 46,734.78 |

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：金鹰持久增利债券型证券投资基金(LOF)
本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30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) | 37,362,834.51 | 16,410,007.00 | 53,772,841.51 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -980,031.94 | -980,031.94 |
| 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) | -862,288.10 | -397,446.43 | -1,259,734.53 |
| 其中：1.基金申购款 | 112,701.90 | 42,936.09 | 155,637.99 |
| 2.基金赎回款 | -974,990.00 | -440,382.52 | -1,415,372.52 |
| 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) | 36,500,546.41 | 15,032,528.63 | 51,533,075.04 |
| 项目 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30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) | 31,342,154.96 | 14,572,110.44 | 45,914,265.40 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 46,734.78 | 46,734.78 |
| 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) | 7,132,706.66 | 3,262,618.14 | 10,395,324.80 |
| 其中：1.基金申购款 | 11,579,081.93 | 5,369,743.90 | 16,948,825.83 |
| 2.基金赎回款 | -4,446,375.27 | -2,107,125.76 | -6,553,501.03 |
| 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) | 38,474,861.62 | 17,881,463.36 | 56,356,324.98 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4，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

### 6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

金鹰持久回报分级债券型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证监会证监许可【2012】111号文核准《关于核准金鹰持久回报分级债券型证券投资基金募集的批复》批准募集，于2012年3月9日正式成立。本基金为契约型，存续期限不定。本基金的基金管理人为金鹰基金管理有限公司，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。根据本基金合同规定，本基金于3年期届满日2015年3月9日转型为上市开放式基金(LOF)。

6.4.2 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。

6.4.3 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的要求，真实、完整地反映了本基金于2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018年6月30日的经营成果和净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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

本基金本报告期内所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

1、印花税

根据财政部、国家税务总局财税字[2007]84号文《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》的规定，自2007年5月30日起，调整证券(股票)交易印花税税率，由原先的1‰调整为3‰；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税；

经国务院批准，根据财政部、国家税务总局《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》的规定，自2008年4月24日起，调整证券(股票)交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，证券(股票)交易印花税调整为单边征税，由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

2、营业税、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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

经本基金管理人2016年第三次临时股东会审议通过，并经中国证券监督管理委员会批复核准(证监许可[2017]2135)，本基金管理人原股东美的集团股份有限公司、东亚联丰投资管理有限公司分别将其持有的本基金管理人20%和11%股权转让给东旭集团有限公司。本次股权转让后，本基金管理人股权结构变更为：东旭集团有限公司66.19%，广州证券股份有限公司24.01%，广州白云山医药集团股份有限公司9.80%。本基金管理人已完成股权变更事项的工商变更登记。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 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 |
| 金鹰基金管理有限公司 | 基金管理人、销售机构 |
| 中国邮政储蓄银行股份有限公司 | 基金托管人 |

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30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 | 66,410,130.53 | 100.00% | 80,889,875.11 | 100.00% |

6.4.8.1.2 权证交易

本基金报告期内及上年度可比期间内均未通过关联方进行权证交易。

6.4.8.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 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 | 82,934,888.31 | 100.00% | 28,865,664.40 | 100.00% |

6.4.8.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 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 | 266,400,000.00 | 100.00% | 1,003,810,000.00 | 100.00% |

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30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 | 60,519.23 | 100.00% | 25,721.08 | 100.00% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30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 | 73,714.96 | 100.00% | 35,520.18 | 100.00% |

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除中国证券登记结算公司收取的证管费、经手费和使用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

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等。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 185,466.12 | 196,586.42 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 12,673.28 | 19,020.46 |

注：在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值0.70%的年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年管理费率÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至法定节假日、公休日结束之日起3个工作日内或不可抗力情形消除之日起3个工作日内支付。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 52,990.28 | 56,167.54 |

注：在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年托管费率÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，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，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至法定节假日、公休日结束之日起3个工作日内或不可抗力情形消除之日起3个工作日内支付。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | | |
|---|---|---|---|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 金鹰持久增利债券(LOF)C | 金鹰持久增利债券(LOF)E | 合计 |
| 中国邮政储蓄银行 | 9,016.52 | - | 9,016.52 |
| 金鹰基金管理有限公司 | 78,218.11 | - | 78,218.11 |
| 合计 | 87,234.63 | - | 87,234.63 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 金鹰持久增利债券(LOF)C | 金鹰持久增利债券(LOF)E | 合计 |
| 金鹰基金管理有限公司 | 76,527.70 | - | 76,527.70 |
| 中国邮政储蓄银行 | 12,692.39 | - | 12,692.39 |
| 广州证券股份有限公司 | - | - | - |
| 合计 | 89,220.09 | - | 89,220.09 |

注：本基金E类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额销售服务费按前一日的基金资产净值的0.35%的年费率逐日计提。基金销售服务费的计算方法如下：

H＝E×年销售服务费率÷当年天数
H为每日应计提的基金销售服务费
E为C类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中划出，由基金管理人按相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至法定节假日、公休日结束之日起3个工作日内或不可抗力情形消除之日起3个工作日内支付。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 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

金鹰持久增利债券(LOF)C
除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。、
金鹰持久增利债券(LOF)E
除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.8.5 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 2018年1月1日至2018年6月30日 | | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国邮政储蓄银行股份有限公司 | 274,523.24 | 3,378.21 | 216,352.01 | 9,428.73 |

注：本基金用于证券交易结算的资金通过"中国邮政储蓄银行基金托管结算资金专用存款账户"转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率或约定利率计息，在资产负债表中的"结算备付金"科目中单独列示。2018年6月30日余额186,696.95元，利息收入3,243.98元；2017年6月30日余额1,247,583.25元，利息收入5,793.60元。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 002051 | 中工国际 | 2018-04-09 | 重大事项停牌 | 15.27 | - | - | 14,000.00 | 231,034.00 | 213,780.00 | 重大事项 |
| 300118 | 东方日升 | 2018-05-07 | 重大事项停牌 | 9.45 | - | - | 14,500.00 | 163,806.00 | 137,025.00 | 重大事项 |

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末交易所市场债券正回购资产余额为3,000,000.00元，以交易所标准券作为质押券。

6.4.10 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)，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，相关债券的公允价值属第二层次。

除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## 7 投资组合报告

### 7.1 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 | 4,837,635.00 | 8.78 |
| | 其中：股票 | 4,837,635.00 | 8.78 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 49,334,468.67 | 89.52 |
| | 其中：债券 | 49,334,468.67 | 89.52 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 461,220.19 | 0.84 |
| 8 | 其他各项资产 | 478,049.66 | 0.87 |
| 9 | 合计 | 55,111,373.52 | 100.00 |

### 7.2 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 | 438,680.00 | 0.85 |
| C | 制造业 | 2,638,240.00 | 5.12 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 213,780.00 | 0.41 |
| F | 批发和零售业 | 439,140.00 | 0.85 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | 544,899.00 | 1.06 |
| K | 房地产业 | 366,000.00 | 0.71 |
| 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 | 196,896.00 | 0.38 |
| 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 | 4,837,635.00 | 9.39 |

### 7.3 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 | 000651 | 格力电器 | 10,000 | 471,500.00 | 0.91 |
| 2 | 603368 | 柳药股份 | 13,000 | 439,140.00 | 0.85 |
| 3 | 601088 | 中国神华 | 22,000 | 438,680.00 | 0.85 |
| 4 | 000338 | 潍柴动力 | 50,000 | 437,500.00 | 0.85 |
| 5 | 600690 | 青岛海尔 | 22,000 | 423,720.00 | 0.82 |
| 6 | 600048 | 保利地产 | 30,000 | 366,000.00 | 0.71 |
| 7 | 601688 | 华泰证券 | 18,800 | 281,436.00 | 0.55 |
| 8 | 600030 | 中信证券 | 15,900 | 263,463.00 | 0.51 |
| 9 | 002051 | 中工国际 | 14,000 | 213,780.00 | 0.41 |
| 10 | 603369 | 今世缘 | 9,300 | 212,319.00 | 0.41 |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 601088 | 中国神华 | 1,103,697.00 | 2.05 |
| 2 | 002242 | 九阳股份 | 494,120.00 | 0.92 |
| 3 | 601688 | 华泰证券 | 493,325.00 | 0.92 |
| 4 | 000651 | 格力电器 | 485,800.00 | 0.90 |
| 5 | 600030 | 中信证券 | 465,310.00 | 0.87 |
| 6 | 600233 | 圆通速递 | 464,199.00 | 0.86 |
| 7 | 600690 | 青岛海尔 | 460,460.00 | 0.86 |
| 8 | 600581 | 八一钢铁 | 453,736.00 | 0.84 |
| 9 | 000338 | 潍柴动力 | 448,555.00 | 0.83 |
| 10 | 000065 | 北方国际 | 445,582.00 | 0.83 |
| 11 | 000070 | 特发信息 | 444,484.00 | 0.83 |
| 12 | 600643 | 爱建集团 | 433,225.62 | 0.81 |
| 13 | 603368 | 柳药股份 | 427,050.00 | 0.79 |
| 14 | 600048 | 保利地产 | 424,500.00 | 0.79 |
| 15 | 002468 | 申通快递 | 418,560.17 | 0.78 |
| 16 | 600477 | 杭萧钢构 | 397,587.00 | 0.74 |
| 17 | 600597 | 光明乳业 | 394,754.00 | 0.73 |
| 18 | 603919 | 金徽酒 | 392,033.21 | 0.73 |
| 19 | 600897 | 厦门空港 | 376,003.99 | 0.70 |
| 20 | 000968 | 蓝焰控股 | 369,774.00 | 0.69 |

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 601088 | 中国神华 | 819,676.00 | 1.52 |
| 2 | 600897 | 厦门空港 | 678,975.00 | 1.26 |
| 3 | 600919 | 江苏银行 | 595,767.00 | 1.11 |
| 4 | 600326 | 西藏天路 | 587,945.00 | 1.09 |
| 5 | 601997 | 贵阳银行 | 568,875.00 | 1.06 |
| 6 | 002615 | 哈尔斯 | 527,384.00 | 0.98 |
| 7 | 002705 | 新宝股份 | 514,205.00 | 0.96 |
| 8 | 601009 | 南京银行 | 506,513.20 | 0.94 |
| 9 | 002242 | 九阳股份 | 489,679.00 | 0.91 |
| 10 | 600093 | 易见股份 | 487,719.00 | 0.91 |
| 11 | 600233 | 圆通速递 | 459,112.00 | 0.85 |
| 12 | 000498 | 山东路桥 | 456,420.00 | 0.85 |
| 13 | 000828 | 东莞控股 | 451,170.00 | 0.84 |
| 14 | 600643 | 爱建集团 | 449,725.00 | 0.84 |
| 15 | 002100 | 天康生物 | 439,029.00 | 0.82 |
| 16 | 000070 | 特发信息 | 431,738.00 | 0.80 |
| 17 | 002468 | 申通快递 | 419,062.00 | 0.78 |
| 18 | 000065 | 北方国际 | 417,631.00 | 0.78 |
| 19 | 600581 | 八一钢铁 | 401,790.00 | 0.75 |
| 20 | 600477 | 杭萧钢构 | 398,163.00 | 0.74 |

7.4.3 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 | 31,038,341.23 |
| 卖出股票的收入(成交)总额 | 35,395,019.30 |

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 2,900,580.00 | 5.63 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 9,492,300.00 | 18.42 |
| | 其中：政策性金融债 | 9,492,300.00 | 18.42 |
| 4 | 企业债券 | 12,060,357.77 | 23.40 |
| 5 | 企业短期融资券 | 4,008,400.00 | 7.78 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | 20,872,830.90 | 40.50 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 49,334,468.67 | 95.73 |

### 7.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 018006 | 国开1702 | 60,000.00 | 5,979,000.00 | 11.60 |
| 2 | 143607 | 18国君G2 | 50,000.00 | 5,000,000.00 | 9.70 |
| 3 | 112196 | 13苏宁债 | 40,389.00 | 4,076,461.77 | 7.91 |
| 4 | 018005 | 国开1701 | 35,000.00 | 3,513,300.00 | 6.82 |
| 5 | 170017 | 17附息国债17 | 29,000.00 | 2,900,580.00 | 5.63 |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

### 7.8 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投资。

### 7.9 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投资。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

### 7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

本基金本报告期内未投资基金。

### 7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 本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。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 22,147.94 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 455,901.72 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 478,049.66 |

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 110040 | 生益转债 | 116,485.20 | 0.23 |
| 2 | 110041 | 蒙电转债 | 1,418,445.00 | 2.75 |
| 3 | 113015 | 隆基转债 | 1,979,809.60 | 3.84 |
| 4 | 127004 | 模塑转债 | 118,170.40 | 0.23 |
| 5 | 128016 | 雨虹转债 | 259,550.00 | 0.50 |
| 6 | 128024 | 宁行转债 | 2,824,470.00 | 5.48 |
| 7 | 128032 | 双环转债 | 1,583,918.00 | 3.07 |
| 8 | 132004 | 15国盛EB | 967,096.00 | 1.88 |
| 9 | 132006 | 16皖新EB | 695,730.00 | 1.35 |

7.13.5 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 | 002051 | 中工国际 | 213,780.00 | 0.41 | 重大事项 |

7.13.6 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。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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 |
| 金鹰持久增利债券(LOF)C | 513 | 97,412.25 | 42,421,243.68 | 84.89% | 7,551,239.29 | 15.11% |
| 金鹰持久增利债券(LOF)E | 8 | 1,719.27 | 0.00 | 0.00% | 13,754.18 | 100.00% |
| 合计 | 521 | 95,942.87 | 42,421,243.68 | 84.87% | 7,564,993.47 | 15.13% |

### 8.2 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 | 韩舒媛 | 103,600.00 | 24.77% |
| 2 | 中铁工程设计咨询集团有限公司企业年金计划－中国工商银行股份 | 71,951.00 | 17.21% |
| 3 | 太原市自来水公司企业年金计划－交通银行股份有限公司 | 58,946.00 | 14.10% |
| 4 | 中铁二院工程集团有限责任公司企业年金计划－中国工商银行股份 | 46,931.00 | 11.22% |
| 5 | 吕新国 | 21,000.00 | 5.02% |
| 6 | 龚完秀 | 19,345.00 | 4.63% |
| 7 | 张志赟 | 19,000.00 | 4.54% |
| 8 | 金挺 | 11,952.00 | 2.86% |
| 9 | 胡葛芳 | 9,535.00 | 2.28% |
| 10 | 兰世游 | 9,100.00 | 2.18% |

金鹰持久增利债券(LOF)C

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额(份) | 占上市总份额比例 |
|---|---|---|---|
| 1 | 韩舒媛 | 103,600.00 | 24.77% |
| 2 | 中铁工程设计咨询集团有限公司企业年金计划－中国工商银行股份 | 71,951.00 | 17.21% |
| 3 | 太原市自来水公司企业年金计划－交通银行股份有限公司 | 58,946.00 | 14.10% |
| 4 | 中铁二院工程集团有限责任公司企业年金计划－中国工商银行股份 | 46,931.00 | 11.22% |
| 5 | 吕新国 | 21,000.00 | 5.02% |
| 6 | 龚完秀 | 19,345.00 | 4.63% |
| 7 | 张志赟 | 19,000.00 | 4.54% |
| 8 | 金挺 | 11,952.00 | 2.86% |
| 9 | 胡葛芳 | 9,535.00 | 2.28% |
| 10 | 兰世游 | 9,100.00 | 2.18% |

注：一级是指金鹰持久增利债券LOF(162105)。

金鹰持久增利债券(LOF)E

指金鹰持久增利债券E类(004267)，该份额为非上市交易份额。

### 8.3 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 | 金鹰持久增利债券(LOF)C | - | - |
| | 金鹰持久增利债券(LOF)E | 920 | 0.07% |
| | 合计 | 920 | 0.00% |

### 8.4 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 | 金鹰持久增利债券(LOF)C | - |
| | 金鹰持久增利债券(LOF)E | - |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 金鹰持久增利债券(LOF)C | - |
| | 金鹰持久增利债券(LOF)E | - |
| | 合计 | 0 |

### 8.5 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 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 金鹰持久增利债券(LOF)C | 金鹰持久增利债券(LOF)E |
|---|---|---|
| 基金合同生效日(2015年3月10日)基金份额总额 | 488,462,429.13 | - |
| 本报告期期初基金份额总额 | 51,165,896.54 | 4,691.70 |
| 本报告期基金总申购份额 | 121,591.82 | 23,923.68 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 1,315,005.39 | 14,861.20 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 49,972,482.97 | 13,754.18 |

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会，无会议决议。

### 10.2 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

1、经本基金管理人第六届董事会第八次会议审议通过，报中国证券监督管理委员会广东监管局备案，并于2018年1月18日在证监会指定媒体披露，李兆廷先生自2018年1月15日起担任本基金管理人的董事长，凌富华先生不再担任本基金管理人的董事长。

2、本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金报告期内没有改变基金投资策略。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期未改聘会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 广州证券 | 2 | 66,410,130.53 | 100.00% | 60,519.23 | 100.00% | - |

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

(1)经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

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

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

本基金专用交易单位的选择程序如下：

(1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单位的证券经营机构。

(2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单位租用协议。

10.7.2 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 |
| 广州证券 | 82,896,805.81 | 100.00% | 266,400,000.00 | 100.00% | - | - |

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 2018年1月1日至2018年6月30日 | 41,607,124.68 | - | - | 41,607,124.68 | 83.24% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |

本基金在报告期内，存在报告期间单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情形，可能会存在以下风险：

1)基金净值大幅波动的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，因巨额赎回，份额净值小数保留位数与方式、管理费及托管费等费用计提等原因，可能会导致本基金份额净值出现大幅波动；

2)巨额赎回的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能触发本基金巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额；

3)流动性风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致基金的流动性风险；

4)基金提前终止、转型或与其他基金合并的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，可能导致本基金面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；

5)基金规模过小导致的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致基金规模过小，基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。

6)份额占比较高的投资者申购申请被拒绝的风险：当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金总份额的50%时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金总份额50%的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金总份额的50%，该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无影响投资者决策的其他重要信息。

金鹰基金管理有限公司
二〇一八年八月二十五日