金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF） 2016年年度报告摘要

（金鹰中证500指数分级证券投资基金）

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

§1 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	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、各行业内成分股权重的构成与分散程度、成分股流动性与风险信等因素的基础上，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。 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%；货币、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%。
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。从基金拆分的两级基金来看，金鹰500B具有较高风险、预期较高收益的特征。

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	本基金主要采用多种量化模型进行股票的选择。基于模型结果，基金管理人结合市场环境和股票特性，精选个股构建投资组合，以追求超越业绩比较基准表现的业绩水平。本基金采用的量化投资策略主要有：（1）多因子选股模型（2）事件驱动模型（3）行业轮动模型（4）评级反转策略 本基金投资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。 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。
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。

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	苏文臻	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		4006138888，020-83936180	95559
传真		020-83282856	021-62701216
注册地址		广东省珠海市古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		凌蓝华	牛锦明

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	http://www.gefund.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市天河区珠江东路28号越秀金融大厦30层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

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期间数据和指标	2016年1月1日-2016年8月24日	2015年末	2014年末
	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	-11,568,357.94	4,399,481.50
加权平均基金份额本期利润	-0.2617	-0.2562	0.2794
本期基金份额净值增长率	-13.61%	-2.21%	30.44%
3.1.1.2期末数据和指标	2016年8月24日	2015年末	2014年末
	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	-0.5560	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。

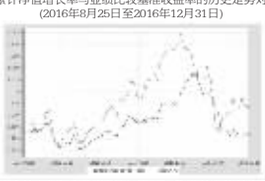
本基金转型后报告期末指 2016年8月25日至2016年12月31日。（下同）

3.2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

(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×80%＋中证全债指数收益率×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25亿元人民币。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、中新证券投资管理公司投资主办、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据策略研究员，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、金鹰添宜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、金鹰添益纯债债券型证券投资基金、金鹰添利纯债债券型证券投资基金基金经理。
伺晓春	-	2015-03-06	2016-06-25	17	伺晓春先生，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工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、金鹰信息产业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，由伺晓春先生、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，在伺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 管理人对投告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》和其他有关法律法规及其各项实施准则，严格遵守本基金的基金合同、托管协议、招募说明书等法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，基金运作合法合规，无出现重大违法违规或违反基金合同的行为，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度及相关执行情况

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，各投资组合投投资管理制度和流程独立决策，并在获利投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则，严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现。同时通过投资交易系统中的公平交易功能执行交易，以尽可能确保公平对待各投资组合。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（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投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投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性，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	-
资产总计		19,658,613.69	22,582,443.97
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
负债合计		369,664.30	702,308.98
所有者权益：		-	-
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
所有者权益合计		19,288,949.39	21,880,134.99
负债和所有者权益总计		19,658,613.69	22,582,443.97

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
一、收入		-5,504,472.76
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
减：二、费用		610,104.97
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
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-6,114,577.73
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-6,114,577.73

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。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。

7.1.4.2证券投资的编制基础

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。

7.1.4.4.4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。

处置股票时，按股权分置改革前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计于成交日结转。

(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