金鹰持久增利债券型证券投资基金(LOF)

2016 年半年度报告

2016 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：二〇一六年八月二十七日

1 重要提示及目录

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 2016 年 8 月 26 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
4 管理人报告 8
4.1 基金管理人及基金经理情况 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 9
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 9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 12
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 12
5 托管人报告 12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 12
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 12
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 12
6 半年度财务会计报告（未经审计） 13
6.1 资产负债表 13
6.2 利润表 14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 15
6.4 报表附注 16
7 投资组合报告 42
7.1 期末基金资产组合情况 42
7.2 期末按行业分类的股票投资组合 43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 47
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 48
7.7 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 48
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 48
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 48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 48
7.12 投资组合报告附注 49
8 基金份额持有人信息 49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 49

8.2 期末上市基金前十名持有人 50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 51
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 51
9 开放式基金份额变动 51
10 重大事件揭示 51
10.1 基金份额持有人大会决议 51
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 51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 51
10.4 基金投资策略的改变 52
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况 52
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 52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 52
10.8 其他重大事件 53
11 影响投资者决策的其他重要信息 55
12 备查文件目录 55
12.1 备查文件目录 55
12.2 存放地点 55
12.3 查阅方式 55

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	金鹰持久增利债券型证券投资基金(LOF)
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	30,578,712.20 份
基金合同存续期	不定期

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。 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 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。

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	苏文锋	田东辉
	联系电话	020-83282627	010-6885811
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	tiandonghui@psbcoa.com.cn

客户服务电话	4006135888,020-83936180	95580
传真	020-83282856	010-68858120
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	北京市西城区金融大街3号
办公地址	广东省广州市天河区珠江新城珠江东路28号越秀金融大厦30层	北京市西城区金融大街3号A座
邮政编码	510623	100808
法定代表人	凌富华	李国华

2.4 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》
登载基金半年度报告正文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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区太平大街 17 号

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（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）**
本期已实现收益	955,644.11
本期利润	-16,024.61
加权平均基金份额本期利润	-0.0004
本期加权平均净值利润率	-0.04%
本期基金份额净值增长率	0.32%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2016 年 6 月 30 日)**
期末可供分配利润	10,079,192.81
期末可供分配基金份额利润	0.3296
期末基金资产净值	32,737,400.23
期末基金份额净值	1.0706
3.1.3 累计期末指标	**报告期末(2016 年 6 月 30 日)**
基金份额累计净值增长率	7.06%

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

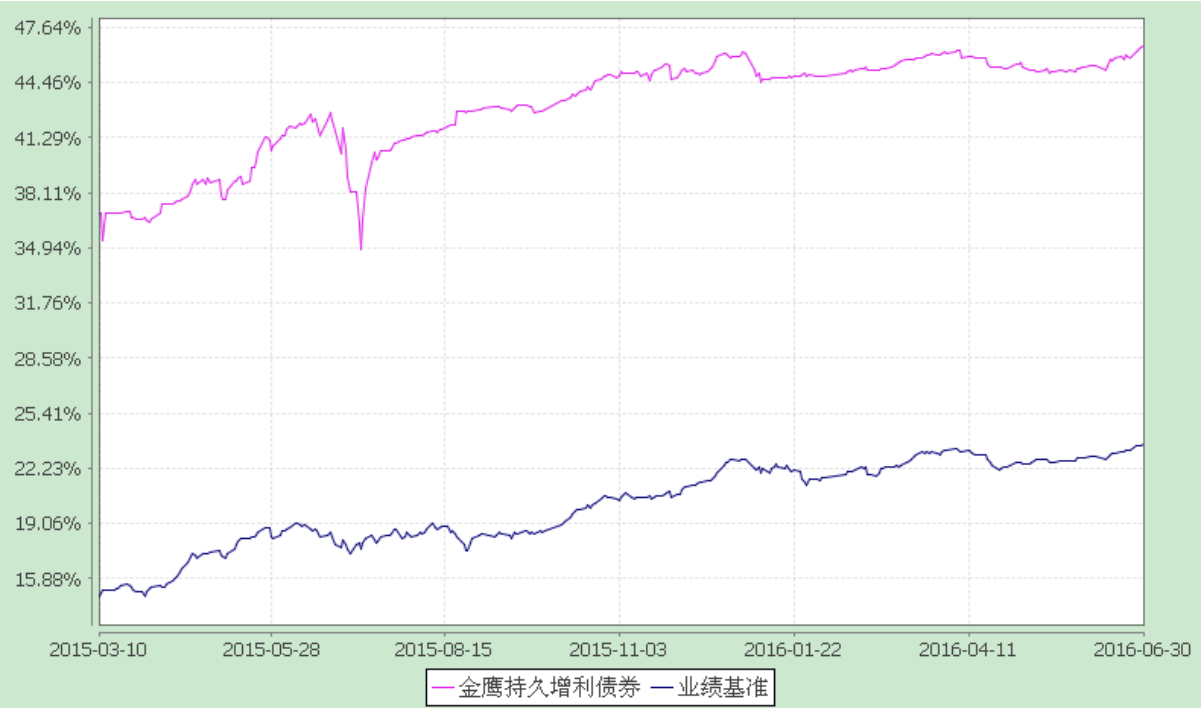
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	0.90%	0.12%	0.63%	0.06%	0.27%	0.06%
过去三个月	0.28%	0.10%	0.32%	0.08%	-0.04%	0.02%
过去六个月	0.32%	0.11%	0.74%	0.11%	-0.42%	0.00%
过去一年	3.35%	0.23%	4.70%	0.13%	-1.35%	0.10%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	7.06%	0.26%	7.60%	0.14%	-0.54%	0.12%

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 2016 年 6 月 30 日）



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%。

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 6 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 6 月末，公司旗下管理公募基金 24 只以及特定客户资产管理业务，资产管理总规模 939 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		
李涛	固定收益部副总监、基金经理	2015-01-09	-	11	李涛先生，北京大学金融学硕士，证券从业经历 11 年。历任光大银行总行资金部货币市场自营投资业务主管、中银国际证券研究部宏观研究员、广州证券资产管理总部投研总监。2014 年 11 月加入金鹰基金管理有限公司，现任固定收益部副总监职务。现任金鹰保本混合型证券投资基金、金鹰持久增利债券型（LOF）证券投资基金、金鹰元安保本混合型证券投资基金、金鹰元丰保本混合型证券投资基金、金鹰灵活配置混合型证券投资基金、金鹰元祺保本混合型证券投资基金基金经理。
黄艳芳	基金经理	2016-03-12	-	9	黄艳芳女士，清华大学硕士研究生，证券从业经历 9 年。历任天相投资顾问有限公司分析师，中航证券资产管理分公司投资主办，量化投资负责人，广州证券股份有限公

					司资产管理部投资主办。2015 年 5 月加入金鹰基金管理有限公司，任指数及量化投资部数量策略研究员，现任金鹰中证 500 指数分级证券投资基金及金鹰持久增利债券型证券投资基金（LOF）基金经理。

注：1、任职日期和离任日期指公司公告聘任或解聘日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会《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

2016 年上半年债券市场走势分为三个阶段。在一季度：随着经济增长基本面的小幅改善，大宗

商品价格上涨、地产销售量维持高位以及 CPI 出现短期上行，导致债券利率呈现震荡走高的态势。10 年国债收益率从年初的低点 2.75%上升到 2.9%附近；进入 4-5 月份，在美联储加息预期提升、人民币贬值等外部影响，预期 MPA 考核对资金面冲击、营改增税务成本提升、城投债置换强制赎回传闻，加之信用违约等系列风险事件的冲击之下，同时银行委外业务放缓的预期，债券利率冲高，10 年期国债接近 3%，10 年期国开最高至 3.48%；而进入 6 月份，随着经济数据特别是通胀数据的走弱、以及英国退欧带来全球经济增速放缓的预期之下，中国债券利率水平跟随全球债券市场收益率水平走出一波快速的下跌。

股票市场经过年初 1 月份的快速下跌之后，2-6 月份基本呈现区间震荡、小幅上行的走势。这中间又分作两个阶段，4 月中旬为界。4 月中旬之前因为经济数据出现较好的回升，市场主要热点在周期类板块，而在 4 月中旬随着高频经济数据的冲高回落，市场出现震荡下跌，直到 5 月底，此后随着资金面的宽松和宏观经济数据的企稳以及美联储加息预期的减弱，市场在中小板新兴产业板块的带动下，逐渐活跃，指数缓慢走高。

上半年，本基金在债券投资方面：贯彻了债券组合短久期和低杠杆的策略，同时积极提升组合债券的信用资质，以获取稳定的票息收益为主要投资目标；股票投资方面在一季度较为谨慎，二季度随着市场热点的扩散，股票仓位小幅提升，对产品净值提升有所贡献。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0706 元，本报告期份额净值增长 0.32%，同期业绩比较基准增长率为 0.74%，基金业绩表现落后比较基准 0.42%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望年内经济形势，上半年经济的亮点在地产市场，但随着需求的快速释放，下半年地产销售将从高位回落，地产投资也将随之下滑，虽然地方政府债务成本下降后，在中央推动下有能力继续提升杠杆水平，从而通过基础设施投资稳定全社会固定资产投资水平，但制造业由于成本的提升和全球经济的低位水平仍难以出现新一轮投资回升，整体固定资产投资增速将低位徘徊。去产能带来的失业压力将继续压制通胀水平，PPI 向 CPI 的传导空间有限，CPI 可能会在个别月份因气候原因出现跳升，但整体水平在年内将处于低位。

2008 年美国金融危机之后，全球央行通过史无前例的宽松货币政策来维持经济增速的刺激效果已经日渐褪色。就中国而言，虽然信贷、M2 与社融增速在 2011 年之后重回下降轨道，但目前仍然是全球主要经济体中增速最高的水平，同时随着经济增速的下滑，货币扩张速度与实体经济增速之间的剪刀差在不断扩大。中期内国内宏观经济走势有三条路径：一是增速剪刀差进一步大幅扩大，

经济增速下滑而通胀逐步提升，进入滞胀环境；二是经济增速改善，剪刀差稳定，经济进入小周期的繁荣，通胀与增速同时提升；三是剪刀差小幅扩大，在经济继续小步下滑的同时，通胀保持低位甚至通缩的环境。

对于债市而言，前两种路径都会带来利率的上行。由于英国脱欧引发全球经济重现衰退的预期，目前的债券市场定价在指向第三条路径，国内利率水平已经重回年初低位。但，英国脱欧本身或许并不会引发全球经济的大幅下滑，美国经济的回升仍然稳定；而随着中国地方政府融资成本的下降、债务偿还期限的拉长，进一步加杠杆的空间仍然存在。同时,美联储加息进程并未结束,一旦欧洲风险预期减弱，全球利率在仍有可能从目前的超低水平出现回升；而在地方政府投资力度、全球经济环境和通胀情况等因素叠加的情况下,未来几个季度中国 10 年期国债利率仍有较大概率从目前的 2.8%水平回升到 3%以上。

股票市场在三季度预计相对活跃，由于经济目前仍处于平台企稳的阶段，而货币环境整体保持宽松。但，部分股票的高估值仍然是潜在的风险，金融监管体系的进一步优化，也会打压市场内资金的风险偏好，股票市场在多数时间内仍将呈现震荡行情。

基于以上判断：我们三季度的债市组合会采取中等久期、适度杠杆、进一步提升持仓债券信用资质的策略，一方面在短期内全球经济恶化预期发酵的过程中，获取一定的价差和利差收益，同时也不过度拉长久期，在市场一旦反转的情况下，带来较大的净值损失。而在股票投资方面，仍将坚持绝对收益策略，加大仓位调整力度，捕捉波段性交易机会，个股选择侧重于业绩增速较为确定的大消费类股票、国企改革带来基本面改善的传统行业股票，同时努力捕捉市场在新兴产业不同热点板块间切换的投资机会。在把握股票二级市场投资机会的同时，本基金将积极参与新股申购。

4.6 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、分管领导、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。

4.7 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

报告期内，本基金资产净值发生过已连续超过 20 个工作日低于 5000 万元的情形。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产：		-	-
银行存款		362,937.09	1,185,467.72
结算备付金		24,032.73	125,866.53
存出保证金		17,832.75	44,112.26
交易性金融资产		35,084,146.60	73,358,997.00
其中：股票投资		3,899,056.60	4,244,300.00
基金投资		-	-
债券投资		31,185,090.00	69,114,697.00
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		906.39	-
应收利息		546,636.40	1,324,369.01
应收股利		-	-
应收申购款		18,357.62	114,000.00
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		**36,054,849.58**	**76,152,812.52**
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2016 年 6 月 30 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		2,100,000.00	12,000,000.00
应付证券清算款		173,056.06	1,006.25
应付赎回款		52,764.26	310,970.26
应付管理人报酬		21,927.24	38,916.14
应付托管费		6,264.93	11,118.91
应付销售服务费		10,963.65	19,458.08
应付交易费用		12,628.07	18,203.36
应交税费		1,915.88	1,915.88

应付利息		1,719.23	4,152.85
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		936,210.03	952,055.23
负债合计		**3,317,449.35**	**13,357,796.96**
所有者权益：		-	-
实收基金		22,326,414.02	42,959,502.87
未分配利润		10,410,986.21	19,835,512.69
所有者权益合计		**32,737,400.23**	**62,795,015.56**
负债和所有者权益总计		**36,054,849.58**	**76,152,812.52**

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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 3 月 10 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		**590,855.61**	**2,627,873.89**
1.利息收入		1,150,928.23	1,556,526.10
其中：存款利息收入		9,136.61	28,722.42
债券利息收入		1,141,791.62	1,304,785.02
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	223,018.66
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		403,945.18	1,728,589.16
其中：股票投资收益		-383,660.68	1,346,274.37
基金投资收益		-	-
债券投资收益		779,214.72	373,194.79
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		8,391.14	9,120.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-971,668.72	-698,565.69
4.汇兑收益（损失以“一”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		7,650.92	41,324.32
减：二、费用		**606,880.22**	**572,415.67**
1．管理人报酬		159,031.54	198,386.25
2．托管费		45,437.57	56,681.81
3．销售服务费		79,515.76	99,193.17

4．交易费用		28,294.94	70,640.67
5．利息支出		136,594.53	14,060.09
其中：卖出回购金融资产支出		136,594.53	14,060.09
6．其他费用		158,005.88	133,453.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**-16,024.61**	**2,055,458.22**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**-16,024.61**	**2,055,458.22**

注：1、本基金由金鹰持久回报分级债券型证券投资基金于 2015 年 3 月 10 日转型而来，故上年度可比期间数据为 2015 年 3 月 10 日至 2015 年 6 月 30 日期间的数据。

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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	42,959,502.87	19,835,512.69	62,795,015.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-16,024.61	-16,024.61
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）	-20,633,088.85	-9,408,501.87	-30,041,590.72
其中：1.基金申购款	10,232,664.00	4,623,864.34	14,856,528.34
2.基金赎回款	-30,865,752.85	-14,032,366.21	-44,898,119.06
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）	22,326,414.02	10,410,986.21	32,737,400.23
项目	**上年度可比期间 2015 年 3 月 10 日（基金合同生效日）至 2015 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）	173,652,382.46	64,191,682.64	237,844,065.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利	-	2,055,458.22	2,055,458.22

润）			
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）	-127,954,925.85	-47,110,558.19	-175,065,484.04
其中：1.基金申购款	6,272,470.17	2,547,750.95	8,820,221.12
2.基金赎回款	-134,227,396.02	-49,658,309.14	-183,885,705.16
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）	45,697,456.61	19,136,582.67	64,834,039.28

注：1、本基金由金鹰持久回报分级债券型证券投资基金于 2015 年 3 月 10 日转型而来，故上年度可比期间数据为 2015 年 3 月 10 日至 2015 年 6 月 30 日期间的数据。

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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日。

6.4.4.2记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.4.3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。

6.4.4.4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。

6.4.4.5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）银行间市场交易的固定收益品种，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。

（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，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。

6.4.4.6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。

6.4.4.7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。

6.4.4.8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)。

6.4.4.9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。

6.4.4.10费用的确认和计量

1、基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.7%的年费率逐日计提；

2、基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20%的年费率逐日计提；

3、基金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；

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。

6.4.4.11基金的收益分配政策

1、本基金基金合同生效之日起 3 年内的收益分配原则

本基金基金合同生效之日起 3 年内，不进行收益分配；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

2、本基金转型为上市开放式基金（LOF）后的收益分配原则

（1）本基金的每份基金份额享有同等分配权；

（2）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 6 次，每次收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的 20%；

（3）本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资。

场外转入或申购的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；投资者在不同销售机构的不同交易账户可选择不同的分红方式；

场内转入、申购和上市交易的基金份额的分红方式为现金分红，投资者不能选择其他的分红方式，具体收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；

（4）分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红，分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红；

（5）基金红利发放日距离收益分配基准日（即期末可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日；

（6）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；

（7）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12分部报告

本基金无分部报告。

6.4.4.13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。

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

本基金本报告期内无会计估计变更。

6.4.5.3差错更正的说明

本基金报告期内无差错更正。

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）交易印花税率的通知》的规定，自 2007 年 5 月 30 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 1‰调整为 3‰；

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

免征收印花税；

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

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

2、营业税、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；

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重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末

	2016 年 6 月 30 日
活期存款	362,937.09
定期存款	-
存款期限 3 个月-1 年	-
存款期限 1 个月以内	-
其他存款	-
合计	362,937.09

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2016 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		3,800,125.10	3,899,056.60	98,931.50
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	30,970,938.22	31,185,090.00	214,151.78
	银行间市场	-	-	-
	合计	30,970,938.22	31,185,090.00	214,151.78
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		34,771,063.32	35,084,146.60	313,083.28

6.4.7.3 买入返售金融资产

6.4.7.3.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.3.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金报告期末未持有买断式回购交易中取得的债券。

6.4.7.4 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	179.31
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-

应收结算备付金利息	9.72
应收债券利息	546,440.17
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	7.20
合计	546,636.40

6.4.7.5 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	12,453.07
银行间市场应付交易费用	175.00
合计	12,628.07

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	4.15
预提审计费	56,918.54
预提信息披露费	599,452.08
预提上市年费	29,835.26
合计	936,210.03

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	58,839,384.32	42,959,502.87
本期申购	14,015,163.63	10,232,664.00
本期赎回（以“-”号填列）	-42,275,835.75	-30,865,752.85
本期末	30,578,712.20	22,326,414.02

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	17,931,106.02	1,904,406.67	19,835,512.69
本期利润	955,644.11	-971,668.72	-16,024.61
本期基金份额交易产生的变动数	-8,807,557.32	-600,944.55	-9,408,501.87
其中：基金申购款	4,543,992.26	79,872.08	4,623,864.34
基金赎回款	-13,351,549.58	-680,816.63	-14,032,366.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,079,192.81	331,793.40	10,410,986.21

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	7,366.22
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	222.67
结算备付金利息收入	1,547.72
其他	-
合计	9,136.61

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	9,289,140.71
减：卖出股票成本总额	9,672,801.39
买卖股票差价收入	-383,660.68

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	779,214.72
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	779,214.72

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	59,525,901.30
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	57,109,538.98
减：应收利息总额	1,637,147.60
买卖债券差价收入	779,214.72

6.4.7.12 贵金属投资收益

6.4.7.12.1 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内未进行贵金属投资。

6.4.7.12.2 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内未进行贵金属投资。

6.4.7.12.3 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内未进行贵金属投资。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内未进行衍生工具投资。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内未进行衍生工具投资。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	8,391.14
基金投资产生的股利收益	-
合计	8,391.14

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1.交易性金融资产	-971,668.72

——股票投资	-148,100.70
——债券投资	-823,568.02
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-971,668.72

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	7,650.92
合计	7,650.92

6.4.7.17 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	28,119.94
银行间市场交易费用	175.00
合计	28,294.94

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	14,918.54
信息披露费	99,452.08
银行汇划费	4,500.00
银行间账户维护费	9,300.00
上市费	29,835.26
其他	-
合计	158,005.88

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1或有事项

本基金本报告期内无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金报告期内无资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 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、基金代销机构
金鹰基金管理有限公司	基金发起人、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、基金代销机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 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6月30日		上年度可比期间 2015年3月10日（基金合同生效日）至2015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	18,761,931.40	100.00%	49,752,339.77	100.00%

注：1、本基金由金鹰持久回报分级债券型证券投资基金于 2015 年 3 月 10 日转型而来，故上年度可比期间数据为 2015 年 3 月 10 日至 2015 年 6 月 30 日期间的数据。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间

	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年3月10日（基金合同生效日）至2015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	66,584,283.54	100.00%	40,504,619.18	100.00%

注：1、本基金由金鹰持久回报分级债券型证券投资基金于 2015 年 3 月 10 日转型而来，故上年度可比期间数据为 2015 年 3 月 10 日至 2015 年 6 月 30 日期间的数据。

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年3月10日（基金合同生效日）至2015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	137,400,000.00	100.00%	1,885,800,000.00	100.00%

注：1、本基金由金鹰持久回报分级债券型证券投资基金于 2015 年 3 月 10 日转型而来，故上年度可比期间数据为 2015 年 3 月 10 日至 2015 年 6 月 30 日期间的数据。

6.4.10.1.5 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 1 月 1 日至 2016 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	17,098.00	100.00%	12,453.07	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2015年3月10日（基金合同生效日）至2015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	44,473.43	100.00%	44,473.43	100.00%

注：1、本基金由金鹰持久回报分级债券型证券投资基金于 2015 年 3 月 10 日转型而来，故上年

度可比期间数据为 2015 年 3 月 10 日至 2015 年 6 月 30 日期间的数据。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年3月10日（基金合同生效日）至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	159,031.54	198,386.25
其中：支付销售机构的客户维护费	37,935.80	24,941.30

注：1、本基金由金鹰持久回报分级债券型证券投资基金于 2015 年 3 月 10 日转型而来，故上年度可比期间数据为 2015 年 3 月 10 日至 2015 年 6 月 30 日期间的数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年3月10日（基金合同生效日）至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	45,437.57	56,681.81

注：1、本基金由金鹰持久回报分级债券型证券投资基金于 2015 年 3 月 10 日转型而来，故上年度可比期间数据为 2015 年 3 月 10 日至 2015 年 6 月 30 日期间的数据。

6.4.10.2.3 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 2016年1月1日至2016年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
金鹰基金管理有限公司	32,450.89
中国邮政储蓄银行	19,618.59
广州证券股份有限公司	0.00
合计	52,069.48
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2015年3月10日（基金合同生效日）至2015年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
金鹰基金管理有限公司	46,577.36
中国邮政储蓄银行	24,489.26

广州证券股份有限公司	4,801.26
合计	75,867.88

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 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6月30日		上年度可比期间 2015年3月10日（基金合同生效日）至2015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	362,937.09	7,366.22	1,735,583.21	12,846.37

注：1、本基金由金鹰持久回报分级债券型证券投资基金于 2015 年 3 月 10 日转型而来，故上年度可比期间数据为 2015 年 3 月 10 日至 2015 年 6 月 30 日期间的数据。

6.4.10.5 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。

6.4.10.6 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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
000639	西王食品	2016-05-27	重大事项停牌	14.12	-	-	1,600.00	22,682.44	22,592.00	-
00210	广东鸿	2016-05	重大事	21.62	-	-	1,300.00	28,028.00	28,106.00	-

1	图	-03	项停牌							
002567	唐人神	2016-05-16	重大事项停牌	13.98	2016-07-29	13.23	1,600.00	19,721.17	22,368.00	-
300355	蒙草生态	2016-06-30	重大事项停牌	7.11	2016-07-06	7.38	6,000.00	41,535.99	42,660.00	-

6.4.12.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.2.1 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。

6.4.12.2.2 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 2,100,000.00 元，以交易所标准券作为质押券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险等。基金成立以来，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，致力于内控机制的建立和完善，公司内部管理制度及业务规范流程的制定和完善，加强内部风险的控制与有效防范，以保证各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

为保证公司规范化运作，有效地防范和化解经营风险，确保基金和公司财务和其他信息真实、准确、完整、及时，从而最大程度地保护基金持有人的合法权益，本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了科学合理、控制严密、运行高效的各项管理制度：

（1）风险管理控制制度

风险控制制度由总则、风险控制的目标和原则、风险控制的机构设置、风险控制的程序、风险类型的界定、风险控制的主要措施、风险控制的具体制度、风险控制制度的监督与评价等部分组成。

风险控制的具体制度主要包括投资风险管理制度、交易风险控制制度、财务风险控制制度、公司资产管理制度等业务风险控制制度，以及岗位分离制度、业务空间隔离制度、作业规则、岗位职责、反馈制度、资料保全制度、保密制度、员工行为守则等程序性风险管理制度。

（2）投资管理制度

投资管理制度包括研究业务管理制度、投资决策管理制度、基金交易管理制度等。

制订研究业务管理制度的目的是保持研究工作的独立、客观。研究业务管理制度包括：建立严

密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法；根据基金合同要求，在充分研究的基础上建立和维护投资对象备选库；建立研究与投资的业务交流制度，保持通畅的交流渠道；建立研究报告质量评价体系。

制订投资决策业务管理制度的目的是严格遵守法律法规的有关规定，确保基金的投资符合基金合同所规定的投资目标、投资范围、投资策略、投资组合和投资限制等要求。投资决策业务管理制度包括投资决策授权制度；投资决策支持制度，重要投资要有详细的研究报告和风险分析支持；投资风险评估与管理制度，在设定的风险权限额度内进行投资决策；投资管理业绩评价制度等。

制订基金交易管理制度的目的是保证基金投资交易的安全、有效、公平。基金交易管理制度包括基金交易的集中交易制度；交易监测、预警、反馈机制；投资指令审核制度；投资指令公平分配制度；交易记录保管制度；交易绩效评价制度等。

（3）监察稽核制度

监察稽核制度包括检查公司各业务部门和工作人员是否遵守法律、法规、规章的有关规定；检查公司各业务部门和工作人员对公司内部控制制度、各项管理制度、业务规章的执行情况；对公司各部门作业流程的遵守合规性和有效性的检查、监督、评价及建议等。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估控制证券发行人的信用风险，建立了内部评级体系，通过内部评级与外部评级相结合的方法充分评估证券的风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年末 2015年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：本统计数据未包含国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债、同业存单。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年末 2015年12月31日
AAA	4,596,750.00	15,147,000.00
AAA 以下	6,590,340.00	43,974,697.00
未评级	0.00	0.00
合计	11,187,090.00	59,121,697.00

注：本统计数据未包含国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债、同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本基金所持有的金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	6 个月以内	3 个月-1 年	6 个月-1 年	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产										
银行存款	362,937.09	-	-	-	-	-	-	-	-	362,937.09
结算备付金	24,032.73	-	-	-	-	-	-	-	-	24,032.73
存出保证金	17,832.75	-	-	-	-	-	-	-	-	17,832.75
交易性金融资产	-	-	-	-	-	19,998,000.00	11,187,090.00	-	3,899,056.60	35,084,146.60
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	906.39	906.39
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	546,636.40	546,636.40
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	18,357.62	18,357.62
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	404,802.57	-	-	-	-	19,998,000.00	11,187,090.00	-	4,464,957.01	36,054,849.58
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	2,100,000.00	-	-	-	-	-	-	-	-	2,100,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	173,056.06	173,056.06
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	52,764.26	52,764.26
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	21,927.24	21,927.24

应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	6,264.93	6,264.93
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-	-	10,963.65	10,963.65
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	12,628.07	12,628.07
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	-	1,915.88	1,915.88
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-	1,719.23	1,719.23
应付利润	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	936,210.03	936,210.03
负债总计	2,100,000.00	-	-	-	-	-	-	-	1,217,449.35	3,317,449.35
利率敏感度缺口	-1,695,197.43	-	-	-	-	19,998,000.00	11,187,090.00	-	3,247,507.66	32,737,400.23
上年度末 2015 年 12 月 31 日	**1 个月以内**	**1-3 个月**	**6 个月以内**	**3 个月-1 年**	**6 个月-1 年**	**1 年以内**	**1-5 年**	**5 年以上**	**不计息**	**合计**
资产										
银行存款	1,185,467.72	-	-	-	-	-	-	-	-	1,185,467.72
结算备付金	125,866.53	-	-	-	-	-	-	-	-	125,866.53
存出保证金	44,112.26	-	-	-	-	-	-	-	-	44,112.26
交易性金融资产	-	-	-	-	-	9,993,000.00	59,121,697.00	-	4,244,300.00	73,358,997.00
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	-	-	-	-	-	-	-	-	1,324,369.01	1,324,369.01
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	114,000.00	114,000.00

递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,355,446.51	-	-	-	-	9,993,000.00	59,121,697.00	-	5,682,669.01	76,152,812.52
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	-	-	-	-	-	12,000,000.00	-	-	-	12,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	1,006.25	1,006.25
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	310,970.26	310,970.26
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	38,916.14	38,916.14
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	11,118.91	11,118.91
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-	-	19,458.08	19,458.08
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	18,203.36	18,203.36
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	-	1,915.88	1,915.88
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-	4,152.85	4,152.85
应付利润	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	952,055.23	952,055.23
负债总计	-	-	-	-	-	12,000,000.00	-	-	1,357,796.96	13,357,796.96
利率敏感度缺口	1,355,446.51	-	-	-	-	-2,007,000.00	59,121,697.00	-	4,324,872.05	62,795,015.56

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他变量不变，只有利率变动通过债券公允价值变动对基金资产净值产生影响。

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	1.利率上升 25 个基点	-56,718.52	-292,765.52
	2.利率下降 25 个基点	56,718.52	292,765.52

6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	3,899,056.60	11.91	4,244,300.00	6.76
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	31,185,090.00	95.26	69,114,697.00	110.06
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	35,084,146.60	107.17	73,358,997.00	116.82

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	市场其他变量保持不变，只有业绩比较基准所对应的市场组合价格发生合理、可能的变动	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

		本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	业绩比较基准变动+5%	950,117.70	3,706,486.36
	业绩比较基准变动-5%	-950,117.70	-3,706,486.36

6.4.14 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。

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	3,899,056.60	10.81
	其中：股票	3,899,056.60	10.81
2	固定收益投资	31,185,090.00	86.49
	其中：债券	31,185,090.00	86.49
	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	386,969.82	1.07
7	其他各项资产	583,733.16	1.62
8	合计	36,054,849.58	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	89,505.00	0.27
B	采矿业	203,441.00	0.62
C	制造业	2,087,336.00	6.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,923.00	0.02
E	建筑业	301,078.40	0.92
F	批发和零售业	355,258.00	1.09
G	交通运输、仓储和邮政业	111,237.00	0.34
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	284,203.80	0.87
J	金融业	66,810.00	0.20
K	房地产业	83,112.00	0.25
L	租赁和商务服务业	50,692.00	0.15
M	科学研究和技术服务业	87,406.00	0.27
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	174,054.40	0.53
S	综合	-	-
	合计	3,899,056.60	11.91

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期未持有沪港通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	601088	中国神华	7,000	98,490.00	0.30
2	000028	国药一致	1,300	84,630.00	0.26
3	300148	天舟文化	4,340	66,011.40	0.20
4	002418	康盛股份	6,100	64,416.00	0.20
5	600845	宝信软件	2,800	62,468.00	0.19
6	002681	奋达科技	3,400	57,392.00	0.18
7	601518	吉林高速	14,600	57,232.00	0.17
8	002035	华帝股份	2,300	56,304.00	0.17
9	300270	中威电子	3,200	54,496.00	0.17
10	002548	金新农	3,100	54,436.00	0.17
11	002124	天邦股份	5,100	54,315.00	0.17
12	000716	黑芝麻	8,000	54,080.00	0.17
13	002357	富临运业	3,500	54,005.00	0.16
14	002329	皇氏集团	3,600	53,964.00	0.16
15	000533	万 家 乐	5,100	52,938.00	0.16
16	002374	丽鹏股份	7,700	52,745.00	0.16
17	002661	克明面业	3,200	52,512.00	0.16
18	000419	通程控股	7,200	52,416.00	0.16
19	300295	三六五网	1,600	52,000.00	0.16
20	000426	兴业矿业	6,900	51,888.00	0.16
21	002351	漫步者	4,000	51,840.00	0.16
22	300342	天银机电	1,700	51,782.00	0.16
23	600491	龙元建设	6,000	51,480.00	0.16
24	000813	天山纺织	4,200	51,198.00	0.16
25	002481	双塔食品	7,000	51,100.00	0.16
26	300272	开能环保	3,300	50,919.00	0.16
27	000796	凯撒旅游	2,900	50,692.00	0.15
28	002087	新野纺织	6,400	50,496.00	0.15
29	600180	瑞茂通	3,300	49,863.00	0.15
30	600137	浪莎股份	1,700	49,793.00	0.15
31	002238	天威视讯	3,340	48,329.80	0.15
32	300247	乐金健康	5,800	48,140.00	0.15
33	002614	蒙发利	4,000	48,040.00	0.15
34	002616	长青集团	2,300	47,610.00	0.15
35	002011	盾安环境	4,200	47,376.00	0.14
36	002290	禾盛新材	1,700	47,311.00	0.14
37	600776	东方通信	5,600	46,984.00	0.14
38	000889	茂业通信	4,300	46,655.00	0.14

39	300119	瑞普生物	2,900	46,545.00	0.14
40	002697	红旗连锁	7,700	46,508.00	0.14
41	000521	美菱电器	7,700	46,431.00	0.14
42	002542	中化岩土	6,100	46,238.00	0.14
43	002656	摩登大道	3,300	46,035.00	0.14
44	300025	华星创业	3,200	45,888.00	0.14
45	600645	中源协和	1,300	45,682.00	0.14
46	300217	东方电热	10,120	45,034.00	0.14
47	600356	恒丰纸业	4,200	44,940.00	0.14
48	002552	宝鼎科技	2,900	44,515.00	0.14
49	600191	华资实业	3,200	44,448.00	0.14
50	300034	钢研高纳	2,000	44,200.00	0.14
51	300160	秀强股份	3,400	43,758.00	0.13
52	002429	兆驰股份	5,200	43,576.00	0.13
53	000810	创维数字	2,400	43,368.00	0.13
54	300355	蒙草生态	6,000	42,660.00	0.13
55	600757	长江传媒	5,000	41,950.00	0.13
56	300050	世纪鼎利	2,900	41,731.00	0.13
57	002178	延华智能	3,800	41,724.00	0.13
58	600477	杭萧钢构	6,070	41,397.40	0.13
59	000673	当代东方	3,300	41,349.00	0.13
60	002032	苏 泊 尔	1,200	41,340.00	0.13
61	603366	日出东方	4,900	41,160.00	0.13
62	603369	今世缘	3,000	40,260.00	0.12
63	600386	北巴传媒	2,100	39,186.00	0.12
64	601886	江河集团	3,800	39,026.00	0.12
65	000798	中水渔业	3,200	38,304.00	0.12
66	600699	均胜电子	1,000	38,300.00	0.12
67	600153	建发股份	3,000	36,000.00	0.11
68	600271	航天信息	1,500	35,700.00	0.11
69	000042	中洲控股	2,000	34,240.00	0.10
70	300168	万达信息	1,300	33,787.00	0.10
71	000885	同力水泥	2,600	33,306.00	0.10
72	600030	中信证券	2,000	32,460.00	0.10
73	002482	广田集团	3,900	29,562.00	0.09
74	600313	农发种业	5,700	29,469.00	0.09
75	002504	弘高创意	1,200	29,040.00	0.09
76	600737	中粮屯河	2,500	28,875.00	0.09
77	001979	招商蛇口	2,000	28,500.00	0.09
78	002101	广东鸿图	1,300	28,106.00	0.09
79	601989	中国重工	4,000	25,320.00	0.08
80	603999	读者传媒	800	24,744.00	0.08
81	000639	西王食品	1,600	22,592.00	0.07
82	002567	唐人神	1,600	22,368.00	0.07

83	300498	温氏股份	600	21,732.00	0.07
84	002781	奇信股份	500	21,675.00	0.07
85	601155	新城控股	2,200	20,372.00	0.06
86	600584	长电科技	1,000	20,290.00	0.06
87	601009	南京银行	2,000	18,780.00	0.06
88	300210	森远股份	1,000	17,880.00	0.05
89	600000	浦发银行	1,000	15,570.00	0.05
90	600167	联美控股	300	4,923.00	0.02
91	600988	赤峰黄金	100	1,865.00	0.01

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	002584	西陇科学	318,796.00	0.51
2	601088	中国神华	173,580.00	0.28
3	002191	劲嘉股份	156,760.00	0.25
4	000019	深深宝 A	142,290.00	0.23
5	300342	天银机电	137,190.00	0.22
6	300050	世纪鼎利	129,524.00	0.21
7	600548	深高速	129,380.00	0.21
8	002263	大 东 南	123,272.00	0.20
9	601208	东材科技	121,650.00	0.19
10	600845	宝信软件	95,919.00	0.15
11	000911	南宁糖业	93,179.00	0.15
12	002443	金洲管道	91,830.00	0.15
13	002032	苏 泊 尔	91,429.00	0.15
14	002548	金新农	87,445.00	0.14
15	000028	国药一致	85,292.00	0.14
16	002418	康盛股份	80,232.00	0.13
17	000639	西王食品	74,479.00	0.12
18	600048	保利地产	74,280.00	0.12
19	603696	安记食品	73,080.00	0.12
20	002357	富临运业	71,161.00	0.11

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	000042	中洲控股	1,507,290.00	2.40
2	000078	海王生物	748,307.00	1.19
3	002096	南岭民爆	664,925.36	1.06
4	002037	久联发展	663,829.15	1.06
5	002584	西陇科学	294,000.00	0.47
6	002191	劲嘉股份	156,652.00	0.25
7	000019	深深宝 A	143,996.00	0.23
8	002263	大 东 南	127,732.00	0.20
9	601208	东材科技	125,680.00	0.20
10	600548	深高速	125,430.00	0.20
11	000911	南宁糖业	103,935.00	0.17
12	300342	天银机电	94,303.50	0.15
13	002443	金洲管道	91,570.00	0.15
14	300050	世纪鼎利	87,298.00	0.14
15	002688	金河生物	75,815.00	0.12
16	603696	安记食品	74,574.00	0.12
17	000421	南京公用	74,541.00	0.12
18	600048	保利地产	74,210.00	0.12
19	601088	中国神华	71,950.00	0.11
20	002664	信质电机	67,601.00	0.11

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	9,475,658.69
卖出股票的收入（成交）总额	9,289,140.71

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	19,998,000.00	61.09
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	11,187,090.00	34.17
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-

7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	31,185,090.00	95.26

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	019518	15 国债 18	200,000.00	19,998,000.00	61.09
2	122633	12 嘉经债	100,000.00	6,243,000.00	19.07
3	122394	15 中银债	45,000.00	4,596,750.00	14.04
4	124158	13 锡东城	4,200.00	347,340.00	1.06

7.7 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。

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 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	17,832.75
2	应收证券清算款	906.39
3	应收股利	-
4	应收利息	546,636.40
5	应收申购款	18,357.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	583,733.16

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有流通受限股票。

7.12.6 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

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
986	31,012.89	12,221,514.00	39.97%	18,357,198.20	60.03%

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	江苏省电力公司（国网 B）企业年金计划－中国银行股份有限公	3,859,072.00	30.23%
2	四川省电力公司企业年金计划－中信银行股份有限公司	1,947,771.00	15.26%
3	江苏省电力公司（国网）企业年金计划－招商银行股份有限公司	1,727,889.00	13.54%
4	宝钢集团有限公司钢铁业企业年金计划－中国工商银行股份有限公	1,407,744.00	11.03%
5	张家港港务集团有限公司企业年金计划－交通银行	848,148.00	6.64%
6	四川省农村信用社联合社企业年金计划－中信银行股份有限公司	700,092.00	5.48%
7	兴业证券股份有限公司企业年金计划－招商银行	636,111.00	4.98%
8	安徽中烟工业有限责任公司企业年金计划－中国工商银行股份有限	537,160.00	4.21%
9	四川省电力公司（子公司）企业年金计划－中国光大银行股份有限	376,566.00	2.95%
10	鲁国强	105,516.00	0.83%

8.3 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	-

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	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 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 3 月 10 日）基金份额总额	237,844,063.65
本报告期期初基金份额总额	58,839,384.32
本报告期基金总申购份额	14,015,163.63
减：本报告期基金总赎回份额	42,275,835.75
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	30,578,712.20

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、经本基金管理人第五届董事会第 25 次会议审议通过，报中国证券投资基金业协会备案，并于 2016 年 5 月 13 日在证监会指定媒体披露，曾长兴同志从 2016 年 5 月 13 日起担任本基金管理人的副总经理。

2、本报告期内，基金托管人中国邮政储蓄银行托管业务部总经理变更为田东辉先生。

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 报告期内改聘会计师事务所情况

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	18,761,931.40	100.00%	17,098.00	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。

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	66,584,283.54	100.00%	137,400,000.00	100.00%	-	-

注： 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。

10.8 其他重大事件

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旗下开放式基金资产净值等的公告	《证券时报》等	2016-01-04
2	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
3	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
4	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
5	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
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	2016-01-08
7	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
8	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
9	金鹰基金管理有限公司关于成都分公司负责人变更的公告	《证券时报》等	2016-01-21
10	金鹰持久增利债券型证券投资基金(LOF)2015 年第 4 季度报告	《证券时报》等	2016-01-21
11	金鹰基金管理有限公司关于从业人员在深圳前海金鹰资产管理有限公司兼职情况的公告	《证券时报》等	2016-01-27
12	金鹰基金管理有限公司关于从业人员在深圳前海金鹰资产管理有限公司兼职情况的公告	《证券时报》等	2016-03-07
13	金鹰基金管理有限公司关于金鹰持久增利债券型证券投资基金（LOF）增聘基金经理的公告	《证券时报》等	2016-03-14
14	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
15	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	《证券时报》等	2016-03-25

	构并参与费率优惠的公告		
16	金鹰基金管理有限公司关于从业人员在深圳前海金鹰资产管理有限公司兼职情况的公告	《证券时报》等	2016-03-29
17	金鹰基金管理有限公司及广州分公司办公地址变更的公告	《证券时报》等	2016-03-29
18	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
19	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
20	【年报】金鹰持久增利债券型证券投资基金（LOF）2015 年年度报告（摘要）	《证券时报》等	2016-03-31
21	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
22	金鹰基金管理有限公司关于网上交易系统升级暂停服务的公告	《证券时报》等	2016-04-11
23	金鹰持久增利债券型证券投资基金(LOF)2016 年第 1 季度报告	《证券时报》等	2016-04-20
24	金鹰持久增利债券型证券投资基金更新的招募说明书摘要 2016 第 1 号	《证券时报》等	2016-04-21
25	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	2016-04-25
26	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
27	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
28	金鹰基金管理有限公司关于员工在深圳前海金鹰资产管理有限公司兼职情况的公告	《证券时报》等	2016-05-04
29	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
30	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
31	金鹰基金管理有限公司关于增聘副总经理的公告	《证券时报》等	2016-05-13
32	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
33	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

34	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
35	金鹰基金管理有限公司关于网上交易系统升级暂停服务的公告	《证券时报》等	2016-06-08
36	金鹰基金管理有限公司关于调整开户证件类型的公告	《证券时报》等	2016-06-16
37	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转换业务的公告	《证券时报》等	2016-06-21

11 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。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会批准金鹰持久回报分级债券型证券投资基金发行及募集的文件。

2、《金鹰持久回报分级债券型证券投资基金基金合同》。

3、《金鹰持久回报分级债券型证券投资基金托管协议》。

4、金鹰基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程。

5、基金托管人业务资格批件和营业执照。

6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、季度报告、半年度报告、更新的招募说明书及其他临时公告。

12.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所

12.3 查阅方式

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

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

金鹰基金管理有限公司

二〇一六年八月二十七日