金鹰元丰债券型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:金鹰基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年十月二十四日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金鹰元丰债券
基金主代码	210014
交易代码	210014
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年9月20日
报告期末基金份额总额	60,247,773.80份
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	本基金将综合考虑国内外政治经济环境、政策形势、宏观经济与资本市场运行状况、固定收益类与权益类资产风险收益特征,定性分析与定量分析并用,灵活确定大类资产配置比例,并将在实际运作中根据证券市场走势以及本基金业绩表现不断对大类资产配置比例进行调整,以期优化大类资产配置,力争获取超额投资收益。
业绩比较基准	中国债券综合指数(全价)×90%+沪深300指数×10%。
风险收益特征	本基金为债券型基金,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。
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日–2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-1,191,635.75
2.本期利润	-40,059.00
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0006
4.期末基金资产净值	62,566,773.55
5.期末基金份额净值	1.0385

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;

2、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、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、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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.32%	0.29%	0.36%	0.14%	-0.04%	0.15%

3.2.2自基金转型以来基金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

金鹰元丰债券型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017年9月20日至2018年9月30日)

注:1、本基金由原金鹰元丰保本混合型证券投资基金于2017年9月20日转型而来;

2、按基金合同和招募说明书的约定,本基金的建仓期为六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

3、本基金的业绩比较基准是:中国债券综合指数(全价)*90%+沪深300指数*10%

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
汪伟	基金经理	2017-09-21	-	5	汪伟先生,2013年7月至2014年9月曾任广州证券股份有限公司交易员、投资经理等职务,2014年9月至2016年2月曾任金鹰基金管理有限公司交易主管,2016年3月至2017年7月曾任广东南粤银行股份有限公司交易员、宏观分析师等职务,2017年7月加入金鹰基金管理有限公司,现任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、金鹰鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金、金鹰民丰回报定期开放混合型证券投资基金、金鹰添利中长期信用债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、金鹰元盛债券型发起式证券投资基金(LOF)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。
吴德瑄	基金经理	2017-09-30	-	5	吴德瑄先生,曾任广州证券股份有限公司研究员。2015年1月加入金鹰基金管理有限公司,任研究部研究员、基金经理助理、基金经理职务。现任金鹰技术领先灵活配置混合型证券投资基金、金鹰元禧混合型证券投资基金、金鹰元丰债券型证券投资基金、金鹰元安混合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颁布的《证券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、本基金《基金合同》等法律文件的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作基本合法合规,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合按投资管理制度和流程独立决策,并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

公司通过规范的投资交易流程、完善的权限管理机制、有效的交易控制制度,确保公平交易的实施。同时通过投资交易系统中的公平交易功能执行交易,不断强化事后监控分析,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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

进入三季度,我们看到了一些积极的因素正在酝酿,企业盈利总体平稳,而政治局会议提出"六个稳",试图扭转前期市场对于信用加速收缩的悲观预期。资本市场也一度走出了较为积极的局面。本组合相比上季度更加积极,提升了权益品种的仓位,但事后来看,本运作期内股债并没有走出一致预期的行情,债券受制于汇率和油价震荡中略微上行,而权益市场并没有受到政策的提振,仅走出一波权重股主导的指数行情。从结果上看,本运作期内本组合未能实现绝对回报。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2018年9月30日,基金份额净值为1.0385元,本报告期份额净值增长率为0.32%,同期业绩比较基准增长率为0.36%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来一个季度,我们认为并不需要过分悲观,在美联储加速收缩的大背景下,所有新兴市场今年都遭受了重创,但中国市场仍然具有相对优势,抗击打能力仍然顽强。当然,仅短期而言,市场仍然会担忧明年通胀与汇率对于市场的干扰,我们倾向于认为四季度会是重要的喘息期,债券资产的表现或会优于三季度。风险资产则需要观察美国的中期选举,以及美债收益率的走向,因为这直接关系到国内资本市场的信心,因为我们现在最缺的也是信心。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内无应当说明的预警事项。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	10,386,726.00	12.31
	其中:股票	10,386,726.00	12.31
2	固定收益投资	70,864,016.16	84.02
	其中:债券	70,864,016.16	84.02
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,927,087.52	2.28
7	其他各项资产	1,168,093.23	1.38
8	合计	84,345,922.91	100.00

注:其他资产包括:交易保证金、应收利息、应收证券清算款、其他应收款、应收申购款。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,392,000.00	2.22
C	制造业	8,994,726.00	14.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	10,386,726.00	16.60

5.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期内未通过港股通投资股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600703	三安光电	120,000	1,963,200.00	3.14
2	300124	汇川技术	70,000	1,939,000.00	3.10
3	601225	陕西煤业	160,000	1,392,000.00	2.22
4	601233	桐昆股份	80,000	1,315,200.00	2.10
5	603816	顾家家居	20,000	996,000.00	1.59
6	600961	株冶集团	160,000	982,400.00	1.57
7	300470	日机密封	37,800	951,426.00	1.52
8	000703	恒逸石化	50,000	847,500.00	1.35

注:本基金本报告期末仅持有8只股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,521,000.00	5.63
	其中:政策性金融债	3,521,000.00	5.63
4	企业债券	49,861,986.96	79.69
5	企业短期融资券	3,025,700.00	4.84
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	14,455,329.20	23.10
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	70,864,016.16	113.26

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	143529	18海通02	50,000.00	5,115,000.00	8.18
2	143512	18中信G1	50,000.00	5,106,000.00	8.16
3	122046	10中铁G2	50,000.00	5,058,000.00	8.08
4	143607	18国君G2	50,000.00	5,036,000.00	8.05
5	112501	17东江G1	50,000.00	5,004,500.00	8.00

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期内未投资贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期内未投资权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1本基金投资的前十名证券的发行主体之一的国泰君安因未按照规定有效监督发行人募集资金使用及信息披露,且出具的2017年度受托管理事务报告中发行人募集资金使用信息与实际情况不符,于2018年8月16日公告被中国证券监督管理委员会甘肃监管局采取出具警示函的监管措施。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策的程序。

5.11.2本基金报告期内基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	21,088.11
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,145,970.49
5	应收申购款	1,034.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,168,093.23

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110040	生益转债	2,333,580.00	3.73
2	113504	艾华转债	705,223.60	1.13
3	127005	长证转债	1,912,400.00	3.06
4	127006	敖东转债	291,780.00	0.47
5	128032	双环转债	569,520.00	0.91
6	132004	15国盛EB	1,329,050.00	2.12
7	132012	17巨化EB	974,000.00	1.56

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	56,575,958.73
报告期基金总申购份额	20,044,172.34
减:报告期基金总赎回份额	16,372,357.27
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	60,247,773.80

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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8月16日至2018年9月30日	-	14,267,097.87	-	14,267,097.87	23.68%

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,可能导致本基金的流动性风险;

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规模的50%,该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期,经基金管理人董事会审议通过,免去李云亮先生督察长、陈瀚先生副总经理、曾长兴先生副总经理职务,聘请曾长兴先生担任公司督察长,聘请满黎先生担任公司副总经理,上述事项已在证监会指定媒体披露。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准发行及募集的文件。

2、《金鹰元丰债券型证券投资基金基金合同》。

3、《金鹰元丰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。

9.2 存放地点

广东省广州市天河区珠江东路28号越秀金融大厦30层

9.3 查阅方式

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

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

金鹰基金管理有限公司

二〇一八年十月二十四日

金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:金鹰基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年十月二十四日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金鹰元和混合	
基金主代码	002681	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年5月31日	
报告期末基金份额总额	816,315,611.84份	
投资目标	本基金在有效控制风险并保持良好流动性的前提下,通过对股票、固定收益和现金类等资产的积极灵活配置,力争使基金份额持有人获得超额收益与长期资本增值。	
投资策略	本基金将从宏观面、政策面、基本面和资金面四个维度进行综合分析,主动判断市场时机,在严格控制投资组合风险的前提下,进行积极的资产配置,合理确定基金在股票类资产、固定收益类资产、现金类资产等各类资产类别上的投资比例,最大限度的提高收益。	
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%	
风险收益特征	本基金为灵活配置混合型基金,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低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金。	
基金管理人	金鹰基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	金鹰元和混合A	金鹰元和混合C
下属分级基金的交易代码	002681	002682
报告期末下属分级基金的份额总额	794,031,250.07份	22,284,361.77份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日–2018年9月30日)	
	金鹰元和混合A	金鹰元和混合C
1.本期已实现收益	-56,592,813.90	-1,851,502.48
2.本期利润	-60,620,603.31	-2,008,447.04
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0813	-0.0857
4.期末基金资产净值	746,098,718.77	20,832,496.43
5.期末基金份额净值	0.9396	0.9348

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;

2、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、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、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。

3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、金鹰元和混合A:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-8.00%	0.42%	-0.56%	0.81%	-7.44%	-0.39%

2、金鹰元和混合C:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-8.15%	0.42%	-0.56%	0.81%	-7.59%	-0.39%

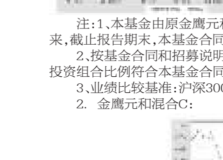
3.2.2 自基金转型以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金

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

(2018年5月31日至2018年9月30日)

1. 金鹰元和混合A:

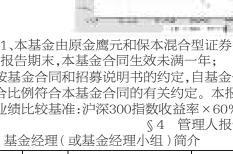


注:1、本基金由原金鹰元和保本混合型证券投资基金于2018年5月31日转型而来,截止报告期末,本基金合同生效未满一年;

2、按基金合同和招募说明书的约定,自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同的有关约定。本报告期本基金处于建仓期内;

3、业绩比较基准:沪深300指数收益率×60%+中证全债指数×20%。

2. 金鹰元和混合C:



注:1、本基金由原金鹰元和保本混合型证券投资基金于2018年5月31日转型而来,截止报告期末,本基金合同生效未满一年;

2、按基金合同和招募说明书的约定,自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同的有关约定。本报告期本基金处于建仓期内;

3、业绩比较基准:沪深300指数收益率×60%+中证全债指数×20%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘丽娟	固定收益部总监,基金经理	2016-10-19	-	11	刘丽娟女士,中南财经政法大学工商管理硕士,历任恒泰证券股份有限公司交易员,投资经理,广州证券股份有限公司资产管理总部固定收益投资总监。2014年12月加入金鹰基金管理有限公司,任固定收益部总监。现任金鹰货币市场证券投资基金、金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金、金鹰添享纯债债券型证券投资基金、金鹰现金增益交易型货币市场基金、金鹰添荣纯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《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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、本基金基金合同等法律文件的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金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,无损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合按投资管理制度和流程独立决策,并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

公司通过规范的投资交易流程、完善的权限管理机制、有效的交易控制制度,确保公平交易的实施。同时通过投资交易系统中的公平交易功能执行交易,不断强化事后监控分析,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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2018年三季度债券市场行情,市场收益率呈整体下行走势。7月定向降准释放7000亿流动性,短端利率在合理充裕的流动性环境下,收益率大幅下行,长端利率在地方债巨量供给压力和一系列宽信用措施下社融企稳预期的影响下,收益率步入区间震荡。整个三季度十年国开债收益率下行约5bp,一年国开债收益率下行近60bp,存单收益率较二季度大幅下行,收益率曲线进一步陡峭化。

流动性层面,央行7月定向降准释放7000亿,每月超量续作到期MLF,货币市场流动性较宽松,7天质押式回购利率一度低于公开市场利率。9月底央行并未跟随美联储上调政策利率,市场机构平稳度过9月末。

在三季度,货币市场利率以及同业存单发行利率都较二季度继续下行,尤其是三个月内存单利率,但相较而言,在流动性充裕以及市场机构风险偏好较低的背景下,机构对同业存单的投资需求较大,同业存单的性价比仍高。我们根据对市场流动性的判断以及对持有人结构分析,严格遵守流动性新规要求,在市场利率冲高时加大了对高利率同业存款和存单的配置,在保持组合流动性和安全性的前提下,取得了一定超额收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2018年9月30日,本基金报告期内A类份额净值为0.9396元,本报告期份额净值增长率为-8.00%, 同期业绩比较基准增长率为-0.56%。C类基金份额净值为0.9348元,本报告期份额净值增长率-8.15% ,同期业绩比较基准增长率为-0.56%。

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年四季度,从基本面来看,四季度经济面临下行压力,贸易战影响下出口回落已然显现,地方债加速发行给基建提供资金支持,但基建对冲只能延缓下行速度,难以扭转下行方向。针对当前经济回落的态势,我们预计后续仍有宽财政政策出台托底经济,但考虑到当前汇率压力及潜在通胀预期,货币政策进一步宽松的空间受到制约。

流动性层面上,央行10月再次定向降准置换MLF,将额外释放7500亿流动性,对冲10月缴税、地方债发行对资金面带来的冲击。在经济下行压力较大、信用风险发酵债务违约增加下,央行将呵护市场资金面,保持流动性合理充裕。

基于以上判断,我们认为在经济下行、美债利率大幅上行和通胀预期担忧下,长端利率仍将区间震荡,短端利率受益于较为宽松的流动性环境及市场需求,继续维持平稳,收益率曲线仍将维持陡峭化。股票市场在内外环境没有明显改善的情况下,市场谨慎心态及疲弱走势仍将延续。我们将继续保持债券部分的短久期利率债配置和股票的低仓位防御策略,力争有效控制并防范风险,竭力为持有人服务。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期无应当说明预警事项。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	32,826,474.92	4.26
	其中:股票	32,826,474.92	4.26
2	固定收益投资	50,400,000.00	6.54
	其中:债券	50,400,000.00	6.54
	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	286,380,611.57	37.14
	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	27,217,173.79	3.53
7	其他各项资产	374,333,935.97	48.54
8	合计	771,158,196.25	100.00

注:其他各项资产包括:交易保证金、应收利息、应收证券清算款、其他应收款、应收申购款、买入返售证券。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	711,815.36	0.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	279,869.20	0.04
J	金融业	31,834,790.36	4.15
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	32,826,474.92	4.28

5.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期内未通过港股通投资股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	978,000	30,014,820.00	3.91
2	603019	中科曙光	10,000	468,800.00	0.06
3	601988	中国银行	100,000	372,000.00	0.05
4	000001	平安银行	30,000	331,500.00	0.04
5	601166	兴业银行	20,010	319,159.50	0.04
6	601288	农业银行	80,000	311,200.00	0.04
7	601939	建设银行	40,000	289,600.00	0.04
8	600588	用友网络	10,060	279,869.20	0.04
9	000977	浪潮信息	10,092	243,015.36	0.03
10	601577	长沙银行	17,329	196,510.86	0.03

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,400,000.00	6.57
	其中:政策性金融债	50,400,000.00	6.57
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	50,400,000.00	6.57

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	018005	国开1701	400,000.00	40,240,000.00	5.25
2	140358	14进出58	100,000.00	10,160,000.00	1.32

注:本基金本报告期末仅持有2只债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期内未投资贵金属。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期内未投资权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11投资组合报告附注

5.11.1本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2报告期内基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	604,361.24
2	应收证券清算款	343,102,185.27
3	应收股利	-
4	应收利息	626,470.15
5	应收申购款	30,000,919.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	374,333,935.97

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	金鹰元和混合A	金鹰元和混合C
本报告期期初基金份额总额	727,113,017.18	25,383,073.50
报告期基金总申购份额	83,560,451.93	109,370.23
减:报告期基金总赎回份额	16,642,219.04	3,208,081.96
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	794,031,250.07	22,284,361.77

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期,经基金管理人董事会审议通过,免去李云亮先生督察长、陈瀚先生副总经理、曾长兴先生副总经理职务,聘请曾长兴先生担任公司督察长,聘请满黎先生担任公司副总经理,上述事项已在证监会指定媒体披露。

§9 备查文件目录

9.1备查文件目录

1、中国证监会批准基金发行及募集的文件。

2、《金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。

3、《金鹰元和灵活配置混合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。

9.2存放地点

广东省广州市天河区珠江东路28号越秀金融大厦30层

9.3查阅方式

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

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

金鹰基金管理有限公司

二〇一八年十月二十四日

金鹰元盛债券型发起式证券投资基金(LOF)

2018年第三季度报告

基金管理人:金鹰基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年十月二十四日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金鹰元盛债券(LOF)	
基金主代码	162108	
基金运作方式	契约型	
基金合同生效日	2015年5月5日	
报告期末基金份额总额	313,699,528.13份	
投资目标	在严格控制投资风险的前提下,通过积极主动的投资管理,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,实现基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金资产配置采用自上而下的投资视角,定性分析与定量分析并用,结合国内外政治经济环境、政策取向、利率变化等,合理确定基金在普通债券、货币市场工具等资产类别上的投资比例,并随着各类资产风险收益特征的相对变化,适时动态地调整本基金投资于普通债券、货币市场工具等资产的比例与期限结构。	
业绩比较基准	中国债券综合财富指数收益率	
风险收益特征	本基金为债券型基金,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。	
基金管理人	金鹰基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	金鹰元盛债券(LOF)C	金鹰元盛债券(LOF)E
下属分级基金的交易代码	162108	004333
报告期末下属分级基金的份额总额	49,396,039.20份	264,303,488.93份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日–2018年9月30日)	
	金鹰元盛债券(LOF)C	金鹰元盛债券(LOF)E
1.本期已实现收益	847,422.06	1,508,208.10
2.本期利润	860,648.94	1,747,976.12
3.加权平均基金份额本期利润	0.0241	0.0323
4.期末基金资产净值	57,125,598.62	333,174,362.43
5.期末基金份额净值	1.156	1.261

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;

2、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、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、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。

3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、金鹰元盛债券(LOF)C:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.21%	0.06%	1.48%	0.06%	0.73%	0.00%

2、金鹰元盛债券(LOF)E:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.35%	0.07%	1.48%	0.06%	0.87%	0.01%

注:本基金的业绩比较基准为:中国债券综合财富指数收益率。

3.2.2 自基金转型以来基金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

金鹰元盛债券型发起式证券投资基金(LOF)

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

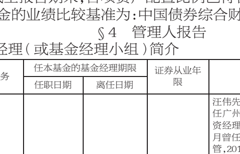
(2015年5月5日至2018年9月30日)

1. 金鹰元盛债券(LOF)C:

注:(1)截至报告期末,各项资产配置比例已符合基金合同约定。

(2)本基金的业绩比较基准为:中国债券综合财富指数收益率。

2. 金鹰元盛债券(LOF)E:



注:(1)截至报告期末,各项资产配置比例已符合基金合同约定。

(2)本基金的业绩比较基准为:中国债券综合财富指数收益率。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
汪伟	基金经理	2018-01-24	-	5	汪伟先生,2013年7月至2014年9月曾任广州证券股份有限公司交易员、投资经理等职务,2014年9月至2016年2月曾任金鹰基金管理有限公司交易主管,2016年3月至2017年7月曾任广东南粤银行股份有限公司交易员、宏观分析师等职务,2017年7月加入金鹰基金管理有限公司,现任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、金鹰鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金、金鹰民丰回报定期开放混合型证券投资基金、金鹰添利中长期信用债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、金鹰元盛债券型发起式证券投资基金(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《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合按投资管理制度和流程独立决策,并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

公司通过规范的投资交易流程、完善的权限管理机制、有效的交易控制制度,确保公平交易的实施。同时通过投资交易系统中的公平交易功能执行交易,不断强化事后监控分析,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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

三季度宏观经济政策明确转向,经济下行压力显现促使稳增长再度成为当前经济的主要目标,基建补短板也成为主要政策抓手。而地方债务约束背景下,基建资金来源主要依赖地方专项债发行,地方债供给由此加速释放。稳定社会融资的增速也陆续出台,但机构风险偏好显著回落下稳融资的成效显现缓慢。债市长端利率在经济下行趋势及地方债供给压力和社融企稳预期的交织下步入焦灼震荡的态势。短端则在合理充裕的流动性环境下保持平稳,收益率曲线明显陡峭化。

金鹰元盛坚持利率骑乘+长端利率波段的操作策略,以中短端利率债票息和骑乘价差为基础收益,通过把握长端利率波段行情增厚组合收益,有效回避了信用风险。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2018年9月30日,本基金C类份额净值1.156元,本报告期份额净值收益率为2.21%, 同期业绩比较基准收益率为1.48%;E类份额净值1.261元,本报告期份额净值收益率为2.35% ,同期业绩比较基准收益率为1.48%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

四季度经济下行趋势几成共识,外需回落已然显现,基建对冲只能延缓下行趋势,难扭转下行方向。针对当前经济回落的态势,我们预计后续仍有托底政策出台,但考虑到当前汇率压力及潜在通胀预期,宽货币已进退维谷,值得期待的主要还是财政的进一步放松。潜在的风险点则来自外部压力(美债利率),内部的通胀预期(油价猪价推升CPI),滞涨预期阶段性将主导市场走势,故我们认为长端利率下行空间受限,上行则面临期限利差牵制,故大概率继续区间震荡。短端利率受益于与流动性环境和理财新规下短端资产的需求支撑,继续维持平稳,收益率曲线陡峭化仍将维系,牛平仍需静待通胀和海外制约的消退。

金鹰元盛将继续坚持利率骑乘+长端利率波段的操作策略,以中短端利率债票息和骑乘价差为基础收益, 通过把握长端利率波段行情增厚组合收益。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内无应当说明的预警事项。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	354,126,330.90	90.06
	其中:债券	354,126,330.90	90.06
	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	3,981,446.64	1.01
7	其他各项资产	35,083,598.51	8.92
8	合计	393,191,376.05	100.00

注:其他资产包括:交易保证金、应收利息、应收证券清算款、其他应收款、应收申购款。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期内未投资股票。

5.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期内未通过港股通投资股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期内未投资股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	353,577,000.00	90.59
	其中:政策性金融债	353,577,000.00	90.59
4	企业债券	549,330.90	0.14
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	354,126,330.90	90.73

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170209	17国开09	1,300,000.00	131,417,000.00	33.67
2	180209	18国开09	900,000.00	90,153,000.00	23.10
3	180202	18国开02	500,000.00	50,745,000.00	13.00
4	180208	18国开08	500,000.00	50,515,000.00	12.94
5	180402	18农发02	300,000.00	30,747,000.00	7.88

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期内未投资贵金属。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期内未投资权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11投资组合报告附注

5.11.1本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2报告期内基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	304.83
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,324,136.13
5	应收申购款	30,759,157.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	35,083,598.51

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期内未投资股票。

5.11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	金鹰元盛债券(LOF)C	金鹰元盛债券(LOF)E
本报告期期初基金份额总额	29,507,450.16	20,750,170.13
报告期基金总申购份额	28,160,523.67	257,587,939.82
减:报告期基金总赎回份额	8,271,934.63	14,034,621.02
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	49,396,039.20	264,303,488.93

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

本基金发起人的三年封闭期限已经届满,报告期末发起资金持有本基金份额为104681.69份,占基金份额比例为0.21%。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期,经基金管理人董事会审议通过,免去李云亮先生督察长、陈瀚先生副总经理、曾长兴先生副总经理职务,聘请曾长兴先生担任公司督察长,聘请满黎先生担任公司副总经理,上述事项已在证监会指定媒体披露。

§10 备查文件目录

10.1备查文件目录

1、中国证监会批准发行及募集的文件。

2、《金鹰元盛分级债券型发起式证券投资基金基金合同》。

3、《金鹰元盛分级债券型发起式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。

10.2存放地点

广州市天河区珠江东路28号越秀金融大厦30层

10.3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

二〇一八年十月二十四日