

金鹰元盛债券型发起式证券投资基金

[2015] 第四季度报告

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:二〇一六年一月二十一日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及高级管理人员根据法律法规的规定,对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、完整性承担个别及连带责任。

基金托管人对本基金报告书的基本情况、定期报告书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。

报告书所载内容未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至2015年12月31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

交易代码 162108

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2013年6月2日

报告期末基金份额总额 483,442,894.85份

投资目标 在严格控制投资风险的前提下,通过积极的主动投资管理,力争为基金份额持有人提供超越业绩比较基准的稳定回报。

投资策略 本基金在充分运用定量分析和定性分析的基础上,结合对宏观经济、利率、信用、行业、股票、债券等市场的深入研究,在严格控制风险的前提下,通过积极的主动投资管理,力争为基金份额持有人提供超越业绩比较基准的稳定回报。

业绩比较基准 中国债券综合指数收益率*65%+银行存款利率(税后)*35%

风险特征 本基金为债券型基金,属于证券投资基金中风险较低的品种,其长期平均风险与预期收益率低于股票型基金,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

注:本基金已于2015年5月4日按照合同约定转型为上市开放式基金(LOF)。

§ 3 主要财务指标

单位:人民币元

报告期 (2015年10月1日-2015年12月31日)

1.本期已实现收益 14,136,713.26

2.本期利润 20,230,146.11

3.期末平均基金份额利润 0.0347

4.期末基金净值 521,529,166.00

5.期末基金份额净值 1.079

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.所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示的指标;

3.2 基金净值表现

3.2.1 报告基金净值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 3.78% 0.12% 2.73% 0.08% 10.02% 0.04%

3.2.2 基金合同生效以来基金累计净值份额净值变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

金额元/盛债券型发起式证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013年5月2日至2015年12月31日)

注:1.本基金对固定收益类金融工具的投资比例不低于基金资产的80%,其中中小企业私募债券的投资比例不超过基金资产的20%,每日需持有现金和到期日不超过一年期的政府债券不低于基金资产净值的5%;

2.业绩比较基准:中国债券综合财富收益率。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人(基金经理小组)简介

姓名 职务 任期日期 离任日期 说明

张俊杰 基金经理 2014-12-10 -

张俊杰先生,厦门大学金融工程硕士,2008年7月加入金鹰基金管理有限公司,历任行业分析师、金融工程研究员,固定收益事业部高级经理,债券研究员,2013年6月加入金鹰基金管理有限公司,现任基金经理,金鹰元盛债券型发起式证券投资基金、金鹰添盈债券型证券投资基金、金鹰添盈灵活配置混合型证券投资基金。

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合规性情况的说明

本报告期内,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取最大利益。

4.3 管理人对宏观经济、行业政策的执行情况

本报告期内,本基金管理人按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,通过规范的交易流程,以公平对待所管理的不同基金,从而保证公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金投资策略、研究和交易流程,确保公平对待不同投资组合,切实防范利益输送的专项说明

本报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,通过规范的交易流程,以公平对待所管理的不同基金,从而保证公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

4.5 管理人对报告期内基金投资策略、研究和交易流程,公平对待所管理的不同基金的专项说明

本报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,通过规范的交易流程,以公平对待所管理的不同基金,从而保证公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

4.6 管理人对报告期内基金投资策略、研究和交易流程,公平对待所管理的不同基金的专项说明

本报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,通过规范的交易流程,以公平对待所管理的不同基金,从而保证公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

4.7 管理人对报告期内基金投资策略、研究和交易流程,公平对待所管理的不同基金的专项说明

本报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,通过规范的交易流程,以公平对待所管理的不同基金,从而保证公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

4.8 管理人对报告期内基金投资策略、研究和交易流程,公平对待所管理的不同基金的专项说明

本报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,通过规范的交易流程,以公平对待所管理的不同基金,从而保证公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

4.9 管理人对报告期内基金投资策略、研究和交易流程,公平对待所管理的不同基金的专项说明

本报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,通过规范的交易流程,以公平对待所管理的不同基金,从而保证公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

4.10 管理人对报告期内基金投资策略、研究和交易流程,公平对待所管理的不同基金的专项说明

本报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,通过规范的交易流程,以公平对待所管理的不同基金,从而保证公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

4.11 管理人对报告期内基金投资策略、研究和交易流程,公平对待所管理的不同基金的专项说明

本报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,通过规范的交易流程,以公平对待所管理的不同基金,从而保证公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

4.12 管理人对报告期内基金投资策略、研究和交易流程,公平对待所管理的不同基金的专项说明

本报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,通过规范的交易流程,以公平对待所管理的不同基金,从而保证公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

4.13 管理人对报告期内基金投资策略、研究和交易流程,公平对待所管理的不同基金的专项说明

本报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,通过规范的交易流程,以公平对待所管理的不同基金,从而保证公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

4.14 管理人对报告期内基金投资策略、研究和交易流程,公平对待所管理的不同基金的专项说明

本报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,通过规范的交易流程,以公平对待所管理的不同基金,从而保证公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

4.15 管理人对报告期内基金投资策略、研究和交易流程,公平对待所管理的不同基金的专项说明

本报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,通过规范的交易流程,以公平对待所管理的不同基金,从而保证公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

4.16 管理人对报告期内基金投资策略、研究和交易流程,公平对待所管理的不同基金的专项说明

本报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,通过规范的交易流程,以公平对待所管理的不同基金,从而保证公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

4.17 管理人对报告期内基金投资策略、研究和交易流程,公平对待所管理的不同基金的专项说明

本报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,通过规范的交易流程,以公平对待所管理的不同基金,从而保证公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

4.18 管理人对报告期内基金投资策略、研究和交易流程,公平对待所管理的不同基金的专项说明

本报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,通过规范的交易流程,以公平对待所管理的不同基金,从而保证公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

4.19 管理人对报告期内基金投资策略、研究和交易流程,公平对待所管理的不同基金的专项说明

本报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,通过规范的交易流程,以公平对待所管理的不同基金,从而保证公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

4.20 管理人对报告期内基金投资策略、研究和交易流程,公平对待所管理的不同基金的专项说明

本报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,通过规范的交易流程,以公平对待所管理的不同基金,从而保证公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

4.21 管理人对报告期内基金投资策略、研究和交易流程,公平对待所管理的不同基金的专项说明

本报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,通过规范的交易流程,以公平对待所管理的不同基金,从而保证公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

4.22 管理人对报告期内基金投资策略、研究和交易流程,公平对待所管理的不同基金的专项说明

本报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,通过规范的交易流程,以公平对待所管理的不同基金,从而保证公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

4.23 管理人对报告期内基金投资策略、研究和交易流程,公平对待所管理的不同基金的专项说明

本报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,通过规范的交易流程,以公平对待所管理的不同基金,从而保证公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

4.24 管理人对报告期内基金投资策略、研究和交易流程,公平对待所管理的不同基金的专项说明

本报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,通过规范的交易流程,以公平对待所管理的不同基金,从而保证公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

4.25 管理人对报告期内基金投资策略、研究和交易流程,公平对待所管理的不同基金的专项说明

本报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,通过规范的交易流程,以公平对待所管理的不同基金,从而保证公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

4.26 管理人对报告期内基金投资策略、研究和交易流程,公平对待所管理的不同基金的专项说明

本报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,通过规范的交易流程,以公平对待所管理的不同基金,从而保证公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

4.27 管理人对报告期内基金投资策略、研究和交易流程,公平对待所管理的不同基金的专项说明

本报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,通过规范的交易流程,以公平对待所管理的不同基金,从而保证公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

4.28 管理人对报告期内基金投资策略、研究和交易流程,公平对待所管理的不同基金的专项说明

本报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,通过规范的交易流程,以公平对待所管理的不同基金,从而保证公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

4.29 管理人对报告期内基金投资策略、研究和交易流程,公平对待所管理的不同基金的专项说明

本报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,通过规范的交易流程,以公平对待所管理的不同基金,从而保证公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

4.30 管理人对报告期内基金投资策略、研究和交易流程,公平对待所管理的不同基金的专项说明

本报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,通过规范的交易流程,以公平对待所管理的不同基金,从而保证公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

4.31 管理人对报告期内基金投资策略、研究和交易流程,公平对待所管理的不同基金的专项说明

本报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,通过规范的交易流程,以公平对待所管理的不同基金,从而保证公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

4.32 管理人对报告期内基金投资策略、研究和交易流程,公平对待所管理的不同基金的专项说明

本报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,通过规范的交易流程,以公平对待所管理的不同基金,从而保证公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

4.33 管理人对报告期内基金投资策略、研究和交易流程,公平对待所管理的不同基金的专项说明

本报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,通过规范的交易流程,以公平对待所管理的不同基金,从而保证公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

4.34 管理人对报告期内基金投资策略、研究和交易流程,公平对待所管理的不同基金的专项说明

本报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,通过规范的交易流程,以公平对待所管理的不同基金,从而保证公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

4.35 管理人对报告期内基金投资策略、研究和交易流程,公平对待所管理的不同基金的专项说明

本报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,通过规范的交易流程,以公平对待所管理的不同基金,从而保证公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

4.36 管理人对报告期内基金投资策略、研究和交易流程,公平对待所管理的不同基金的专项说明

本报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,通过规范的交易流程,以公平对待所管理的不同基金,从而保证公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。