金鹰鑫益灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

2017年9月30日
基金管理人:金鹰基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年十月二十五日

§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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年10月24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2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金鹰鑫益混合
基金主代码	003484
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年11月16日
报告期末基金份额总额	87,199,420.12份
投资目标	本基金在严格控制风险并保持良好流动性的前提下,通过精选股票、债券等投资标的,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。通过“自上而下”及“自下而上”相结合的方法挖掘优质的上市公司,构建股票投资组合;以经济基本面变化趋势分析为基础,结合货币、财政宏观政策,以及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素,判断利率和债券市场走势;运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略等多种积极管理策略,深入研究挖掘价值被低估的债券和市场投资机会,构建收益稳定、流动性良好的债券组合。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金,属于证券投资基金中预期较高风险、较高收益的品种,其预期收益和风险水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	金鹰鑫益混合A	金鹰鑫益混合C
下属分级基金的交易代码	003484	003485
报告期末下属分级基金的份额总额	83,699,318.43份	3,500,101.69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(2017年7月1日-2017年9月30日)	
	金鹰鑫益混合A	金鹰鑫益混合C
1.本期已实现收益	4,804,738.47	37,439.45
2.本期利润	3,858,506.67	45,941.57
3.加权平均基金份额本期利润	0.0162	0.0131
4.期末基金资产净值	86,647,211.38	3,618,672.71
5.期末基金份额净值	1.0352	1.0339

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.金鹰鑫益混合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	1.31%	0.15%	2.60%	0.29%	-1.29%	-0.14%

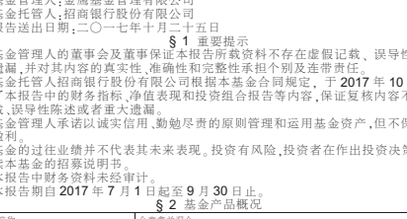
2.金鹰鑫益混合C:

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	1.28%	0.15%	2.60%	0.29%	-1.32%	-0.14%

3.2.2 自基金合同生效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

金鹰鑫益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
(2016年11月16日至2017年9月30日)

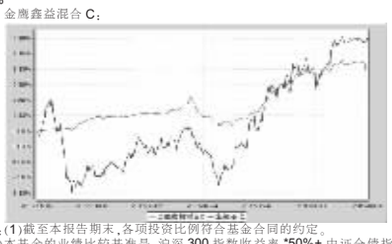
1.金鹰鑫益混合A:



注:(1)截至本报告期末,各项投资比例符合基金合同的约定。

(2)本基金的业绩比较基准是:沪深300指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%

2.金鹰鑫益混合C:



注:(1)截至本报告期末,各项投资比例符合基金合同的约定。

(2)本基金的业绩比较基准是:沪深300指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%

§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		
黄艳芳	基金经理	2016-11-16	-	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,中银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,金鹰鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金,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,金鹰添润纯债债券型证券投资基金,金鹰添富纯债债券型证券投资基金,金鹰民丰回报定期开放混合型证券投资基金基金经理。

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

2017年三季度以来，经济稳中求缓的迹象初显。8月工业增加值同比增速滑落至6%,一方面是环保限产的影响,另一方面受基数的影响。但从环比数据来看,并未出现明显回落。财政约束下,基建投资放缓延续;房地产新开工增速已经跟随销售回落,投资增速从累计同比来看,回落还不明显,但单月同比增速显示,已经开始调头向下。地产下行压力下半年逐步显现。三季度出口数据显示,出口已经处于平缓回落的过程中。总得来看宏观经济,在经历了上半年反弹后,平稳放缓的迹象初步显现。通胀在食品CPI触底回升的带动下,也逐步掉头,不过年内暂无通胀压力。

监管政策三季度稍有缓和,但监管政策并未结束,仍处于监管下半程。货币依然中性偏紧,这导致低超储率下,资金面的阶段性偏紧成常态。债市受流动性、风险偏好等制约,依然较为疲弱。整体处于低位震荡的态势,并未有明显改观。我们在三季度延续了中短久期的操作策略,以票息收益为主,同时积极把握利率长端的交易性机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2017年9月30日，基金份额净值1.056元，本报告期份额净值增长1.34%,同期业绩比较基准增长率为0.54%,基金业绩表现优于比较基准0.80%。

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2017年四季度,考虑到本轮库存周期基本结束、基建后继乏力、地产投资仍存下行压力下、消费和出口也将放缓,总需求缓步下行趋势相对确定。供给侧改革和环保限产是短期焦点,环保限产制约的不仅仅是供给,对需求也有很强的抑制作用,在这种格局下,经济下行压力大。但这并不意味着,宏观经济会再度失速,过剩产能的出清和房地产库存去化,以及海外需求的复苏,使得国内经济,有底气有空间保持在当前平台区间,经济或在较长时间上下有度。通胀四季度依旧缓和,但需关注预期的变化,PPI将见顶回落。而在去杠杆的大背景下,货币政策暂时不存在转向的基础,依然维持中性适度,但对流动性以及经济结构性引导有望进一步提升。监管来看,未来将有更多细则出台来落实前期的监管要求。虽然监管加强趋势不可逆,但监管协调下对市场的影响将更加可控。

基于以上分析,我们认为,从中长期经济基本面来看,投资环境在逐步改善,利率上行空间或有限,但是经济短期仍在韧性,资金面仍有波动,货币政策放松空间有限,监管政策还将陆续出台,这些因素都将制约利率下行的空间,后续债市获将继续保持震荡态势。因此,四季度整体策略继续谨慎,本基金债券部分继续采取稳健操作,持仓以存单为主,少量配置可转债,等待经济、政策信号明确后再拉长久期布局长端。

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	2,231,798.89	2.19
	其中:股票	2,231,798.89	2.19
2	固定收益投资	95,906,221.40	94.00
	其中:债券	95,906,221.40	94.00
	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	1,619,531.79	1.59
7	其他各项资产	2,266,391.29	2.22
8	合计	102,023,943.37	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	39,793.60	0.04
C	制造业	440,298.46	0.49
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	26,385.45	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,468.03	0.02
J	金融业	1,535,757.00	1.70
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	115,299.99	0.13
R	文化、体育和娱乐业	31,224.45	0.03
S	综合	-	-
	合计	2,231,798.89	2.47

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投资港股通股票。

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	601336	新华保险	27,100	1,535,757.00	1.70
2	603882	金域医学	2,763	115,299.99	0.13
3	603106	恒银金融	2,786	84,025.76	0.09
4	603055	台华新材	2,658	62,489.58	0.07
5	603367	辰欣药业	3,315	55,658.85	0.06
6	603321	梅轮电梯	2,725	54,309.25	0.06
7	603386	广东骏亚	1,644	41,823.36	0.05
8	603619	中曼石油	1,760	39,793.60	0.04
9	603157	拉夏贝尔	2,150	38,119.50	0.04
10	603378	亚士创能	1,627	33,337.23	0.04

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	9,995,000.00	11.07
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,990,000.00	5.53
	其中:政策性金融债	4,990,000.00	5.53
4	企业债券	59,167,000.00	65.55
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	19,819,000.00	21.96
7	可转债(可交换债)	1,935,221.40	2.14
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	95,906,221.40	106.25

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	112483	16亚新01	200,000.00	19,330,000.00	21.41
2	1280469	12淮北建投集团债	300,000.00	15,273,000.00	16.92
3	019563	17国债09	100,000.00	9,995,000.00	11.07
4	101660036	16九华山MTN002	100,000.00	9,926,000.00	11.00
5	136426	16电投01	100,000.00	9,904,000.00	10.97

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

本基金本报告期内未投资资产支持证券。

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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

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	21,932.72
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,244,258.77
5	应收申购款	199.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,266,391.29

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	603619	中曼石油	39,793.60	0.04	未上市待流通

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	金鹰鑫益混合A	金鹰鑫益混合C
本报告期期初基金份额总额	260,327,646.82	3,500,090.00
报告期基金总申购份额	36,469.74	496.99
减:报告期基金总赎回份额	176,664,798.13	485.30
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	83,699,318.43	3,500,101.69

§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	2017年7月1日-2017年9月26日	148,455,067.30	0.00	148,455,067.30	0.00	0.00%

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个工作日基金资产净值低于5000万元,可能导致本基金提前终止基金合同的风险。 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

1、本报告期内,经公司股东会审议通过,聘请刘岩先生担任公司法定代表人职务,并同时免去凌富华先生公司法定代表人职务,该事项已于2017年7月15日在证监会指定媒体披露;

2、本报告期内,经公司股东会审议通过,公司注册地址由“广东省珠海市香洲区吉大九洲大道东段商业银行大厦716单元”变更为“广东省珠海市香洲区水湾路246号3栋2单元3D房”。该事项已于2017年7月20日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、中国证监会注册的金鹰鑫益灵活配置混合型证券投资基金发行及募集的文件。

2、《金鹰鑫益灵活配置混合型证券投资基金合同》。

3、《金鹰鑫益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。

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。

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
二〇一七年十月二十五日

金鹰元祺保本混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

2017年9月30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
报告送出日期:二〇一七年十月二十五日

§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年10月24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2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金鹰元祺保本混合
基金主代码	002490
交易代码	002490
基金运作方式	保本期封闭式运作
基金合同生效日	2016年4月6日
报告期末基金份额总额	679,143,145.51份
投资目标	本基金在有效控制风险的前提下,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	本基金在投资组合管理过程中采取主动投资方法,通过数量化方法严格控制风险,并通过有效的资产配置策略,动态调整安全资产和风险资产的投资比例。在重风险与收益的平衡,力争实现基金资产长期稳健增值。
业绩比较基准	2年期银行定期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为保本混合型证券投资基金,属于证券投资基金当中的低风险品种,其长期平均风险与预期收益率低于股票型基金,非保本的混合型基金,高于债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
基金保证人	深圳市高新投集团有限公司

§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(2017年7月1日-2017年9月30日)
1.本期已实现收益	9,467,846.11
2.本期利润	9,913,075.08
3.加权平均基金份额本期利润	0.0146
4.期末基金资产净值	717,465,587.72
5.期末基金份额净值	1.056

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。

3.2 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、金鹰元祺保本混合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	1.39%	0.20%	1.19%	0.12%	0.20%	0.08%

2、金鹰元禧混合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	1.37%	0.20%	1.19%	0.12%	0.18%	0.08%

3.2.2 自基金合同生效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

金鹰元祺保本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
(2016年4月6日至2017年9月30日)

注:1、本基金于2016年4月6日成立。

2、截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同约定。

3、本基金业绩比较基准为:2年期银行定期存款利率(税后)。

§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		
倪超	基金经理	2016-04-06	-	8	倪超先生,厦门大学硕士研究生。2009年6月加盟金鹰基金管理有限公司,先后任行业研究员,消费品研究小组组长、基金经理助理。现任金鹰行业优势混合型证券投资基金,金鹰元祺保本混合型证券投资基金,金鹰元禧混合型证券投资基金,金鹰元祺保本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基金经理。
刘丽娟	固定收益部总监、基金经理	2016-10-19	-	10	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,金鹰添益纯债债券型证券投资基金,金鹰灵活配置混合型证券投资基金,金鹰元宝混合型证券投资基金,金鹰元丰保本混合型证券投资基金,金鹰元祺保本混合型证券投资基金,金鹰元和保本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,金鹰添宝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,金鹰添惠纯债债券型证券投资基金,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,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

2017年三季度以来，宏观经济稳中求缓的迹象初显。8月工业增加值同比增速滑落至6%,一方面是环保限产的影响,另一方面受基数的影响。但从环比数据来看,并未出现明显回落。财政约束下,基建投资放缓延续;房地产新开工增速已经跟随销售回落,投资增速从累计同比来看,回落还不明显,但单月同比增速显示,已经开始调头向下。地产下行压力下半年逐步显现。三季度出口数据显示,出口已经处于平缓回落的过程中。总得来看宏观经济,在经历了上半年反弹后,平稳放缓的迹象初步显现。通胀在食品CPI触底回升的带动下,也逐步掉头,不过年内暂无通胀压力。

监管政策三季度稍有缓和,但监管政策并未结束,仍处于监管下半程。货币依然中性偏紧,这导致低超储率下,资金面的阶段性偏紧成常态。债市受流动性、风险偏好等制约,依然较为疲弱。整体处于低位震荡的态势,并未有明显改观。我们在三季度延续了中短久期的操作策略,以票息收益为主,同时积极把握利率长端的交易性机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止2017年9月30日，基金份额净值1.056元，本报告期份额净值增长1.34%,同期业绩比较基准增长率为0.54%,基金业绩表现优于比较基准0.80%。

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2017年四季度,考虑到本轮库存周期基本结束、基建后继乏力、地产投资仍存下行压力下、消费和出口也将放缓,总需求缓步下行趋势相对确定。

但这并不意味着,宏观经济会再度失速,过剩产能的出清和房地产库存去化,以及海外需求的复苏,使得国内经济,有底气有空间保持在当前平台区间,得做好经济较长时间上下有度的准备。通胀四季度依旧缓和,但需关注预期的变化,PPI将见顶回落。货币政策暂时不存在转向的基础,但对流动性以及经济结构性引导有望进一步提升。我们认为四季度债券市场仍将保持震荡走势。我们在确保组合良好流动性和安全性的前提下,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	371,474,946.80	50.99
	其中:债券	371,474,946.80	50.99
	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	322,100,420.20	44.22
	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	29,899,262.97	4.10
7	其他各项资产	4,997,455.48	0.69
8	合计	728,472,085.45	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

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未投资港股通股票。

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

本基金本报告期末未投资股票。

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	39,696,000.00	5.53
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	245,917,200.00	34.28
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	49,305,000.00	6.87
7	可转债(可交换债)	7,252,746.80	1.01
8	同业存单	29,304,000.00	4.08
9	其他	-	-
10	合计	371,474,946.80	51.78

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	122388	15华泰G1	500,000.00	49,830,000.00	6.95
2	122394	15中银债	500,000.00	49,765,000.00	6.94
3	101653023	16光明MTN001	500,000.00	49,305,000.00	6.87
4	136581	16外高02	500,000.00	48,615,000.00	6.78
5	112138	12乐宇01	410,000.00	41,012,300.00	5.72

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

本基金本报告期内未投资资产支持证券。

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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无

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不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	21,844.53
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,975,610.95
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,997,455.48