金鹰元安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:广发银行股份有限公司
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。

基金托管人广发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	金鹰元安混合	
基金主代码	000110	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年6月6日	
报告期末基金份额总额	19,048,640.32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,注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	沪深300指数收益率×20%+中债总财富(总值)指数收益率×80%	
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金,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	广发银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	金鹰元安混合A	金鹰元安混合C
下属分级基金的交易代码	000110	002513
报告期末下属分级基金的份额总额	14,803,097.30份	4,245,543.02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)	
	金鹰元安混合A	金鹰元安混合C
1.本期已实现收益	41,438.90	7,256,055.89
2.本期利润	610,695.48	6,331,230.34
3.加权平均基金份额本期利润	0.0449	0.0171
4.期末基金资产净值	16,456,909.65	4,606,484.96
5.期末基金份额净值	1.1117	1.0848

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.金鹰元安混合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	4.30%	0.30%	0.48%	0.27%	3.82%	0.03%

2.金鹰元安混合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	7.19%	0.56%	0.48%	0.27%	6.71%	0.29%

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

金鹰元安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

(2017年6月6日至2018年9月30日)

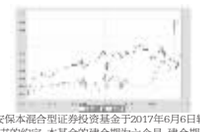
1. 金鹰元安混合A:

注:1.本基金由原金鹰元安保本混合型证券投资基金于2017年6月6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:沪深300指数收益率×20%+中债总财富(总值)指数收益率×80%。

2. 金鹰元安混合C:



注:1.本基金由原金鹰元安保本混合型证券投资基金于2017年6月6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:沪深300指数收益率×20%+中债总财富(总值)指数收益率×80%。

§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	2017-09-08	-	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。现任金鹰持久期纯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。
吴德琨	基金经理	2017-09-30	-	5	吴德琨先生,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《证券业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,提升了权益品种和转债品种的仓位,因而本运作期内净值波动较前期有所放大。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2018年9月30日,A类基金份额净值为1.1117元,本报告期份额净值增长率为4.30%,同期业绩比较基准增长率为0.48%;C类基金份额净值为1.0848元,本报告份额期净值增长率7.19% ,同期业绩比较基准增长率为0.48%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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	3,899,890.30	17.75
	其中:股票	3,899,890.30	17.75
2	固定收益投资	9,842,506.14	44.81
	其中:债券	9,842,506.14	44.81
	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	2,000,000.00	9.11
	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	5,639,538.18	25.67
7	其他各项资产	583,948.00	2.66
8	合计	21,965,882.62	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	304,500.00	1.45
C	制造业	1,989,900.00	9.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	460,800.00	2.19
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,144,690.30	5.43
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	3,899,890.30	18.52

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	601111	中国国航	89,962	733,190.30	3.48
2	603816	顺丰家居	11,500	572,700.00	2.72
3	000703	恒逸石化	30,000	508,500.00	2.41
4	601233	桐昆股份	30,000	493,200.00	2.34
5	600310	桂东电力	120,000	460,800.00	2.19
6	300124	汇川技术	15,000	415,500.00	1.97
7	601006	大秦铁路	50,000	411,500.00	1.95
8	601225	陕西煤业	35,000	304,500.00	1.45

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	1,131,750.00	5.37
	其中:政策性金融债	1,131,750.00	5.37
4	企业债券	1,102,860.00	5.24
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	7,607,896.14	36.12
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,842,506.14	46.73

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	132012	17巨化EB	15,000.00	1,461,000.00	6.94
2	132014	18中化EB	12,000.00	1,244,400.00	5.91
3	018005	国开1701	11,250.00	1,131,750.00	5.37
4	127006	敖东转债	10,500.00	1,021,230.00	4.85
5	112501	17东江G1	10,000.00	1,000,900.00	4.75

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	364,168.41
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	63,708.67
5	应收申购款	156,070.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	583,948.00

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	110041	蒙电转债	489,204.30	2.32
2	113011	光大转债	650,160.00	3.09
3	113504	艾华转债	453,520.00	2.15
4	127005	长证转债	314,781.04	1.49
5	127006	敖东转债	1,021,230.00	4.85
6	132004	15国盛EB	855,000.00	4.06
7	132012	17巨化EB	1,461,000.00	6.94

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	金鹰元安混合A	金鹰元安混合C
本报告期期初基金份额总额	13,197,538.11	499,860,651.45
报告期基金总申购份额	3,206,847.28	5,086,169.98
减:报告期基金总赎回份额	1,601,288.09	500,701,278.41
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	14,803,097.30	4,245,543.02

§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7月1日至2018年9月4日	499,749.125.44	-	499,749.125.44	0.00	0.00%
产品持有风险								

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60%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.《金鹰元安混合型证券投资基金基金合同》。

3.《金鹰元安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

金鹰元祺信用债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:交通银行股份有限公司
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。

基金托管人交通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	金鹰元祺债券
基金主代码	002490
交易代码	002490
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年11月8日
报告期末基金份额总额	28,351,870.88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	本基金充分考虑基金资产的安全性、收益性及流动性,在严格控制风险的前提下力争实现资产的稳定增值。在资产配置中,本基金以信用债为主,通过密切关注债券市场变化,持续研究债券市场运行状况,研判市场风险,在确保资产稳定增值的基础上,通过积极主动的资产配置,力争实现超越业绩比较基准的投资收益。
业绩比较基准	中债信用债总财富(总值)指数收益率×80%+一年定期存款利率(税后)×20%
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金,属于较低预期收益、较低预期风险的证券投资基金品种,其预期收益和预期风险高于货币市场基金,但低于混合型基金、股票型基金。
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

§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	265,601.03
2.本期利润	342,816.92
3.加权平均基金份额本期利润	0.0152
4.期末基金资产净值	31,253,952.06
5.期末基金份额净值	1.1024

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

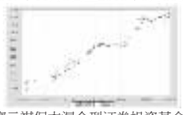
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.63%	0.11%	1.74%	0.04%	-0.11%	0.07%

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

金鹰元祺信用债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11月8日至2018年9月30日)



注:1.本基金由原金鹰元祺保本混合型证券投资基金于2017年11月8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,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:中债信用债总财富(总值)指数收益率*80%+一年定期存款利率(税后)*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		
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。
林龙军	基金经理	2018-06-02	-	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。现任金鹰持久期纯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。

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、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

二季度我们表达了对于转债品种的看好,主要基于绝对价格和收益率两大因素。在三季度我们继续加大了转债品种的配置,尤其是平衡型的转债。在7月份充分享受到了权益市场回暖带来的平价上行,本组合也取得了不错的超额回报。进入8月份后,在汇率和油价的双重压力下,风险资产还是经受了较大程度的回调,转债市场也不例外。为了提升组合的静态收益率,在严控信用风险的前提下,我们在本运作期内置换或新增了部分短久期信用债,而对于长端信用债,我们认为性价比仍然偏低。

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1.1024元,本报告期份额净值增长率为1.63%,同期业绩比较基准增长率为1.74%。

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

报告期内, 本基金资产净值已发生连续超过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 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	35,097,405.40	97.10
	其中:债券	35,097,405.40	97.10
	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	535,863.61	1.48
7	其他各项资产	513,571.99	1.42
8	合计	36,146,841.00	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	1,912,840.00	6.12
	其中:政策性金融债	1,912,840.00	6.12
4	企业债券	22,902,685.10	73.28
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	10,281,880.30	32.90
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	35,097,405.40	112.30

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	122328	12开滦02	24,000.00	2,458,800.00	7.87
2	132004	15国盛EB	25,100.00	2,384,500.00	7.63
3	112674	18国通01	21,000.00	2,091,600.00	6.69
4	136614	16融业01	20,920.00	2,066,059.20	6.61
5	112214	14杰赛债	20,000.00	2,022,600.00	6.47

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	364,168.41
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	63,708.67
5	应收申购款	156,070.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	583,948.00

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	747,600.00	2.39
2	110041	蒙电转债	522,975.80	1.67
3	113013	国君转债	10,460.00	0.03
4	127005	长证转债	764,960.00	2.45
5	127006	敖东转债	291,780.00	0.93
6	132004	15国盛EB	2,384,500.00	7.63
7	132006	16皖新EB	1,040,071.50	3.33
8	132008	17山高EB	7,704.00	0.02
9	132011	17浙投EB	899,800.00	2.88
10	132012	17巨化EB	1,071,400.00	3.43

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

本报告期期初基金份额总额	19,168,817.58
报告期基金总申购份额	10,271,725.83
减:报告期基金总赎回份额	1,088,672.53
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	28,351,870.88

§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