

# 金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）

## 2018 年年度报告摘要

2018 年 12 月 31 日

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

送出日期：二〇一九年三月二十六日

## § 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 25 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经审计。中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                   |                  |
|-----------------|-------------------|------------------|
| 基金简称            | 金鹰元盛债券（LOF）       |                  |
| 场内简称            | 元盛债券              |                  |
| 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    |                  |
| 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      |                  |
| 报告期末基金份额总额      | 752,820,896.42 份  |                  |
| 基金合同存续期         | 不定期               |                  |
| 基金份额上市的证券交易所    | 深圳市福田区深南大道 2012 号 |                  |
| 上市日期            | 2015 年 5 月 20 日   |                  |
| 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 | 71,116,149.17 份   | 681,704,747.25 份 |

### 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，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、宏观政策、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。 |
|--|-----|

### 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              | 中国建设银行股份有限公司         |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 曾长兴                     | 田青                   |
|             | 联系电话 | 020-38898996            | 010-67595096         |
|             | 电子邮箱 | csmail@gefund.com.cn    | tianqing1.zh@ccb.com |
| 客户服务电话      |      | 4006135888,020-83936180 | 010-67595096         |
| 传真          |      | 020-83282856            | 010-66275853         |

### 2.4 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.gefund.com.cn">http://www.gefund.com.cn</a> |
| 基金年度报告备置地点          | 广州市天河区珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层                                      |

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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<br>数据和指<br>标 | 2018 年       |               | 2017 年        |              | 2016 年        |              |
|-----------------------|--------------|---------------|---------------|--------------|---------------|--------------|
|                       | 金鹰元盛债券（LOF）C | 金鹰元盛债券（LOF）E  | 金鹰元盛债券（LOF）C  | 金鹰元盛债券（LOF）E | 金鹰元盛债券（LOF）C  | 金鹰元盛债券（LOF）E |
| 本期已实现收益               | 2,125,369.52 | 9,812,111.80  | -3,013,768.37 | -345,753.05  | 23,757,401.76 | -            |
| 本期利润                  | 3,521,797.10 | 13,103,302.78 | -300,905.99   | -925,954.50  | 1,330,440.32  | -            |
| 加权平均基金份额本期利润          | 0.0820       | 0.0739        | -0.0029       | -0.0867      | 0.0032        | -            |
| 本期基金份额净值增长率           | 8.23%        | 8.87%         | -0.55%        | 8.51%        | 0.74%         | -            |

| 3.1.2 期末<br>数据和指<br>标 | 2018 年末           |                   | 2017 年末           |                   | 2016 年末           |                   |
|-----------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
|                       | 金鹰元盛债券<br>(LOF) C | 金鹰元盛债券<br>(LOF) E | 金鹰元盛债券<br>(LOF) C | 金鹰元盛债券<br>(LOF) E | 金鹰元盛债券<br>(LOF) C | 金鹰元盛债券<br>(LOF) E |
| 期末可供分配基金份额利润          | 0.1265            | 0.2279            | 0.0660            | 0.1555            | 0.0933            | -                 |
| 期末基金资产净值              | 83,229,913.94     | 870,368,328.39    | 52,434,798.16     | 40,806,242.29     | 289,240,848.62    | -                 |
| 期末基金份额净值              | 1.170             | 1.277             | 1.081             | 1.173             | 1.087             | -                 |

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、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、本基金 E 类份额自 2017 年 2 月 14 日起设立，故 E 类份额上年度可比期间为 2017 年 2 月 14 日至 2017 年 12 月 31 日，下同。

### 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

##### 金鹰元盛债券（LOF）C

| 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   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | 1.21%    | 0.05%       | 2.67%      | 0.05%         | -1.46% | 0.00% |
| 过去六个月      | 3.45%    | 0.06%       | 4.19%      | 0.06%         | -0.74% | 0.00% |
| 过去一年       | 8.23%    | 0.07%       | 8.22%      | 0.07%         | 0.01%  | 0.00% |
| 过去三年       | 8.43%    | 0.12%       | 10.49%     | 0.08%         | -2.06% | 0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | 17.00%   | 0.12%       | 16.80%     | 0.08%         | 0.20%  | 0.04% |

##### 金鹰元盛债券（LOF）E

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差 | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差 | ①—③ | ②—④ |
|----|----------|------------|------------|--------------|-----|-----|
|----|----------|------------|------------|--------------|-----|-----|

|            |        | ②     |       | 准差④   |        |       |
|------------|--------|-------|-------|-------|--------|-------|
| 过去三个月      | 1.27%  | 0.05% | 2.67% | 0.05% | -1.40% | 0.00% |
| 过去六个月      | 3.65%  | 0.06% | 4.19% | 0.06% | -0.54% | 0.00% |
| 过去一年       | 8.87%  | 0.07% | 8.22% | 0.07% | 0.65%  | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 18.13% | 0.40% | 9.22% | 0.07% | 8.91%  | 0.33% |

注：1、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

金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）

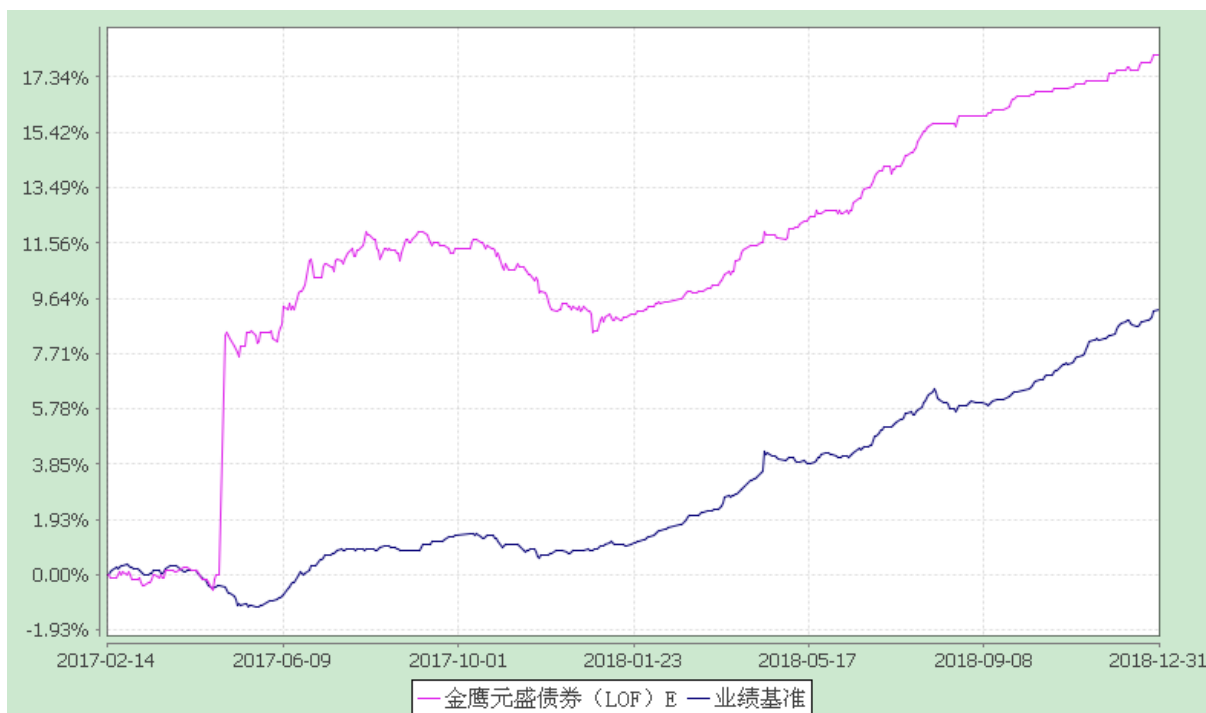
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2015年5月5日至2018年12月31日）

#### 金鹰元盛债券（LOF）C



#### 金鹰元盛债券（LOF）E



注：

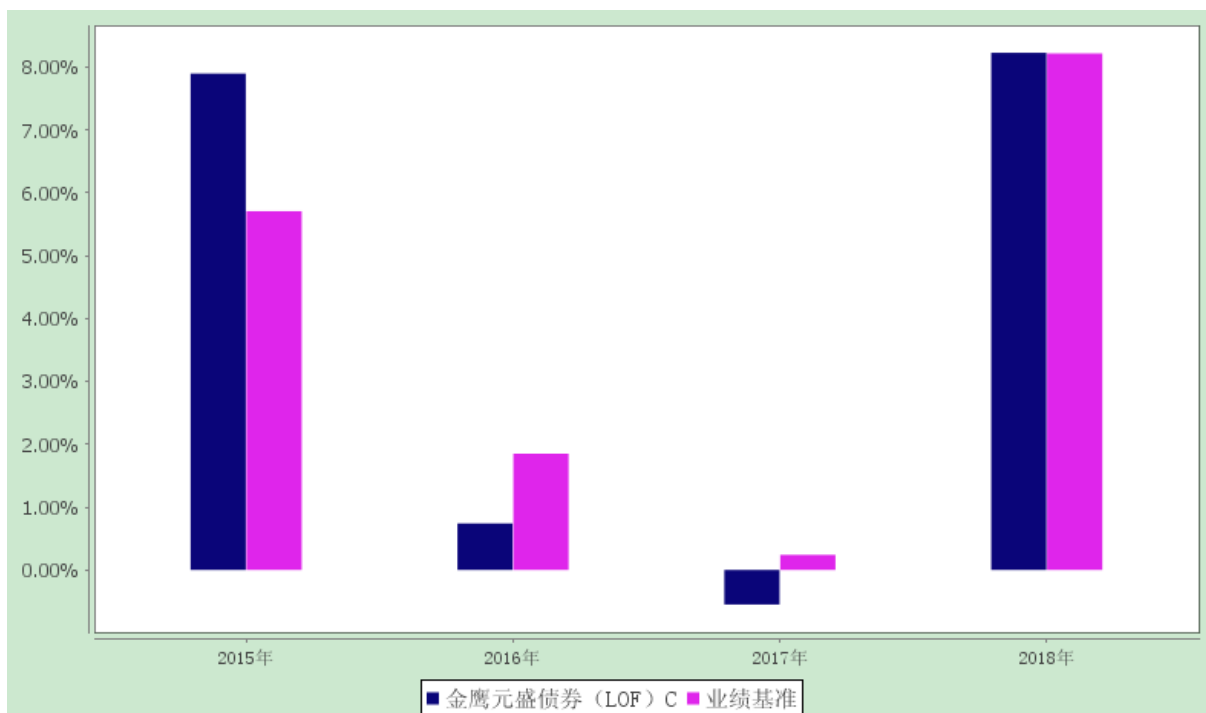
- 1、本基金自 2015 年 5 月 5 日起转型。E 类基金份额于 2017 年 2 月 14 日设立。
- 2、截至报告期末，各项资产配置比例已符合基金合同约定。
- 3、本基金的业绩比较基准为：中国债券综合财富指数收益率。

### 3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

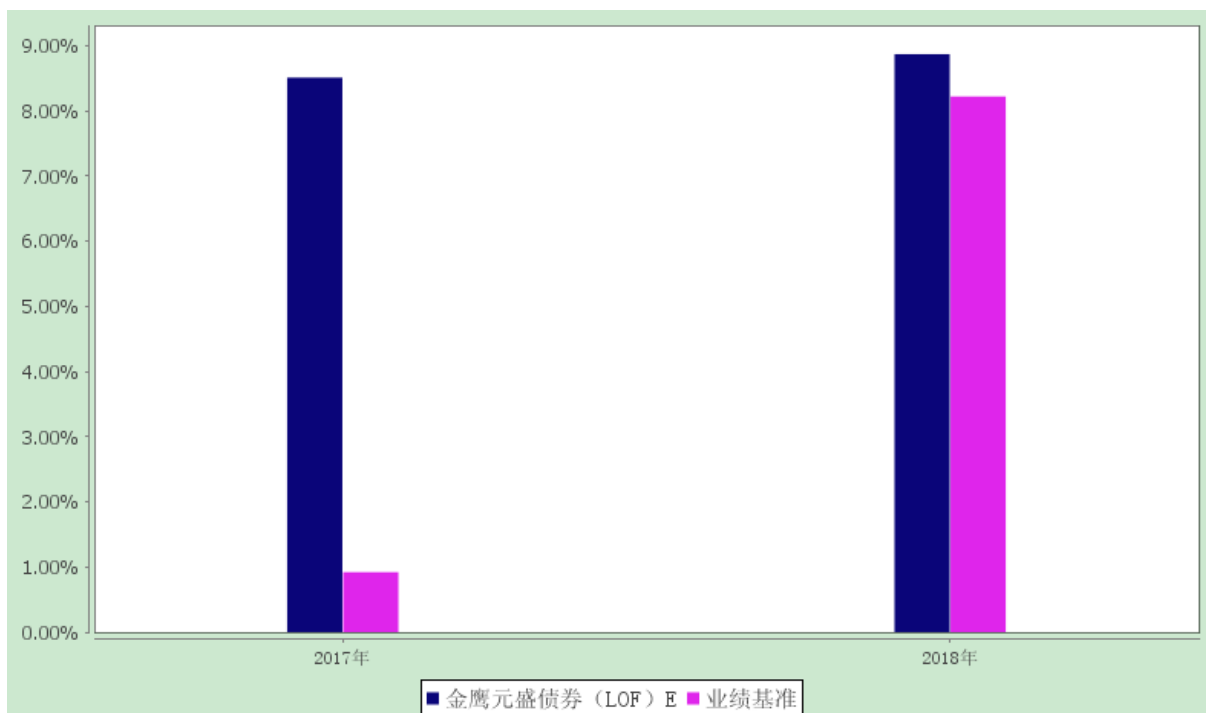
金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）

自基金转型以来基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图

金鹰元盛债券（LOF）C



**金鹰元盛债券（LOF）E**



注：

1、本基金自 2015 年 5 月 5 日起转型。E 类基金份额于 2017 年 2 月 14 日设立。

**3.3 过去三年基金的利润分配情况**

本基金过去三年未进行利润分配。



## § 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

经中国证监会证监基字[2002]97 号文批准，金鹰基金管理有限公司于 2002 年 12 月 25 日成立。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——广州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。公司坚持价值投资为导向，着力打造高水准的投研团队，努力为投资者创造丰厚回报。截至报告期末，公司共有 45 只公募基金，管理规模 601.09 亿元。

## 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务   | 任本基金的<br>基金经理（助<br>理）期限 |          | 证券<br>从业<br>年限 | 说明  |
|----|------|-------------------------|----------|----------------|---|
|    |      | 任职<br>日期                | 离任<br>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。 |
| 戴骏 | 基金经理 | 2019-03-19              | -        | 7              | 戴骏先生，美国密歇根大学金融工程硕士研究生，历任国泰基金管理有限公司基金经理助理、东兴证券股份有限公司债券交易员等职务，2016 年 7 月加入金鹰基金管理有限公司，现任   |

|    |      |            |            |   |   |
|----|------|------------|------------|---|---|
|    |      |            |            |   | 金鹰元禧混合型证券投资基金、金鹰添瑞中短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，金鹰鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金等基金的基金经理助理。   |
| 戴骏 | 基金经理 | 2016-10-20 | 2018-03-20 | 7 | 戴骏先生，美国密歇根大学金融工程硕士研究生，历任国泰基金管理有限公司基金经理助理、东兴证券股份有限公司债券交易员等职务，2016年7月加入金鹰基金管理有限公司，现任金鹰元禧混合型证券投资基金、金鹰添瑞中短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，金鹰鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金等基金的基金经理助理。 |

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合规守信情况的说明

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，严格遵守本基金的基金合同、托管协议、招募说明书等法律文件的规定，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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了保证本基金管理人管理的不同投资组合得到公平对待，本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，以及公司内控大纲的要求，制定了《金鹰基金管理有限公司公平交易管理规定》并严格执行，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。本基金管理人通过投资交易系统公平交易功能，对不同投资组合进行公平交易事前控制。同时，本基金管理人引入公平交易分析系统，定期或不定期对公司旗下投资组合在一定期间内买卖相同证券的情况进行监控和分析。

##### 4.3.2 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。

报告期内，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。

#### 4.3.3 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

2018 年宏观经济在内忧外患交织下再度承压放缓，全年增速回落至 6.6%，四季度单季回落至 6.4%。内部环境的压力主要来自信用收缩造成的融资失速。而社融增速的断崖式跳水，又加剧企业（尤其是中小民企）外部融资环境恶化，信用违约事件常态化。尽管年中政策开始向宽信用转向，但机构表内资本金约束、表外理财整改规范、机构风险偏好较低、微观激励机制不到位等，均导致资金淤积在银行间市场而无法有效传导到实体，宽信用效果迟迟未能见效。外部环境的制约主要来自贸易摩擦加剧经济下滑和产业链调整预期。

市场风险偏好在融资失速和贸易摩擦的双重打压下，始终难有提振。加之流动性宽松（全年四次降准），利率债成为全年表现最好的资产，尤其是中长端利率。信用债上半年在信用违约事件的冲击下，仅高等级品种市场认可。下半年在宽信用政策的引导下，信用利差逐步收敛，行情进一步向中等级迁移。但市场对于低评级债券仍偏谨慎，评级利差仍处分化。

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有效增厚组合收益。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 12 月 31 日，基金 C 类份额净值 1.170，本报告期份额净值收益率为 8.23%，同期业绩比较基准收益率为 8.22%；E 类份额净值 1.277，本报告期份额净值收益率为 8.87%，同期业绩比较基准收益率为 8.22%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年广义流动性收缩造成的信用环境恶化，随着宽信用效果的显现有望显著缓解。当前市场对信用债已经显现出偏好修复，但还是预期修复层面。未来在信用利差收缩的过程中，社融增速有望逐步企稳，信用环境将继续改善。M1 的企稳回升，会是信用环境进一步改善的信号，因为企业流动性出现实质性改善。在信用环境从预期改善到实质改善的过程中，信用利差压缩，评级利差逐步收敛，信用债将在今年享受更多溢价。利率债相对优势弱化，交易比配置更有价值。经过近一年的收益下行，当前利率债距 16 年底部，仅 50bp 之遥。但名义经济增速距彼时仍有距离，且当下并无当年激进扩张的同业理财资金支撑市场，而专项债的大幅发行分流利率债的配置需求，故当前利率债下行空间已较为有限。常态化的降准操作和经济下行逻辑，已较难推动收益下行，只有 MLF 及逆回购利率的下调才能有效推动利率下行。总的来看，越来越逼仄的空间导致利率债下行步履阑珊，波动加大与价值弱化成为常态。故 2019 年利率债只有抓住波动频繁的特性，加大价差操作才能有效增强收益。

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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会由基金估值业务分管领导、督察长、基金估值核算负责人、基金会计、合规风控部人员及相关投研人员等组成。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。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理、投资经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行，一切以维护基金持有人利益为准则。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场债券品种的估值数据及交易所交易的债券品种的估值数据、流通受限股票流动性折扣。

#### 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进行利润分配。

#### 4.8 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

本报告期，会计师事务所未对本基金出具非标准审计报告。

#### 4.9 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

在本报告期内，本基金未出现持有人数或资产净值达到或低于预警线的情形。

### § 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

#### 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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

### § 6 审计报告

中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）审计了 2018 年 12 月 31 日的资产负债表、2018 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注，并出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

### § 7 年度财务报表

#### 7.1 资产负债表

会计主体：金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产         | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| <b>资 产:</b> |                         |                          |
| 银行存款        | 4,630,421.32            | 533,893.78               |
| 结算备付金       | 0.00                    | 188,327.55               |
| 存出保证金       | 476.70                  | 4,052.38                 |
| 交易性金融资产     | 935,727,158.50          | 105,055,052.72           |
| 其中：股票投资     | 0.00                    | -                        |
| 基金投资        | -                       | -                        |
| 债券投资        | 935,727,158.50          | 105,055,052.72           |
| 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    | -                       | 19,206,348.81            |
| 应收证券清算款     | -                       | 5,004,334.87             |
| 应收利息        | 21,219,908.63           | 1,775,486.63             |
| 应收股利        | -                       | -                        |
| 应收申购款       | 990,817.67              | 427.61                   |
| 递延所得税资产     | -                       | -                        |
| 其他资产        | 500.00                  | -                        |
| <b>资产总计</b> | <b>962,569,282.82</b>   | <b>131,767,924.35</b>    |
| 负债和所有者权益    | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |
| <b>负 债:</b> |                         |                          |
| 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   | 1,959,877.06            | 35,319,707.02            |
| 应付证券清算款     | -                       | -                        |

|                   |                       |                       |
|-------------------|-----------------------|-----------------------|
| 应付赎回款             | 5,451,935.94          | 2,029,227.71          |
| 应付管理人报酬           | 581,073.62            | 57,324.01             |
| 应付托管费             | 166,021.04            | 16,378.29             |
| 应付销售服务费           | 28,742.23             | 18,793.00             |
| 应付交易费用            | 34,998.55             | 8,283.49              |
| 应交税费              | 434,702.93            | 434,630.88            |
| 应付利息              | 1,387.12              | 21,016.08             |
| 应付利润              | -                     | -                     |
| 递延所得税负债           | -                     | -                     |
| 其他负债              | 312,302.00            | 621,523.42            |
| <b>负债合计</b>       | <b>8,971,040.49</b>   | <b>38,526,883.90</b>  |
| <b>所有者权益：</b>     |                       |                       |
| 实收基金              | 749,527,569.98        | 81,029,671.79         |
| 未分配利润             | 204,070,672.35        | 12,211,368.66         |
| <b>所有者权益合计</b>    | <b>953,598,242.33</b> | <b>93,241,040.45</b>  |
| <b>负债和所有者权益总计</b> | <b>962,569,282.82</b> | <b>131,767,924.35</b> |

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，本基金份额总额 752,820,896.42 份。本基金 C 类份额净值 1.170 元，份额总额 71,116,149.17 份；本基金 E 份额净值 1.277 元，份额总额 681,704,747.25 份。

## 7.2 利润表

会计主体：金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目         | 本期                                  | 上年度可比期间                             |
|-------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
|             | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年<br>12 月 31 日 | 2017 年 1 月 1 日至 2017<br>年 12 月 31 日 |
| <b>一、收入</b> | <b>19,984,846.94</b>                | <b>1,650,013.61</b>                 |
| 1.利息收入      | 10,191,122.31                       | 5,494,024.89                        |
| 其中：存款利息收入   | 38,787.55                           | 22,984.45                           |
| 债券利息收入      | 9,613,282.65                        | 5,013,175.74                        |

|                            |                      |                      |
|----------------------------|----------------------|----------------------|
| 资产支持证券利息收入                 | -                    | -                    |
| 买入返售金融资产收入                 | 539,052.11           | 457,864.70           |
| 其他利息收入                     | -                    | -                    |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           | 4,947,384.17         | -6,014,875.37        |
| 其中：股票投资收益                  | -                    | 183,690.13           |
| 基金投资收益                     | -                    | -                    |
| 债券投资收益                     | 4,947,384.17         | -6,198,565.50        |
| 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                       | -                    | -                    |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 4,687,618.56         | 2,132,660.93         |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          | -                    | -                    |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 158,721.90           | 38,203.16            |
| <b>减：二、费用</b>              | <b>3,359,747.06</b>  | <b>2,876,874.10</b>  |
| 1. 管理人报酬                   | 1,888,187.83         | 889,541.52           |
| 2. 托管费                     | 539,482.38           | 254,154.67           |
| 3. 销售服务费                   | 194,929.94           | 464,595.46           |
| 4. 交易费用                    | 46,468.42            | 27,731.32            |
| 5. 利息支出                    | 384,263.84           | 756,427.23           |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | 384,263.84           | 756,427.23           |
| 6. 税金及附加                   | 131.70               | -                    |
| 7. 其他费用                    | 306,282.95           | 484,423.90           |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>16,625,099.88</b> | <b>-1,226,860.49</b> |
| 减：所得税费用                    | -                    | -                    |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | <b>16,625,099.88</b> | <b>-1,226,860.49</b> |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）



本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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）                        | 81,029,671.79                               | 12,211,368.66  | 93,241,040.45    |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -   | 16,625,099.88  | 16,625,099.88    |
| 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）      | 668,497,898.19                              | 175,234,203.81 | 843,732,102.00   |
| 其中：1.基金申购款                             | 840,028,012.68                              | 214,182,455.33 | 1,054,210,468.01 |
| 2.基金赎回款                                | -171,530,114.49                             | -38,948,251.52 | -210,478,366.01  |
| 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）                        | 749,527,569.98                              | 204,070,672.35 | 953,598,242.33   |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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）                        | 253,776,575.21                              | 35,464,273.41  | 289,240,848.62   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本                   | -   | -1,226,860.49  | -1,226,860.49    |

|  |                 |                |                 |
|--|-----------------|----------------|-----------------|
| 期利润)                                   |                 |                |                 |
| 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）      | -172,746,903.42 | -22,026,044.26 | -194,772,947.68 |
| 其中：1.基金申购款                             | 37,835,423.87   | 7,483,878.68   | 45,319,302.55   |
| 2.基金赎回款                                | -210,582,327.29 | -29,509,922.94 | -240,092,250.23 |
| 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）                        | 81,029,671.79   | 12,211,368.66  | 93,241,040.45   |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：李兆廷，主管会计工作负责人：王亮，会计机构负责人：谢文君

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

金鹰元盛分级债券型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可【2013】13 号《关于核准金鹰元盛分级债券型发起式证券投资基金募集的批复》的核准，由金鹰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《金鹰元盛分级债券型发起式证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。在基金合同生效之日起 2 年内，本基金的名称为“金鹰元盛分级债券型发起式证券投资基金”，本基金的基金份额分为元盛 A、元盛 B 两级份额。首次设立募集资金为 3,169,732,923.27 元，其中元盛 A 募集资金 2,218,800,266.48 元；元盛 B 募集资金 950,932,656.79 元，认购资金在募集期间产生的利息 461,985.28 元，合计为 3,170,194,908.55 元，按照每份基金份额面值人民币 1.00 元计算，折合基金份额为 3,170,194,908.55 份，业经立信会计师事务所（特殊普通合伙）出具验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《金鹰元盛分级债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2013 年 5 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为

3,170,194,908.55 份，其中元盛 A 的份额为 2,219,127,187.10 份；元盛 B 的份额为 951,067,721.45 份。

根据《金鹰元盛分级债券型发起式证券投资基金基金合同》，本基金的分级运作期于基金合同生效后 2 年，即 2015 年 5 月 4 日（如该对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日）届满。本基金的基金管理人金鹰基金管理有限公司于 2015 年 4 月 30 日发布《金鹰元盛分级债券型发起式证券投资基金之元盛 B 终止上市的提示性公告》，向深圳交易所申请终止本基金之元盛 B 的基金份额上市交易，并获得深圳证券交易所《终止上市通知书》（深证上[2015]171 号）的同意。

元盛 B 于 2015 年 4 月 30 日进行基金份额权益登记，2015 年 5 月 4 日终止上市。本基金在封闭期届满后，按照基金合同在封闭期内的资产及收益的分配约定分别对元盛 A 和元盛 B 份额计算封闭期末基金份额净值，并以各自的份额净值为基础，按照本基金的基金份额净值转换为同一上市开放式基金(LOF)的份额。基金份额转换完成后，本基金更名为“金鹰元盛债券型发起式证券投资基金(LOF)”。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《金鹰元盛分级债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金可投资于固定收益类金融工具，包括国债、央行票据、金融债、次级债、企业债、公司债、可转债（含分离交易可转债）、资产支持证券、中小企业私募债、短期融资券、债券回购、银行存款等固定收益类品种，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益证券品种（但须符合中国证监会的相关规定）。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%；为维持投资组合的流动性，元盛 A 的开放日或基金合同生效后 2 年期届满日之前的 4 个工作日内起至元盛 A 的开放日（含）或基金合同生效后 2 年期届满日（含）止，以及本基金转型为金鹰元盛债券型发起式证券投资基金(LOF)并开放申购赎回之后，持有现金和到期日不超过一年的政府债券不低于基金资产净值的 5%；在其他时段，本基金持有现金和到期日不超过一年的政府债券可低于基金资产净值的 5%。

经与本基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致并报中国证监会备案，自 2017 年 2 月 14 日起，本基金增加 E 类份额。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则(以下简称“企业会计准则”)和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和

基金净值变动情况。

#### 7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 7.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《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》、财税[2015]101号《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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1. 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、债券免征增值税; 2018年1月1日起, 公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为, 以基金管理人为增值税纳税人, 暂适用简易计税方法, 按照3%的征收率缴纳增值税。

2. 对证券投资基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不缴纳企业所得税。

3. 对基金取得的股票股息、红利收入, 由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳, 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, 股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4. 对基金取得的债券利息收入, 由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税, 暂不缴纳企业所得税。

5. 对于基金从事A股买卖, 出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税, 对受让方不再缴纳印花税。

#### 7.4.7 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|-------|---------|
|-------|---------|

|                 |          |
|-----------------|----------|
| 东旭集团有限公司        | 基金管理人股东  |
| 广州证券股份有限公司      | 基金管理人股东  |
| 广州白云山医药集团股份有限公司 | 基金管理人股东  |
| 广州金鹰资产管理有限公司    | 基金管理人子公司 |
| 金鹰基金管理有限公司      | 基金管理人    |
| 中国建设银行股份有限公司    | 基金托管人    |
| 美的集团股份有限公司      | 原基金管理人股东 |
| 东亚联丰投资管理有限公司    | 原基金管理人股东 |

注：经基金管理人 2016 年第三次临时股东会审议通过，并经中国证券监督管理委员会批复核准（证监许可[2017]2135），公司原股东美的集团股份有限公司、东亚联丰投资管理有限公司分别将其持有的本公司 20%和 11%股权转让给东旭集团有限公司。公司股东东旭集团有限公司向本公司增资人民币 260,200,000 元。本次股权转让及增资后，公司股权结构变更为：东旭集团有限公司 66.19%，广州证券股份有限公司 24.01%，广州白云山医药集团股份有限公司 9.80%，本公司注册资本由人民币 250,000,000 元增加至人民币 510,200,000 元。公司《公司章程》的有关条款已根据本次股权变更情况进行了相应修改。本公司已完成注册资本及股权变更事项的工商变更登记。上述事项已于 2018 年 1 月 30 日在证监会指定媒体披露。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 7.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

1、本基金本报告期及上年度可比期间均没有应支付关联方的佣金。

2、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除中国证券登记结算公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

##### 7.4.8.2 关联方报酬

**7.4.8.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2018年1月1日至2018年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12<br>月31日 |
|-----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 1,888,187.83                    | 889,541.52                           |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 936,275.76                      | 105,594.39                           |

注：在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值 0.70% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

**7.4.8.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2018年1月1日至2018年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12<br>月31日 |
|----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 539,482.38                      | 254,154.67                           |

注：在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

**7.4.8.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各<br>关联方名称 | 本期<br>2018年1月1日至2018年12月31日      |              |            |
|--------------------|----------------------------------|--------------|------------|
|                    | 当期发生的基金应支付的销售服务费                 |              |            |
|                    | 金鹰元盛债券（LOF）C                     | 金鹰元盛债券（LOF）E | 合计         |
| 建设银行股份有限公司         | 41,523.33                        | -            | 41,523.33  |
| 广州证券股份有限公司         | 967.95                           | -            | 967.95     |
| 金鹰基金管理有限公司         | 72,525.69                        | -            | 72,525.69  |
| 合计                 | 115,016.97                       | -            | 115,016.97 |
| 获得销售服务费的各<br>关联方名称 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12月31日 |              |            |
|                    | 当期发生的基金应支付的销售服务费                 |              |            |
|                    | 金鹰元盛债券（LOF）C                     | 金鹰元盛债券（LOF）E | 合计         |
| 建设银行股份有限公司         | 57,358.61                        | -            | 57,358.61  |
| 广州证券股份有限公司         | 1,026.87                         | -            | 1,026.87   |
| 金鹰基金管理有限公司         | 308,091.80                       | -            | 308,091.80 |
| 合计                 | 366,477.28                       | -            | 366,477.28 |

注：金鹰元盛（LOF）类份额的销售服务费按前一日金鹰元盛（LOF）类基金份额资产净值 0.4% 的年费率逐日计提，基金 E 类份额不收取销售服务费。基金 C 类份额销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用自有资金投资本基金的情况。

#### 7.4.8.5 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                    |                       | 上年度可比期间               |                       |
|--------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
|              | 2018年1月1日至2018年12月31日 | 2017年1月1日至2017年12月31日 | 2017年1月1日至2017年12月31日 | 2017年1月1日至2017年12月31日 |
|              | 期末余额                  | 当期利息收入                | 期末余额                  | 当期利息收入                |
| 中国建设银行股份有限公司 | 4,630,421.32          | 38,392.27             | 533,893.78            | 11,821.67             |

注：本基金用于证券交易结算的资金通过托管行结算资金专用存款账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息，在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示。本报告期末清算备付金余额 0 元，清算备付金利息收入 359.96 元，上年度可比期间期末清算备付金期末余额 188,327.55 元，清算备付金利息收入 11,038.75 元。

#### 7.4.8.6 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。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

##### 7.4.8.7.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

本基金本报告期及上年度可比期间未投资基金。

#### 7.4.9 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止，本基金从事证券银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券余额款 1,959,877.06 元，抵押证券如下：

金额单位：人民币元



| 债券代码   | 债券名称     | 回购到期日      | 期末估值<br>单价 | 数量（张）     | 期末估值总额       |
|--------|----------|------------|------------|-----------|--------------|
| 170212 | 17 国开 12 | 2019-01-02 | 103.40     | 20,000.00 | 2,068,000.00 |
| 合计     |          |            |            | 20,000.00 | 2,068,000.00 |

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无交易所市场债券正回购。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 1. 公允价值

##### (1) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

##### (2) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级参见附注 7.4.4.5。

##### (ii) 各层级金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第二层级的余额为 935,727,158.50 元。无属于第一层级和第三层级的金额。

##### (iii) 公允价值所属层级间的重大变动

本基金本报告期内无公允价值所属层级间的重大变动。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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证券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

2. 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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 | -  | -            |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
|   | 其中：股票             | -              | -      |
| 2 | 基金投资              | -              | -      |
| 3 | 固定收益投资            | 935,727,158.50 | 97.21  |
|   | 其中：债券             | 935,727,158.50 | 97.21  |
|   | 资产支持证券            | -              | -      |
| 4 | 贵金属投资             | -              | -      |
| 5 | 金融衍生品投资           | -              | -      |
| 6 | 买入返售金融资产          | -              | -      |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -      |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计      | 4,630,421.32   | 0.48   |
| 8 | 其他各项资产            | 22,211,703.00  | 2.31   |
| 9 | 合计                | 962,569,282.82 | 100.00 |

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末无股票投资。

### 8.2.2 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通过港股通投资股票。

## 8.3 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

本基金本报告期末无股票投资。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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

本基金本报告期内未投资股票。

### 8.4.2 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

本基金本报告期内未投资股票。

## 8.5 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 | -    | -            |

|    |           |                |       |
|----|-----------|----------------|-------|
| 2  | 央行票据      | -              | -     |
| 3  | 金融债券      | 935,176,000.00 | 98.07 |
|    | 其中：政策性金融债 | 935,176,000.00 | 98.07 |
| 4  | 企业债券      | 551,158.50     | 0.06  |
| 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        | 935,727,158.50 | 98.13 |

#### 8.6 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  | 180208 | 18 国开 08 | 2,000,000.00 | 203,660,000.00 | 21.36        |
| 2  | 170209 | 17 国开 09 | 2,000,000.00 | 203,100,000.00 | 21.30        |
| 3  | 170205 | 17 国开 05 | 1,500,000.00 | 151,530,000.00 | 15.89        |
| 4  | 180209 | 18 国开 09 | 1,500,000.00 | 150,480,000.00 | 15.78        |
| 5  | 180202 | 18 国开 02 | 1,000,000.00 | 101,720,000.00 | 10.67        |

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

**8.12 本报告期投资基金情况****8.12.1 投资政策及风险说明**

本基金本报告期末投资基金。

**8.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细**

本基金本报告期末投资基金。

**8.13 投资组合报告附注**

8.13.1 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。

8.13.2 本基金报告期末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。

**8.13.3 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   | 476.70        |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 21,219,908.63 |
| 5  | 应收申购款   | 990,817.67    |
| 6  | 其他应收款   | 500.00        |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 22,211,703.00 |

**8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末无处于转股期的可转换债券。

**8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末无股票投资。

**8.13.6 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。

## §9 基金份额持有人信息

## 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别         | 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  |
| 金鹰元盛债券（LOF）C | 4,310    | 16,500.27  | 13,387,098.46 | 18.82% | 57,729,050.71  | 81.18%  |
| 金鹰元盛债券（LOF）E | 5,216    | 130,694.93 | 0.00          | 0.00%  | 681,704,747.25 | 100.00% |
| 合计           | 9,526    | 79,028.02  | 13,387,098.46 | 1.78%  | 739,433,797.96 | 98.22%  |

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

金鹰元盛债券（LOF）C

| 序号 | 持有人名称                         | 持有份额（份）      | 占上市总份额比例 |
|----|-------------------------------|--------------|----------|
| 1  | 中国人民财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品      | 3,766,440.00 | 22.05%   |
| 2  | 万家共赢资产管理有限公司                  | 3,287,357.00 | 19.25%   |
| 3  | 中国交通建设集团有限公司企业年金计划—交通银行股份有限公司 | 2,000,000.00 | 11.71%   |
| 4  | 中国银河证券股份有限公司企业年金计划—中信银行股份有限公司 | 1,967,049.00 | 11.52%   |
| 5  | 申银万国证券—上海银行—申银万国月月盈1号集合资产管理计  | 1,500,000.00 | 8.78%    |
| 6  | 北京京煤集团有限责任公司企业年金计划—中国工商银行     | 780,687.00   | 4.57%    |
| 7  | 刘健礼                           | 732,673.00   | 4.29%    |
| 8  | 杨惠俊                           | 523,363.00   | 3.06%    |

|    |     |            |       |
|----|-----|------------|-------|
| 9  | 赖明  | 211,680.00 | 1.24% |
| 10 | 桂许武 | 157,010.00 | 0.92% |

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别         | 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 | 金鹰元盛债券（LOF）C | 260,248.43 | 0.37%    |
|                  | 金鹰元盛债券（LOF）E | 107,162.24 | 0.02%    |
|                  | 合计           | 367,410.67 | 0.05%    |

### 9.4 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                             | 份额级别         | 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 | 金鹰元盛债券（LOF）C | 0                 |
|                                | 金鹰元盛债券（LOF）E | 0                 |
|                                | 合计           | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 金鹰元盛债券（LOF）C | 0                 |
|                                | 金鹰元盛债券（LOF）E | 0                 |
|                                | 合计           | 0                 |

### 9.5 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。

## § 10 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   |
|-------------------------------|------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2015 年 5 月 5 日）基金份额总额 | 1,034,736,325.55 | -              |
| 本报告期期初基金份额总额                  | 48,500,645.57    | 34,780,880.64  |
| 本报告期基金总申购份额                   | 82,489,903.29    | 761,346,645.14 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                 | 59,874,399.69    | 114,422,778.53 |
| 本报告期基金拆分变动份额                  | -                | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                  | 71,116,149.17    | 681,704,747.25 |

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 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、经本基金管理人股东会或董事会审议通过，报中国证券监督管理委员会广东监管局备案：

2018 年 1 月 18 日在中国证监会指定媒体披露，聘请李兆廷先生担任公司董事长，凌富华先生不再担任公司董事长。

2018 年 8 月 25 日在中国证监会指定媒体披露，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，李云亮先生不再担任公司督察长，曾长兴先生不再担任公司副总经理。

2018 年 9 月 22 日在中国证监会指定媒体披露，免去陈瀚先生副总经理职务。

自 2018 年 11 月 5 日起免去李兆廷先生公司董事职务，自 2018 年 11 月 16 日起聘请李兆廷先生担任公司董事、董事长，上述事项已在中国证监会指定媒体披露。

2018 年 12 月 5 日在中国证监会指定媒体披露，公司董事长李兆廷先生代行总经理（法定代表人）职务。

2018 年 12 月 22 日在中国证监会指定媒体披露，聘请刘志刚先生担任公司副总经理。

2018 年 12 月 29 日在中国证监会指定媒体披露，免去刘岩先生总经理职务，免去满黎先生副总经理职务。

2、本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金审计的会计师事务所为中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）。

本报告期内实际应支付会计师事务所的审计费为 22400 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金报告期内无管理人、托管人的托管业务部门及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 11.7.1 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 |    |
| 东吴证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |

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、个股分析报告及丰富全面的信息；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。

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。

## 11.7.2 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          |              | 债券回购交易        |                | 权证交易 |              |
|------|---------------|--------------|---------------|----------------|------|--------------|
|      | 成交金额          | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额          | 占当期债券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 |
| 东吴证券 | 36,794,305.92 | 100.00%      | 30,100,000.00 | 100.00%        | -    | -            |



## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 影响投资者决策的其他重要信息

经本基金管理人董事会审议通过，报中国证券监督管理委员会广东监管局备案，并于 2019 年 3 月 5 日在中国证监会指定媒体披露，聘请刘志刚先生担任公司总经理。

金鹰基金管理有限公司  
二〇一九年三月二十六日