

金鹰元盛债券发起式证券投资基金 (LOF) 2019年第1季度报告

2019-03-31

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：2019-04-20

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2019年4月19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。

基金管理人承诺及基金合同、招募说明书约定的投资策略和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

本基金的过往业绩并不预示其未来表现。投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期财务报表未经审计。

本报告自2019年1月1日起至3月31日止。

基金基本情况

Table with columns: 项目 (Item), 数值 (Value). Rows include: 基金名称 (金鹰元盛债券 (LOF)), 场内简称 (元盛债券), 基金代码 (962108), 基金运作方式 (契约型), 基金合同生效日 (2015-05-05), 报告期末基金份额总额 (415,601,287.73), 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。

主要财务指标

Table with columns: 主要财务指标, 主基金(元), 金鹰元盛债券 (LOF) C(元), 金鹰元盛债券 (LOF) E(元). Rows include: 本期已实现收益 (769,016.81), 本期利润 (612,870.53), 加权平均基金份额本期利润 (0.0074), 期末基金资产净值 (79,041,966.33), 期末基金份额净值 (1.178).

- 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值(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。

基金净值表现

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

Table with columns: 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. Rows include: 过去三个月 (0.68%, 0.65%, 1.16%, 0.65%, -0.48%, 0.00%).

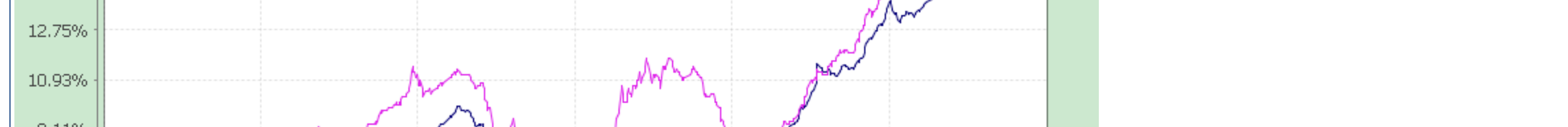
注: 本基金的业绩比较基准为: 中证债券综合财富指数收益率。

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

Table with columns: 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. Rows include: 过去三个月 (0.78%, 0.65%, 1.16%, 0.65%, -0.38%, 0.00%).

注: (1)截至报告期末, 各项资产配置比例符合基金合同约定; (2)本基金的业绩比较基准为: 中证债券综合财富指数收益率。

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



注: (1)截至报告期末, 各项资产配置比例符合基金合同约定; (2)本基金的业绩比较基准为: 中证债券综合财富指数收益率。

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



注: (1)截至报告期末, 各项资产配置比例符合基金合同约定; (2)本基金的业绩比较基准为: 中证债券综合财富指数收益率。

其他指标

Table with columns: 其他指标, 报告期 (2019-01-01至2019-03-31), 报告期 (2019-03-31). Rows include: 基金份额持有人数量 (1,000), 基金资产净值 (79,041,966.33).

基金经理 (或基金经理小组) 简介

Table with columns: 姓名, 职务, 任职基金名称, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明. Rows include: 汪伟 (基金经理), 魏俊 (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。

管理人对于报告期内本基金运作的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, 基金运作合法合规, 无出现重大违法违规或违反基金合同行为, 无损害基金份额持有人利益的行为。

公平交易专项说明

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, 各投资组合按照投资管理流程和流程独立决策, 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, 确保公平交易的实现, 同时通过比较交易系统中的公平交易数据执行分析, 不断优化事后监控分析, 以尽可能确保公平对待各投资组合。报告期内, 公司对连续四个季度内同、不同时间窗 (1日内、3日内、5日内) 公司管理的不同投资组合间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。

异常交易行为的专项说明

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, 未发现同日反向交易成交较多的单边交易或超过该证券当日成交量的5%的情况。

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。

报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾2019年第一季度债券市场, 利率债窄幅震荡, 2月份公布1月份金融数据, 金融信贷超预期, 市场对于经济企稳的预期大幅抬升, 但由于2月份整体金融数据较为疲软, 利率债在3月份出现小幅下行, 直至3月中下旬中期利率全面企稳, 导致利率债大幅震荡, 整个季度来看, 利率债整体收益率水平下行的态势, 10年期国债收益率下行11bp至3.06%, 10年期国债收益率下行21bp至3.38%。

金鹰元盛在第一季度坚持利率债+长期利率债的操作策略, 以中长期利率债和利率债为基准收益, 通过把握长期利率债行情有效增厚组合收益, 一季度整体表现良好, 未出现较大回撤, 主要回撤率为主要回撤。

报告期内基金的投资表现

截至本报告期末, 基金总资产净值1.178, 本报告期净值收益率为0.68%, 同期业绩比较基准收益率为1.16%, 同类份额净值1.287, 本报告期净值收益率为0.78%, 同期业绩比较基准收益率为1.16%。

管理人对于宏观经济、证券市场及行业趋势的简要展望

展望二季度, 我们认为利率债体系来讲存在较大的调整压力, 首先, 在3月份经济数据的大幅度超预期, 市场对于经济企稳的预期大幅抬升, 同时, 微通胀显示3月份信贷数据表现较好, 补链企稳, 表现出密切的关联性, 经济企稳信号较为明显。其次, 伴随着猪肉价格、煤炭价格、黑色金属及油价的大幅上行, 市场对于通胀的担忧再起, 通胀上行是制约利率下行的最大因素, 使得利率债难以上行, 利率债下行空间有限。最后, 由于央行对于货币政策从全面放水到精准滴灌的调整, 货币市场资金面的松紧弹性很有可能二季度加大, 除利率债带来不确定性, 故我们认为二季度利率债呈现一个震荡上行的态势, 金鹰元盛将继续坚持利率债+长期利率债的操作策略, 以中长期利率债和利率债为基准收益, 通过把握长期利率债行情有效增厚组合收益, 由于二季度整体经济的波动加大, 故可适时把握利率债投资机会。

报告期内基金持有人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。

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号, 项目, 金额 (元), 占基金总资产的比例 (%). Rows include: 权益类投资 (1, 2), 固定收益投资 (3, 4), 贵金属投资 (5), 买入返售金融资产 (6), 其他资产 (7, 8).

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、应收中购款。

报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with columns: 序号, 行业类别, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). Rows include: A 农、林、牧、渔业, B 采矿业, C 制造业, 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 信息技术、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.

注: 本基金本报告期末无股票投资。

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

Table with columns: 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 (%). Rows include: 1, 2, 3, 4, 5, 6, 7, 8, 9, 10.

注: 本基金本报告期末无股票投资。

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with columns: 序号, 债券品种, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). Rows include: 1 国债债券, 2 央行票据, 3 金融债券, 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 资产支持证券, 9 其他, 10 合计.

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

Table with columns: 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 (%). Rows include: 1, 2, 3, 4, 5.

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

注: 本基金本报告期末无资产支持证券投资。

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

Table with columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量 (份), 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). Rows include: 1, 2, 3, 4, 5.

注: 本基金本报告期末无贵金属投资。

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

注: 本基金本报告期末无权证投资。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

Table with columns: 代码, 名称, 持仓量 (买/卖), 合约市值 (元), 公允价值变动 (元), 风险指标说明. Rows include: 公允价值变动总额合计 (元), 股指期货投资本期收益 (元), 股指期货投资本期公允价值变动 (元).

注: 本基金本报告期末无股指期货投资。

本基金投资股指期货的投资政策

无。

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码, 名称, 持仓量 (买/卖), 合约市值 (元), 公允价值变动 (元), 风险指标说明. Rows include: 公允价值变动总额合计 (元), 国债期货投资本期收益 (元), 国债期货投资本期公允价值变动 (元).

注: 本基金本报告期末无国债期货投资。

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况

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

申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额 (元). Rows include: 1 存出保证金, 2 应收证券清算款, 3 应收股利, 4 应收利息, 5 应收申购款, 6 其他应收款, 7 待摊费用, 8 其他, 9 合计.

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注: 本基金本报告期末无处于转股期的可转换债券。

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注: 本基金本报告期末无股票投资。

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。

开放式基金份额变动

Table with columns: 项目, 金鹰元盛债券 (LOF), 金鹰元盛债券 (LOF) C, 金鹰元盛债券 (LOF) E. Rows include: 报告期初基金份额总额, 报告期间基金份额净申购额, 报告期间基金份额净赎回额, 报告期间基金份额变动额 (份额减少以“-”填列), 报告期末基金份额总额.

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

基金管理人持有本基金基金份额变动情况

Table with columns: 项目, 金鹰元盛债券 (LOF), 金鹰元盛债券 (LOF) C, 金鹰元盛债券 (LOF) E. Rows include: 报告期末基金管理人持有的基金份额, 报告期末基金管理人/高级管理人员持有的基金份额, 报告期末基金管理人/高级管理人员持有的基金份额, 报告期末基金管理人/高级管理人员持有的基金份额, 报告期末基金管理人/高级管理人员持有的基金份额.

注: 无。

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table with columns: 序号, 交易方式, 交易日期, 交易份额 (份), 交易金额 (元), 适用费率. Rows include: 合计.

注: 无。

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

Table with columns: 项目, 持有份额总数, 持有份额占基金总份额比例, 发起份额总数, 发起份额占基金总份额比例, 发起份额承诺持有期限. Rows include: 基金管理人自有资金, 基金管理人高级管理人员, 基金管理人基金经理, 基金管理人股东, 其他, 合计.

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

Table with columns: 投资者类别, 序号, 持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间, 期初份额, 中购份额, 赎回份额, 持有份额, 份额占比. Rows include: 机构, 个人.

产品特有风险

影响投资者决策的其他重要信息

广东省工商行政管理局核准, 本基金管理人法定代表人已于2019年3月27日变更为刘志刚先生。

备查文件目录

- 1、中国证监会批准发行及募集的文件; 2、《金鹰元盛债券发起式证券投资基金 (LOF) 基金合同》; 3、《金鹰元盛债券发起式证券投资基金 (LOF) 招募说明书》; 4、《金鹰元盛债券发起式证券投资基金 (LOF) 托管协议》; 5、基金托管人业务资格批件和营业执照。

存放地点

广州市天河区珠江东路29号越秀金融大厦30层

查阅方式

投资者可在业务时间内免费查阅或工本费购买复印件, 也可登录本基金管理人网站查阅, 本基金管理人网址: http://www.gffund.com.cn. 投资者对本报告如有任何疑问, 可咨询本基金管理人客户服务中心, 客户服务中心电话: 4006-136-8888/020-83900160.