

# 金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）

## 2020 年中期报告

### 2020 年 6 月 30 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：二〇二〇年八月二十九日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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。本中期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 2020 年 8 月 28 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	38
7.6 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	39
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	39
7.8 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	39
7.9 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	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	40

7.12 本报告期投资基金情况 .....	40
7.13 投资组合报告附注 .....	40
<b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>41</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	41
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	41
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	42
8.4 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 .....	42
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	42
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>42</b>
<b>§ 10 重大事件揭示</b> .....	<b>43</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	43
10.2 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 .....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	43
10.4 基金投资策略的改变 .....	43
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	43
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	43
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	44
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	44
10.9 其他重大事件 .....	45
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>46</b>
11.1 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 .....	46
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	47
<b>§ 12 备查文件目录</b> .....	<b>47</b>
12.1 备查文件目录 .....	47
12.2 存放地点 .....	48
12.3 查阅方式 .....	48

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）	
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	138,531,469.59份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
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	70,498,276.20份	68,033,193.39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	姓名	徐娇娇	李申

负责人	联系电话	020-83936180	021-60637102
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		4006135888	021-60637111
传真		020-83282856	021-60635778
注册地址		广东省广州市南沙区滨海路 171号11楼自编1101之一J79	北京市西城区金融大街25号
办公地址		广州市天河区珠江东路28号越 秀金融大厦30层	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼
邮政编码		510623	100033
法定代表人		王铁	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期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>
基金中期报告备置地点	广东省广州市天河区珠江新城珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区太平大街 17 号
注册登记机构	金鹰基金管理有限公司	广州市天河区珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

注：本基金 C 类份额注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，E 类份额注册登记机构为金鹰基金管理有限公司。

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日）	
	金鹰元盛债券（LOF）C	金鹰元盛债券（LOF）E
本期已实现收益	2,902,727.39	2,704,013.07
本期利润	2,729,880.60	2,001,614.37

加权平均基金份额本期利润	0.0346	0.0325
本期加权平均净值利润率	3.05%	2.79%
本期基金份额净值增长率	5.46%	5.77%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2020年6月30日)</b>	
	金鹰元盛债券（LOF）C	金鹰元盛债券（LOF）E
期末可供分配利润	6,546,490.15	8,322,433.67
期末可供分配基金份额利润	0.0929	0.1223
期末基金资产净值	80,306,792.85	79,834,500.67
期末基金份额净值	1.139	1.173
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2020年6月30日)</b>	
	金鹰元盛债券（LOF）C	金鹰元盛债券（LOF）E
基金份额累计净值增长率	26.15%	28.43%

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）。

### 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
过去一个月	0.00%	0.04%	-0.68%	0.12%	0.68%	-0.08%
过去三个月	0.71%	0.11%	-0.22%	0.12%	0.93%	-0.01%
过去六个月	5.46%	0.17%	2.35%	0.12%	3.11%	0.05%
过去一年	7.00%	0.12%	5.13%	0.09%	1.87%	0.03%
过去三年	14.58%	0.10%	16.26%	0.07%	-1.68%	0.03%
自基金合同生效起至今	26.15%	0.11%	25.02%	0.08%	1.13%	0.03%

##### 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
过去一个月	0.00%	0.04%	-0.68%	0.12%	0.68%	-0.08%
过去三个月	0.77%	0.12%	-0.22%	0.12%	0.99%	0.00%

过去六个月	5.77%	0.17%	2.35%	0.12%	3.42%	0.05%
过去一年	7.62%	0.12%	5.13%	0.09%	2.49%	0.03%
过去三年	16.37%	0.10%	16.26%	0.07%	0.11%	0.03%
自基金合同生效起至今	28.43%	0.31%	16.91%	0.07%	11.52%	0.24%

注：（1）本基金 C 类份额合同生效日为 2015 年 5 月 5 日，E 类份额合同生效日为 2017 年 2 月 14 日。

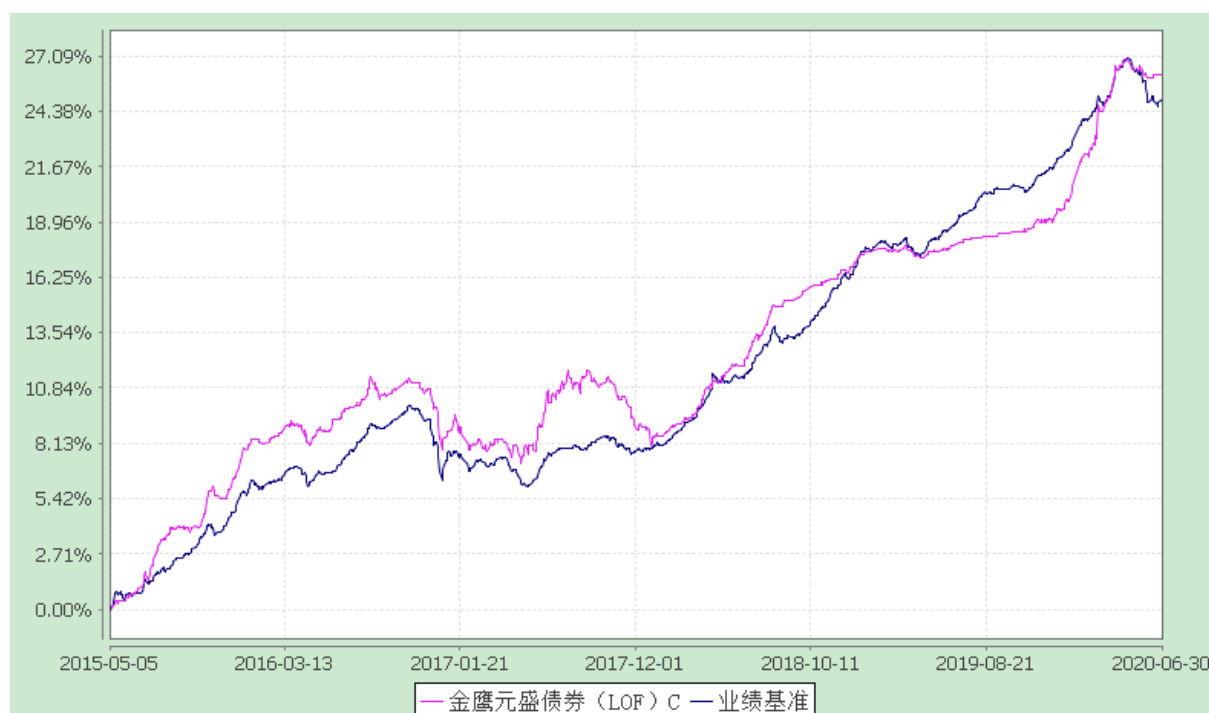
（2）本基金业绩比较基准是：中国债券综合财富指数收益率。

### 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

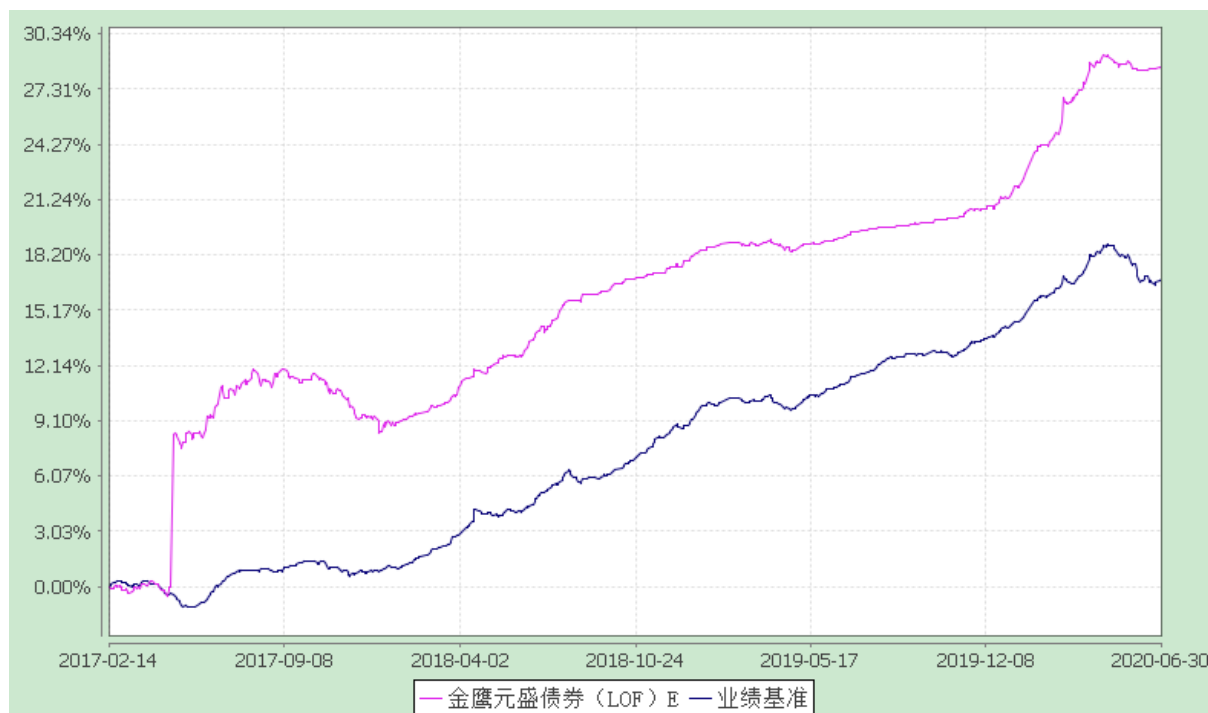
（2015 年 5 月 5 日至 2020 年 6 月 30 日）

金鹰元盛债券（LOF）C



金鹰元盛债券（LOF）E





注：（1）本基金 C 类份额合同生效日为 2015 年 5 月 5 日，E 类份额合同生效日为 2017 年 2 月 14 日。

（2）本报告期末，本基金各项投资比例符合基金合同约定。

（3）本基金业绩比较基准是：中国债券综合财富指数收益率。

## § 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。2015 年 12 月，获得受托管理保险资金投资管理人资格。

“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。金鹰基金拥有一支经验丰富，风格多元的投资团队。

公司秉承开放、包容、多元的投资文化，采取基金经理负责制，将产品契约与基金经理风格有机结合，鼓励基金经理个人风格的充分展现，强化产品投资风格的稳定性，逐步形成了风险收益特征多元，投资研究体系有机互补的整体投研平台和基金产品线。截至报告期末，合计管理公募基金

46 支。

#### 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 基金经理（助 理）期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
戴 骏	本基金的基金经理，公司固定收益研究部总监	2019-03-19	-	9	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，现任固定收益部基金经理。

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、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 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内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，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间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 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

上半年，债券市场先涨后跌，开年以后新冠疫情爆发，全国停工停产，导致生产生活受到了极大干扰，春节假期以后，伴随着央行巨量投放流动性，债券利率大幅下行，同时，一季度经济数据大幅下行，GDP 增速低于预期，带动债券利率再次下探，一度达到 2016 年以后最低点，10 年国债收益率盘中达到 2.47%。但随着二季度全国复工复产的顺利进行以及疫情的较为有效的控制，经济数据环比回升，同时海外疫情也逐步得到缓解，经济数据环比回升，市场对经济缓慢复苏预期增强，同时，伴随着巨额地方政府债额度的提前下达及发行，供给压力干扰市场而央行并没有再次降准提供流动性，引发长端利率债出现了明显调整。6 月份，央行严查资金套利空转，主动抬升短端利率水平，带动 1 至 5 年品种出现了明显调整，届时，长端利率水平也持续小幅上行，6 月底，10 年期国债收益率收于 2.82%，10 年期国开债收益率收于 3.1%，均基本回到春节过后当日的估值水平。

金鹰元盛在上半年坚持利率骑乘+长端利率波段的操作策略，由于上半年较好的把握住了新冠疫情所带来的上涨行情，基金操作较为积极频繁，及时止盈止损，让组合获得了较好的超额收益。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 6 月 30 日，基金 C 类份额净值 1.139 元，本报告期份额净值收益率为 5.46%，同期业绩比较基准收益率为 2.35%；E 类份额净值 1.173 元，本报告期份额净值收益率为 5.77%，同期业绩比较基准收益率为 2.35%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为，虽然经济最坏的时候已经过去，但是环比数据的强劲表现还有待持续验证，市场目前处于风险偏好较高同时对经济预期较强的阶段，经济数据是否会低于预期有待验证，同时，近期我们看到海外疫情有所反复，是否会出现疫情对经济的二次影响也有待观察。同时，今年发行了大量的地方政府债也发行了抗疫国债，央行降低企业融资成本的主线也没有改变，故虽然债券出现了比较明显的调整，但是我们认为长端利率仍处在有顶的阶段，毕竟现行的经济情况不能容忍过高的利率水平，下半年长端利率仍存在交易性机会。

金鹰元盛将继续坚持利率骑乘+长端利率波段的操作策略，由于下半年整体市场震荡幅度加大，

金鹰元盛将在策略上更为极端，以超短债券组合搭配长端波段操作作为组合谋取震荡市场带来的资本利得机会。

#### 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、中债金融估值中心有限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 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

本报告期内无应当说明的预警事项。

### § 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。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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 托管人对本中期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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 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：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	3,017,421.29	475,759.51
结算备付金		0.00	-
存出保证金		1,915.56	10,300.86
交易性金融资产	6.4.7.2	160,065,000.00	242,871,024.40
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		160,065,000.00	242,871,024.40
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.7.4.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	2,131,915.69	4,390,640.34
应收股利		-	-
应收申购款		88,503.68	692.40
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		165,304,756.22	247,748,417.51
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年6月30日</b>	<b>上年度末 2019年12月31日</b>
负债：			
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		-	38,699,821.95
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		4,186,597.49	1,268,074.87
应付管理人报酬		105,426.74	146,881.77
应付托管费		30,121.91	41,966.21
应付销售服务费		30,264.12	11,160.72
应付交易费用	6.4.7.7	27,446.92	42,618.92
应交税费		434,630.88	434,634.34
应付利息		-	3,269.85
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	348,974.64	273,001.13
负债合计		5,163,462.70	40,921,429.76
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	135,264,164.53	185,920,496.37
未分配利润	6.4.7.10	24,877,128.99	20,906,491.38
所有者权益合计		160,141,293.52	206,826,987.75
负债和所有者权益总计		165,304,756.22	247,748,417.51

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，本基金份额总额 138,531,469.59 份。本基金 C 类份额净值 1.139 元，份额总额 70,498,276.20 份；本基金 E 份额净值 1.173 元，份额总额 68,033,193.39 份。

## 6.2 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020年1月1日至 2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至 2019年6月30日
<b>一、收入</b>		<b>5,921,026.86</b>	<b>13,332,098.48</b>
1.利息收入		2,737,972.89	13,608,719.66
其中：存款利息收入	6.4.7.11	16,133.69	45,730.62
债券利息收入		2,683,210.29	12,853,543.21

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		38,628.91	709,445.83
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,900,722.00	1,052,512.03
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	3,900,722.00	1,052,512.03
资产支持证券投资收益	6.4.7.15	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.16	-	-
衍生工具收益	6.4.7.17	-	-
股利收益	6.4.7.18	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	-875,245.49	-1,464,344.48
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	157,577.46	135,211.27
<b>减：二、费用</b>		<b>1,189,531.89</b>	<b>3,976,662.61</b>
1. 管理人报酬		558,911.97	2,529,550.49
2. 托管费		159,689.09	722,728.76
3. 销售服务费		177,583.26	158,748.65
4. 交易费用	6.4.7.21	26,152.33	21,481.30
5. 利息支出		134,520.91	299,787.40
其中：卖出回购金融资产支出		134,520.91	299,787.40
6. 税金及附加		0.72	27.03
7. 其他费用	6.4.7.22	132,673.61	244,338.98
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>4,731,494.97</b>	<b>9,355,435.87</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>4,731,494.97</b>	<b>9,355,435.87</b>

### 6.3 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 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）	185,920,496.37	20,906,491.38	206,826,987.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利	-	4,731,494.97	4,731,494.97

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）	-50,656,331.84	-760,857.36	-51,417,189.20
其中：1.基金申购款	305,181,378.63	55,603,095.52	360,784,474.15
2.基金赎回款	-355,837,710.47	-56,363,952.88	-412,201,663.35
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）	135,264,164.53	24,877,128.99	160,141,293.52
项目	上年度可比期间		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 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）	749,527,569.98	204,070,672.35	953,598,242.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,355,435.87	9,355,435.87
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）	1,208,843,689.54	351,178,584.55	1,560,022,274.09
其中：1.基金申购款	1,942,872,118.55	556,121,289.54	2,498,993,408.09
2.基金赎回款	-734,028,429.01	-204,942,704.99	-938,971,134.00
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）	1,958,371,259.52	564,604,692.77	2,522,975,952.29

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：姚文强，主管会计工作负责人：刘盛，会计机构负责人：谢文君

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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》，向深圳证券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。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则(以下简称“企业会计准则”)要求，并按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在会计核算和信息披露方面亦参考了中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及其发布的若干基金行业实务操作。

#### 6.4.3 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及基金业协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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 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

本基金本报告期所采用的会计政策与上年度会计报表一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 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。

#### 6.4.6 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;对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税;同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。2018年1月1日(含)以后,资管产品管理人(以下称管理人)运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,以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。对资管产品在2018年1月1日以前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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.对基金从上市公司取得的股息、红利所得,由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起,对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额: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,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入个人所得税应纳税所得额。

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。

6.基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价,暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

7.对基金在2018年1月1日(含)以后运营过程中缴纳的增值税,分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率,计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
活期存款	3,017,421.29
定期存款	-

其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	3,017,421.29

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	160,178,871.09	160,065,000.00
	合计	160,178,871.09	160,065,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	160,178,871.09	160,065,000.00	-113,871.09

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期内及上年度可比期间内均无衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	670.50
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	2,131,244.29
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-

应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	0.90
合计	2,131,915.69

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	27,446.92
合计	27,446.92

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	6,290.84
应付证券出借违约金	-
预提审计费用	33,176.20
预提信息披露费	279,672.34
预提上市年费	29,835.26
合计	348,974.64

#### 6.4.7.9 实收基金

##### 金鹰元盛债券（LOF）C

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	30,128,846.23	28,733,270.65
本期申购	200,220,346.74	190,952,590.46
本期赎回（以“-”号填列）	-159,850,916.77	-152,454,889.97
本期末	70,498,276.20	67,230,971.14

##### 金鹰元盛债券（LOF）E

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	157,187,225.72	157,187,225.72
本期申购	114,228,788.17	114,228,788.17
本期赎回（以“-”号填列）	-203,382,820.50	-203,382,820.50
本期末	68,033,193.39	68,033,193.39

## 6.4.7.10 未分配利润

## 金鹰元盛债券（LOF）C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	974,803.73	2,828,034.65	3,802,838.38
本期利润	2,902,727.39	-172,846.79	2,729,880.60
本期基金份额交易产生的变动数	2,668,959.03	3,874,143.70	6,543,102.73
其中：基金申购款	16,805,443.52	19,464,703.00	36,270,146.52
基金赎回款	-14,136,484.49	-15,590,559.30	-29,727,043.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,546,490.15	6,529,331.56	13,075,821.71

## 金鹰元盛债券（LOF）E

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	8,870,997.33	8,232,655.67	17,103,653.00
本期利润	2,704,013.07	-702,398.70	2,001,614.37
本期基金份额交易产生的变动数	-3,252,576.73	-4,051,383.36	-7,303,960.09
其中：基金申购款	12,779,613.62	6,553,335.38	19,332,949.00
基金赎回款	-16,032,190.35	-10,604,718.74	-26,636,909.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,322,433.67	3,478,873.61	11,801,307.28

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	活期存款利息收入	15,847.97
定期存款利息收入	-	
其他存款利息收入	-	

结算备付金利息收入	237.68
其他	48.04
合计	16,133.69

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

本基金本报告期内无股票投资收益。

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益。

#### 6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

#### 6.4.7.14 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,372,669,190.41
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,352,437,147.86
减：应收利息总额	16,331,320.55
买卖债券差价收入	3,900,722.00

#### 6.4.7.15 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.16 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.17 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.18 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

#### 6.4.7.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
1.交易性金融资产	-875,245.49
——股票投资	-

——债券投资	-875,245.49
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-875,245.49

## 6.4.7.20 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	156,969.09
转换费收入	608.37
合计	157,577.46

## 6.4.7.21 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	502.33
银行间市场交易费用	25,650.00
合计	26,152.33

## 6.4.7.21.1 持有基金产生的费用

本基金本报告期末投资基金。

## 6.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	15,176.20
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
上市费	29,835.26
帐户维护费	18,600.00
汇划手续费	9,389.81
合计	132,673.61



#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

经基金管理人 2019 年第一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[2019]2306），基金管理人原股东中信证券华南股份有限公司（原广州证券股份有限公司）将其持有的本公司 24.01%股权转让给广州越秀金融控股集团股份有限公司。本次股权转让后，基金管理人股权结构变更为：东旭集团有限公司 66.19%，广州越秀金融控股集团股份有限公司 24.01%，广州白云山医药集团股份有限公司 9.80%。基金管理人已完成股权变更事项的工商变更登记。上述事项已于 2020 年 1 月 4 日在证监会规定媒介披露。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
金鹰基金管理有限公司	基金管理人、销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 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。

###### 6.4.10.1.2 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。

###### 6.4.10.1.3 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。

###### 6.4.10.1.4 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。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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。

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、经手费和使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。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	558,911.97	2,529,550.49
其中：支付销售机构的客户维护费	237,028.73	1,196,410.36

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。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	159,689.09	722,728.76

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。

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30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	29,461.37	-	29,461.37
金鹰基金管理有限公司	17,662.92	-	17,662.92
合计	47,124.29	-	47,124.29
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30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	20,228.55	-	20,228.55
中信证券华南股份有限公司	499.81	-	499.81
金鹰基金管理有限公司	29,699.62	-	29,699.62
合计	50,427.98	-	50,427.98

注：本基金E类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的基金销售服务费按前一日C类基金份额资产净值0.4%的年费率计提。基金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为每日应计提的C类基金份额销售服务费

E为前一日的C类基金份额资产净值

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。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内不存在与关联方进行的银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未参与转融通证券出借业务。

**6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

**6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况****金鹰元盛债券（LOF）C**

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

**金鹰元盛债券（LOF）E**

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

**6.4.10.6 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	
	2020年1月1日至2020年6月30日		2019年1月1日至2019年6月30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	3,017,421.29	15,847.97	2,126,093.54	45,728.59

注：1、本基金清算备付金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算公司等结算账户；

2、2020年6月30日清算备付金期末余额0.00元，清算备付金利息收入237.68元；2019年6月30日清算备付金期末余额0.00元，清算备付金利息收入0.00元。

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明****6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期内未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2020年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

**6.4.12.2 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。

**6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期内未参与转融通证券出借业务。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险等。基金成立以来，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，致力于内控机制的建立和完善，公司内部管理制度及业务规范流程的制定和完善，加强内部风险的控制与有效防范，以保证各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

为保证公司规范化运作，有效地防范和化解经营风险，确保基金和公司财务和其他信息真实、准确、完整、及时，从而最大程度地保护基金持有人的合法权益，本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了科学合理、控制严密、运行高效的各项管理制度：

###### （1）风险管理控制制度

风险控制制度由总则、风险控制的目标和原则、风险控制的机构设置、风险控制的程序、风险类型的界定、风险控制的主要措施、风险控制的具体制度、风险控制制度的监督与评价等部分组成。

风险控制的具体制度主要包括投资风险管理制度、交易风险控制制度、财务风险控制制度、公司资产管理制度等业务风险控制制度，以及岗位分离制度、业务空间隔离制度、作业规则、岗位职责、反馈制度、资料保全制度、保密制度、员工行为守则等程序性风险管理制度。

###### （2）投资管理制度

投资管理制度包括研究业务管理制度、投资决策管理制度、基金交易管理制度等。

制订研究业务管理制度的目的是保持研究工作的独立、客观。研究业务管理制度包括：建立严密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法；根据基金合同要求，在充分研究的基础上建立和维护投资对象备选库；建立研究与投资的业务交流制度，保持通畅的交流渠道；建立研究报告质量评价体系。

制订投资决策业务管理制度的目的是严格遵守法律法规的有关规定，确保基金的投资符合基金合同所规定的投资目标、投资范围、投资策略、投资组合和投资限制等要求。投资决策业务管理制度包括投资决策授权制度；投资决策支持制度，重要投资要有详细的研究报告和风险分析支持；投

资风险评估与管理制度，在设定的风险权限额度内进行投资决策；投资管理业绩评价制度等。

制订基金交易管理制度的目的是保证基金投资交易的安全、有效、公平。基金交易管理制度包括基金交易的集中交易制度；交易监测、预警、反馈机制；投资指令审核制度；投资指令公平分配制度；交易记录保管制度；交易绩效评价制度等。

### （3）监察稽核制度

监察稽核制度包括检查公司各业务部门和工作人员是否遵守法律、法规、规章的有关规定；检查公司各业务部门和工作人员对公司内部控制制度、各项管理制度、业务规章的执行情况；对公司各部门作业流程的遵守合规性和有效性的检查、监督、评价及建议等。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
A-1	59,985,000.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	59,985,000.00	0.00

注：本统计数据未包含国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债、同业存单。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末	上年度末

	2020年6月30日	2019年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：以上数据按照最新发行人评级填列。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	0.00	108,024.40
AAA 以下	0.00	352,000.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	460,024.40

注：本统计数据未包含国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债、同业存单。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：以上数据按照最新发行人评级填列。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自于投资品种流动性不足，导致金融资产不能在合理价格变现。本基金采用分散投资、监控流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时基金管理人通过分析持有人结构、申购赎回行为分析、变现比例、压力测试等方法评估组合的流动性风险。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限资产投资比例等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间市场进行交易，除本报告所列示的期末本基金持有的流通受限证券暂时不能自由转让外，本基金持有的其余资产均能及时变现。评估结果显示本基金的组合持仓变现能力较好，流动性风险可控。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年6月 30日	1个月 以内	1-3 个月	6个月 以内	3个月 -1年	6个月 -1年	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产										
银行存款	3,017,421.29	-	-	-	-	-	-	-	-	3,017,421.29
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	1,915.56	-	-	-	-	-	-	-	-	1,915.56
交易性金融资产	50,030,000.00	-	-	-	-	110,035,000.00	-	-	-	160,065,000.00
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	2,131,915	2,131,915



										.69	15.69
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	88,503.68	88,503.68
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	53,049,336.85	-	-	-	-	110,035,000.00	-	-	-	2,220,419.37	165,304,756.22
负债											
短期借款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	4,186,597.49	4,186,597.49
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	-	105,426.74	105,426.74
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	30,121.91	30,121.91
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	30,264.12	30,264.12
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	-	27,446.92	27,446.92
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	434,630.88	434,630.88
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-	348,974.64	348,974.64
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	-	5,163,462.70	5,163,462.70
利率敏感度缺口	53,049,336.85	-	-	-	-	110,035,000.00	-	-	-	-2,943,043.33	160,141,293.52
上年度末 2019年12月31日	1个月以内	1-3个月	6个月以内	3个月-1年	6个月-1年	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计	
资产											
银行存款	475,759.51	-	-	-	-	-	-	-	-	-	475,759.51

结算备付金	-	-	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	10,300.86	-	-	-	-	-	-	-	10,300.86
交易性金融资产	-	-	-	-	40,280,000.00	141,905,000.00	60,686,024.40	-	242,871,024.40
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	4,390,640.34	4,390,640.34
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	692.40	692.40
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	486,060.37	-	-	-	40,280,000.00	141,905,000.00	60,686,024.40	4,391,332.74	247,748,417.51
负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	38,699,821.95	-	-	-	-	-	-	-	38,699,821.95
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	1,268,074.87	1,268,074.87
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	146,881.77	146,881.77
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	41,966.21	41,966.21
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-	11,160.72	11,160.72
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	42,618.92	42,618.92
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	434,634.34	434,634.34
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	3,269.85	3,269.85
应付利润	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	273,001.13	273,001.13
负债总计	38,699,821.95	-	-	-	-	-	-	2,221,607.81	40,921,429.76

利率敏感度缺口	-38,213,761.58	-	-	-	-	40,280,000.00	141,905,000.00	60,686,024.40	2,169,724.93	206,826,987.75
---------	----------------	---	---	---	---	---------------	----------------	---------------	--------------	----------------

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照金融资产及金融负债的剩余到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
	利率上升 25 个基点	-49,941.75	-2,184,949.04
利率下降 25 个基点	50,017.40	2,300,427.42	

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		上年度末 2019年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	160,065,000.00	99.95	242,871,024.40	117.43
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	160,065,000.00	99.95	242,871,024.40	117.43

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

##### 金鹰元盛债券（LOF）C

假设	市场其他变量保持不变，只有业绩比较基准所对应的市场组合价格发生合理、可能的变动；		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
	业绩比较基准变动+5%	4,364,187.65	886,204.14
	业绩比较基准变动-5%	-4,364,187.65	-886,204.14

##### 金鹰元盛债券（LOF）E

假设	市场其他变量保持不变，只有业绩比较基准所对应的市场组合价格发生合理、可能的变动；		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
	业绩比较基准变动+5%	4,391,343.01	4,511,240.62
	业绩比较基准变动-5%	-4,391,343.01	-4,511,240.62

#### 6.4.14 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。公允价值计量层次可分为：

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (ii) 各层级金融工具公允价值

于 2020 年 6 月 30 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 160,065,000.00 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。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	160,065,000.00	96.83
	其中：债券	160,065,000.00	96.83
	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	3,017,421.29	1.83
8	其他各项资产	2,222,334.93	1.34
9	合计	165,304,756.22	100.00

注：其他各项资产包括：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、待摊费用。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 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。

### 7.2.2 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。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期内未投资股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未投资股票。

## 7.5 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	59,896,000.00	37.40
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,184,000.00	25.09
	其中：政策性金融债	40,184,000.00	25.09
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	59,985,000.00	37.46
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	160,065,000.00	99.95
----	----	----------------	-------

#### 7.6 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	170209	17 国开 09	400,000.00	40,184,000.00	25.09
2	170016	17 附息国债 16	200,000.00	20,026,000.00	12.51
3	209920	20 贴现国债 20	200,000.00	19,938,000.00	12.45
4	209922	20 贴现国债 22	200,000.00	19,932,000.00	12.45
5	072000091	20 海通证券 CP003	100,000.00	10,004,000.00	6.25

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

#### 7.8 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

本基金本报告期内未投资贵金属。

#### 7.9 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

本基金本报告期内未投资权证。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.10.1 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。

##### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 7.12 本报告期投资基金情况

### 7.12.1 投资政策及风险说明

本基金不投资基金。

## 7.13 投资组合报告附注

7.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体之一的中信建投证券股份有限公司因私募资管业务风险管控不足，于 2020 年 4 月 21 日被中国证券监督管理委员会北京监管局采取出具警示函的监督管理措施。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

本基金投资的前十名证券的发行主体之一的东兴证券股份有限公司因对子公司规范经营的合规风控管理存在缺失，于 2019 年 7 月 17 日被中国证券监督管理委员会北京监管局采取责令改正的监督管理措施。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

7.13.2 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。

### 7.13.3 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	1,915.56
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,131,915.69
5	应收申购款	88,503.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-



8	其他	-
9	合计	2,222,334.93

#### 7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期内未投资股票。

#### 7.13.6 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。

### §8 基金份额持有人信息

#### 8.1 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	3,095	22,778.12	5,819,054.46	8.25%	64,679,221.74	91.75%
金鹰元盛债券（LOF）E	4,126	16,488.90	0.00	0.00%	68,033,193.39	100.00%
合计	7,221	19,184.53	5,819,054.46	4.20%	132,712,415.13	95.80%

#### 8.2 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	33.37%
2	刘健礼	732,673.00	12.43%

3	张官富	374,178.00	6.35%
4	朱波	218,021.00	3.70%
5	赖明	211,680.00	3.59%
6	桂许武	157,010.00	2.66%
7	吴子毅	135,332.00	2.30%
8	查小玲	125,618.00	2.13%
9	杜志红	104,678.00	1.78%
10	于萍	104,674.00	1.78%

金鹰元盛债券（LOF）E

金鹰元盛债券 E 类份额为非上市交易份额。

### 8.3 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	29.85	0.00%
	金鹰元盛债券（LOF）E	51.56	0.00%
	合计	81.41	0.00%

### 8.4 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

### 8.5 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。

## §9 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	30,128,846.23	157,187,225.72
本报告期基金总申购份额	200,220,346.74	114,228,788.17
减：本报告期基金总赎回份额	159,850,916.77	203,382,820.50
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	70,498,276.20	68,033,193.39

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会，无会议决议。

### 10.2 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、本报告期，本基金管理人法定代表人、董事长、总经理、副总经理等进行了调整。截至报告日，王铁先生担任公司法定代表人及董事长、姚文强先生担任公司总经理，徐娇娇女士担任公司督察长，刘盛先生担任公司副总经理及首席信息官职务。

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。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 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。

### 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金报告期内未持有基金。

### 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期未改聘会计师事务所。

## 10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.8.1 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。

### 10.8.2 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	42,811,480.2 2	100.00%	7,300,000. 00	100.00%	-	-
------	-------------------	---------	------------------	---------	---	---

## 10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金参加中国工商银行 AI 投服务基金申购费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2020-01-02
2	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2020-01-02
3	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金参加中国工商银行“2020 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	证监会规定媒介	2020-01-02
4	金鹰基金高级管理人员变更公告	证监会规定媒介	2020-01-04
5	金鹰基金管理有限公司关于公司股权变更的公告	证监会规定媒介	2020-01-04
6	金鹰基金高级管理人员变更公告	证监会规定媒介	2020-01-04
7	金鹰基金改聘会计师事务所公告	证监会规定媒介	2020-01-14
8	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订基金合同、托管协议的提示性公告	证监会规定媒介	2020-01-20
9	金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）招募说明书更新	证监会规定媒介	2020-01-20
10	金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）招募说明书摘要更新	证监会规定媒介	2020-01-20
11	金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）基金合同更新	证监会规定媒介	2020-01-20
12	金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）托管协议更新	证监会规定媒介	2020-01-20
13	金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）修改基金合同的公告	证监会规定媒介	2020-01-20
14	金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）2019 年四季度报告	证监会规定媒介	2020-01-21
15	金鹰基金管理有限公司关于调整旗下基金产品 2020 年春节假期相关安排的提示性公告	证监会规定媒介	2020-01-30
16	金鹰基金管理有限公司关于新增阳光人寿保险股份有限公司为本公司旗下部分基金代销机构的公告	证监会规定媒介	2020-02-13

17	金鹰基金管理有限公司关于董事变更的公告	证监会规定媒介	2020-03-11
18	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告	证监会规定媒介	2020-03-13
19	金鹰基金管理有限公司关于董事会成员变更的公告	证监会规定媒介	2020-03-13
20	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国国际期货股份有限公司定投及费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2020-03-18
21	金鹰基金管理有限公司关于延期披露旗下基金 2019 年年度报告的公告	证监会规定媒介	2020-03-27
22	金鹰基金行业高级管理人员变更公告	证监会规定媒介	2020-03-28
23	金鹰基金管理有限公司关于网上交易系统升级暂停服务的公告	证监会规定媒介	2020-04-11
24	金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）暂停在代销机构大额申购（转换转入、定期定额投资）公告	证监会规定媒介	2020-04-16
25	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告	证监会规定媒介	2020-04-17
26	金鹰基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	证监会规定媒介	2020-04-21
27	金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）2020 年一季度报告	证监会规定媒介	2020-04-21
28	金鹰基金管理有限公司董事长变更公告	证监会规定媒介	2020-04-24
29	金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）基金恢复（大额）申购（转换转入、赎回、转换转出、定期定额投资）公告	证监会规定媒介	2020-04-27
30	金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）2019 年年度报告	证监会规定媒介	2020-04-30
31	金鹰关于公司法定代表人变更公告	证监会规定媒介	2020-05-06
32	金鹰关于网上交易系统升级暂停服务的公告	证监会规定媒介	2020-05-08
33	金鹰基金关于终止泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理相关销售业务的公告	证监会规定媒介	2020-05-11
34	金鹰基金管理有限公司关于网上交易系统升级暂停服务的公告	证监会规定媒介	2020-05-29

注：相关信息披露文件请登录本基金管理人网站查询。

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占

		到或者超过20%的时间区间					比
机构	1	2020年1月2日至 2020年1月2日	108,441,518 .21	0.00	108,441,518 .21	0.00	0.00%
	2	2020年1月3日至 2020年1月6日	19,364,058. 87	0.00	19,364,058. 87	0.00	0.00%
产品特有风险							
<p>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：</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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六十个工作日基金资产净值低于5000万元，可能导致本基金面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>							

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。
- 2、《金鹰元盛分级债券型发起式证券投资基金基金合同》。
- 3、《金鹰元盛分级债券型发起式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、年度报告、更新的招募说明书及其他临时公告。

## 12.2 存放地点

广州市天河区珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

## 12.3 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

二〇二〇年八月二十九日