

# 金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）

## 2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 月 30 日

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年十月二十五日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年7月1日起至9月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	金鹰元盛债券（LOF）
场内简称	金鹰元盛债券 LOF
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
报告期末基金份额总额	27,671,915.01 份
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。		
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		
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	金鹰元盛债券（LOF）D
下属分级基金的交易代码	162108	004333	022146
报告期末下属分级基金的份额总额	22,489,449.18 份	5,182,457.57 份	8.26 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 (2024年7月1日-2024年9月30日)		
	金鹰元盛债券 (LOF) C	金鹰元盛债券 (LOF) E	金鹰元盛债券 (LOF) D
1.本期已实现收益	34,019.92	15,706.38	0.07
2.本期利润	111,665.59	38,631.28	0.21
3.加权平均基金份额 本期利润	0.0046	0.0072	0.0300
4.期末基金资产净值	27,806,589.36	6,729,340.75	10.21

5.期末基金份额净值	1.2364	1.2985	1.2361
------------	--------	--------	--------

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额；

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、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；

4、本基金自2024年9月10日起增设D类基金份额，D类基金份额首次确认日为2024年9月11日。

### 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

##### 金鹰元盛债券（LOF）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	0.52%	0.24%	0.90%	0.10%	-0.38%	0.14%
过去六个月	2.69%	0.22%	2.65%	0.09%	0.04%	0.13%
过去一年	3.21%	0.20%	6.16%	0.07%	-2.95%	0.13%
过去三年	3.55%	0.16%	14.70%	0.06%	-11.15%	0.10%
过去五年	15.66%	0.14%	24.24%	0.07%	-8.58%	0.07%
自基金合同生效起至今	36.94%	0.13%	49.82%	0.07%	-12.88%	0.06%

##### 金鹰元盛债券（LOF）E

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	0.66%	0.24%	0.90%	0.10%	-0.24%	0.14%
过去六个月	2.89%	0.22%	2.65%	0.09%	0.24%	0.13%
过去一年	3.63%	0.20%	6.16%	0.07%	-2.53%	0.13%
过去三年	4.89%	0.16%	14.70%	0.06%	-9.81%	0.10%

过去五年	18.48%	0.14%	24.24%	0.07%	-5.76%	0.07%
自基金合同生效起至今	42.17%	0.23%	40.10%	0.06%	2.07%	0.17%

**金鹰元盛债券（LOF）D**

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
自基金合同生效起至今	1.99%	0.25%	-0.36%	0.18%	2.35%	0.07%

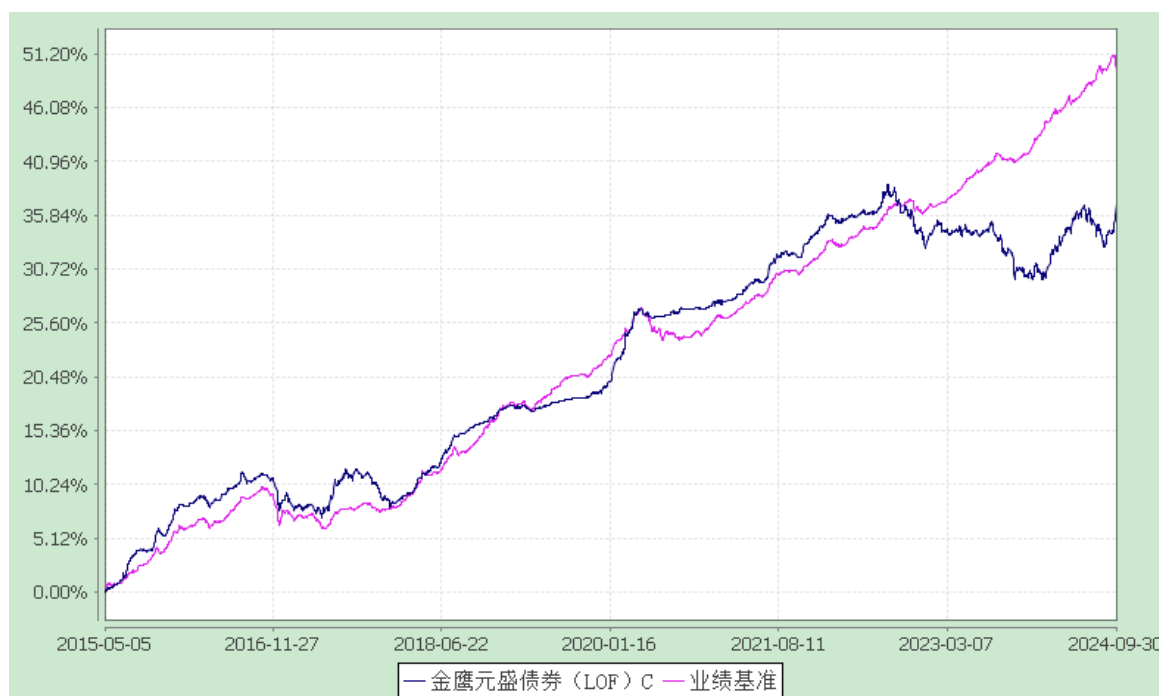
注：本基金的业绩比较基准为：中国债券综合财富指数收益率。

**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**

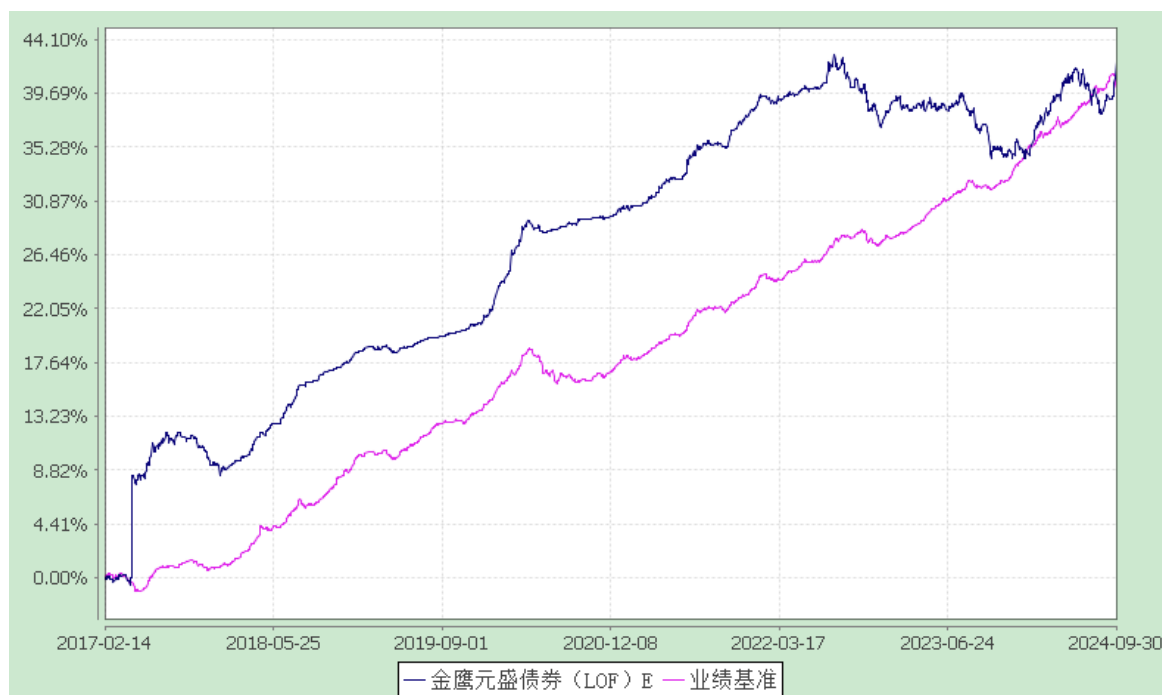
金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2015年5月5日至2024年9月30日）

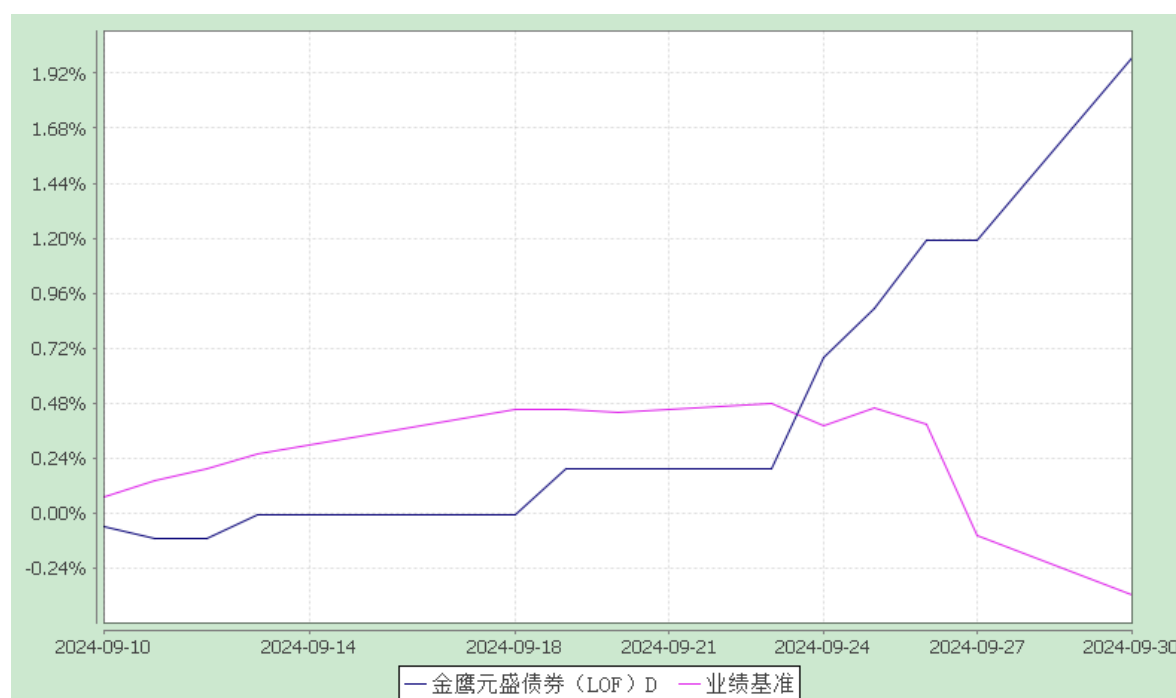
金鹰元盛债券（LOF）C



金鹰元盛债券（LOF）E



### 金鹰元盛债券（LOF）D



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；

（2）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）本基金自 2024 年 9 月 10 日起增设 D 类基金份额，D 类基金份额首次确认日为 2024 年 9 月 11 日。

## § 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		
王怀震	本基金的基金经理，公司总经理助理、混合投资部总经理	2022-10-20	-	20	王怀震先生，曾任新疆证券有限责任公司研究所行业研究员，浙商银行股份有限公司债券交易员，招商证券股份有限公司投资经理，银华基金管理股份有限公司基金经理，歌斐诺宝资产管理公司总经理助理，嘉实基金管理有限公司投资经理，招商信诺资产管理有限公司副总经理。2022年7月加入金鹰管理有限公司，现任混合投资部基金经理。
许浩琨	本基金的基金经理	2024-05-17	-	7	许浩琨先生，伊利诺伊大学香槟分校经济学硕士。曾任中国出口信用保险公司资产管理部研究分析处职员、天弘基金管理有限公司中央交易室债券研究员及固定收益部研究员、光大理财管理有限公司固定收益部职员。2023年5月加入金鹰基金管理有限公司，现任混合投资部基金经理。

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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，严格遵守本基金基金合同等法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，基金运作合法合规，无出现重大违法违规或违反基金合同的行为，无损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

公司通过规范的投资交易流程、完善的权限管理机制、有效的交易控制制度，确保公平交易的实施。同时通过投资交易系统内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

三季度经济较为弱势，债券收益率先下后上，债券市场由经济预期、政策预期和机构行为等因素共同作用。经济端，地产销售较弱，且从地产销售向建筑业链条传导受阻，国内建筑链条承压，出口虽然有韧性，但考虑到海外经济形势以及各国贸易政策调整，出口拉动经济的效果预计边际转弱。政策方面，政策出现明显转向，9月召开的政治局会议直面经济问题，央行一系列操作降低居民债务负担，后续预计财政政策将继续发力。

债券市场受经济预期、政策预期和机构行为等因素共同作用，地产销售较为弱势、经济和金融数据承压显示经济内生融资需求较弱，对债市形成有力支撑。政策方面，



央行降息和调整存量按揭利率显示出政策决心，市场参与者对于政策效果预期发生分歧，快速调整仓位，导致债券收益率快速上行。展望后市，我们认为政策对于经济的效果仍需要观察，同时考虑到政策利率较低以及银行等机构欠配，债券市场并未转向。

转债市场受到股市影响，三季度跟随股票市场大幅波动。伴随股市调整，转债市场回落，部分机构重仓转债价格大幅波动，导致转债市场出现较大幅度回调，尤其是低价转债，然而随着政策预期发生变化，转债市场跟随权益市场在9月下旬快速修复。

我们认为政策转向有利于打开权益市场空间，在低利率环境下叠加转债估值分位数水平不高，转债依旧是参与权益市场博取收益的重要手段。

具体到组合上，本基金债券投资以利率债为主，三季度在季初适度提升利率债久期并在九月下旬降低，转债方面三季度主要参与大盘低价转债，有效规避转债市场大幅波动，努力在收益和回撤之间取得平衡。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金C类份额净值为1.2364元，本报告期份额净值收益率为0.52%，同期业绩比较基准收益率为0.90%；E类份额净值为1.2985元，本报告期份额净值收益率为0.66%，同期业绩比较基准收益率为0.90%；D类份额净值为1.2361元，本报告期份额净值收益率为1.99%，同期业绩比较基准收益率为-0.36%。

#### 4.5 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。自2024年7月1日起，本基金在迷你期间，如涉及信息披露费、审计费、基金份额持有人大会费、银行间账户维护费、IOPV计算与发布费（如有）、注册登记费（如有）等相关固定费用，由管理人承担，不再从基金资产中列支。

## §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	33,626,985.57	94.98
	其中：债券	33,626,985.57	94.98
	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	998,987.40	2.82
	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	442,932.01	1.25
7	其他资产	335,246.87	0.95
8	合计	35,404,151.85	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、待摊费用。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资的股票。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 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	18,896,124.66	54.71
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-

	其中：政策性金融债	-	-
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）	14,730,860.91	42.65
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	33,626,985.57	97.37

#### 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	019739	24 国债 08	70,000.00	7,132,942.47	20.65
2	019735	24 国债 04	60,000.00	6,109,093.15	17.69
3	019732	24 国债 01	20,000.00	2,079,434.52	6.02
4	019740	24 国债 09	20,000.00	2,016,052.60	5.84
5	127031	洋丰转债	10,000.00	1,130,046.58	3.27

#### 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 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之一的兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局福建监管局的处罚。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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 本基金本报告期没有投资股票，因此不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,628.65
2	应收证券清算款	323,618.22
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,000.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	335,246.87

### 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	127031	洋丰转债	1,130,046.58	3.27
2	113052	兴业转债	1,094,593.15	3.17
3	123158	宙邦转债	1,038,080.52	3.01
4	132026	G 三峡 EB2	904,307.18	2.62
5	113638	台 21 转债	788,584.52	2.28
6	123064	万孚转债	761,448.49	2.20
7	127045	牧原转债	710,219.86	2.06
8	128136	立讯转债	696,729.04	2.02

9	113616	韦尔转债	675,605.33	1.96
10	110089	兴发转债	665,518.36	1.93
11	128135	洽洽转债	567,687.67	1.64
12	113042	上银转债	567,390.55	1.64
13	113682	益丰转债	497,424.33	1.44
14	113043	财通转债	469,106.30	1.36
15	127038	国微转债	455,206.03	1.32
16	123113	仙乐转债	434,209.86	1.26
17	127085	韵达转债	329,045.01	0.95
18	113060	浙 22 转债	265,668.02	0.77
19	113623	凤 21 转债	227,537.26	0.66
20	123212	立中转债	226,804.66	0.66
21	128121	宏川转债	208,659.67	0.60
22	110085	通 22 转债	205,956.00	0.60
23	111014	李子转债	155,359.32	0.45
24	113675	新 23 转债	120,455.89	0.35
25	123114	三角转债	119,204.11	0.35
26	123119	康泰转 2	115,696.44	0.34
27	123115	捷捷转债	114,008.08	0.33
28	113671	武进转债	112,280.96	0.33
29	113659	莱克转债	111,305.75	0.32
30	127066	科利转债	110,496.30	0.32
31	127046	百润转债	109,226.58	0.32
32	128131	崇达转 2	108,904.68	0.32
33	110076	华海转债	108,354.79	0.31
34	127024	盈峰转债	107,288.22	0.31
35	113661	福 22 转债	106,855.81	0.31
36	123210	信服转债	104,797.86	0.30
37	127073	天赐转债	104,084.03	0.30
38	113059	福莱转债	102,713.70	0.30

## 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

## 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

项目	金鹰元盛债券	金鹰元盛债券	金鹰元盛债券
----	--------	--------	--------

	(LOF) C	(LOF) E	(LOF) D
报告期期初基金份额总额	25,266,675.07	5,615,951.96	-
报告期期间基金总申购份额	30,451.89	20,690.27	8.26
减：报告期期间基金总赎回份额	2,807,677.78	454,184.66	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-
报告期期末基金份额总额	22,489,449.18	5,182,457.57	8.26

## § 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

基金管理人未运用固有资金投资本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

## § 8 报告期末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 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准发行及募集的文件。
- 2、《金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》。
- 3、《金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）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。

#### 10.2 存放地点

广州市天河区珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

#### 10.3 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  
二〇二四年十月二十五日