

金鹰元盛分级债券型发起式证券投资基金

2013第三季度报告

2013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:2013年10月24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约定，于2013年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告内容，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。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	基金代码
金鹰元盛	162108
基金管理方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年5月2日
报告期末基金总资产	3,170,194,008.53元
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	本基金在严格控制风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的稳定收益。
业绩比较基准	中国债券综合指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中风险较低的品种，其长期平均风险与预期收益水平低于股票型基金、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	元盛 A 元盛 B
下属分级基金的交易代码	162109 150132
报告期末下属分级基金的份额总额	2,219,127,187.10份 951,067,721.45份
下属分级基金的风险收益特征	自基金合同生效之日起2年内，元盛 A 由具有一定的杠杆效应，其预期收益与风险较高。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	30,894,656.94	
2.本期利润	-13,106,314.38	
3.期初至报告期末的累计净值	3,148,436,025.55	
4.期末基金资产净值	0.993	

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.基金净值是指基金资产的总值减去总负债后的净值。

4.基金资产净值=基金资产总额-基金负债总额。

5.期末基金资产净值=报告期末基金资产净值/报告期末基金份额总额。

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、