（上接B67版）

联系人：张彤
电话：022-28451955
客服电话：400-651-5988
网址：www.ewww.com.cn
（51）华泰证券股份有限公司
注册（办公）地址：江苏省南京市江东中路228号
法定代表人：周易
联系人：虞晓芸
电话：0755-82492193
客服电话：95597
网址：www.htsc.com.cn
（52）山西证券股份有限公司
注册地址：山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
法定代表人：侯巍
联系人：邓颖赟
联系电话：0351-8686796
客服电话：95573
网址：www.i618.com.cn
（53）中信证券（山东）有限责任公司
注册（办公）地址：山东省青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层
法定代表人：杨宝林
联系人：孙秋月
电话：0532-85022026
客服电话：95548
网址：www.zxwt.com.cn
（54）东兴证券股份有限公司
注册（办公）地址：北京市西城区金融大街5号（新盛大厦）12、15层
法定代表人：魏庆华
联系人：汤漫川
电话：010-66555316
客服电话：010-66555835
网址：www.dxzq.net
（55）东吴证券股份有限公司
注册（办公）地址：苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦
法定代表人：范力
联系人：陆晓
电话：0512-62938521
客服电话：0512-96288
网址：www.dwzq.com.cn
（56）信达证券股份有限公司
注册（办公）地址：北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层
法定代表人：张志刚
联系人：尹旭航
电话：010-63081493
客服电话：4008008899
网址：www.cindasc.com
（57）东方证券股份有限公司
注册（办公）地址：上海市中山南路318号2号楼22层-29层
法定代表人：潘鑫军
联系人：胡月茹
电话：021-63325888
客服电话：95503（全国）
网址：www.dfzq.com.cn
（58）长城证券有限责任公司
注册（办公）地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层
法定代表人：黄耀华
联系人：刘阳
电话：0755-83516289
客服电话：400-6666-888
网址：www.cgws.com
（59）光大证券股份有限公司
注册（办公）地址：上海市静安区新闸路 1508 号
法定代表人：薛峰
联系人：李晓哲
电话：021-22169111
客服电话：95525（全国）、4008888788
网址：www.ebscn.com
（60）广州证券股份有限公司
注册（办公）地址：广东省广州市珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心19-20楼
法定代表人：邱三发
联系人：梁薇
电话：020-88836999-5408
客服电话：95396
网址：www.gzs.com.cn
（61）东北证券股份有限公司
注册（办公）地址：长春市自由大路1138号
法定代表人：杨树财
联系人：安岩岩
电话：0431-85096517
客服电话：95360/4006-000686
网址：www.nesc.cn
（62）上海证券有限责任公司
注册（办公）地址：上海市黄浦区四川中路213号7楼
法定代表人：李俊杰
联系人：邵珍珍
电话：021-53686262
客服电话：400-891-8918
网址：www.962518.com
（63）新时代证券有限责任公司
注册（办公）地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
法定代表人：刘汝军
联系人：孙恺
电话：010-83561149
客服电话：4006-989898
网址：www.xsdzq.cn
（64）大同证券有限责任公司
注册地址：大同市城区迎宾街15号桐城中央12层
办公地址：山西省太原市长治路111号山西世贸中心A座12、13层
法定代表人：董祥
联系人：薛津
电话：0351-4130322
客服电话：400-7121-212
网址：www.dtsbc.com.cn
（65）国联证券股份有限公司
注册（办公）地址：江苏省无锡市太湖新城金融一街8号 国联金融大厦7-9楼
法定代表人：姚志勇
联系人：沈刚
电话：0510-82831662
客服电话：0510-82588168
网址：http://www.gtjac.com.cn
（66）浙商证券股份有限公司
注册（办公）地址：浙江省杭州市西湖区杭大路1号黄龙世纪广场A座6、7楼
法定代表人：吴承根
联系人：陈韵
电话：021-64718888-2024
客服电话：95345
网址：http://www.stocke.com.cn
（67）平安证券有限责任公司
注册（办公）地址：深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
法定代表人：谢永林
联系人：石静武
电话：021-20667181
客服电话：95511转8
网址：www.stock.pingan.com
（68）华安证券股份有限公司
注册地址：合肥市长江中路357号
办公地址：合肥市阜南路166号
法定代表人：李工
联系人：范超
电话：0551-65161821
客服电话：96518、4008-096-518
网址：www.hazq.com
（69）国海证券股份有限公司
注册地址：广西桂林市辅星路13号
办公地址：广西南宁市滨湖路46号
法定代表人：何春梅
联系人：郑杜鹃
电话：021-20281096
客服电话：0771-5539032
网址：www.ghzq.com.cn
（70）财富证券有限责任公司
注册（办公）地址：长沙市芙蓉中路二段8 0 号顺天国际财富中心2 6 层
法定代表人：蔡一兵
联系人：郭蕾
电话：0731-84403319
客服电话：0731-84403350
网址：www.cfzq.com
（71）东莞证券股份有限公司
注册（办公）地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号
法定代表人：张运勇
联系人：孙旭
电话：0769-22119348
客服电话：0769-95328
网址：http://www.dgzq.com.cn
（72）国都证券有限责任公司
注册（办公）地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层
法定代表人：常甦
联系人：李骁
电话：010-84183331
客服电话：400-818-8118
网址：www.guodu.com
（73）东海证券股份有限公司
注册地址：江苏省常州延陵西路23号投资广场18层
办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人：朱科敏
联系人：王一彦
电话：021-20333333
客服电话：95531；400-8888-588
网址：www.longone.com.cn
（74）国盛证券有限责任公司
注册（办公）地址：江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦
法定代表人：曾小普
联系人：俞驰
电话：0791-86283080
客服电话：400-822-2111
网址：www.gsstock.com
（75）中泰证券股份有限公司
注册（办公）地址：山东省济南市市中区经七路 86 号
法定代表人：李玮
联系人：陈曦
电话：021-20315086
客服电话：95538（全国）
网址：www.qlzq.com.cn
（76）世纪证券有限责任公司
注册（办公）地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦41楼
法定代表人：姜昧军
联系人：袁媛
电话：0755-83199511
客服电话：0755-83199599
网址：www.csco.com.cn
（77）金元证券股份有限公司
注册地址：海口市南宝路36号证券大厦4楼
办公地址：深圳市深南大道4001号时代金融中心大厦17楼
法定代表人：陆涛
联系人：马贤清
电话：0755-83025022
客服电话：4008-888-228
网址： www.jyzq.cn
（78）中航证券有限公司
注册（办公）地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷大道1619号国际金融大厦A座41楼
法定代表人：王宜四
联系人：史江蕊
电话：010-64818301
客服电话：400-8866-567
网址：www.avicsec.com
（79）华林证券股份有限公司
注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区察古大道1-1号君泰国际B栋一层3号
办公地址：深圳市福田区民田路178号华融大厦6楼
法定代表人：林立
联系人： 胡倩
电话：0755-83255199
客服电话：4001883888
网址：http://www.chinalions.com
（80）德邦证券股份有限公司
注册地址：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼
办公地址：上海市福山路 500 号城建国际中心 26 楼
法定代表人：姚文平
联系人：刘 熠
联系/客服：电话：400-8888-128
网址： www.tebon.com.cn
（81）西部证券股份有限公司
注册（办公）地址：西安市东新街232号信托大厦16-17层
法定代表人：刘建武
联系人：梁采华
电话：029-87406168
客服电话：95582
网址：http://www.westsecu.com
（82）华福证券有限责任公司
注册（办公）地址：福州市鼓楼区温泉街道五四路157号7-8层
法定代表人：黄金琳
联系人：郭相兴
电话：021-20655175
客服电话：96326
网址：http://www.hfzq.com.cn
（83）中国国际金融有限公司
注册（办公）地址：北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
法定代表人：丁学东
联系人：黄峻敏
电话：0755-83196491
客服电话：010-65051166
0755-8319 5000
网址：www.cicc.com.cn
（84）财通证券股份有限公司
注册（办公）地址：杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心
法定代表人：沈继宁
联系人：陶志华
电话：0571-87789160
客服电话：0571-95336
网址：http://www.ctsec.com
（85）五矿证券有限公司
注册地址：深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心办公楼 47 层 01 单元
办公地址：深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心大厦47、48、49层
法定代表人：赵立功
联系人：王鹏宇
电话：0755-83219194
客服电话：40018-40028
网址：www.wkzq.com.cn
（86）华鑫证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01（ b）单元
办公地址：上海市肇嘉浜路 750 号
法定代表人：俞洋
联系人：杨莉娟
电话：021-64376936
客服电话： 4008-888-999
网址： www.cfsc.com.cn
（87）中国中投证券有限责任公司
注册（办公）地址：深圳福田区益田路6003号荣超商务中心A座第4、第18-21层
法定代表人：高涛
联系人：万玉琳
电话：0755-82026907
客服电话：95532；400-600-8008
网址：www.china-invs.cn
（88）中山证券有限责任公司
注册及办公地址：深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层
法定代表人：黄扬录
业务联系人：罗艺琳
电话：0755- 82570586
客服电话：4001-022-011
网址：www.zszq.com
（89）联讯证券股份有限公司
注册（办公）地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
法定代表人：徐刚
联系人：彭莲
电话： 0752-2119700
客服电话： 95564
网址： www.lxzq.com.cn
（90）江海证券有限公司
注册（办公）地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人： 孙名扬
联系人：周俊
电话：0451-85863726
客服电话：400-666-2288
网址：www.jhzq.com.cn
（91）九州证券股份有限公司
注册地址：青海省西宁市城中区西大街11号
办公地址：深圳市福田区民田路新华保险大厦18楼
北京运营总部：北京市朝阳区安立路30号仰山公园东一门2号楼
法定代表人：吴强
联系人：张靓雅
电话：010-57672000、0755-33331188-8807
客服电话：4006-5432-18
网址：www.tyzq.com.cn
（92）国金证券股份有限公司
注册（办公）地址：四川省成都市东城根上街 95 号
法定代表人：冉云
联系人：刘婧漪、贾鹏
电话：028-86690057、028-86690058
客服电话：95310
网址： www.gjzq.com.cn
（93）中国民族证券有限责任公司
注册地址：北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼
办公地址：北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观A座40F-43F
法定代表人：何亚刚
联系点人：李小雅
电话：010-59355930
客服电话：4008895618
网址：www.e5618.com
（94）爱建证券有限责任公司
注册(办公)地址： 上海市浦东新区世纪大道1600号32楼
法定代表人：钱华
联系人：王薇
电话：021-32229888-25125
客服电话：4001962502
网址：http://www.ajzq.com
（95）英大证券有限责任公司
注册（办公）地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
法定代表人：吴佳
联系人：吴尔辉
电话：0755-83007159
客服电话：4008-188-688
网址：www.ydsc.com.cn
（96）华融证券股份有限公司
注册（办公）地址：北京市西城区金融大街8号
法定代表人：祝献忠
联系人：李慧灵
电话：010-85556100
客服电话：95390；400-898-9999
网址：www.hrsec.com.cn
（97）天风证券股份有限公司
注册（办公）地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼
法定代表人：余磊
联系人：陈璐
电话：027-87618882
客服电话：027-87618882
网址：www.tfzq.com
（98）首创证券有限责任公司
注册（办公）地址：北京市西城区德胜门外大街115号德胜尚城E座
法定代表人：吴涛
联系人：刘宇
电话：010-59366070
客服电话：4006200620
网址：http://www.sczq.com.cn/
（99）宏信证券有限责任公司
注册（办公）地址：四川省成都市人民南路二段十八号川信大厦10楼
法定代表人：吴玉明
联系人：杨磊
电话：028-86199041
客服电话：4008-366-366
网址： http://www.hxzq.cn
（100）太平洋证券股份有限公司
注册（办公）地址：云南省昆明市青年路389号志远大厦18层
法定代表人：李长伟
联系人：唐昌田
电话：010-88321717
客服电话：0871-68898130
网址：http://www.tpyzq.com
（101）开源证券股份有限公司
注册（办公）地址：西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层
法定代表人：李刚
联系人：袁伟涛
电话：029-63387289
客服电话：400-860-8866
网址： www.kysec.cn
（102）华金证券有限责任公司
注册地址：上海市浦东新区杨高南路759号（陆家嘴世纪金融广场）30层
办公地址：上海市浦东新区杨高南路759号（陆家嘴世纪金融广场）30层
法定代表人：宋卫东
电话：021-20655660
客服电话：4008211357
网址： www.huajinsc.cn
（103）武汉市伯嘉基金销售有限公司
注册（办公）地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城90（一期）第七幢23层1号4号
法定代表人：陶捷
联系人：陆锋
电话： 027-87006003-8026
客服电话：400-027-9899
公司网站：http://www.buyfunds.cn
（104）泰诚财富基金销售（大连）有限公司
注册（办公）地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
法定代表人：林卓
联系人：张晓辉
电话：0411-88891212
客服电话：400-6411-999
公司网站：http:// www.taichengcaifu.com
（105）上海基煜基金销售有限公司
注册地址：上海市崇明县长兴镇潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区）
办公地址：上海市昆明路518号北美广场A1002
法定代表人：王翔
联系人：吴笛
联系电话：021-6537-0077
客服电话：021-6537-0077
公司网站：www.jiyufund.com.cn
（106）北京汇成基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108号
办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108号
法定代表人：王伟刚
联系人：丁向坤
联系电话：010-56282140
客服电话：400-619-9059
公司网站：www.fundzone.cn
金鹰元盛债券（LOF）的场内销售机构为具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员。基金管理人可根据有关法律、法规的要求，调整本基金代理销售机构。
（二）注册登记机构
名称：中国证券登记结算有限责任公司
住所：北京西城区金融大街27 号投资广场23 层
办公地址：北京西城区金融大街27 号投资广场23 层
法定代表人：周明
电话：（010）58598839
传真：（010）58598907
联系人：朱立元
（三）律师事务所和经办律师
名称：广东岭南律师事务所
住所：广州市新港西路135号中山大学西门科技园601-605室
法定代表人：黄添顺
电话：020-84035397
传真：020-84113152
经办律师：欧阳氏、何宫益
（四）会计师事务所和经办注册会计师
名称：中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：武汉市武昌区东湖路169号众环海华大厦2-9层
法定代表人：石文先
电话：027 86770549
传真：027 85424329
邮编：430077
经办注册会计师：王兵、龚静伟

四、基金的名称

金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF），简称金鹰元盛债券。

五、基金的类型

本基金类型：上市契约型开放式

六、基金的投资

（一）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。

（二）投资理念

坚持“主动管理、严控风险、理性决策、稳健投资”的投资理念，在审慎权衡投资品种的安全性、收益性与流动性的基础上，努力把握投资机会，谋求基金资产的长期稳定增值。

（三）投资范围

本基金主要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）。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，不参与一级市场新股的申购或增发，但可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资分离交易可转债而产生的权证等。因上述原因持有的股票和权证等资产，本基金将在其可交易之日起90 个交易日内卖出。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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%。

（四）投资策略

1、大类资产的配置策略

本基金大类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。

2、债券投资策略

本基金通过自上而下与自下而上相结合的分析视角，预测利率和确定组合之加权平均久期。自上而下是指基金管理人在审慎分析宏观经济运行状况、货币政策、财政政策运行趋势的基础上，通过定量与定性相结合的方法，对利率尤其是中短期利率的变化趋势进行预测，决定本基金组合在各类属资产上的配置比例、期限结构与品种构成；自下而上是指当某一类资产投资收益率持续上升或下降时，本基金将审慎研判其基本面因素，重新调整个券、类属资产、大类资产的配置比例与期限结构。

（1）债券类资产的期限配置

本基金根据宏观经济走势、CPI、利率等因素，通过审慎分析与测算确定投资组合的加权平均久期。当预期利率下降时，适当提升久期，以分享债券的上涨收益；当预期利率上升时，适当降低久期，以规避债券的下跌风险。

在确定了债券类、货币类资产的配置比例与大致的期限结构之后，根据债券类资产的加权平均久期之目标区间确定久期为1年以下、1～2年、2～5年、5年以上的债券品种之市值占本基金债券总市值的相对比例。

（2）债券类资产的类属配置

本基金通过分析宏观经济走势、未来利率的变动趋势、证券市场运行状况等定性与定量因素的综合分析，确定国债、央票、金融债、信用债等类属债券市值占本基金债券总市值的相对比例。

在确定了各类属债券配置的相对比例后，本基金将根据各类属债券的流动性、换手率、债券类资产加权平均久期的目标区间，进一步确定各类属债券的期限构成。

（3）债券品种选择

本基金主要投资于国债、央票、政策性金融债、以及非国家信用担保的信用债。其中非国家信用担保的信用债券，主要包括企业债、公司债、非政策性金融债、地方政府债、短期融资券、中期票据、可转换债券、分离交易可转债、资产支持证券、以及中小企业私募债等非国家信用的固定收益类金融工具。

1）国债与央票

对于国债与央行票据，本基金原则上采取买入并持有的投资策略，但在持有过程中会结合利率走势、到期收益率、换手率、投资组合的加权平均久期之目标区间等，在不同剩余期限的国债与央票之间选取适当的品种。另外，本基金将审慎评估回购收益率与国债、央票的到期收益率之间的利差，选择到期收益率高于回购收益率或者预期收益率有下降空间的国债、央票品种。

2）政策性金融债

本基金将根据未来利率的变化趋势、政策性金融债各品种的到期收益率、换手率、外部评级、投资组合的加权平均久期之目标区间等因素，审慎筛选具有比较优势的政策性金融债品种。

3）信用债券

本基金将根据债券的信用评级（内部评级与外部评级）、信用利差分析，并结合流动性、息票率、税赋、提前偿付与赎回等因素，选择具有比较优势的信用债券品种进行投资。

同时本基金将对债券的信用风险和信用利差进行持续评估，预判整体与个券的信用利差曲线走势，据此对本基金的信用债配置比例和个券构成进行调节，优化组合收益。

本基金对债券信用风险的评估主要包括发行人信用风险和债项风险。本基金将根据国内外宏观经济周期、行业周期与景气状况的变化，分析企业债券发行人所处行业的发展前景、发行人业务发展状况，在所属行业内的市场地位、相关财务指标、公司治理结构的有效性等因素，评价债券发行人的信用风险；在此基础上结合特定债券的发行条约，对该项债券信用风险进行评估。

对于中小企业私募债券的投资，在审慎评估中小企业私募债券信用风险和信用利差的基础上，本基金还将结合中小企业私募债券的流动性状况、到期期限、本基金申赎情况、可交易对手的数量和分布结构，合理确定本基金中小企业私募债券的投资比例和持有中小企业私募债券的期限分布和平均久期，以在获取中小企业私募债券收益的同时，维持本基金的流动性。同时，基金管理人将根据审慎原则，制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案，并经董事会批准，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

（4）债券交易策略

在债券配置策略外，本基金亦将根据宏观经济运行状况、证券市场走势、CPI与未来利率的变化趋势，灵活选择恰当的交易策略，在严格控制风险、保持投资组合流动性的前提下，以争取更大的投资回报。

1）跨市场套利策略

跨市场套利是针对因投资主体、交易方式等不同而导致相同的投资品种在各细分投资市场之间存在的价差而进行套利操作，以获得投资收益。

债券市场分为银行间市场和交易所市场两个子市场，两个子市场的投资群体、交易方式不尽相同，造成一定程度的市场分割、信息不对称，可能会造成市场在短期内的非有效性，导致两个市场的资金价格在一定期间内可能存在定价偏离；两个市场的非有效性为本基金提供了一定的套利机会。在充分论证这种套利机会可行性的基础上，基金将寻找最佳时机，实施跨市场套利策略，积极把握市场当中出现的套利机会。

由于新股、新债发行以及季节效应等因素会使市场资金供求关系短期内发生变化，这种变化很可能引发市场短期收益率的上升，本基金将积极利用这种机会获得投资收益。

2）跨品种套利策略

跨品种套利是针对各品种间因流动性、税收等因素的不同而导致的资产定价偏离进行套利操作，以获得投资收益。由于不同投资群体对于流动性、税收等因素的不同偏好，可能会造成发行条件相似的品种之内在价值发生明显偏离，本基金将在保持流动性的基础上，进行品种间的套利操作。

基于本基金研判分析结果，识别出被市场错误定价的债券，进而采取适当的交易方式以获取收益。一方面，可通过利率期限结构分析，在现金流特征相近且处于同一风险等级的多只债券品种中寻找价值被高估或低估的品种；另一方面，通过分析债券的信用等级、债券息票率、发债企业所处行业的属性等因素，评估判断风险债券与无风险债券间的合理息差。

3）跨期限套利策略

由于投资群体的差异、信息不对称、投资者对于某种期限的偏好等因素可能会造成市场对于不同期限的相似投资标的错误定价，本基金将在保持流动性的基础上，实施跨期限套利，以获取投资收益。

4）回购策略

当预期市场利率下跌或走势平稳时，将债券进行正回购，融资后再购买票息较高债券，若融资成本低于所购入债券的票息，该策略便可实现正收益。

根据市场利率的波动性特征，利用市场时机（例如：季节性因素、突发事件等）造成的短期市场失衡带来的交易机会，获取投资收益。比如在季末或新股发行时，利用市场资金面趋紧、利率走高时机进行逆回购。

5）一级市场参与策略

本基金积极参与债券、票据等品种的一级市场投标，获取一级市场与二级市场间的价差，扩大盈利空间。本基金将基于二级市场的收益水平和市场资金面的状况，对一级市场的招标利率进行预测，以确定本基金的投标价。

3、货币市场类资产的配置策略

根据投资组合的加权平均久期的目标区间、未来利率的变化趋势、各期限货币市场类资产的流动性、收益率的变化等确定本基金在不同期限货币资产上的配置额占本基金货币资产总额的相对比例，并随着前述决策变量的变化，实时动态地调整配置的相对比例，严格控制货币资产的加权平均剩余期限。

（五）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准是：中国债券综合财富指数收益率。

本基金选择中国债券综合财富指数作为业绩比较基准，主要理由是：

（1）样本债券涵盖的范围广。中国债券综合指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的中国全市场债券指数，除了美元债、资产支持证券和部分在交易所发行上市的债券以外，其他所有债券均纳入样本债券范围，且待偿期在一年以内的债券亦进入指数样本券，能够较好地反映债券市场整体状况。中国债券综合指数样本债券涵盖的范围与本基金可投资的债券子类基本一致。

（2）时间序列完整。其起始时间点为2002年1月4日，较长的时间序列有利于本基金更加深入地研究和分析债券市场。

随着我国资本市场的发展，将来如有更合适作为本基金业绩比较基准的指数推出，基金管理人经与基金托管人达成一致后，可以在履行适当程序后变更本基金的业绩比较基准，并及时公告。

（六）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。

七、基金投资组合报告（未经审计）

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。

本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已复核了本报告中的内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告有关数据截止日为2016年9月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

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	406,359,123.50	60.14
	其中：债券	406,359,123.50	60.14
	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	259,732,677.58	38.44
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	50,132,321.58	7.42
6	银行存款和结算备付金合计	2,315,191.94	0.34
7	其他各项资产	7,276,490.21	1.08
8	合计	675,683,483.23	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

（1）报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末持有股票投资。

（2）报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末持有股票投资。

3、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

本基金本报告期末持有股票投资。

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	51,181,000.00	9.53
2	央行票据	-	-
3	金融债券	110,429,000.00	20.57
	其中：政策性金融债	110,429,000.00	20.57
4	企业债券	146,219,123.50	27.23
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	98,530,000.00	18.35
9	其他	-	-
10	合计	406,359,123.50	75.68

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	160210	16国开10	1,100,000.00	110,429,000.00	20.57
2	111617125	16光大CD125	1,000,000.00	98,530,000.00	18.35
3	112171	12久联债	250,300.00	26,131,320.00	4.87
4	1280469	12淮北建投集团债	300,000.00	23,505,000.00	4.38
5	1180199	11淮南产投债	200,000.00	21,446,000.00	3.99

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

本基金本报告期末持有资产支持证券。

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。

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

本基金本报告期末持有权证。

9、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。

10、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。

11、投资组合报告附注

（1）本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

（2）报告期内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。

（3）其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	23,753.09
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,152,737.12
5	应收申购款	100,000.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,276,490.21

（4）报告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可转换债券。

（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。

（6）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。

八、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效日为2013年5月2日，2015年5月5日二年届满后转型为金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）。基金转型以来（截至2016年9月30日）的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示：

1、金鹰元盛债券型证券投资基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

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
2015.5.5-2015.12.31	7.90%	0.10%	5.71%	0.07%	2.19%	0.03%
2016.1.1-2016.9.30	2.69%	0.10%	3.37%	0.06%	-0.68%	0.04%
2015.5.5-2016.9.30	10.80%	0.10%	9.27%	0.07%	1.53%	0.03%

2、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

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历史走势对比图
(2015年5月5日至2016年9月30日)

注：（1）截至本报告期末，本基金的各项投资比例已符合基金合同约定。（2）本基金业绩比较基准为：中国债券综合财富指数收益率。

九、基金的费用和税收

（一）与基金运作相关的费用

1、与基金运作相关的费用种类

（1）基金管理人的管理费；

（2）基金托管人的托管费；

（3）基金销售服务费；

（4）基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；

（5）基金份额持有人大会费用；

（6）基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；

（7）基金的证券交易费用；

（8）基金的银行汇划费用；

（9）基金的上市初费和上市月费；

（10）按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内按照公允的市场价格确定；本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金资产总值中扣除；法律法规和基金合同另有规定时从其规定。

2、与基金运作相关的费用之计提方法、计提标准和支付方式

（1）基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的0.70%年费率计提。

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

H＝E×0.70%÷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。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起五个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至法定节假日、公休日结束之日起3个工作日内或不可抗力情形消除之日起3个工作日内支付。

（2）基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.20%年费率计提。

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

H＝E×0.20%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起五个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至法定节假日、公休日结束之日起3个工作日内或不可抗力情形消除之日起3个工作日内支付。

（3）基金销售服务费

基金销售服务费用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。

本基金销售服务费率为年费率0.4%。

本基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值0.4%的年费率计提。基金销售服务费的计算方法如下：

H＝E×年销售服务费率÷当年天数

H为每日应计提的基金销售服务费

E为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人自动在月初五个工作日内、按照指定的帐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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

（4）、本条第（一）款第1项第（4）至第（9）小项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

3、不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

4、基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率和基金销售服务费。调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售服务费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；降低基金管理费率、基金托管费率或基金销售服务费率等费率的，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒体和基金管理人网站上刊登公告。

（二）与基金销售有关的费用

1、申购费和赎回费

（1）本基金不收取申购费用。

（2）赎回费率

本基金的场外赎回费率随基金份额持有人持有本基金的时间的增加而递减，具体赎回费率如下表所示：

持有期限（T）	赎回费率
T<90天	0.1%
T≥90天	0

本基金的场内赎回费率为0.1%。

（3）本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取，扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产，赎回费归入基金财产的比例不得低于赎回费总额的25%。

（4）本基金由原有元盛A、元盛B份额转入的场外份额不收取赎回费；由原有元盛A、元盛B份额转入的场内份额赎回费率为0.1%。

（5）基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前2 个工作日在至少一家指定媒体上公告。

2、转换费率

本基金与基金管理人所管理的其他基金之间的转换费率由基金管理人根据有关法律法规和基