

金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）

2025 年中期报告

2025 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：二〇二五年八月三十日

§ 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 2025 年 8 月 29 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 2025 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	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
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	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
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	42
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	42
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	42
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	42
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	43

7.12 投资组合报告附注.....	43
§8 基金份额持有人信息.....	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
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.....	46
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况.....	46
§9 开放式基金份额变动.....	46
§10 重大事件揭示.....	47
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 本报告期持有的基金发生重大影响事件.....	47
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
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.....	47
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.9 其他重大事件.....	49
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	50
11.1 影响投资者决策的其他重要信息.....	50
§12 备查文件目录.....	50
12.1 备查文件目录.....	50
12.2 存放地点.....	50
12.3 查阅方式.....	50

§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	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		
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	23,909,557.66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	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	15,355,994.99份	8,086,061.77份	467,500.90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 负责人	姓名	凡湘平	王小飞
	联系电话	020-83936180	021-60637103
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话	4006135888		021-60637228
传真	020-83282856		021-60635778
注册地址	广州市南沙区横沥镇汇通二街 2号3212房		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	姚文强		张金良

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	http://www.gefund.com.cn
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、D 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（2025年1月1日至2025年6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

本期已实现收益	740,338.45	321,842.11	70,254.34
本期利润	528,531.85	266,597.65	10,522.56
加权平均基金份额本期利润	0.0322	0.0413	0.0071
本期加权平均净值利润率	2.46%	2.99%	0.54%
本期基金份额净值增长率	2.79%	3.00%	2.79%
报告期末(2025年6月30日)			
3.1.2 期末数据和指标	金鹰元盛债券（LOF）C	金鹰元盛债券（LOF）E	金鹰元盛债券（LOF）D
期末可供分配利润	3,887,478.63	2,571,586.06	97,029.08
期末可供分配基金份额利润	0.2532	0.3180	0.2075
期末基金资产净值	20,445,639.19	11,340,195.37	623,710.77
期末基金份额净值	1.3314	1.4024	1.3341
报告期末(2025年6月30日)			
3.1.3 累计期末指标	金鹰元盛债券（LOF） C	金鹰元盛债券（LOF） E	金鹰元盛债券（LOF） D
基金份额累计净值增长率	47.46%	53.55%	10.07%

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，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）；

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（下同）。

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	1.78%	0.12%	0.50%	0.03%	1.28%	0.09%
过去三个月	1.75%	0.20%	1.67%	0.09%	0.08%	0.11%
过去六个月	2.79%	0.20%	1.05%	0.11%	1.74%	0.09%
过去一年	8.24%	0.25%	4.80%	0.10%	3.44%	0.15%
过去三年	8.24%	0.20%	15.59%	0.07%	-7.35%	0.13%
自基金合同生	47.46%	0.14%	55.61%	0.07%	-8.15%	0.07%

效起至今						
------	--	--	--	--	--	--

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	1.82%	0.13%	0.50%	0.03%	1.32%	0.10%
过去三个月	1.86%	0.20%	1.67%	0.09%	0.19%	0.11%
过去六个月	3.00%	0.20%	1.05%	0.11%	1.95%	0.09%
过去一年	8.71%	0.25%	4.80%	0.10%	3.91%	0.15%
过去三年	9.56%	0.20%	15.59%	0.07%	-6.03%	0.13%
自基金合同生 效起至今	53.55%	0.23%	45.52%	0.07%	8.03%	0.16%

金鹰元盛债券（LOF）D

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	1.79%	0.12%	0.50%	0.03%	1.29%	0.09%
过去三个月	1.75%	0.20%	1.67%	0.09%	0.08%	0.11%
过去六个月	2.79%	0.20%	1.05%	0.11%	1.74%	0.09%
自基金合同生 效起至今	10.07%	0.25%	3.49%	0.11%	6.58%	0.14%

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。

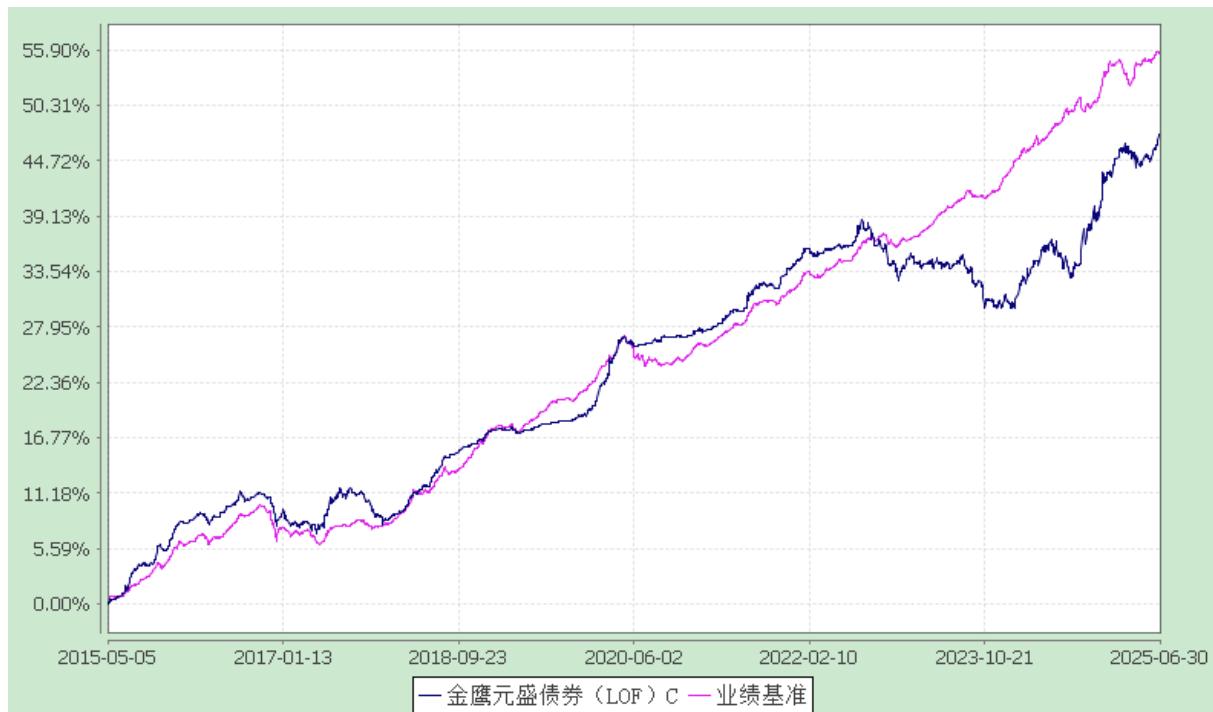
3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）

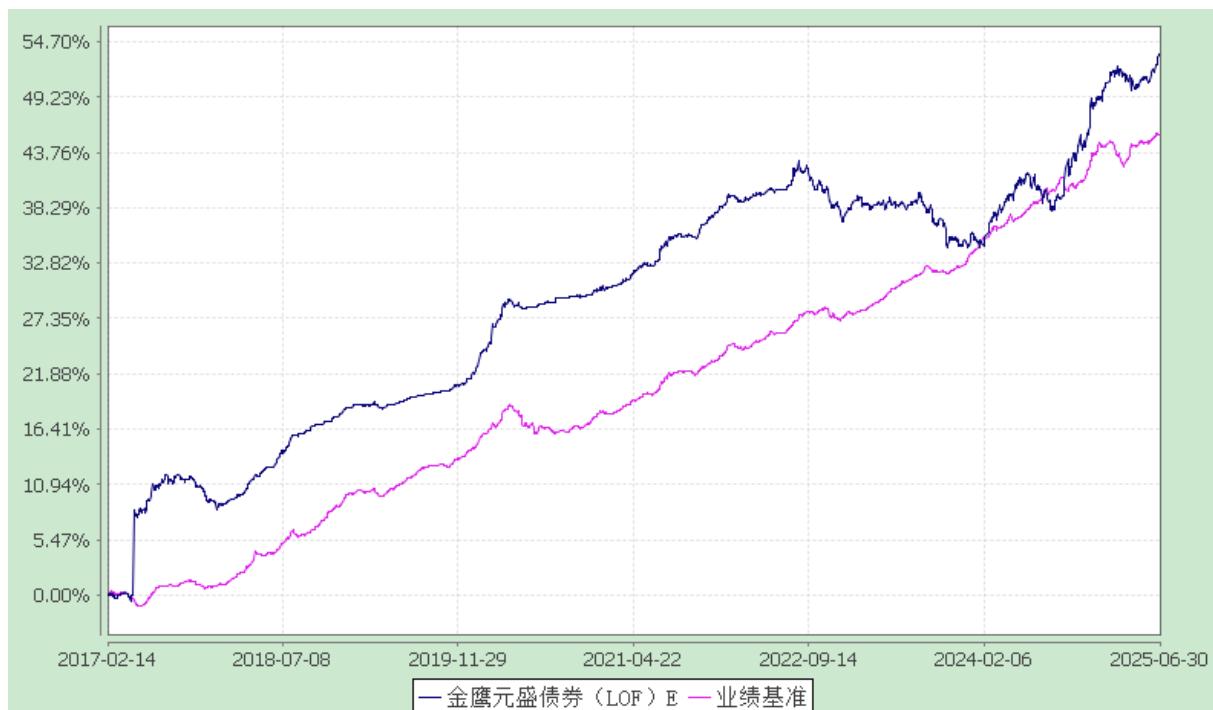
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2015年5月5日至2025年6月30日）

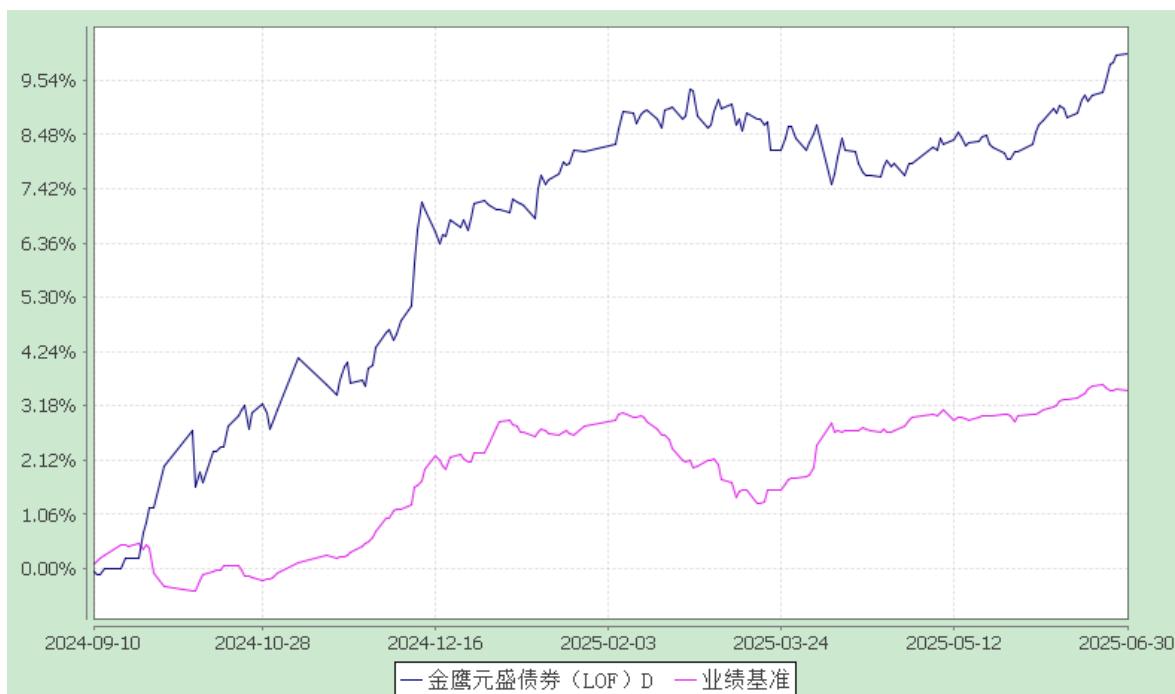
金鹰元盛债券（LOF）C



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，D类基金份额于2024年9月10日设立。

2、本基金的业绩比较基准为：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。

“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72只。

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		
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	-	21	王怀震先生，山东大学经济学硕士。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月加入金鹰基金管理有限公司，现任总经理助理兼混合投资部总经理、基金经理。
许浩琨	本基金的基金经理	2024-05-17	-	8	许浩琨先生，伊利诺伊大学香槟分校经济学硕士。曾任天弘基金管理有限公司债券交易员、研究员等职，光大理财有限责任公司投资经理。2023年5月加入金鹰基金管理有限公司，曾任混合投资部基金经理助理，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/基金经理助理，“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、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中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。

报告期内，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 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

上半年经济呈现一定韧性，内需方面一季度较强，二季度环比有所走弱。外需方面，外贸环境巨变导致上半年呈现较强的抢出口因素，外需对经济形成支撑。

债券市场受经济预期、政策预期、资金利率和机构行为等因素共同作用，一季度央行暂停买入国债，并适度提高资金利率，适度引导债券收益率上行。4月初中美贸易恶化导致收益率快速下行，随后贸易谈判缓和以及央行降准降息，市场参与者认为债券市场利多出尽，进行止盈导致收益率小幅上行，进入6月资金宽松叠加经济走弱导致收益率再次下行。

转债市场受利率和股市双重影响，估值在一季度持续修复，在增量资金的带动下转债价格震荡向上。二季度初，转债受中美贸易恶化冲击大幅下跌，随着股市回升和增量资金涌入，转债市场估值不断提升。

具体到组合上，本基金债券投资以利率债为主，一季度适度保持利率债久期，二季度适度调整久期进行波段操作，转债投资端一季度保持较高转债仓位，二季度随着转债估值回升，适度减持高价转债。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2025年6月30日，基金C类份额净值为1.3314元，本报告期份额净值收益率为2.79%，同期业绩比较基准收益率为1.05%；E类份额净值为1.4024元，本报告期份额净值收益率为3.00%，同期业绩比较基准收益率为1.05%；D类份额净值为1.3341元，本报告期份额净值收益率为2.79%，

同期业绩比较基准收益率为1.05%。

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，我们认为经济更加强调高质量发展，动能或有所减弱，前期抢出口因素透支一定外贸需求；内需方面高频数据显示房地产量价均呈现一定压力，居民消费在前期补贴的情况下也存在一定透支，相较于总量，经济结构变化更值得关注，“反内卷”政策的实施或一定程度能够改变当下降缩局面，提升经济整体质量。

债券市场方面，经济自发性融资需求疲弱，债券市场仍具备中长期配置价值，然而市场定价较为拥挤，参与机构行为扰动导致债券收益率上行或提供更好参与机会。

转债市场估值水平较高，转债市场向上弹性有所减弱。展望后市，转债或许依旧是低利率环境参与权益市场博取收益的重要手段，但转债估值水位或有所波动，需要适度关注。

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

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，本基金在迷你基金期间，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 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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本基金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损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	200,225.88	288,085.04
结算备付金		355,098.76	63,274.34
存出保证金		2,322.67	5,066.42
交易性金融资产	6.4.7.2	28,092,562.48	25,645,173.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		28,092,562.48	25,645,173.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	4,000,000.00	1,999,875.73
应收清算款		232,491.50	-
应收股利		-	-
应收申购款		84,996.31	289,034.79
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	9,300.00	2,830.88
资产总计		32,976,997.60	28,293,340.20
负债和净资产	附注号	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	210,825.14
应付赎回款		1,552.31	2,428.45
应付管理人报酬		18,638.20	15,469.99
应付托管费		5,325.23	4,420.02
应付销售服务费		6,949.10	6,706.67
应付投资顾问费		-	-
应交税费		434,984.77	434,949.13
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	100,002.66	130,245.79
负债合计		567,452.27	805,045.19
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	23,200,275.41	20,233,807.29
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	9,209,269.92	7,254,487.72

净资产合计		32,409,545.33	27,488,295.01
负债和净资产总计		32,976,997.60	28,293,340.20

注：截至本报告期末 2025 年 6 月 30 日，本基金 D 类基金份额净值为 1.3341 元，D 类基金份额总额为 467,500.90 份；C 类基金份额净值为 1.3314 元，C 类基金份额总额为 15,355,994.99 份；E 类基金份额净值为 1.4024 元，E 类基金份额总额为 8,086,061.77 份；基金份额总额为 23,909,557.66 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业收入		996,522.73	2,504,392.69
1.利息收入		17,357.27	24,577.80
其中：存款利息收入	6.4.7.9	2,860.51	4,970.39
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		14,496.76	19,607.41
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,301,590.93	2,102,550.26
其中：股票投资收益	6.4.7.10	78,121.60	282,635.47
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	1,223,469.33	1,746,472.47
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	-	73,442.32
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-326,782.84	376,615.30
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	4,357.37	649.33
减：二、营业总支出		190,870.67	396,758.00
1.管理人报酬		111,574.08	182,729.92
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2.托管费		31,878.33	52,208.58
3.销售服务费		46,294.43	88,582.16
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	2,498.48

其中：卖出回购金融资产支出		-	2,498.48
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		235.39	230.42
8. 其他费用	6.4.7.19	888.44	70,508.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		805,652.06	2,107,634.69
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		805,652.06	2,107,634.69
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		805,652.06	2,107,634.69

6.3 净资产变动表

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：2025年1月1日至2025年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	20,233,807.29	-	7,254,487.72	27,488,295.01
二、本期期初净资产	20,233,807.29	-	7,254,487.72	27,488,295.01
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,966,468.12	-	1,954,782.20	4,921,250.32
(一)、综合收益总额	-	-	805,652.06	805,652.06
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	2,966,468.12	-	1,149,130.14	4,115,598.26
其中：1.基金申购款	19,615,216.88	-	6,915,497.02	26,530,713.90
2.基金赎回款	-16,648,748.76	-	-5,766,366.88	-22,415,115.64
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净	-	-	-	-

资产变动（净资产减少以“-”号填列）				
四、本期期末净资产	23,200,275.41	-	9,209,269.92	32,409,545.33
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	49,854,405.55	-	11,970,966.92	61,825,372.47
二、本期期初净资产	49,854,405.55	-	11,970,966.92	61,825,372.47
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-20,138,595.38	-	-3,374,378.17	-23,512,973.55
（一）、综合收益总额	-	-	2,107,634.69	2,107,634.69
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-20,138,595.38	-	-5,482,012.86	-25,620,608.24
其中：1.基金申购款	1,932,919.04	-	548,753.75	2,481,672.79
2.基金赎回款	-22,071,514.42	-	-6,030,766.61	-28,102,281.03
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	29,715,810.17	-	8,596,588.75	38,312,398.92

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：周蔚，主管会计工作负责人：刘盛，会计机构负责人：董霞

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

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日后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。自 2024 年 9 月 10 日，本基金增加 D 类份额。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况、本报告期的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号）、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《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[2008]1号文《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》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《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]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、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，本基金适用的主要税项列示如下：

- (a)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。
- (b)自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

自2018年1月1日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让2017年12月31日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价（2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2018年1月1日（含）以后，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。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债券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

增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c)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。

(d)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。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴20%的个人所得税。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，其股息红利所得暂减按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。

(e)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f)对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g)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附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日
活期存款	200,225.88
等于： 本金	200,123.33
加： 应计利息	102.55
定期存款	-
等于： 本金	-
加： 应计利息	-
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	-
等于： 本金	-

加：应计利息	-
合计	200,225.88

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日			
	成本	应计利息	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	169,604.40	28,092,562.48	409,965.36
	银行间市场	-	-	-
	合计	27,512,992.72	169,604.40	28,092,562.48
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	27,512,992.72	169,604.40	28,092,562.48	409,965.36

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/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

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	4,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	4,000,000.00	-

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 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日
应收利息	-
其他应收款	9,300.00
待摊费用	-
合计	9,300.00

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2.66
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	100,000.00
合计	100,002.66

6.4.7.7 实收基金

金鹰元盛债券（LOF）C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	16,166,833.84	15,420,061.08
本期申购	6,944,497.64	6,623,737.48
本期赎回（以“-”号填列）	-7,755,336.49	-7,397,085.82
本期末	15,355,994.99	14,646,712.74

金鹰元盛债券（LOF）E

金额单位：人民币元

项目	本期	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	4,709,762.31	4,709,762.31
本期申购	4,723,568.32	4,723,568.32
本期赎回（以“-”号填列）	-1,347,268.86	-1,347,268.86
本期末	8,086,061.77	8,086,061.77

金鹰元盛债券（LOF）D

金额单位：人民币元

项目	本期	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	103,983.90	103,983.90
本期申购	8,267,911.08	8,267,911.08
本期赎回（以“-”号填列）	-7,904,394.08	-7,904,394.08
本期末	467,500.90	467,500.90

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 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	3,349,765.59	2,170,530.05	5,520,295.64
本期期初	3,349,765.59	2,170,530.05	5,520,295.64
本期利润	740,338.45	-211,806.60	528,531.85
本期基金份额交易产生的变动数	-202,625.41	-47,275.63	-249,901.04
其中：基金申购款	1,570,643.23	939,192.84	2,509,836.07
基金赎回款	-1,773,268.64	-986,468.47	-2,759,737.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,887,478.63	1,911,447.82	5,798,926.45

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	1,257,210.49	445,999.91	1,703,210.40
本期期初	1,257,210.49	445,999.91	1,703,210.40
本期利润	321,842.11	-55,244.46	266,597.65
本期基金份额交易产生的变动数	992,533.46	291,792.09	1,284,325.55
其中：基金申购款	1,394,229.53	400,273.01	1,794,502.54

基金赎回款	-401,696.07	-108,480.92	-510,176.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,571,586.06	682,547.54	3,254,133.60

金鹰元盛债券（LOF）D

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	16,796.12	14,185.56	30,981.68
本期期初	16,796.12	14,185.56	30,981.68
本期利润	70,254.34	-59,731.78	10,522.56
本期基金份额交易产生的变动数	9,978.62	104,727.01	114,705.63
其中：基金申购款	1,451,760.85	1,159,397.56	2,611,158.41
基金赎回款	-1,441,782.23	-1,054,670.55	-2,496,452.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	97,029.08	59,180.79	156,209.87

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
活期存款利息收入	2,593.82
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	261.29
其他	5.40
合计	2,860.51

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
卖出股票成交总额	776,584.78
减：卖出股票成本总额	697,671.00
减：交易费用	792.18
买卖股票差价收入	78,121.60

6.4.7.11 债券投资收益**6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	217,896.67

债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,005,572.66
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,223,469.33

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	35,174,952.31
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	33,949,979.52
减：应计利息总额	217,667.55
减：交易费用	1,732.58
买卖债券差价收入	1,005,572.66

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
1.交易性金融资产	-326,782.84
——股票投资	-
——债券投资	-326,782.84
——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	-326,782.84

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	4,190.87
转换费收入	166.50
合计	4,357.37

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	-
信息披露费	-
证券出借违约金	-
汇划手续费	888.44
合计	888.44

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

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未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

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未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

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无应支付关联方的佣金。

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 2025年1月1日至2025年6月 30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	111,574.08	182,729.92
其中：应支付销售机构的客户维护费	49,426.83	85,240.88
应支付基金管理人的净管理费	62,147.25	97,489.04

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 2025年1月1日至2025年6月 30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月 30日

当期发生的基金应支付的托管费	31,878.33	52,208.58
----------------	-----------	-----------

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 2025年1月1日至2025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	金鹰元盛债券 (LOF) D	合计
中国建设银行股份有限公司	12,589.71	-	-	12,589.71
金鹰基金管理有限公司	11.66	-	0.09	11.75
合计	12,601.37	-	0.09	12,601.46
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	金鹰元盛债券 (LOF) D	合计
中国建设银行股份有限公司	10,085.58	-	-	10,085.58
金鹰基金管理有限公司	23.99	-	-	23.99
合计	10,109.57	-	-	10,109.57

注：本基金 E 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额和 D 类基金份额收取销售服务费。

本基金 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% 的年费率逐日计提，D 类基金份额的销售服务费按前一日 D 类基金份额的基金资产净值的 0.4% 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 为每日应计提的该类基金份额销售服务费

E 为前一日的该类基金份额资产净值

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。

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

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方进行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

本基金本报告期及上年度可比期间无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。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

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

本报告期内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

本报告期内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）D

本报告期内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	
	2025年1月1日至2025年6月30日	2024年1月1日至2024年6月30日	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	200,225.88	2,593.82	290,572.25	2,147.90

注：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；本

报告期末清算备付金余额 355,098.76 元，清算备付金利息收入为 261.29 元。上年度可比期间清算备付金余额 271,362.22 元，清算备付金利息收入为 2,777.62 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无在承销期内参与关联方承销的证券。

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（2025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

本基金本报告期末无因认购新发/增发而流通受限的证券。

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

截至本报告期末 2025 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 6 月 30 日止，本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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、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的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不

得超过该证券的10%。

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。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估控制证券发行人的信用风险，建立了内部评级体系，通过内部评级与外部评级相结合的方法充分评估证券以及交易对手的信用风险。

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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
AAA	2,951,272.24	2,935,745.03
AAA 以下	10,399,169.69	11,564,361.11

未评级	-	-
合计	13,350,441.93	14,500,106.14

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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

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所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

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。基金管理人通过久期、凸度等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	200,225.88	-	-	-	200,225.88
结算备付金	355,098.76	-	-	-	355,098.76
存出保证金	2,322.67	-	-	-	2,322.67
交易性金融资产	3,617,299.62	15,599,778.37	8,875,484.49	-	28,092,562.48
买入返售金融资产	4,000,000.00	-	-	-	4,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	232,491.50	232,491.50
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	84,996.31	84,996.31
其他资产	-	-	-	9,300.00	9,300.00
资产总计	8,174,946.93	15,599,778.37	8,875,484.49	326,787.81	32,976,997.60
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	-	-	-	1,552.31	1,552.31
应付管理人报酬	-	-	-	18,638.20	18,638.20
应付托管费	-	-	-	5,325.23	5,325.23
应付销售服务费	-	-	-	6,949.10	6,949.10
应交税费	-	-	-	434,984.77	434,984.77
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	100,002.66	100,002.66
负债总计	-	-	-	567,452.27	567,452.27

利率敏感度缺口	8,174,946.93	15,599,778.37	8,875,484.49	-240,664.46	32,409,545.33
上年度末 2024年12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	288,085.04	-	-	-	288,085.04
结算备付金	63,274.34	-	-	-	63,274.34
存出保证金	5,066.42	-	-	-	5,066.42
交易性金融资产	2,223,822.33	16,913,148.47	6,508,202.20	-	25,645,173.00
买入返售金融资产	1,999,875.73	-	-	-	1,999,875.73
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	289,034.79	289,034.79
其他资产	-	-	-	2,830.88	2,830.88
资产总计	4,580,123.86	16,913,148.47	6,508,202.20	291,865.67	28,293,340.20
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	-	-	-	210,825.14	210,825.14
应付赎回款	-	-	-	2,428.45	2,428.45
应付管理人报酬	-	-	-	15,469.99	15,469.99
应付托管费	-	-	-	4,420.02	4,420.02
应付销售服务费	-	-	-	6,706.67	6,706.67
应交税费	-	-	-	434,949.13	434,949.13
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	130,245.79	130,245.79
负债总计	-	-	-	805,045.19	805,045.19
利率敏感度缺口	4,580,123.86	16,913,148.47	6,508,202.20	-513,179.52	27,488,295.01

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日

	利率上升 25 个基点	-312,411.42	-230,310.49
	利率下降 25 个基点	342,742.48	251,009.90

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		上年度末	
	2025年6月30日	占基金资产净值比例（%）	2024年12月31日	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	13,350,441.93	41.19	14,500,106.14	52.75
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	13,350,441.93	41.19	14,500,106.14	52.75

注：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，主要涉及股票、可转债、可交换债、权证等交易性金融资产。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2025 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资占基金资产净值的比例为 0.00%，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响，所以未进行其他价格风险的敏感性分析。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层 次	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	13,350,441.93	14,500,106.14
第二层次	14,742,120.55	11,145,066.86
第三层次	-	-
合计	28,092,562.48	25,645,173.00

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间重大变动

本基金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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2025年6月30日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	28,092,562.48	85.19
	其中：债券	28,092,562.48	85.19
	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	4,000,000.00	12.13
	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	555,324.64	1.68
8	其他各项资产	329,110.48	1.00
9	合计	32,976,997.60	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

本基金本报告期末未持有股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601998	中信银行	697,671.00	2.54

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601998	中信银行	776,584.78	2.83

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	697,671.00
卖出股票收入（成交）总额	776,584.78

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

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	14,742,120.55	45.49
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）	13,350,441.93	41.19
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	28,092,562.48	86.68

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	019735	24 国债 04	30,000.00	3,182,436.99	9.82
2	019770	25 国债 05	30,000.00	3,018,916.44	9.31
3	019742	24 特国 01	20,000.00	2,285,914.52	7.05
4	110059	浦发转债	16,000.00	1,803,947.40	5.57
5	019758	24 国债 21	12,000.00	1,210,767.78	3.74

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 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

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	2,322.67
2	应收清算款	232,491.50
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	84,996.31
6	其他应收款	9,300.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	329,110.48

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110059	浦发转债	1,803,947.40	5.57
2	113655	欧 22 转债	822,759.14	2.54
3	113049	长汽转债	808,902.24	2.50
4	113059	福莱转债	729,937.53	2.25

5	113638	台 21 转债	692,752.09	2.14
6	113045	环旭转债	648,667.14	2.00
7	118042	奥维转债	563,174.66	1.74
8	123179	立高转债	483,114.93	1.49
9	118033	华特转债	470,788.28	1.45
10	113659	莱克转债	469,319.45	1.45
11	110089	兴发转债	465,872.33	1.44
12	118034	晶能转债	414,698.74	1.28
13	127050	麒麟转债	370,417.80	1.14
14	113054	绿动转债	356,082.74	1.10
15	111010	立昂转债	346,475.75	1.07
16	123154	火星转债	342,339.86	1.06
17	110085	通 22 转债	338,422.60	1.04
18	128121	宏川转债	334,490.63	1.03
19	127085	韵达转债	329,389.56	1.02
20	118022	锂科转债	322,369.32	0.99
21	123113	仙乐转债	293,550.00	0.91
22	118037	上声转债	247,169.04	0.76
23	113064	东材转债	242,335.07	0.75
24	128136	立讯转债	233,133.70	0.72
25	110076	华海转债	231,941.59	0.72
26	118024	冠宇转债	229,595.89	0.71
27	113627	太平转债	225,387.95	0.70
28	113670	金 23 转债	170,781.58	0.53
29	127089	晶澳转债	157,627.64	0.49
30	113636	甬金转债	118,247.53	0.36
31	123222	博俊转债	86,749.75	0.27

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限证券。

7.12.6 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	户均持有的	持有人结构
------	------	-------	-------

	数(户)	基金份额	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	1,114	13,784.56	0.46	0.00%	15,355,994.53	100.00%
金鹰元盛债券 (LOF) E	1,249	6,474.03	0.00	0.00%	8,086,061.77	100.00%
金鹰元盛债券 (LOF) D	60	7,791.68	0.00	0.00%	467,500.90	100.00%
合计	2,423	9,867.75	0.46	0.00%	23,909,557.20	100.00%

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	刘健礼	525,900.00	38.69%
2	桂许武	157,010.00	11.55%
3	查小玲	125,618.00	9.24%
4	于萍	104,674.00	7.70%
5	徐静	104,673.00	7.70%
6	唐小玲	80,000.00	5.89%
7	王春风	66,990.00	4.93%
8	周建军	52,336.00	3.85%
9	杨惠俊	23,363.00	1.72%
10	栾永军	22,337.00	1.64%

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。

金鹰元盛债券（LOF）D

金鹰元盛债券 D 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	金鹰元盛债券（LOF）	0.00	0.00%

员持有本基金	C		
	金鹰元盛债券（LOF）E	15.80	0.00%
	金鹰元盛债券（LOF）D	8.26	0.00%
	合计	24.06	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	0~10
	金鹰元盛债券（LOF）D	0
	合计	0~10
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
	金鹰元盛债券（LOF）D	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	金鹰元盛债券（LOF）D
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	16,166,833.84	4,709,762.31	103,983.90
本报告期基金总申购份额	6,944,497.64	4,723,568.32	8,267,911.08
减：本报告期基金总赎回份额	7,755,336.49	1,347,268.86	7,904,394.08
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	15,355,994.99	8,086,061.77	467,500.90

§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、本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

2、本报告期内，本基金托管人中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

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

10.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，托管人托管业务部门及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

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	
万联证券	1	-	-	-	-	新增1个
东吴证券	2	776,584.78	100.00%	354.20	100.00%	-

注：本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的专用交易单元。本基金专用交易单元的选择标准如下：

- (1) 财务状况良好；
- (2) 经营行为规范，最近一年相关业务未发生重大违规行为而受到有关管理机关的处罚；
- (3) 具备较强的合规风控能力，包括具有较完备的内控制度、内部管理流程体系及信息系统建设等；
- (4) 具备较强的交易能力或者研究服务能力，包括配备充足人员、交易系统稳定或能够提供具有针对性的较高质量研究成果等。

本基金专用交易单元的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后初步确定选用交易单元的证券公司；
- (2) 由研究部门统筹安排与提供证券交易服务的证券公司签订相关服务协议并发起相关流程；
- (3) 经研究部门分管领导、合规风控部人员、督察长及总经理审批后予以执行。

本基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。2024年7月1日前，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。自2024年7月1日起，根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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
万联证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	69,705,175.54	100.00%	195,700,00.00	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旗下基金2024年第四季度报告提示性公告	证监会规定媒介	2025-01-22
2	金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）2024年第4季度报告	证监会规定媒介	2025-01-22
3	金鹰基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司交易及佣金支付情况公告	证监会规定媒介	2025-03-31
4	金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）2024年年度报告	证监会规定媒介	2025-03-31
5	金鹰基金管理有限公司部分基金新增万联证券股份有限公司为代销机构并开通基金转换、基金定投业务及费率优惠的公告	证监会规定媒介	2025-04-16
6	金鹰基金管理有限公司旗下基金2025年第一季度报告提示性公告	证监会规定媒介	2025-04-22
7	金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）2025年第1季度报告	证监会规定媒介	2025-04-22
8	金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）（金鹰元盛债券（LOF）D）基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2025-05-30
9	金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）（金鹰元盛债券（LOF）E）基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2025-05-30
10	金鹰基金管理有限公司关于终止民商基金销售（上海）有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证监会规定媒介	2025-05-30
11	金鹰元盛债券型发起式证券投资基金	证监会规定媒介	2025-05-30

	(LOF)(金鹰元盛债券(LOF)C)基金产品资料概要更新		
12	金鹰基金管理有限公司新增北京创金启富基金销售有限公司为代销机构并开通基金转换、基金定投业务及费率优惠的公告	证监会规定媒介	2025-06-23

注：相关信息披露文件请通过本基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站及规定报刊查询。

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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和营业执照。
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照。
- 6、本报告期内在规定媒介公开披露的公告。

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

二〇二五年八月三十日