



# 金鹰鑫日享债券型证券投资基金 更新招募说明书摘要

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

时间：二〇二〇年一月

---

## 重要提示

本基金经 2018 年 8 月 23 日中国证券监督管理委员会证监许可[2018] 1367 号文注册募集。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

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，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资有风险。投资者在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书、基金合同和基金产品资料概要等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主作出投资决策，自行承担基金投资中出现的各类风险，包括因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、流动性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、基金投资过程中产生的操作风险、因交收违约和投资债券引发的信用风险、基金投资对象与投资策略引致的特有风险等等。本基金的特定风险详见招募说明书“风险揭示”章节。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定），在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。在特殊市场条件下，如证券市场的成交量发生急剧萎缩、基金发生巨额赎回以及其他未能预见的特殊情形下，可能导致基金资产变现困难或变现对证券资产价格造成较大冲击，发生基金份额净值波动幅度较大、无法进行正常赎回业务、基金不能实现既定的投资决策等风险。

本基金投资中小企业私募债券，该债券是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的。受限于该债券非公开交易和发债主体自身资质，一般情况下潜在较大流动性风险和信用风险。当发债主体信用质量恶化或债券市场流动性受限时，可能会使得本基金总体风险水平增加，由此可能给基金净值带来更

---

大的负面影响和损失。

本基金为债券型基金，其预期风险收益水平高于货币市场基金，但低于股票型基金和混合型基金。

投资者应充分考虑自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本招募说明书已经本基金托管人复核。除非另有说明，本招募说明书所载内容截止日为 2019 年 12 月 31 日（其中基金管理人信息截止日为 2020 年 1 月 19 日），有关财务数据截止日为 2019 年 9 月 30 日，净值表现截止日为 2019 年 12 月 31 日，本报告中财务数据未经审计。

本招募说明书关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

# 一、基金管理人

## (一) 基金管理人简况:

名称: 金鹰基金管理有限公司

注册地址: 广东省广州市南沙区海滨路 171 号 11 楼自编 1101 之一 J79

办公地址: 广东省广州市天河区珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 楼

设立日期: 2002 年 12 月 25 日

批准设立机关及批准设立文号: 中国证监会、证监基金字[2002]97 号

组织形式: 有限责任公司

注册资本: 5.102 亿元人民币

存续期限: 持续经营

联系电话: 020-83936180

股权结构:

发起人名称	出资额 (万元)	出资比例
东旭集团有限公司	33770	66.19%
广州越秀金融控股集团股份有限公司	12250	24.01%
广州白云山医药集团股份有限公司	5000	9.8%
总计	51020	100%

## (二) 主要人员情况

### 1、董事会成员

李兆廷先生, 董事长, 北京交通大学软件工程硕士。曾任石家庄市柴油机厂技术员、车间主任、总经理助理、副总经理等职务。现任东旭集团有限公司董事长、西藏金融租赁有限公司董事长、中国生产力学会副会长。

王中女士, 董事, 中国科学院大学工商管理硕士, 现任东旭集团有限公司高级副总经理、东旭资本控股集团常务副总经理、东旭光电科技股份有限公司董事。

刘志刚先生, 董事, 数量经济学博士, 历任工银瑞信基金管理有限公司产品开发经理, 安信基金管理有限责任公司产品部总监, 东方基金管理有限责任公司量化投资部总经理、基金经理, 金鹰基金管理有限公司副总经理、总经理等职务。

---

苏丹先生，董事，管理学硕士，历任华为技术有限公司人力资源部绩效考核岗、韬睿惠悦咨询有限公司咨询顾问、德勤咨询公司咨询经理、越秀集团人力资源部高级主管、广州证券股份有限公司人力资源部副总经理，现任广州证券股份有限公司战略管理部总经理。

王毅先生，董事，工商管理硕士、经济师，历任广州证券有限责任公司营业部经理、营业部总经理助理、营业部副总经理，办公室副主任（主持全面工作）、合规总监、董事会秘书。现任广州证券股份有限公司副总裁兼任董事会秘书、首席风险官、合规总监。

黄雪贞女士，董事，英语语言文学硕士，历任深圳高速公路股份有限公司董事会秘书助理和证券事务代表、广州药业股份有限公司董事会秘书处副主任、主任、证券事务代表。现任广州白云山医药集团股份有限公司董事会秘书室主任、证券事务代表、董事会秘书。

刘金全先生，独立董事，数量经济学博士。历任吉林大学经济管理学院讲师、商学院教授、院长，现任广州大学经济与统计学院特聘教授。

杨之曙先生，独立董事，数量经济学博士。历任云南航天工业总公司财务处助理经济师，现任清华大学经济管理学院教授。

王克玉先生，独立董事，法学博士。历任山东威海高技术开发区进出口公司法务、山东宏安律师事务所律师、北京市重光律师事务所律师，现中央财经大学法学院副院长、博士生导师。

## 2、监事会成员

姚志智女士，监事，党校本科学历、会计师、经济师。历任郴州电厂职员、郴州市农业银行储蓄代办员、飞虹营业所副主任、国北所主任、广州天河保德交通物资公司主管会计、广州珠江啤酒集团财务部主管会计、广州荣鑫容器有限公司财务部经理、总经理助理、广州白云山侨光制药有限公司财务部副部长、广州白云山制药有限公司财务部副部长、广州白云山化学制药创新中心财务负责人、广州白云医药集团股份有限公司财务部高级经理、财务部部长、广州医药海马品牌整合传播有限公司监事，现任广州白云山医药集团股份有限公司财务副总监。

赖德昌先生，监事，本科学历，历任广东证券有限责任公司审计员、广发基金管理有限公司交易员，现任金鹰基金管理有限公司集中交易部总监。姜慧斌先

---

生，监事，管理学硕士。曾任宇龙计算机通信科技（深圳）有限公司人力资源部组织发展经理，现任金鹰基金管理有限公司综合管理部总监。

### 3、公司高级管理人员

姚文强先生，副总经理，经济学硕士，历任上海中央登记结算公司深圳代办处财务部负责人，上海中央登记结算公司深圳代办处主管，浙江证券深圳营业部投资咨询部经理、大成基金管理公司市场部高级经理，汉唐证券有限责任公司市场总监，招商基金营销管理部总经理助理，国投瑞银基金管理有限公司华南总经理，博时基金管理有限公司零售南方总经理，金鹰基金管理有限公司总经理助理等职务。经公司第五届董事会第四十二次会议审议通过，并已按规定报中国证券投资基金业协会及广东证监局备案，现任金鹰基金管理有限公司副总经理。经公司第六届董事会第五十六次会议审议通过，自 2020 年 1 月 3 日起代行金鹰基金管理有限公司总经理职责。

徐娇娇女士，督察长，法学硕士研究生，历任南京证券股份有限公司投资银行部项目经理、中国证券业协会会员服务三部高级主办、第一创业证券股份有限公司总裁办公室新业务/产品管理组负责人、第一创业证券股份有限公司资产管理运营部负责人。经公司第六届董事会第四十六次会议审议通过，并已按规定报中国证券投资基金业协会及广东证监局备案，现任金鹰基金管理有限公司督察长。

刘盛先生，副总经理，首席信息官，化学工程硕士，历任长江证券有限公司电脑主管、平安证券有限公司电脑主管、巨田证券有限公司总裁助理、宏源证券股份有限公司技术总监、广州证券股份有限公司副总裁、天源证券有限公司总经理、广州证券股份有限公司副总裁等职务。经公司第六届董事会第四十八次会议、第五十六次会议审议通过，并已按规定报中国证券投资基金业协会及广东证监局备案，现任金鹰基金管理有限公司副总经理兼首席信息官职务。

### 4、基金经理

龙悦芳，曾任平安证券股份有限公司投资助理、交易员、投资经理等职务。2017 年 5 月加入金鹰基金管理有限公司，任固定收益部基金经理助理职务。2019 年 9 月至 2019 年 4 月金鹰货币市场证券投资基金现任金鹰添瑞中短债债券型证券投资基金基金经理（自 2017 年 9 月 21 日）、金鹰鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自 2018 年 6 月 14 日）、金鹰添祥中短债债券型证券投资基金基金经理（自 2018 年 9 月 19 日）和金鹰鑫日享债券型证券投资基金（自 2019

---

年3月起)。

林擘先生，曾任兴业证券股份有限公司交易员、中海基金管理有限公司基金经理助理、兴业证券股份有限公司投资经理、国泰君安证券资产管理有限公司投资经理。2018年6月加入金鹰基金管理有限公司。2019年6月起担任金鹰鑫日享债券型证券投资基金。2019年7月起担任金鹰添盛定期开放债券型发起式证券投资基金、金鹰添鑫定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2019年10月起担任金鹰元祺信用债债券型证券投资基金基金经理。

## 5、投资决策委员会

本公司采取集体投资决策制度，相关投资决策委员会成员有：

### (1) 公司投资决策委员会

姚文强，投资决策委员会主席，副总经理（代行总经理职责）；

王超伟先生，投资决策委员会委员，总经理助理；

王喆先生，投资决策委员会委员，权益投资部总监，基金经理；

林龙军先生，投资决策委员会委员，绝对收益投资部总监，基金经理；

陈立先生，投资决策委员会委员，权益投资部副总监，基金经理；

刘丽娟女士，投资决策委员会委员，固定收益部总监，基金经理。

### (2) 权益投资决策委员会

姚文强，权益投资决策委员会主席，副总经理（代行总经理职责）；

王超伟先生，权益投资决策委员会副主席，总经理助理；

王喆先生，权益投资决策委员会委员，权益投资部总监，基金经理；

陈立先生，权益投资决策委员会委员，权益投资部副总监，基金经理；

陈颖先生，权益投资决策委员会委员，权益投资部副总监，基金经理。

### (3) 固定收益投资决策委员会

姚文强，固定收益投资决策委员会主席，副总经理（代行总经理职责）；

林龙军先生，固定收益投资决策委员会委员，绝对收益投资部总监，基金经理；

林擘先生，固定收益投资决策委员会委员，基金经理；

龙悦芳女士，固定收益投资决策委员会委员，固定收益部副总监，基金经理；

---

戴骏先生，固定收益投资决策委员会委员，固定收益部副总监，基金经理。  
上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

名称：中国民生银行股份有限公司（以下简称“中国民生银行”）

住所：北京市西城区复兴门内大街2号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人：洪崎

成立时间：1996年2月7日

基金托管业务批准文号：证监基金字[2004]101号

组织形式：其他股份有限公司（上市）

注册资本：28,365,585,227元人民币

存续期间：持续经营

电话：010-58560666

联系人：罗菲菲

## 三、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、直销机构

名称：金鹰基金管理有限公司

注册地址：广东省广州市南沙区海滨路171号11楼自编1101之一J79

办公地址：广东省广州市天河区珠江东路28号越秀金融大厦30楼

成立时间：2002年12月25日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2002]97号

组织形式：有限责任公司

注册资本：5.102亿元人民币

存续期间：持续经营

联系人：蔡晓燕

联系电话：020-83282925

传真电话：020-83283445



---

客户服务及投诉电话：4006-135-888

电子邮箱：csmail@gefund.com.cn

网址：www.gefund.com.cn

## 2、代销机构：

（1）名称：诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室

办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路32号c栋

法定代表人：汪静波

联系人：余翼飞

电话：021-80359115

客服电话：400-821-5399

公司网址：www.noah-fund.com

（2）名称：深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼

办公地址：深圳罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

电话：0755-33227950

客服电话：4006-788-887

公司网址：www.zlfund.cn

（3）名称：蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路969号3幢5层599室

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F

法定代表人：祖国明

联系人：韩爱彬

客服电话：4000-766-123

---

公司网址: [www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

(4) 名称: 南京苏宁基金销售公司  
注册地址: 南京玄武区苏宁大道 1-5 号  
办公地址: 南京玄武区苏宁大道 1-5 号  
法定代表人: 王锋  
联系人: 张慧  
电话: 025-66996699  
客服电话: 95177  
公司网址: <https://www.snjijin.com/fsws/index.htm>

(5) 名称: 一路财富(北京)信息科技有限公司  
注册地址: 北京市西城区车公庄大街 9 号院 5 号楼 702 室  
办公地址: 北京市西城区阜城门内大街 2 号万通大厦 22 层 2208 室  
法定代表人: 吴雪秀  
联系人: 徐越  
电话: 010-883128877  
客服电话: 400-001-1566  
公司网址: [www.yilucaifu.com](http://www.yilucaifu.com)

(6) 名称: 中信建投证券股份有限公司  
注册地址: 北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼  
办公地址: 北京市东城区朝内大街 188 号  
法定代表人: 王常青  
联系人: 刘芸  
电话: 010-85156310  
客服电话: 4008-888-108

---

网址: [www.csc108.com](http://www.csc108.com)

(7) 名称: 国泰君安证券股份有限公司  
注册地址: 自由贸易试验区商城路 618 号  
办公地址: 上海市静安区新闸路 669 号博华广场 21 层  
法定代表人: 杨德红  
联系人: 钟伟镇  
电话: 021-38032284  
客服电话: 95521  
网址: [www.gtja.com](http://www.gtja.com)

(8) 名称: 光大证券股份有限公司  
地址: 上海市静安区新闸路 1508 号  
法定代表人: 周健男  
联系人: 李晓哲  
电话: 021-22169111  
客服电话: 95525  
网址: [www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

(9) 名称: 北京唐鼎耀华基金销售有限公司  
注册地址: 北京市延庆县延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 236 室  
办公地址: 北京市朝阳区东三环北路 38 号院 1 号泰康金融中心 38 层  
法定代表人: 张冠宇  
联系人: 王国壮  
电话: 010-85934903  
客服电话: 400-819-9868

---

公司网址: [www.tdyhfund.com](http://www.tdyhfund.com)

(10) 名称: 北京肯特瑞基金销售有限公司

注册地址: 北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15

办公地址: 北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院a座17层

法定代表人: 江卉

联系人: 韩锦星

电话: 010-89181356

公司网址: [www.fund.jd.com](http://www.fund.jd.com)

客服电话: 95118

(11) 名称: 湖北银行股份有限公司

地址: 武汉市武昌区水果湖街中北路86号汉街总部国际8栋

法定代表人: 陈大林

联系人: 李昕雅

电话: 027-87139129

客服电话: 400-85-96599

公司网址: [www.hubeibank.cn](http://www.hubeibank.cn)

(12) 名称: 海银基金销售有限公司

注册地址: 自由贸易试验区银城中路8号402室

办公地址: 上海市浦东新区银城中路8号4楼

法定代表人: 刘惠

联系人: 毛林

电话: 021-80133597

客服电话: 400-808-1016

---

公司网址: [www.fundhaiyin.com](http://www.fundhaiyin.com)

(13) 名称: 上海证券有限责任公司

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: 魏熠琿

电话: 021-53686278

客服电话: 4008918918

网址: [www.shzq.com](http://www.shzq.com)

(14) 名称: 平安证券股份有限公司

地址: 深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人: 何之江

联系人: 周一涵

电话: 021-38637436

客服电话: 95511 转 8

网址: [www.stock.pingan.com](http://www.stock.pingan.com)

(15) 名称: 华泰证券股份有限公司

注册地址: 南京市江东中路 228 号

办公地址: 南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人: 周易

联系人: 庞晓芸

电话: 0755-82492193

客服电话: 95597

网址: [www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

---

(16) 名称：华龙证券股份有限公司

地址：兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心 21 楼

法定代表人：陈牧原

联系人：范坤

电话：0931-4890208

客服电话：400-6898888

网址：www.hlzq.com

(17) 名称：奕丰基金销售有限公司

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室

法定代表人：TEO WEE HOWE

联系人：叶健

电话：0755-89460507

客服电话：400-684-0500

公司网址：www.ifastps.com.cn

(18) 名称：东吴证券股份有限公司

地址：苏州工业园区星阳街 5 号

法定代表人：范力

联系人：陆晓

电话：0512-62938690

客服电话：95330

网址：www.dwzq.com.cn

---

(19) 名称：国都证券股份有限公司  
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：王少华  
联系人：杜正中  
电话：010-84183142  
客服电话：400-818-8118  
网址：www.guodu.com

(20) 名称：国联证券股份有限公司  
注册地址：江苏省无锡市金融一街8号  
办公地址：江苏省无锡市金融一街8号国联大厦702  
法定代表人：姚志勇  
联系人：祁昊  
电话：0510-82831662  
客服电话：95570  
网址：www.glsc.com.cn

(21) 名称：中信证券（山东）有限责任公司  
注册地址：山东省青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001  
办公地址：山东省青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层  
法定代表人：姜晓林  
联系人：孙秋月  
电话：0532-85022026  
客服电话：95548  
网址：sd.citics.com

---

(22) 名称：阳光人寿保险股份有限公司

注册地址：海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层

办公地址：北京市朝阳区朝外大街乙 12 号昆泰国际大厦 12 层

法定代表人：李科

联系人：王超

电话：010-85632771

客服电话：95510

网址：fund.sinosig.com

(23) 名称：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

公司网址：www.cfsc.com.cn

(24) 名称：华融证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 8 号

办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦 12 层

法定代表人：张海文

联系人：孙燕波

电话：010-85556048

客服电话：95390；400-898-9999

网址：www.hrsec.com.cn



---

(25) 名称：上海挖财基金销售有限公司

注册地址：自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

办公地址：自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

法定代表人：冷飞

联系人：孙琦

电话：021-50810687

客服电话：4000256569

公司网址：[www.wacai.com](http://www.wacai.com)

(26) 名称：北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路甲 19 号嘉盛 SOHO 中心 30 层

法定代表人：周斌

联系人：侯艳红

电话：010-53572363

客服电话：4008980618

网址：[www.chtwm.com](http://www.chtwm.com)

(27) 名称：宜信普泽投资顾问（北京）有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号楼 soho 现代城 C 座 18 层 1809

法定代表人：戎兵

联系人：魏晨

电话：010-52413385

客服电话：400-6099-200

网址：[www.yixinfund.com](http://www.yixinfund.com)

---

(28) 名称：济安财富（北京）基金销售有限公司  
注册地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307  
办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307  
法定代表人：杨健  
联系人：李海燕  
电话：010-65309516  
客服电话：400-673-7010  
公司网址：www.jianfortune.com

(29) 名称：凤凰金信（银川）基金销售有限公司  
注册地址：宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路 142 号  
14 层 1402  
办公地址：北京市朝阳区紫月路 18 号院 朝来高科技产业园 18 号楼  
法定代表人：张旭  
联系人：张旭  
电话：010-58160168  
客服电话：400-810-5919  
公司网址：www.fengfd.com

(30) 名称：北京植信基金销售有限公司  
注册地址：北京市密云县兴盛南路 8 号院 2 号楼 106 室-67  
办公地址：北京市朝阳区惠河南路盛世龙源 10 号  
法定代表人：于龙  
联系人：吴鹏  
电话：010-56075718  
客服电话：4006-802-123

---

公司网址: [www.zhixin-inv.com](http://www.zhixin-inv.com)

(31) 名称: 长江证券股份有限公司  
地址: 武汉市新华路特 8 号长江证券大厦  
法定代表人: 李新华  
联系人: 奚博宇  
电话: 021-61118795  
客服电话: 95579 或 4008-888-999  
网址: [www.cjsc.com.cn](http://www.cjsc.com.cn)

(32) 名称: 万家财富基金销售(天津)有限公司  
注册地址: 迎宾大道 1988 号滨海浙商大厦公寓 2-2413 室  
办公地址: 北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 5 层  
法定代表人: 张军  
联系人: 李明然  
电话: 010-59013707  
客服电话: 010-59013895  
网址: [www.wanjiawealth.com](http://www.wanjiawealth.com)

(33) 名称: 中信期货有限公司  
注册地址: 广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座  
13 层 1301-1305、14 层  
法定代表人: 张皓  
联系人: 刘宏莹  
电话: 010-60834022  
客服电话: 400-990-8826

---

公司网址: [www.citicsf.com](http://www.citicsf.com)

(34) 名称: 长城证券股份有限公司

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: 曹宏

联系人: 张涛

电话: 0755-33680000

客服电话: 95514; 400-6666-888

网址: [www.cgws.com.cn](http://www.cgws.com.cn)

(35) 名称: 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)

公司网址: [www.qlzq.com.cn](http://www.qlzq.com.cn)

(36) 名称: 世纪证券有限责任公司

注册地址: 深圳市前海深港合作区南山街道桂湾五路 128 号前海深港基金小镇对冲基金中心 406

办公地址: 深圳市福田区深南大道招商银行大厦 40-42 层

法定代表人: 李强

联系人: 王雯

电话: 0755-83199511

客服电话: 400-8323-000

网址: [www.csc.com.cn](http://www.csc.com.cn)

---

(37) 名称：大同证券有限责任公司

注册地址：山西省大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层

办公地址：山西省太原市小店区长治路世贸中心 12 层

法定代表人：董祥

联系人：薛津

电话：0351-4130322

客服电话：4007-121212

网址：www.dtsbc.com.cn

(38) 名称：安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层

法定代表人：王连志

联系人：彭洁联

电话：0755-82558266

客服电话：95517

网址：www.essence.com.cn

(39) 名称：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：深圳市福田区深南大道 4001 号时代金融中心 17 层

法定代表人：王作义

联系人：刘萍

电话：0755-83025693

客服电话：95372

---

网址: [www.jyzq.com.cn](http://www.jyzq.com.cn)

(40) 名称: 宏信证券有限责任公司

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: [www.hxzq.cn](http://www.hxzq.cn)

(41) 名称: 江苏汇林保大基金销售有限公司

注册地址: 南京市高淳区经济开发区古檀大道 47 号

办公地址: 南京市鼓楼区中山北路 2 号绿地紫峰大厦 2005 室

法定代表人: 吴言林

联系人: 林伊灵

电话: 025-66046166-810

客服电话: 025-66046166

网址: [www.huilinbd.com](http://www.huilinbd.com)

(42) 名称: 众升财富(北京)基金销售有限公司

注册地址: 北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室

办公地址: 北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08

法定代表人: 李招弟

联系人: 李艳

联系电话: 010-59497361

客服电话: 400-059-8888

---

公司网址: [www.zscffund.com](http://www.zscffund.com)

(43) 名称: 上海天天基金销售有限公司

注册地址: 上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址: 上海市徐汇区宛平南路 88 号金座东方财富大厦 26 楼

法定代表人: 其实

联系人: 黄妮娟

电话: 021-54509998

客服电话: 400-1818-188

公司网址: [www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

(44) 名称: 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址: 杭州市文二西路 1 号 903 室

办公地址: 杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号同花顺大楼

法定代表人: 凌顺平

联系人: 吴强

电话: 0571-88911818

客服电话: 4008-773-772

公司网址: [www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

(45) 名称: 北京创金启富基金销售有限公司

注册地址: 北京市西城区白纸坊东街 2 号院 6 号楼 712 室

办公地址: 北京市西城区白纸坊东街 2 号经济日报社综合楼 A 座 712 室

法定代表人: 梁蓉

联系人: 魏小清

电话: 010-66154828-8006

客服电话: 400-6262-1818

---

网址: [www.5irich.com](http://www.5irich.com)

(46) 名称: 上海陆金所基金销售有限公司

注册地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人: 王之光

联系人: 宁博宇

电话: 021-20665952

客服电话: 4008219031

公司网址: [www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

(47) 名称: 中国银河证券股份有限公司

注册地址: 北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 2-6 层

办公地址: 北京市西城区金融大街 35 号国企大厦 C 座

法定代表人: 陈共炎

联系人: 辛国政

电话: 010-83574507

客服电话: 4008888888 或 95551

网址: [www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

(48) 名称: 北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址: 北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

办公地址: 北京市朝阳区望京 SOHO 塔 2, B 座 2507

法定代表人: 钟斐斐

联系人: 王悦

电话: 010-61840688



---

客服电话：400-0618-518

公司网址：www.danjuanapp.com

(49) 名称：上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山东一路 12 号

办公地址：上海市黄浦区中山东一路 12 号

法定代表人：郑杨

联系人：姜基彬

电话：021-61616885

客服电话：95528

公司网址：www.spdb.com.cn

(50) 名称：平安银行股份有限公司

注册地址：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

办公地址：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

法定代表人：谢永林

联系人：汤俊劼

电话：0755-22168301

客服电话：95511

公司网址：www.bank.pingan.com

(51) 名称：上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906

室

法定代表人：杨文斌

联系人：王诗琦

---

电话：021-20613643

客服电话：400-700-9665

公司网址：www.ehowbuy.com

(52) 名称：天津国美基金销售有限公司

注册地址：天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公楼 D 座二层  
202-124 室

办公地址：北京市朝阳区霄云路 26 号鹏润大厦 B 座 9 层

法定代表人：丁东华

联系人：郭宝亮

电话：010-59287984

客服电话：400-111-0889

公司网址：www.gomefund.com

(53) 名称：中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址：山东省青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

法定代表人：姜晓林

联系人：孙秋月

电话：0532-85022026

客服电话：95548

网址：sd.citics.com

(54) 名称：联储证券有限责任公司

注册地址：广东省深圳市福田区华强北路圣廷苑酒店 B 座 26 楼

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 333 号金砖大厦 8 楼

---

法定代表人：沙常明  
联系人：丁倩云  
联系方式：010-56177851  
客服电话：400 - 620 - 6868  
公司网址：www.lczq.com

(55) 名称：中国民生银行股份有限公司  
注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号  
办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号  
法定代表人：洪崎  
联系人：穆婷  
电话：010-56367136  
客服电话：95568  
公司网址：www.cmbc.com.cn

(56) 名称：深圳市新兰德证券投资咨询有限公司  
地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园四栋10层1006  
法定代表人：洪弘  
联系人：文雯  
电话：010-83363101  
客服电话：4001661188  
网址：www.xinlande.com.cn

(57) 名称：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

电话：010-56282140

客服电话：4006199059

公司网址：[www.hcjijim.com](http://www.hcjijim.com)

(58) 名称：珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔1201-1203室

法定代表人：肖雯

联系人：熊艳芳

电话：020-89629066

客服电话：020-89629066

公司网址：<https://www.yingmi.cn/>

(59) 名称：中衍期货有限公司

注册地址：北京市朝阳区东四环中路82号2座2-1座、2-2座7层；B2座  
一层108单元

办公地址：北京市朝阳区东四环中路82号金长安大厦B座7层

法定代表人：马宏波

联系人：李卉

电话：010-57414268

客服电话：4006881117

公司网址：[www.cdfco.com.cn](http://www.cdfco.com.cn)

(60) 名称：信达证券股份有限公司

---

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：肖林

联系人：付婷

电话：010-83252185

客服电话：95321

网址：[www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

(61) 名称：华安证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号财智中心 B1 座

法定代表人：章宏韬

联系人：范超

电话：0551-65161821

客服电话：95318

网址：[www.hazq.com.cn](http://www.hazq.com.cn)

(62) 名称：新时代证券股份有限公司

注册地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

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：叶顺德

联系人：田芳芳

电话：010-83561146

客服电话：4006989898 或 95399

网址：[www.xsdzq.cn](http://www.xsdzq.cn)

---

(63) 名称：粤开证券股份有限公司

注册地址：惠州市江北东江三路 55 号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、  
四层

办公地址：深圳市福田区深南中路 2002 号中广核大厦北楼 10 层

法定代表人：严亦斌

联系人：彭莲

电话：0755-83331195

客服电话：95564

网址：[www.ykzq.com](http://www.ykzq.com)

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构销售本基  
金。代销机构信息，以基金管理人网站公示为准。

(二) 登记机构名称：

名称：金鹰基金管理有限公司

注册地址：广东省广州市南沙区海滨路 171 号 11 楼自编 1101 之一 J79

办公地址：广东省广州市天河区珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 楼

电话：020-38283037

传真：020-83282856

联系人：张盛

(三) 律师事务所和经办律师

名称：广东岭南律师事务所

住所：广州市海珠区阅江西路 370 号广报中心北塔 15 楼

法定代表人：邓柏涛

电话：020-81836088

传真：020-31952316

经办律师：欧阳兵、谢洁、伍瑞祥

(四) 会计师事务所和经办注册会计师

---

名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）  
住所：中国北京东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层  
法定代表人：邹俊  
电话：+86（10）85085000  
传真：+86（10）85085111  
邮编：100738  
经办注册会计师：叶云晖，刘西茜

## 四、基金的名称

金鹰鑫日享债券型证券投资基金

## 五、基金的类型

债券型证券投资基金

## 六、基金的投资

### 一、投资目标

本基金在严格控制风险和保持良好流动性的前提下，力争使基金份额持有人获得超越业绩比较基准的投资收益。

### 二、投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的债券（含国债、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债、中小企业私募债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金不直接投资股票、权证等权益类资产，但可持有因可转债转股所形成的股票、因持有该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的 10 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。

---

本基金债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%，持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不得低于基金资产净值的 5%。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

当法律法规的相关规定变更时，基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。

### 三、投资策略

本基金充分考虑基金资产的安全性、收益性及流动性，在严格控制风险的前提下力争实现资产的稳定增值。在资产配置中，本基金以债券为主，通过密切关注债券市场变化，持续研究债券市场运行状况、研判市场风险，在确保资产稳定增值的基础上，通过积极主动的资产配置，力争实现超越业绩基准的投资收益。

#### （一）资产配置策略

本基金在对宏观经济形势以及微观市场充分研判的基础上，采取积极主动的投资管理策略，积极进行资产组合配置。对利率变化趋势、债券收益率曲线移动方向、信用利差等影响信用债券投资价值的因素进行评估，主动调整债券组合。

#### （二）债券投资策略

##### 1、类属配置策略

本基金根据各具体债券的风险收益比、信用利差、流动性利差、债项评级及相对价差收益等特点，研究各类具体信用类债券的投资价值；在此基础上结合各细分种类债券供需状况、风险与收益率变化等因素谨慎进行类属配置。

##### 2、久期配置策略

本基金以研究宏观经济趋势、经济周期位置和宏观政策动向等为出发点，预测市场未来债券收益率曲线的变化趋势，及对收益率曲线形态和期限结构变动进行分析，结合信用债投资以构建债券组合确定最优的期限结构，并据此积极调整债券组合的平均久期及期限分布，以有效提高债券组合的总投资收益。

##### 3、收益率曲线策略

通过对财政货币政策取向、流动性、债券供求、市场风险偏好等因素进行综合分析，在此基础上预测利率期限结构及收益率曲线的变化趋势以进行积极资产配置；并根据收益率曲线上不同年限收益率的息差特征，通过骑乘策略，投资于具备潜在价值的债券。



---

#### 4、套利策略

本基金在对债券基本面分析的基础上，利用市场定价偏差、收益率曲线偏移、流动性、息差、久期、限制条款等差异因素，积极运用各类套利方法对固定收益资产投资组合进行管理与调整，捕捉交易机会，力争获取超额收益。

#### 5、相对价值投资策略

本基金将综合运用利率预期、收益率曲线估值、信用风险分析、流动性分析等方法来评估个券的投资价值，重点关注一定利率区间范围内且符合设定久期区间、具有较高评级及较好流动性的个券，或存在定价偏差、市场交易价格被低估的优质个券。

#### 6、信用利差曲线策略

信用债收益率是在基准收益率基础上加上反映信用风险的信用利差，因此信用债利差曲线能够直接影响相应债券品种的信用利差收益率。本基金通过关注信用利差的变化趋势，精选利差趋向缩小的类属品种及个券。在信用利差曲线的分析上，本基金将重点关注经济周期、国家或产业政策、发债主体所属行业景气度、债券市场供求、信用债券市场结构、信用债券品种的流动性等因素对信用利差的影响，进而进行信用债投资。

#### （三）中小企业私募债券投资策略

本基金将运用基本面研究结合公司财务分析方法，对债券发行人信用风险进行分析和度量，选择风险与收益相匹配的更优品种进行投资。深入研究债券发行人基本面信息，分析企业的长期运作风险；对债券发行人进行财务风险评估；利用历史数据、市场价格以及资产质量等信息，估算私募债券发行人的违约率及违约损失率并考察债券发行人的增信措施。综合上述分析结果，确定信用利差的合理水平，利用市场的相对失衡，确定具有投资价值的债券品种。

#### （四）资产支持证券投资策略

本基金将综合运用资产配置、久期管理、收益率曲线、信用管理和个券 $\alpha$ 策略等策略积极主动进行资产支持证券产品投资。本基金管理人将坚持风险调整后收益最大化的原则，通过信用资质研究和流动性管理，遵守法律法规和基金合同的约定，严格控制投资风险，确保本金相对安全和基金资产具有良好流动性，以期获得长期稳定收益。

---

#### （五）可转换债券投资策略

本基金管理人将对可转债发行人的基本情况进行深入研究，对公司的盈利和成长能力进行充分论证；同时对可转换债券的投资价值进行初步评估，考虑其内含期权等因素对债券投资的影响。本基金将选择价值低估、具有较好成长空间的可转换债券进行投资。

#### （六）可交换债券投资策略

可交换债券与可转换债券的区别在于换股期间用于交换的股票并非自身新发的股票，而是发行人持有的其他上市公司的股票。可交换债券同样具有股性和债性，其中债性与可转换债券相同，即选择持有可交换债券至到期以获取票面价值和票面利息；而对于股性的分析则需关注目标公司的股票价值。本基金将通过目标公司股票的投资价值分析和可交换债券的纯债部分价值分析综合开展投资决策。

### 四、投资决策依据及程序

#### 1、投资决策依据

- （1）有关法律、法规和基金合同的有关规定。
- （2）经济运行状况和证券市场走势。
- （3）各类资产的风险收益配比。

#### 2、投资决策程序

（1）投资决策委员会：确定本基金总体资产配置和投资策略。投资决策委员会定期召开会议，如需做出及时重大决策或基金经理提议，可临时召开投资决策委员会会议。

（2）基金经理：设计和调整投资组合。设计和调整投资组合需要考虑的基本因素包括：每日基金申购和赎回净现金流量；基金合同的投资限制和比例限制；研究员的投资建议；基金经理的独立判断等。

（3）集中交易部：基金经理向集中交易部下达投资指令，集中交易部负责人收到投资指令后分发予交易员，交易员收到基金投资指令后准确执行。

（4）绩效与风险评估：对基金投资组合进行评估，向基金经理提出绩效或风险建议。

（5）合规风控部：对投资流程等进行合法合规审核、监督和检查。

---

## 五、投资限制

### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- (1) 本基金债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；
- (2) 本基金应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；
- (3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- (4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- (5) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- (6) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
- (7) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- (8) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
- (9) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；
- (10) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%，本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；
- (11) 基金总资产不得超过基金净资产的 140%；
- (12) 本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；
- (13) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%。

因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因

---

素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。

(14)基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

(15) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，除上述第(2)、(9)、(13)、(14)项规定的情况外，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。期间，基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。

基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规或者中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按

---

照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

如法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

## 六、业绩比较基准

本基金业绩比较基准：中债综合（全价）指数收益率 $\times$ 80%+一年期定期存款利率（税后） $\times$ 20%

本基金选择上述业绩比较基准主要是因为本基金为债券型基金。中债综合指数由中央国债登记结算有限公司编制，该指数旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况，该指数涵盖了银行间市场和交易所市场，具有广泛的市场代表性，适合作为市场债券投资收益的衡量标准。由于本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，其余基金资产配置于现金及到期日在一年以内的政府债券等，因而采用上述业绩基准可以较好地反映本基金的业绩走势。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的指数时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后，适当调整业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

本基金的业绩比较基准仅作为衡量本基金业绩的参照，不决定也不必然反映本基金的投资策略。

## 七、风险收益特征

本基金为债券型证券投资基金，其预期收益和风险水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

## 八、基金管理人代表基金行使股东或债权人权利的处理原则及方法

- 1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东或债权人权利，保护基金份额持有人的利益；
- 2、不谋求对上市公司的控股；
- 3、有利于基金财产的安全与增值；

4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

#### 九、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。

本基金的托管人根据基金合同的规定，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 2019 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	2,081,025,625.15	94.33
	其中：债券	1,960,385,625.15	88.86
	资产支持证券	120,640,000.00	5.47
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	94,913,262.37	4.30
	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	683,130.53	0.03
7	其他各项资产	29,515,638.20	1.34
8	合计	2,206,137,656.25	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。

## 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

本基金本报告期内未投资股票。

### (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。

## 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

本基金本报告期内未投资股票。

## 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	10,206,851.80	0.57
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,429,885,348.45	80.46
	其中：政策性金融债	558,599,848.45	31.43
4	企业债券	40,320,000.00	2.27
5	企业短期融资券	70,340,000.00	3.96
6	中期票据	91,431,000.00	5.15
7	可转债（可交换债）	36,816,424.90	2.07
8	同业存单	281,386,000.00	15.83
9	其他	-	-
10	合计	1,960,385,625.15	110.32

## 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	180206	18 国开 06	1,000,000.00	106,030,000.00	5.97
2	108604	国开 1805	1,020,200.00	103,305,452.00	5.81
3	170310	17 进出 10	1,000,000.00	101,050,000.00	5.69
4	091900013	19 中信证券 金融债 01	1,000,000.00	100,550,000.00	5.66
5	111907045	19 招商银行 CD045	1,000,000.00	97,020,000.00	5.46

#### 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

序号	证券代码	证券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比 (%)
1	139469	链融 08A1	1,000,000.00	100,640,000.00	5.66
2	139975	锦绣 01A	200,000.00	20,000,000.00	1.13

注：本基金本报告期末仅持有两只资产支持证券。

#### 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

本基金本报告期内未投资贵金属。

#### 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

本基金本报告期内未投资权证。

#### 9、 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### (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于股指期货。

**(2) 本基金投资股指期货的投资政策**

无。

**10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

**(1) 本期国债期货投资政策**

无。

**(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期内未投资于国债期货。

**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没有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未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	89,752.55
2	应收证券清算款	255,152.76
3	应收股利	-
4	应收利息	28,889,158.52
5	应收申购款	281,574.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,515,638.20

**(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	110053	苏银转债	13,987,675.60	0.79
2	113011	光大转债	1,135,200.00	0.06
3	132006	16 皖新 EB	21,120,000.00	1.19

**(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金报告期内未投资股票。

**(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。

## 七、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。

本基金基金合同生效以来（截至 2019 年 12 月 31 日）的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示：

**1、金鹰鑫日享债券型证券投资基金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**

**(1) 金鹰鑫日享债券 A:**

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
2019.3.20-2019.12.31	3.58%	0.03%	1.01%	0.04%	2.57%	-0.01%

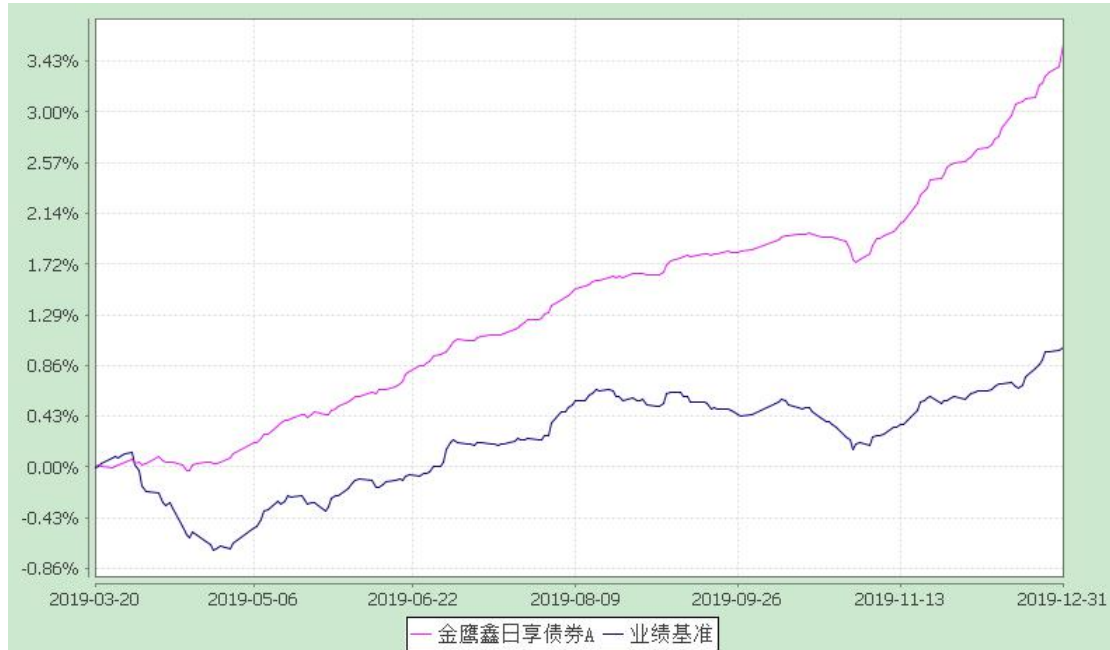
**(2) 金鹰鑫日享债券 C:**

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
2019.3.20-2019.12.31	3.50%	0.03%	1.01%	0.04%	2.49%	-0.01%

**2、自基金成立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**

金鹰鑫日享债券型证券投资基金  
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  
(2019年3月20日至2019年12月31日)

1. 金鹰鑫日享债券 A:

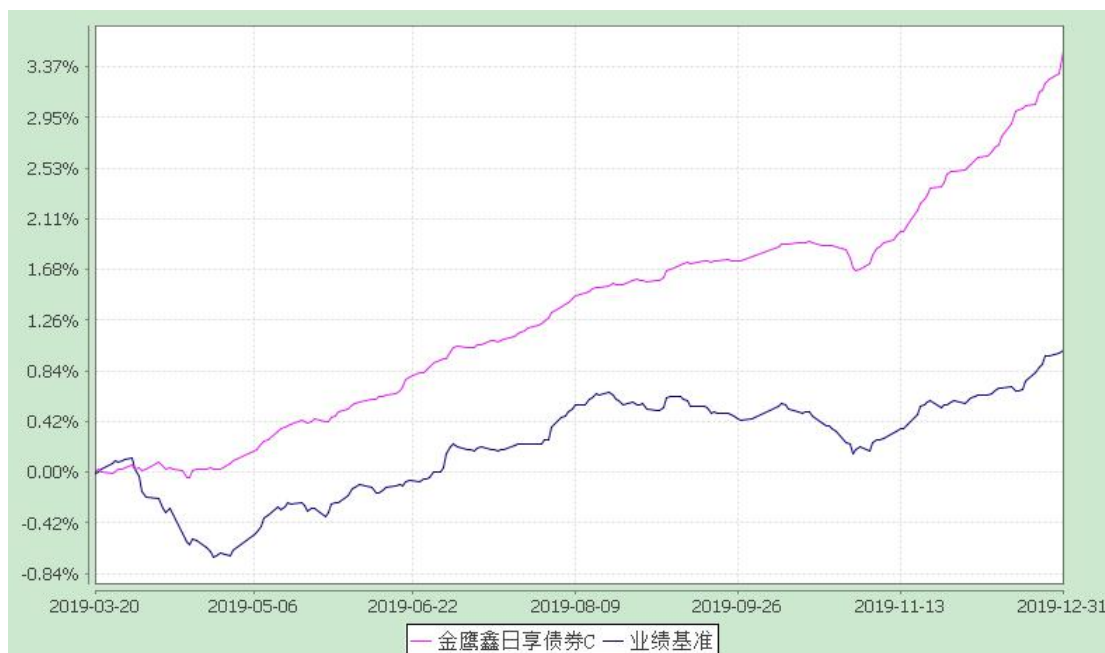


注：1.1 本基金合同于 2019 年 3 月 20 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年；

1.2 本基金业绩比较基准为：中债综合（全价）指数收益率×80%+1 年期银行定期存款利率（税后）×20%；

1.3 按基金合同和招募说明书的约定，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同的有关约定。本报告期本基金处于建仓期内。

2. 金鹰鑫日享债券 C:



注：1.1 本基金合同于2019年3月20日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年；

1.2 本基金业绩比较基准为：中债综合（全价）指数收益率×80%+1年期银行定期存款利率（税后）×20%；

1.3 按基金合同和招募说明书的约定，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同的有关约定。本报告期本基金处于建仓期内。

## 八、基金的费用与税收

### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、C类基金份额的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的相关账户的开户费用、账户维护费用；
- 8、基金的证券交易及结算费用；
- 9、基金的银行汇划费用；
- 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。

## 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 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、公休日等，支付日期顺延。

### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 3、销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费。

本基金销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.1% 年费率计提，销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

---

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给登记结算机构，由登记结算机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第4—10项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、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；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、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。

### 四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

## 九、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其它有关法律法规的要求，结合本基金的投资管理活动，对《金鹰鑫日享债券型证券投资基金招募说明书》进行了修改，主要修改的内容如下：

- (1) 在“三、基金管理人”部分，更新了基金管理人情况；
- (2) 在“五、相关服务机构”部分，更新了相关服务机构信息；
- (3) 在“十一、基金的投资（九）投资组合报告”部分，更新了投资组合报告；

---

(4) 在“十二、基金的业绩”部分，更新了本基金基金合同生效以来的投资业绩；

(5) 在“二十四、其他应披露事项”部分，更新了本基金在本报告期内公开披露的信息内容并对重要信息进行了提示；

(6) 依据本基金修改后的基金合同，更新了“第一部分 绪言”、“第二部分 释义”、“第九部分 基金份额的申购与赎回”、“第十六部分 基金费用与税收”、“第十五部分 基金的收益与分配”、“第十七部分 基金的会计与审计”、“第十八部分 基金的信息披露”、“第二十一部分 基金合同的内容摘要”、“第二十二部分 基金托管协议的内容摘要”等相关内容。

金鹰基金管理有限公司

2020年1月20日