



金鹰添享纯债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：浙商银行股份有限公司

时间：二〇二〇年一月

重要提示

本基金经 2016 年 10 月 31 日中国证券监督管理委员会证监许可[2016]2480 号文注册募集。募集期间为 2017 年 2 月 21 日至 2017 年 2 月 23 日，募集规模为 200,006,127.16 份。经中国证券监督管理委员会备案并书面确认，基金合同于 2017 年 2 月 28 日生效并按法规规定在指定媒体公告。

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、基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险、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，属于证券投资基金中较低预期收益、较低预期风险的品种，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。

本招募说明书中基金投资组合报告和基金业绩中的数据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

刘丽娟女士，曾任恒泰证券股份有限公司债券交易员、投资经理，广州证券股份有限公司资产管理总部固定收益投资总监，2014 年 12 月加入金鹰基金管理

有限公司，现任固定收益部总监。2015年7月起任金鹰货币市场证券投资基金基金经理。2016年7月至2017年9月担任金鹰元盛债券型发起式证券投资基金(LOF)基金经理。2016年8月19日至2018年5月任金鹰添益纯债债券型证券投资基金基金经理。2016年10月至2018年3月任金鹰元祺保本混合型证券投资基金(2017年11月8日起转型为金鹰元祺信用债债券型证券投资基金)基金经理。2016年10月至2019年5月起任金鹰元和保本混合型证券投资基金(2018年5月底转型为金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金)基金经理。2016年10月至2018年3月任金鹰元安保本混合型证券投资基金(2017年6月6日起转型为金鹰元安混合型证券投资基金)基金经理。2016年10月至2017年9月任金鹰元丰保本混合型证券投资基金基金经理。2017年2月至2018年7月担任金鹰添利中长期信用债债券型证券投资基金基金经理。2017年2月起任金鹰添享纯债债券型证券投资基金基金经理。2017年3月起任金鹰添荣纯债债券型证券投资基金基金经理。2017年3月起任金鹰现金增益交易型货币市场基金基金经理。2017年8月起至2018年8月担任金鹰鑫富灵活配置混合型证券投资基金(2018年4月13号起转型为金鹰医疗健康产业股票型证券投资基金)基金经理。2017年9月至2018年3月任金鹰元丰债券型证券投资基金基金经理。2017年3月至2018年7月担任金鹰添惠纯债债券型证券投资基金(2018年4月18号起转型为金鹰信息产业股票型证券投资基金)基金经理。2016年10月至2018年7月担任金鹰灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017年6月至2018年7月担任金鹰民丰回报定期开放混合型证券投资基金基金经理。

5、投资决策委员会成员有：

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；

林暉先生，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：浙商银行股份有限公司

住所：浙江省杭州市庆春路 288 号

法定代表人：沈仁康

联系人：项星星

电话：0571-88267931

传真：0571-88268688

成立时间：1993 年 04 月 16 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 18,718,696,778 元

存续期间：持续经营

批准设立机关和批准设立文号：中国银行业监督管理委员会银监复【2004】91 号

基金托管资格批文及文号：《关于核准浙商银行股份有限公司证券投资基金托管资格的批复》；证监许可【2013】1519 号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。本行经国家外汇管理局批准，可以经营结汇、售汇业务。

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新城珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

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：020-83282950

传真电话：020-83283445

客户服务及投诉电话：400-6135-888

电子信箱：csmail@gefund.com.cn

公司网址：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：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

(3) 名称：北京加和基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街 4 号 5 号楼 1 层

办公地址：北京市西城区金融街 11 号 703

法定代表人：徐福贺

联系人：张巍

电话：010-50866176

客服电话：400-600-0030

公司网址：www.bzfunds.com

(4) 名称：北京坤元基金销售有限公司

注册地址：北京市石景山区古城大街特钢公司十一区(首特创业基地 A 座)八层 816 号

法定代表人：杜福胜

联系人：王玲玲

联系方式：010-85264512

客服电话: 010-85354356

公司网址: www.kunyuangfund.com

(5) 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

(6) 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

客服电话: 95118

(7) 名称: 民生证券股份有限公司

地址: 北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层

法定代表人: 冯鹤年

联系人: 韩秀萍

电话: 010-85127609

客服电话：400-619-8888

网址：www.msq.com.cn

(8) 名称：北京电盈基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区酒仙桥路 14 号 53 号楼 7 层 719 室

办公地址：北京市朝阳区酒仙桥路 14 号 53 号楼 7 层 719 室

法定代表人：曲馨月

联系人：张旭

电话：13581833721

客服电话：4001003391

网址：www.bjdyfund.com

(9) 名称：大连网金基金销售有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

法定代表人：樊怀东

联系人：贾伟刚

电话：0411-39027808

客服电话：4000-899-100

公司网址：www.yibaijin.com

(10) 名称：苏州财路基金销售有限公司

注册地址：苏州市高新区华佗路 99 弄 6 幢 1008 室

办公地址：苏州市姑苏区苏站路 1599 号 7 号楼 1101 室

法定代表人：高志华

联系人：张君

电话：18516765123

客服电话：400-0512-800

公司网址：www.cai6.com

(11) 名称：嘉实财富管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层
5312-15 单元

办公地址：北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层

法定代表人：赵学军

联系人：李雯

电话：010-60842306

客服电话：400-021-8850

公司网址：www.harvestwm.cn

(12) 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

(13) 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

(14) 名称：上海挖财基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

办公地址：中国（上海）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

(15) 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

(16) 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

(17) 名称：上海基煜基金销售有限公司
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
电话：021-6537-0077
客服电话：021-6537-0077
公司网址：www.jiyufund.com.cn

(18) 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

(19) 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

(20) 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

(21) 名称：西藏东方财富证券股份有限公司

注册地址：拉萨市北京中路 101 号

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座东方财富大厦

法定代表人：陈宏

联系人：付佳

电话：021-23586603

客服电话：95357

公司网址：www.18.cn

(22) 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

(23) 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

(24) 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

(25) 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

(26) 名称：民商基金销售（上海）有限公司

注册地址：上海黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 A31 室

办公地址：上海市浦东新区张杨路 707 号生命人寿大厦 32 楼

法定代表人：贲惠琴

联系人：杨一新

电话：021-50206003

客服电话：021-50206003

公司网址：www.msftec.com

(27) 名称：泰信财富基金销售有限公司

注册地址：北京市石景山区实兴大街 30 号院 3 号楼 8 层 8995 房间

办公地址：北京市朝阳区建国路甲 92 号世茂大厦 c-12

法定代表人：张虎

联系人：王玲玲

电话：400-004-8821

客服电话：400-004-8821

公司网址：www.hxlc.com

(28) 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

(29) 名称: 深圳信诚基金销售有限公司

注册地址: 深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室

办公地址: 深圳市福田区中心区东南部时代财富大厦 49A

法定代表人: 周文

联系人: 殷浩然

电话: 010-84865370

客服电话: 0755-23946579

公司网址: www.ecpefund.com

(30) 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

(31) 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

(32) 名称：上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室
办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层
法定代表人：张跃伟
联系人：苗明
电话：021-20691923
客服电话：400-820-2899
公司网址：www.erichfund.com

(33) 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/>

(34) 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

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新城珠江东路 28 号越秀金融大厦 30
层

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：中审众环会计师事务所

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、董晓敏

四、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定募集，经 2016 年 10 月 31 日中国证监会证监许可[2016]2480 号文件准予募集注册。

募集期间为 2017 年 2 月 21 日至 2017 年 2 月 23 日，募集规模为 200,006,127.16 份。符合有关本基金募集的相关法规和基金合同、招募说明书等法律文件的约定。

五、基金合同的生效

（一）基金备案的条件

本基金的募集结果符合份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币且基金认购人数不少于 200 人的条件，经验资后向中国证监会办理基金备案手续，经中国证监会书面确认并公告后于 2017 年 2 月 28 日基金合同生效。

自基金合同生效之日起，由本基金管理人管理本基金。

（二）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

六、基金份额的申购与赎回

（一）申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在基金管理人网站公示。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

（二）申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

投资者在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

（三）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资者认购、申购的先后次序进行顺序赎回。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

（四）申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

投资者必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

2、申购和赎回的款项支付

投资者申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资者交付申购款项，申购成立；基金份额登记机构确认基金份额时，申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；基金份额登记机构确认赎回时，赎回生效。投资者赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

若遇证券、期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项顺延至下一个工作日划出。在发生巨额赎回或基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T 日），在正常情况下，本基金登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资者可在 T+2 日后（包括该日）到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项退还给投资者。

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询并妥善行使合法权利。

在法律法规允许的范围内，本基金登记机构可根据相关业务规则，在不影响基金份额持有人利益的前提下，对上述业务办理时间进行调整，基金管理人将于开始实施前按照有关规定予以公告。

(五) 申购和赎回的数量限制

1、投资者通过各代销机构申购本基金时（含定期定额申购），申购最低金额为 1 元（含申购费，如有），超过部分不设最低级差限制。

投资者通过本公司网上交易平台申购本基金时（含定期定额申购），申购最低金额为 10 元（含申购费，如有），超过部分不设最低级差限制。

投资者通过本公司直销柜台申购基金时，申购最低金额为 5 万元（含申购费，如有），超过部分不设最低级差限制。

投资者当期分配的基金收益转为基金份额时，不受申购最低金额的限制。投资者可多次申购，对单个投资者累计持有基金份额不设上限限制。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

2、投资者通过各代销机构赎回的，赎回最低份额为 1 份，基金份额余额不得低于 1 份，赎回后导致基金份额不足 1 份的需全部赎回。

投资者通过本公司网上交易平台赎回的，单笔最低赎回份额不受限制，持有基金份额不足 10 份时发起赎回需全部赎回。

投资者通过本公司直销柜台赎回时，赎回最低份额为 1 份，基金份额余额不得低于 1 份，赎回后导致基金份额不足 1 份的需全部赎回。

3、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额、赎回份额、单个投资者累计持有基金份额上限及单个交易账户的最低基金份额余额的数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

4、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。具体请参见相关公告。

5、基金管理人可与其他销售机构约定，对投资者通过其他销售机构办理基金申购与赎回的，其他销售机构可以按照委托协议的相关规定办理，不必遵守以

上限制。

（六）申购费用和赎回费用

1、申购费用

对于本基金，投资者在申购时需交纳前端申购费。投资者缴纳申购费用时，按单次认购金额采用比例费率，投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。具体费率如下：用费率按单笔分别计算。具体费率如下：

申购金额 M（元）	费率
$M < 100$ 万	0.80%
$100 \text{ 万} \leq A < 300 \text{ 万}$	0.50%
$300 \text{ 万} \leq A < 500 \text{ 万}$	0.30%
$A \geq 500 \text{ 万}$	1000 元/笔

本基金的申购费用由投资者承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

2、赎回费用。

本基金赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。

本基金的赎回费率随持有基金份额的时间不同而有差异，具体的赎回费率设置如下：

持有期限 T	费率
$T < 7$ 天	1.50%
$7 \text{ 天} \leq T < 3 \text{ 个月}$	0.10%
$T \geq 3 \text{ 个月}$	0

（注：3 个月按 90 天计算。投资者通过日常申购所得基金份额，持有期限自登记机构确认登记之日起计算。）

其中对于持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产。对于持续持有期大于等于 7 日的投资者收取赎回费中的 25%计入基金财产，其余部分用于支付登记费及其他必要的手续费。

3、本基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五

入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

4、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

5、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，包括但不限于针对以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以对基金销售费用实行一定的优惠并依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

6、本基金暂不采用摆动定价机制，基金管理人可结合基金实际运作情况，根据相关法律法规在履行适当程序并提前公告后增加摆动定价机制。

七、基金的投资

（一）投资目标

在严格控制风险的前提下，力争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、次级债、中小企业私募债、可分离交易可转债的纯债部分、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。

本基金不投资于股票、权证等权益类资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。

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

本基金主要投资于固定收益类金融工具，在充分考虑基金资产的安全性、收益性及流动性及严格控制风险的前提下，通过分析经济周期变化、货币政策、债券供求等因素，持续研究债券市场运行状况、研判市场风险，制定债券投资策略，挖掘价值被低估的标的券种，力争实现超越业绩基准的投资收益。

1、资产配置策略

本基金在综合判断宏观经济形势以及微观市场的基础上，分析不同类别资产的收益率水平、流动性特征和风险水平特征，确定大类金融资产配置和债券类属配置，同时，根据市场的变化，动态调整大类资产和债券资产的投资比例，以规避市场风险，提高投资收益。

2、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

本基金通过对宏观经济趋势、经济周期和政策动向进行分析，对未来利率走势进行判断，确定债券组合久期，并动态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）杠杆策略

本基金在考虑债券投资的风险收益情况，以及回购成本等因素的情况下，在风险可控的情况下，通过债券回购，放大杠杆进行投资操作。

（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，或存在定价偏误、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。

3、资产支持证券投资策略

本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

4、中小企业私募债投资策略

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）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分配和投资策略。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) 本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；
- (2) 本基金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；
- (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) 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%；
- (12) 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；
- (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,基金管理人应当在相关证券可上市交易之日起的 10 个交易日内进行调整(除(2)、(9)、(13)、(14)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六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,本基金的投资范围、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。

如果法律法规对上述投资比例限制进行变更的,以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制,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。

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,但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外;
- (5) 向基金管理人、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) 依照法律法规有关规定,由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,应当符合本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、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后，本基金可不受上述规定的限制。

（六）业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：中债综合（全价）指数收益率×80%+一年期定期存款利率（税后）×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，属于较低预期收益、较低预期风险的证券投资基金品种，其预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。

（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) 投资组合报告（未经审计）

本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，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	479,011.70	70.33
	其中：债券	479,011.70	70.33
	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	100,000.00	14.68
	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	93,506.23	13.73
7	其他各项资产	8,587.69	1.26
8	合计	681,105.62	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	479,011.70	84.79
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	479,011.70	84.79

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	019611	19 国债 01	3,300.00	329,967.00	58.41

2	019608	18 国债 26	1,490.00	149,044.70	26.38
---	--------	----------	----------	------------	-------

注：本基金本报告期末仅持有2只债券。

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

本基金本报告期内未投资资产支持证券。

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) 本基金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	99.53
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,488.16
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,587.69

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期内无处于转股期的可转换债券。

(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。

八、基金业绩

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。

本基金托管人复核了基金业绩，且无异议。

（一）业绩比较

本基金合同生效日为2017年2月28日，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：

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
2017.2.28 至 2017.12.31	1.66%	0.04%	-1.81%	0.05%	3.47%	-0.01%
2018.1.1 至 2018.12.31	1.46%	0.10%	4.13%	0.05%	-2.67%	0.05%
2019.1.1-201 9.12.31	-6.16%	0.12%	1.35%	0.04%	-7.51%	0.08%
2017.2.28 至 2019.12.31	-3.22%	0.10%	3.63%	0.05%	-6.85%	0.05%

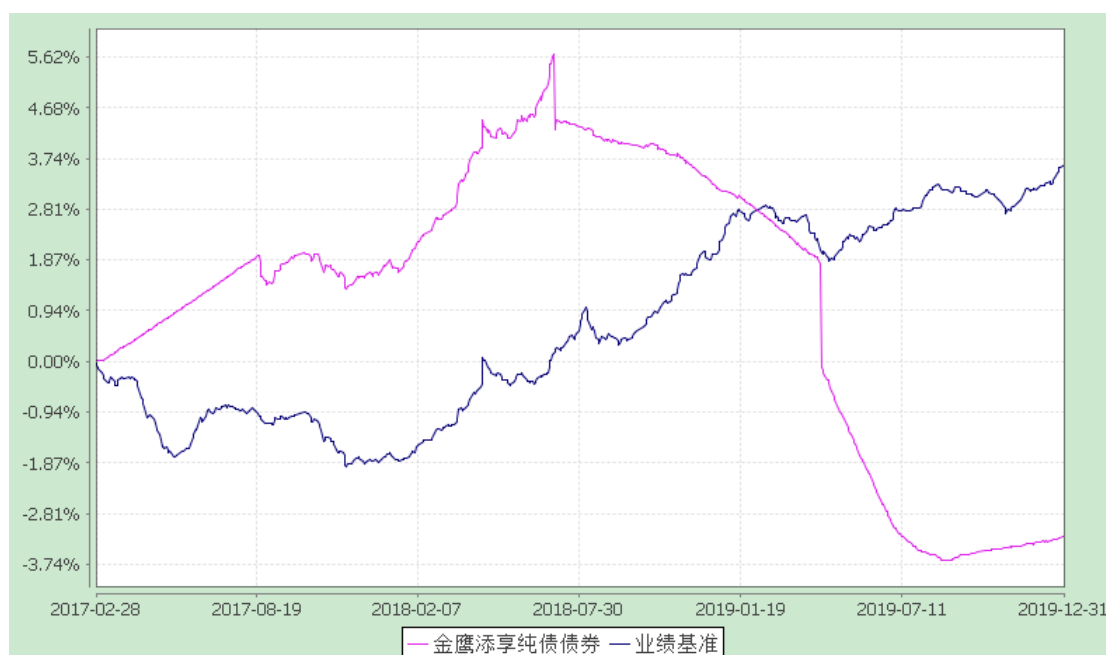
注：本基金业绩比较基准是：中债综合（全价）指数收益率*80%+一年期定期存款利率（税后）*20%。

（二）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

金鹰添享纯债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历史走势对比图

(2017年2月28日至2019年12月31日)



注：（1）基金合同生效日期为2017年2月28日。

（2）截至本报告期末，各项投资比例符合基金合同的约定。

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

九、基金的财产

（一）基金资产总值

基金资产总值是指购买各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

（二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

（三）基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户、期货账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

（四）基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人对基金托管账户中的资金进行保管。基金管理人、基金托管人、基金登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。

十、基金的收益分配

（一）基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

（二）基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

（三）基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、本基金每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。基金管理人在履行适当程序后，将对上述基金收益分配原则进行调整。

（四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

（五）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。

（六）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

十一、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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券、期货交易费用及结算费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金的相关账户的开户费用、账户维护费用；
- 9、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 0.30% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 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、公休假等，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% 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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 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。

上述“一、基金费用的种类中第 3—9 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。

十二、修改说明

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，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对前期披露的《金鹰添享纯债债券型证券投资基金招募说明书》进行了更新，此次对招募说明书的更新包括下列内容：

- （1） 更新本周期的相关资料数据；
- （2） 更新基金管理人的相关信息，详见第三部分；
- （3） 更新代销机构等相关服务机构的信息。详见第五部分；
- （4） 更新了基金投资组合、基金业绩比较及基金成立以来累计净值增长率趋势等相关投资业绩信息。详见第九部分之第（九）基金投资组合报告，第十部分基金的业绩；
- （5） 详细披露了2019年本基金有关的公告及重大事项信息。详见第二十二部分其它应披露事项；
- （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”、“第八部分 基金份额的申购、赎回与转换”、“第十三部分 基金的收益分配”、“第十四部分 基金费用与税收”、“第十五部分 基金的会计与审计”、“第十六部分 基金的信息披露”、“第十九部分 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