金鹰添润定期开放债券型发起式证券投资基金更新的招募说明书摘要

2018年第2号

基金管理人:金鹰基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司

重要提示

金鹰添润定期开放债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)由金鹰添润纯债债券型证券投资基金转型而来。

金鹰添润纯债债券型证券投资基金经2016年11月22日中国证券监督管理委员会证监许可[2016]2806号文注册募集。该基金自2017年2月10日至2017年2月13日进行公开募集,募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认,《金鹰添润纯债债券型证券投资基金基金合同》于2017年2月16日生效。

自2018年2月26日至2018年3月20日,金鹰添润纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开,会议审议通过了《关于金鹰添润纯债债券型证券投资基金转型相关事项的议案》,内容包括金鹰添润纯债债券型证券投资基金变更为发起式基金及修订基金合同等,并同意将“金鹰添润纯债债券型证券投资基金”更名为“金鹰添润定期开放债券型发起式证券投资基金”,上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。自2018年3月28日起,《金鹰添润定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》生效,原《金鹰添润纯债债券型证券投资基金基金合同》自同一日起失效。

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,但中国证监会对金鹰添润纯债债券型证券投资基金变更注册为本基金,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和基金合同等信息披露文件,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,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。

本基金单一投资者持有的基金份额或者构成一致行动人的多个投资者持有的基金份额可达到或者超过50%,基金不向个人投资者公开销售。

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2018年9月28日,有关财务数据截止日为2018年9月30日,净值表现截止日为2018年9月30日,本报告中财务数据未经审计。

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

法定代表人:刘岩

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%
广州证券股份有限公司	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、公司董事会和监事会成员构成

(1)董事会成员

李佳女士,董事,清华大学工商管理硕士,历任新华都特种电器股份有限公司副总经理、董事会秘书等职务。现任东旭集团有限公司副总裁。经公司第六届董事会第二十三次会议决议通过,自2018年11月起,担任金鹰基金管理有限公司董事。

刘岩先生,董事,金融学博士,历任中国光大银行总行投行业务部业务主管,中国光大银行总行财富管理中心业务副经理,广州证券有限责任公司资产管理总部总经理等职。经公司第四届董事会第三十九次会议审议通过,并报经中国证监会核准,自2014年8月至今,担任金鹰基金管理有限公司总经理,并于2017年7月12日开始担任金鹰基金管理有限公司法定代表人。

王中女士,董事,中国科学院大学工商管理硕士,历任北京华旗咨询(爱国者)科技有限公司人力资源副总监、国美在线人力资源行政总监、北京国美总经理助理兼行政总监、(国美)北京大中人力行政总监、(国美)中关村科技集团人力资源行政总监、佳典公司、瀚海投资管理集团副总经理、人力资源总经理等职务。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。经公司第六届董事会第二十三次会议决议通过,自2018年11月起,担任金鹰基金管理有限公司董事。

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。

陈家雄先生,监事,硕士研究生,历任东莞证券资产管理部投资经理、广州证券资产管理部产品总监,现任金鹰基金管理有限公司产品研发部总监。

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。

2、公司高级管理人员

刘岩先生,总经理,金融学博士,历任中国光大银行总行投行业务部业务主管,中国光大银行总行财富管理中心业务副经理,广州证券有限责任公司资产管理总部总经理等职。经公司第四届董事会第三十九次会议审议通过,并报经中国证监会核准,2014年8月7日起担任公司总经理,并于2017年7月12日开始担任金鹰基金管理有限公司法定代表人。

曾长兴先生, 督察长,金融学博士,历任广东证券公司(原)研究员、安信证券股份有限公司分析师、国联安基金管理有限公司产品开发部总监、金鹰基金管理有限公司产品研发部总监、总经理助理、副总经理等职。经公司第六届董事会第二十次会议审议通过,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。

满黎先生,副总经理, 商业发展专业硕士,历任华安基金管理有限公司任北京总部高级董事总经理,国联安基金管理有限公司首席市场官、副总理等职务。2018年8月加入金鹰基金管理有限公司,经公司第六届董事会第二十次会议审议通过,并已按规定报中国证券投资基金业协会备案。现任金鹰基金管理有限公司副总经理。

3、基金经理

黄倩倩女士, 曾任广州证券股份有限公司债券交易员。2014年11月加入金鹰基金管理有限公司,任债券交易员、基金经理助理职务。2017年6月起任金鹰现金增益交易型货币市场基金基金经理。2017年9月起担任金鹰添纯债债券型证券投资基金基金经理。2018年7月起担任金鹰添盈纯债债券型证券投资基金基金经理。2018年7月起担任金鹰添富纯债债券型证券投资基金基金经理。2018年7月起担任金鹰添润定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2018年9月起任金鹰添盛定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。

本基金历任基金经理情况:黄艳芳女士,管理时间2017年2月16日至2018年7月11日。

4、投资决策委员会成员会成员有:

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

刘岩先生,投资决策委员会主席,总经理;

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;

王喆先生,投资决策委员会委员,权益投资部总监,基金经理;

于利强先生,投资决策委员会委员,研究部总监,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。

(2)权益投资决策委员会

刘岩先生,权益投资决策委员会主席,总经理;

周国兴先生,权益投资决策委员会委员,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;

于利强先生,权益投资决策委员会委员,研究部总监,基金经理。

(3)固定收益投资决策委员会

刘丽娟女士,固定收益投资决策委员会主席,固定收益部总监,基金经理;

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;

汪伟先生,固定收益投资决策委员会委员,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:兴业银行股份有限公司(以下简称“兴业银行”)

注册地址:福州市湖东路154号

办公地址:上海市江宁路168号

法定代表人:高建平

成立时间:1988年8月22日

注册资本:207.74亿元人民币

存续期间:持续经营

基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基金字[2005]74号

托管部门联系人:

电话:021-52629999

传真:021-62159217

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

法定代表人:刘岩

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:符薇薇

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)东莞农村商业银行股份有限公司

注册地址:广东省东莞市东城区鸿福东路2号

办公地址:广东省东莞市东城区鸿福东路2号

法定代表人:何沛良

联系人:林培珊

电话:0769-22866254

客服电话:0769-961122

公司网址:www.drcbank.com

(2)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

联系电话: 010-52413385

客服电话:400-6099-200

公司网址:www.yixinfund.com

(3)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

联系电话: 010-65309516

客服电话:400-673-7010

公司网址:www.jianfortune.com

(4)北京坤元基金销售有限公司

注册(办公)地址:北京市东城区建国门内大街8号B座501

法定代表人:李雪松

联系人:崔炜

联系方式:010-85264512

客服电话: 400-818-5585

公司网址: www.kunyuanfund.com

(5)北京电盈基金销售有限公司

注册(办公)地址:北京市朝阳区呼家楼(京广中心)1号楼36层3603室

法定代表人:程刚

联系人:李丹

电话:010-56176115

客服电话:400-100-3391

公司网址:www.bjdyfund.com

(6)天津万家财富资产管理有限公司

注册地址:天津自贸区(中心商务区)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:李修辞

联系人:李明然

联系电话:010-59013707

客服电话:010-59013825

公司网址:www.wanjiawealth.com

(7)联讯证券股份有限公司

注册地址:广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三楼

办公地址:深圳市福田区深南中路2002号中广核大厦北楼10楼

法定代表人:徐刚

联系人:彭莲

电话:0755-83331195

客服电话:95564

公司网址:www.lxsec.com

(8)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

(9)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 25层2507

法定代表人:周斌

联系人:陈霞

电话:010-59313555

客服电话: 4008980618

公司网址: www.chtwm.com

(10)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

联系电话:021-54509998

客服电话:400-1818-188

公司网址:www.1234567.com.cn

(11)蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

住所:杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202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:陈柏青

联系人:韩爱彬

联系电话:0571-26888888-37494

客服电话:4000-766-123

公司网址:www.fund123.cn

(12)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

联系电话:021-20691923

客服电话:400-820-2899

公司网址:www.erichfund.com

(13)上海基煜基金销售有限公司

注册地址:上海市崇明县长兴镇潘园公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展区)

办公地址:上海市昆明路518号北美广场A1002

法定代表人:王翔

联系人:吴笛

联系电话:021-6537-0077

客服电话:021-6537-0077

公司网址:www.jiyufund.com.cn

(14)华林证券股份有限公司

注册地址:西藏自治区拉萨市柳梧新区察古大道1-1号君泰国际B栋一层3号

办公地址:深圳市福田区民田路178号华融大厦6楼

法定代表人:林立

联系人: 胡倩

联系电话:0755-83255199

客服电话:400-188-3888

公司网址:www.chinalin.com

(15)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1-1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

(16)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

联系电话:010-84865370

客服电话:0755-23946579

公司网址:www.ecpefund.com

(17)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

联系电话: 0512-68603767

客服电话:400-0512-800

公司网址:www.cai6.com

(18)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

联系电话:0411-39027808

客服电话:4000-899-100

公司网址:www.yibaijin.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,并及时公告。

(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

法定代表人:刘岩

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:广州市新港西路135号中山大学西门科技园A座601-605室

法定代表人:黄添顺

电话:020-84035397

传真:020-84113152

经办律师:欧阳兵、马晓灵、唐明

(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、赵会娜

四、基金的历史沿革

本基金由金鹰添润纯债债券型证券投资基金转型而来。

金鹰添润纯债债券型证券投资基金经中国证监会《关于核准金鹰添润纯债债券型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2016]2806号)核准募集,基金管理人为金鹰基金管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

金鹰添润纯债债券型证券投资基金自2017年2月10日至2017年2月13日进行公开募集,募集结束后基金管理人向中国证监会办理基金备案手续。经中国证监会书面确认,《金鹰添润纯债债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 2月16日生效。

自2018年2月26日至2018年3月20日,金鹰添润纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开,会议审议通过了《关于金鹰添润纯债债券型证券投资基金转型相关事项的议案》,内容包括金鹰添润纯债债券型证券投资基金变更为发起式基金及修订基金合同等,并同意将“金鹰添润纯债债券型证券投资基金”更名为“金鹰添润定期开放债券型发起式证券投资基金”,上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。自2018年3月28日起,《金鹰添润定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》生效,原《金鹰添润纯债债券型证券投资基金基金合同》自同一日起失效。

五、基金的存续

一、基金份额的变更登记

本基金合同生效后,本基金登记机构将办理基金份额的变更登记,对基金份额更名并进行必要的信息变更。

二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同生效之日起三年后的对应日(指自然日),若基金资产净值低于2亿元,本基金应当按照本基金合同约定的程序进行终止并清算,且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。

基金合同生效三年后继续存续的,自基金合同生效满三年后的基金存续期内,连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的, 基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续六十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。

法律法规或监管机构另有规定时,从其规定。

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。具体的销售机构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,并予以公告。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本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、其他特殊情况或根据业务需要, 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

本基金合同生效之日起(包括基金合同生效之日)进入首个开放期,开始办理申购和赎回等业务。自首个开放期结束之后次日起(包括该日),本基金进入首个封闭期。本基金每个封闭期结束之后第一个工作日起(包括该日)进入下一个开放期。

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、赎回或转换价格为下一开放日基金份额申购、赎回或转换的价格。但若投资者在开放期最后一日业务办理时间结束之后提出申购、赎回或者转换等申请的,视为无效申请。

(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;

5、办理申购、赎回业务时,应遵循基金份额持有人利益优先原则;

6、本基金的申购、赎回等业务,按照登记机构的相关业务规则执行。若相关法律法规、中国证监会或登记机构对申购、赎回业务等规则有新的规定,按新规定执行。

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。

投资者办理申购、赎回等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守基金合同和招募说明书规定的前提下,以各销售机构的具体规定为准。

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,投资者全额交付申购款项,申购申请成立;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。基金份额持有人赎回申请生效后,基金管理人在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。

如遇证券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,则赎回款项的支付时间可相应顺延。在发生巨额赎回或本基金合同约定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本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,投资者应及时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。若申购不成功或无效,则申购款项本金退还给投资者。

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

基金管理人在不违反法律法规的前提下,可对上述程序规则进行调整。基金管理人应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。

(五)申购和赎回的金额限制

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并报中国证监会备案。

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%
100万≤A<200万	0.50%
200万≤A<500万	0.30%
A≥500万	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。

持有基金份额期限	费率
在同一开放期内申购后又赎回的且持续持有期小于7日的基金份额	1.50%
在同一开放期内申购后又赎回的且持续持有期大于7日(含7日)的基金份额	0.50%
在某一开放期申购并持有一个封闭期以上的基金份额	0

对持续持有期小于7日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产;对持续持有期大于7日(含7日)的投资者,应当将赎回费总额的25%计入基金财产。赎回费中计入基金财产之余的费用用于支付登记费和其他必要的手续费。

3、本基金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,经中国证监会同意,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、当本基金发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

(七)申购份额与赎回金额的计算

1、当投资者申购本基金份额时,申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值,有效份额单位为份。申购份额的计算公式:

1)申购费用采用比例费率时:

净申购金额=申购金额/(1+申购费率)

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值

2)申购费用采用固定金额时:

申购费用=固定金额

净申购金额=申购金额-申购费用

申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值

2、上述计算结果均按四舍五入方法,保留到小数点后2位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例:某投资者投资100,000.00元申购本基金,假设申购当日基金份额净值为 1.0500元,则可得到的申购份额为:

净申购金额=100,000/(1+0.80%)=99,206.35元

申购费用=100,000-99,206.35=793.65元

申购份额=99,206.35/1.0500=94,482.24份

即:该投资者投资100,000.00元申购本基金,假设申购当日基金份额净值为1.0500元,则其可得到94,482.24份基金份额。

例:某投资者投资5,000,000.00元申购本基金,假设申购当日基金份额净值为 1.0500元,则可得到的申购份额为:

申购费用=1,000.00元

净申购金额=5,000,000.00-1,000.00=4,999,000.00元

申购份额= 4,999,000.00/1.0500=4,760,952.38份

即:该投资者投资5,000,000.00元申购本基金,假设申购当日基金份额净值为1.0500元,则其可得到4,760,952.38份基金份额。

3、赎回金额的计算及余额处理方式

本基金采用“份额赎回”方式,赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用,赎回金额单位为元,计算公式:

赎回总金额=赎回份额×赎回当日基金份额净值

赎回费用=赎回总金额×赎回费率

净赎回金额=赎回总金额?赎回费用

上述计算结果均按四舍五入方法,保留到小数点后2位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例:某投资者在同一开放期内申购后又赎回本基金10,000份基金份额,且持续持有期为5日,则对应的赎回费率为1.50%,假设赎回当日基金份额净值是1.0800元,则其可得到的赎回金额为:

赎回总金额=10,000.00×1.0800=10,800.00元

赎回费用=10,800×1.50%=162.00元

净赎回金额=10,800-162=10,638.00元

即:该投资者在同一开放期内申购后又赎回本基金10,000.00份基金份额,且持续持有期为5日,假设赎回当日基金份额净值是1.0800元,则其可得到的赎回金额为10,638.00元。

例:某投资者赎回本基金10,000.00份基金份额,持有期为一个封闭期以上,对应的赎回费率为0,假设赎回当日基金份额净值是1.0800元,则其可得到的赎回金额为:

赎回总金额=10,000.00×1.080=10,800.00元

赎回费用=0元

净赎回金额=10,800-0=10,800.00元

即:投资者赎回本基金10,000.00份基金份额,持有期为一个封闭期以上,假设赎回当日基金份额净值是1.0800元,则其可得到的赎回金额为10,800.00元。

(八)拒绝或暂停申购的情形

在开放期内发生下列情况时,基金管理人可拒绝或暂停接受投资者的申购申请:

1、因不可抗力导致基金无法正常运作。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。

3、证券交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

5、基金资产规模过大,使基金管理人无法找到合适的投资品种,或其他可能对基金业绩产生负面影响,或其他损害现有基金份额持有人利益的情形。

6、基金管理人、基金托管人、登记机构、销售机构、支付结算机构等因异常情况导致基金销售系统、基金销售支付结算系统、基金登记系统、基金会计系统等无法正常运行。

7、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时,经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当暂停接受基金申购申请。

8、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限的。

9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第1、2、3、5、6、7、9项情形之一且基金管理人决定拒绝或暂停申购申请时,基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上进行公告。如果投资者的申购申请被拒绝,被拒绝的申购款项本金将退还给投资者。在暂停申购的情况消除时,基金管理人应及时恢复申购业务的办理,开放期相应顺延。

(九)暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

在开放期内发生下列情况时,基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项:

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。

3、证券交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、继续接受赎回可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

6、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时,经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金申购赎回申请的措施。

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形(第4项除外)之一且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人赎回申请或延缓支付赎回款项时,基金管理人应报中国证监会备案,已确认的赎回申请,基金管理人应足额支付;如暂时不能足额支付, 未支付部分可延期支付, 并以赎回申请日的基金份额净值为依据计算赎回金额。若出现上述第4项所述情形,按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时,基金管理人应及时恢复赎回业务的办理,开放期相应顺延。

(十)巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一工作日的基金总份额的20%,即认为是发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时, 基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

(1)全额赎回:当基金管理人认为有能力支付投资者的全部赎回申请时,按正常赎回程序执行。

(2)延缓支付:当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为因支付投资者的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时, 基金管理人可对赎回款项进行延缓支付,但不得超过20个工作日。延缓支付的赎回申请以赎回申请当日的基金份额净值为基础计算赎回金额。

(3)在开放期内,若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的单日赎回申请超过前一工作日基金总份额50%的,基金管理人认为支付该基金份额持有人的全部赎回申请有困难或者因支付该基金份额持有人的全部赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时,在当日接受该基金份额持有人的全部赎回的比例不低于前一工作日基金总份额50%的前提下,其余赎回申请可以延期办理,但延期办理的期限不得超过20个工作日,如延期办理期限超过开放期的,开放期相应延长,延长的开放期内不办理申购,亦不接受新的赎回申请,即基金管理人仅为原开放期内因提交赎回申请超过基金总份额50%以上而被延期办理赎回的单个基金份额持有人办理赎回业务。

3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延缓支付时,基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在3个交易日内通知基金份额持有人,说明有关处理方法,同时在指定媒介上公告。

(十一)暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的,基金管理人应按规定向中国证监会备案,并依据相关规定进行公告。

2、如发生暂停的时间为1日,基金管理人应于重新开放日,在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公布最近1个开放日的基金份额净值。

3、如发生暂停的时间超过1日,基金管理人自行确定公告增加次数,并根据《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上刊登公告。

(十二)基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务,基金转换可以收取一定的转换费,相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告,并提前告知基金托管人与相关机构。

(十三)基金份额的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下, 基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的,将提前公告,基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。

(十四)基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下,接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资者。

继承是指基金份额持有人死亡,其持有的基金份额由其合法的继承人继承;捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体; 司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料, 对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理,并按基金登记机构规定的标准收费。

(十五)基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管, 基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

(十六)定期定额投资计划

基金管理人可以为投资者办理定期定额投资计划,具体规则由基金管理人另行规定。投资者在办理定期定额投资计划时可自行约定每期申购金额, 每期申购金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

(十七)基金的冻结和解冻

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻,以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金账户或基金份额被冻结的,被冻结基金份额所产生的权益一并冻结,被冻结部分份额仍然参与收益分配,法律法规另有规定的除外。

(十八)其他业务

在不违反相关法律法规、对基金份额持有人的权利无实质性不利影响的前提下,基金管理人可办理份额的质押或其他基金业务,基金管理人可制定相应的业务规则,届时无需召开基金份额持有人大会审议但须报中国证监会核准或备案并提前公告。

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、同业存单以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但需符合中国证监会相关规定)。

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)、可交换债券及国债期货。

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%;但应开放期流动性需要,为保护基金份额持有人利益,在每次开放期前10个交易日、开放期及开放期结束10个交易日的期间内,基金投资不受上述比例限制。

开放期内, 本基金每个交易日日终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%,在封闭期内,本基金不受上述5%的限制,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款。

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。

1、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。

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,利用市场定价偏误、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

本基金将综合运用资产配置 、久期管理、收益率曲线、信用管理和个券α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。

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%,但在每个开放期前10个交易日、开放期及开放期结束10个交易日的期间内,基金投资不受上述比例限制;

(2)开放期内,本基金每个交易日日终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%,在封闭期内,本基金不受上述5%的限制,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款;

(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%;进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;

(11)在封闭期内,本基金总资产不得超过基金净资产的200%;在开放期内,本基金总资产不得超过基金净资产的140%;

(12)本基金投资于单只中小企业私募债的市值,不得超过本基金资产净值的10%;

(13)本基金投资中小企业私募债券的剩余期限,不得超过基金的剩余封闭运作期;

(14) 开放期内, 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%。

(15) 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;

(16)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)、(14)、(15)外),但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。

因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合第(14)条所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。

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。在上述期间内,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本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制,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以变更后的规定为准,但须提前公告。

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)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;

(6)向其基金管理人、基金托管人出资;

(7)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

3、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。

4、法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定,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变更后的规定执行。

(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×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本基金合同的规定,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2018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	1,481,553,000.00	96.68
	其中:债券	1,481,553,000.00	96.68
	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	8,000,000.00	0.52
	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	10,365,005.15	0.68
7	其他各项资产	32,578,705.62	2.13
8	合计	1,532,496,710.77	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。

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

(1)报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

(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

本基金本报告期末未持有股票。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	80,387,000.00	5.28
	其中:政策性金融债	80,387,000.00	5.28
4	企业债券	137,232,000.00	9.01
5	企业短期融资券	60,334,000.00	3.96
6	中期票据	1,203,600,000.00	79.00
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,481,553,000.00	97.25

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	101761029	17徐州经开MTN005	800,000.00	78,544,000.00	5.16
2	101759003	17康得新MTN001	800,000.00	76,240,000.00	5.00
3	180404	18农发04	700,000.00	70,343,000.00	4.62
4	101661033	16衡阳水投MTN001	700,000.00	68,362,000.00	4.49
5	101800151	18名城建设MTN001	500,000.00	52,300,000.00	3.43

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期内未投资贵金属。

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)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	9,206.80
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	32,569,498.82
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,578,705.62

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有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

本基金本报告期末未持有股票。

(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。

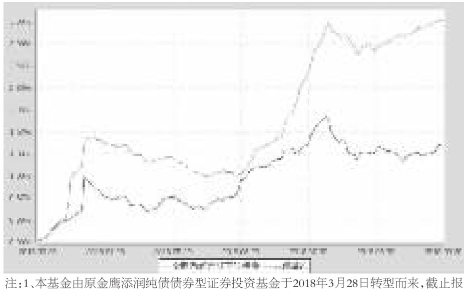
(一)业绩比较

本基金合同生效日为2018年3月28日,基金合同生效以来(截至2018年9月30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
2018.3.28-2018.6.30	1.04%	0.07%	0.94%	0.08%	0.10%	-0.01%
2018.3.28-2018.9.30	3.34%	0.07%	1.48%	0.07%	1.86%	0.00%

(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

金鹰添润定期开放债券型发起式证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2018年3月28日至2018年9月30日)



注:1、本基金由原金鹰添润纯债债券型证券投资基金于2018年3月28日转型而来,截止报告期末,本基金合同生效未满一年;

2、按基金合同和招募说明书的约定,本基金的建仓期为六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关约定;

3、本基金的业绩比较基准是: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%。

九、基金的财产

一、基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和。

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、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、在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下,基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式,不需召开基金份额持有人大会审议;

6、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

(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,在2个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

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、诉讼费和仲裁费;

5、基金份额持有人大会费用;

6、基金的证券交易及结算费用;

7、基金的银行汇划费用;

8、基金的开户费用、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×0.30%÷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,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%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.10%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,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5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休假等,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》、《公开募集证券基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《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《金鹰添润定期开放债券型发起式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,包括主要董事、高管、基金经理及投资决策委员会人员任职变动信息。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)更新了本报告期末基金投资组合、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)增加“本法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险”的风险揭示。详见第十七部分之(七);

(6)根据修改重新编排各章节的编号。

金鹰基金管理有限公司

2018年11月10日

金鹰基金管理有限公司关于提请非自然人客户及时登记受益所有人信息的公告

尊敬的投资者:

根据《中国人民银行关于加强反洗钱客户身份识别有关工作的通知》(银发〔2017〕235号)的规定,基金公司应加强对非自然人客户的身份识别,在建立或者维持业务关系时,采取合理措施了解非自然人客户的业务性质与股权或者控制权结构,了解相关的受益所有人信息,并登记客户受益所有人的姓名、地址、身份证件或者身份证明文件的种类、号码和有效期限。同时了解、收集并妥善保存信息和资料,包括非自然人客户股权或者控制权的相关信息及股东或者董事会成员登记信息等。

根据此项规定,金鹰基金管理有限公司(以下简称“我公司”)特此提醒非自然人客户,请尽快联系我公司直销柜台或代销机构,并根据销售渠道的要求登记受益所有人信息、补充完善相关证明材料,以免影响交易。

如有疑问,请联系客户经理、拨打我公司客户服务电话4006135888或登录我公司网站www.gefund.com.cn了解相关情况。

特此公告。

金鹰基金管理有限公司

二〇一八年十一月十日