（上接B229版）

联系电话：021-20292031
客服电话：021-20292031
公司网址：www.wg.com.cn
（125）北京加和基金销售有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街11号7层703室
办公地址：北京市西城区金融大街11号7层703室
法定代表人：曲阳
联系人：王晨
联系电话：010-50866170
客服电话：400-803-1188
公司网址：www.bzfunds.com
（126）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
（127）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
（128）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
（129）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
（130）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
（131）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
联系电话：021-23586603
客服电话：95357
公司网址：www.18.cn
（132）华瑞保险销售有限公司
注册地址：上海市嘉定区南翔镇众仁路399号运通星财富广场1号楼B座13、14层
办公地址：上海市浦东新区银城中路501号上海中心大厦32层
法定代表人：路昊
联系人：茆勇强
联系电话：021-61058785
客服电话：4001115818
公司网址：www.huaruisales.com
（133）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：北京市西城区华远北街2号西单通港大厦12层 1212
法定代表人：周斌
联系人：张鼎
电话：18641514414
客服电话：4008980618
公司网址：http://www.chtwm.com
（134）北京恒宇天泽基金销售有限公司
注册地址：北京市延庆区延庆经济开发区百泉街10号2栋883室
办公地址：北京市东城区东滨河路乙1号航星园8号楼9层
法定代表人：梁越
联系人：颜光阳
联系电话：010-84259261
客服电话：400-188-8848
公司网址：www.1314fund.com
（135）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
联系电话：021-50206003
客服电话：021-50206003
公司网址：www.msftec.com
（136）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座12层
法定代表人：张虎
联系人：李丹
联系电话：010-53579751
客服电话：400-004-8821
公司网址：www.hxlc.com
（137） 德邦证券股份有限公司
注册地址：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼
办公地址：上海市福山路 500 号城建国际中心 26 楼
法定代表人：姚文平
联系人：刘熠
客服电话：400-8888-128
公司网址：www.tebon.com.cn
（138）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：北京市朝阳区昆泰国际大厦12层
法定代表人：李科
联系人：王超
联系电话：010-85632771
客服电话：95510
公司网址：fund.sinosig.com
4、场内发售代理机构
场内发售代理机构情况详见基金份额发售公告以及相关公告。
基金管理人可根据有关法律法规的要求，根据实情，选择其他符合要求的机构销售本基金或变更上述销售机构，并及时公告。
（二）登记机构名称：
1、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
法定代表人：刘志刚
电话：020-38283037
传真：020-83282856
联系人：张盛
2、名称：中国证券登记结算有限责任公司
住所：北京市西城区太平桥大街17号
办公地址：北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人：周明
联系人：费琳
电话：（021）68419135
传真：（021）68870311
（三）出具法律意见书的律师事务所：
名称：广东岭南律师事务所
办公地址：广州市新港西路135号中山大学西门科技园601-605室
法定代表人：邓柏涛
电话：020-84035397
传真：020-84113152
经办律师：欧阳兵、马晓灵、陈红
（四）审计基金财产的会计师事务所：
名称：中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：武汉市武昌区东湖路 169 号众环海华大厦 2-9 层
法定代表人：石文先
电话：027-86770549
传真：027-85424329
邮编：430077
经办注册会计师：王兵、赵会娜

四、基金份额的分类

（一）基金份额类别设置

本基金设A类、B类和E类三类基金份额，A类和B类为场外基金份额，E类为场内基金份额。三类基金份额单独设置基金代码。

基金管理人分别公布A类和B类基金份额的每万份基金已实现收益和7日年化收益率，以及E类基金份额每百份基金已实现收益和7日年化收益率。

A类和B类基金份额通过基金管理人指定的场外销售机构办理认购、申购和赎回等业务。E类基金份额通过上海证券交易所场内交易平台办理认购、申购和赎回等业务，并在上海证券交易所上市交易。

（二）A类、B类基金份额的自动升降级规则

当投资者在单个基金账户保留的A类基金份额达到B类基金份额的最低份额（目前设定为5,000,000份）要求时，登记机构自动将投资者在该基金账户保留的A类基金份额全部升级为B类基金份额。当投资者在单个基金账户保留的B类基金份额不能满足B类基金份额最低份额要求时，登记机构自动将投资者在该基金账户保留的B类基金份额全部降级为A类基金份额。

在投资者持有的某类基金份额满足升降级条件后，基金的登记机构自动为其办理升降级业务，投资者持有的基金份额在升降级业务办理当日按照新的基金份额类别享有基金收益。根据《业务规则》，如果登记机构在T日对投资者持有的基金份额进行了升降级处理，那么投资者在该日对升降级前的基金份额提交的赎回、基金转换转出、转托管等交易申请将确认失败，基金管理人不承担由此造成的一切损失；从T＋1日起，投资者可以升降级后的基金份额类别提交上述交易申请。

基金份额升降级的相关规则由基金管理人和登记机构制定。E类基金份额不适用基金份额升降级规则。

（三）在遵守法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，经履行适当程序后，基金管理人可增加、减少或调整基金份额类别设置、对基金份额分类办法及规则进行调整并在调整实施之日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

五、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11月23日中国证监会证监许可[2016]2827号文件准予募集注册。

募集期间为2017年3月6日至2017年3月10日，募集规模为1,688,617,731.20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。

六、基金合同的生效

本基金基金合同于2017年3月20日正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

《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，应召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规另有规定时，从其规定。

七、基金份额的折算

本基金合同生效后，本基金E类基金份额进行基金份额折算，A 类和B类基金份额不进行基金份额折算。下述为E 类基金份额的折算规则：

（一）基金份额折算的时间

基金合同生效当日，基金管理人办理E类基金份额折算。

（二）基金份额折算的原则

基金份额折算由基金管理人办理，并由登记机构进行基金份额的变更登记。E类基金份额折算后，本基金的基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额将发生调整，但调整后的基金份额持有人持有的基金份额的净值占基金资产净值的比例不发生变化。基金份额折算对基金份额持有人的权益无实质性影响。基金份额折算后，基金份额持有人将按照折算后的基金份额享有权利并承担义务。

基金份额持有人持有的每一基金份额在其对应的份额类别内拥有平等的投票权。E 类基金份额折算后，每份E 类基金份额与每100 份A 类或B类基金份额拥有同等投票权。由于A 类和B类基金份额的面值为1 元，E 类基金份额在基金合同生效日折算后的面值为100 元，因此在计算包括但不限于提议召开基金份额持有人大会、参加基金份额持有人大会、基金份额持有人大会提案和表决、提名新任基金管理人和基金托管人、基金财产清算后剩余资产分配等事项的基金份额持有人所持有的基金份额和基金总份额时，每100 份A 类或B类基金份额等同于1 份E类基金份额。

如果基金份额折算过程中发生不可抗力，基金管理人可延迟办理基金份额折算。

（三）基金份额折算的方法

折算后E 类基金份额持有人持有的基金份额=折算前E 类基金份额持有人持有的基金份额/100

折算后E 类每份基金份额对应的面值为100 元。

E 类基金份额折算的具体安排和结果将另行公告。

八、基金份额的上市交易

（一）基金份额的上市

基金合同生效后，具备下列条件的，基金管理人可依据《上海证券交易所证券投资基金上市规则》，向上海证券交易所申请E类基金份额的上市：

1、基金募集金额不低于2亿元；

2、基金份额持有人不少于1000人；

3、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的其他条件。

基金上市前，基金管理人应与上海证券交易所签订上市协议书。基金获准在上海证券交易所上市的，基金管理人应在基金上市日前至少3个工作日发布基金上市交易公告书。

（二）基金份额的上市交易

本基金基金份额在上海证券交易所的上市交易的规则、费用、停复牌、暂停上市、恢复上市等需遵照《上海证券交易所交易规则》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》等有关规定。

（三）终止上市交易

基金份额上市交易后，有下列情形之一的，上海证券交易所可终止基金份额的上市交易，并报中国证监会备案：

1、不再具备本部分第一条规定的上市条件；

2、基金合同终止；

3、基金份额持有人大会决定终止上市；

4、上海证券交易所认为应当终止上市的其他情形。

基金管理人应当在收到上海证券交易所终止基金上市的决定之日起2个工作日内发布基金份额终止上市交易公告。

（四）相关法律法规、中国证监会及上海证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，应当以届时有效的法律法规和规则为准。如基金合同应予以修改的，则此项修改无须召开基金份额持有人大会。若上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司增加本基金上市交易方面的新功能，基金管理人与基金托管人协商一致增加相应功能的，基金管理人应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告，无须召开基金份额持有人大会。

九、基金份额的申购与赎回

（一）申购和赎回场所

本基金基金份额的申购与赎回包括场外和场内两种方式。本基金A 类和B类基金份额通过场外方式办理申购和赎回等业务；E 类基金份额通过场内方式办理申购和赎回等业务。

本基金场外申购和赎回通过基金管理人的直销网点及其他基金场外销售机构的销售网点办理；

场内申购和赎回通过申购赎回代理券商办理基金申购、赎回业务的营业场所或按申购赎回代理券商提供的其他方式办理。

具体的销售网点及申购赎回代理券商名单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。

（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三个月开始办理申购，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三个月开始办理赎回，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，视为下一开放日的申购、赎回或转换申请。

（三）场外申购与赎回

A 类和B类基金份额通过场外进行申购赎回。

1、申购与赎回的原则

（1）"确定价"原则，即申购、赎回价格以每份A类或B类基金份额净值为1.00 元为基准进行计算；

（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，基金销售机构另有规定的，以基金销售机构的规定为准；

（4）基金管理人有权决定本基金的总规模限额，但最迟应在新的限额实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

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。

2、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本基金合同有关条款处理。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他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，则赎回款项在该等故障消除后及时划往投资者银行账户。

（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，登记机构可根据《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。

3、申购和赎回的数量限制

（1）投资者通过基金管理人指定的场外销售机构申购本基金A类基金份额时，首次申购最低金额为人民币0.01元，追加申购最低金额为人民币0.01元；投资者通过基金管理人网上直销平台申购的，申购的最低金额为人民币1元，追加申购的最低金额为人民币1元；通过基金管理人直销中心柜台申购时，首次申购最低金额为人民币10000元，追加申购最低金额为人民币1000元。具体申购金额以各基金销售机构的公告为准。

投资者申购本基金B类基金份额，首次单笔最低申购金额为人民币5,000,000元，追加申购最低金额为人民币1,000元。

如各基金销售机构另有规定的，以各销售机构的规定为准。本基金管理人网上直销平台和直销中心柜台单笔申购最低金额可由基金管理人调整。

（2）本基金不对单笔最低赎回份额进行限制，基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回，不能满足B类基金份额最低份额要求时，登记机构自动将投资者在该基金账户保留的B类基金份额全部降级为A类基金份额。基金销售机构另有规定的，以基金销售机构的规定为准；

（3）本基金对单个投资者不设累计持有的基金份额上限；

（4）基金管理人可以设置单日累计申购金额/净申购金额上限、单个账户单日累计申购金额/净申购金额上限、单笔申购上限。

（5）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。

（6）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和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《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、申购和赎回的价格、费用及其用途

（1）本基金场外基金份额不收取申购费用和赎回费用，本基金合同另有约定的除外。

（2）本基金场外份额的申购、赎回价格为每份基金份额1.00 元。投资者申购所得的份额等于申购金额除以1.00 元，赎回所得的金额等于赎回份额乘以1.00 元。

（3）申购份额的计算及余额的处理方式

申购份额的计算方法如下：

申购份额＝申购金额/1.00

申购份额计算结果保留到小数点后2 位，小数点2 位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

例：投资者投资100,000 元申购本基金A类基金份额，则其可得到的申购份额为：

申购份额＝100,000/1.00=100,000.00 份

即：投资者投资100,000 元申购本基金A类基金份额，则其可获得100,000.00 份申购份额。

（4）赎回金额的计算及处理方式

赎回金额的确定分为两种情况处理：

1）部分赎回

投资者部分赎回基金份额时，如基金份额其未付收益为正，或该笔赎回完成后剩余的基金份额按照1.00 元人民币为基准计算的价值足以弥补其累计至该日的基金份额未付收益负值时，赎回金额如下计算：

赎回金额=赎回份额×1.00

例：假定某投资者在T 日所持有的基金份额为5,010.50 份A类基金份额，对应的未付收益为55.05元，该投资者申请赎回1,000 份A类基金份额，则其获得的赎回金额计算如下：

赎回金额= 1,000×1.00 ＝ 1,000.00 元

投资者部分赎回基金份额时，如其该笔赎回完成后剩余的基金份额按照1.00 元人民币为基准计算的价值不足以弥补其累计至该日的基金份额未付收益负值时，则将自动按比例结转基金份额当前未付收益。

例：假定某投资者在T日持有10万份A类基金份额，未结转收益为－500.00元：

A. 若该投资者赎回6万份A类基金份额，剩余的4万份，远大于未结转收益，则赎回金额计算如下：

赎回金额＝60,000.00×1.00＝60,000.00元

B. 若该投资者赎回99,700.00份A类基金份额，剩余的300.00份低于未结转收益，则赎回金额计算如下：

赎回金额＝99,700.00×1.00－99,700/100,000.00×500＝99,201.50元

2）全部赎回

投资者在全部赎回基金份额时，基金管理人自动将投资者的基金份额未付收益一并结算并与赎回款一起支付给投资者，赎回金额包括赎回份额和未付收益两部分，具体的计算方法为：

赎回金额=赎回份额×1.00 +该份额对应的未付收益

例：假定某投资者在T 日所持有的基金份额为2万份A类基金份额，且有80.08 元的未付收益。投资者申请全部赎回持有的A类基金份额，则其获得的赎回金额计算如下

赎回金额=20,000.00×1.00 + 80.08 = 20 ,080.08 元

例：假定某投资者在T 日所持有的基金份额为2万份A类基金份额，且有一50.00元的未付收益。投资者申请全部赎回持有的A类基金份额，则其获得的赎回金额计算如下

赎回金额=20,000.00×1.00－50.00= 19 ,950.00元

赎回金额以人民币元为单位，计算结果均按四舍五入，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。

（四）场内申购与赎回

E 类基金份额通过场内进行申购赎回。

1、申购与赎回的原则

（1）"确定价"原则，即申购、赎回价格以每份E类基金份额净值100.00元为基准进行计算；

（2）"份额申购、份额赎回"原则，即申购以份额申请，赎回以份额申请；

（3）本基金的申购对价、赎回对价包括现金替代及其他对价；

（4）当日的申购、赎回申请在当日基金交易时间内提交后不得撤销。

（5）基金管理人有权决定本基金的总规模限额，但应最迟在新的限额实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

（6）申购、赎回应遵守上海证券交易所和登记机构相关业务规则。

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。

2、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

投资者在申购本基金时须根据申购、赎回清单备足申购对价；投资者在提交赎回申请时，必须有足够的基金份额余额。否则所提交的申购、赎回的申请不成立而不予成交。

投资者T 日赎回申请成功后，基金管理人将在T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。如遇证券交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行交换系统故障或其他非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响了业务流程，则赎回款项划付时间相应顺延。在发生巨额赎回时，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

如投资者未能提供符合要求的申购对价，则申购申请不成立。如投资者持有的符合要求的基金份额不足，则赎回申请不成立。投资者申购、赎回申请按上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司相关业务规则进行确认。

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。

基金管理人可以在不违反法律法规的前提下，对上述业务办理时间进行调整，并提前公告。

在不损害基金份额持有人权益的前提下，基金管理人可以因交易所和登记机构相关规则的变更等原因更改上述程序。基金管理人最迟须于新规则开始日前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

3、申购和赎回的数量限制

（1）投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。本基金最小申购、赎回单位为1 份。最小申购、赎回单位由基金管理人确定和调整，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。

（2）基金管理人可以规定投资者每个证券账户的最低基金份额余额，具体规定请参见相关公告。

（3）基金管理人可以规定单个投资者累计持有的基金份额上限，具体规定请参见相关公告。

（4）基金管理人根据基金每日运作情况，可对基金场内每日总申购份额和赎回份额进行控制并在基金管理人网站公布。上海证券交易所可根据基金管理人的要求对当日的申购/赎回申请进行总量控制。

（5）基金管理人可以依照相关法律法规以及基金合同的约定，在特定市场条件下暂停或者拒绝接受一定金额以上的资金申购，具体以基金管理人的公告为准。

（6）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。

（7）基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述各项规定的数量限制。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、申购和赎回的清算交收与登记

本基金申购赎回过程中涉及的资金和基金份额交收适用上海证券交易所和登记机构的结算规则。

登记机构可在法律法规允许的范围内，对清算交收和登记的办理时间、方式进行调整。

5、申购和赎回的价格、费用及其用途

（1）本基金E类基金份额不收取申购费用和赎回费用，本基金合同另有约定的除外。

（2）本基金E类基金份额的申购、赎回价格为每份基金单位100.00元。

（3）申购对价是指投资者申购基金份额时应交付的现金替代及其他对价。赎回对价是指投资者赎回基金份额时，基金管理人应交付给赎回人的现金替代及其他对价。申购对价、赎回对价根据申购、赎回清单和投资者申购、赎回的基金份额数额确定。

（4）申购、赎回清单由基金管理人编制。T 日的申购、赎回清单在当日上海证券交易所开市前公告。如遇特殊情况，可以适当延迟编制或公告，并报中国证监会备案。如申购、赎回清单产生差错，基金管理人可申请基金交易的临时停牌或暂停基金的申购、赎回，并报中国证监会备案。因差错而获得不当得利的当事人应及时返还不当得利。

6、申购赎回清单的内容与格式

（1）申购赎回清单的内容

T日申购赎回清单公告内容包括最小申购、赎回单位所对应的申赎现金、申购限额、赎回限额及其他相关内容。

（2）申赎现金

本基金采用现金申购、赎回，"申赎现金"的现金替代标志为"必须"，每一申赎份额对应的申赎现金为100.00元人民币。

（3）预估现金部分与现金差额

预估现金部分是指由基金管理人估计并在T日申购赎回清单中公布的当日现金差额的估计值，预估现金部分的计算公式如下：

T日预估现金部分＝T－1日最小申购赎回单位的基金资产净值－T日申赎现金。一般情况下预估现金部分为0。

T日现金差额在T＋1日的申购赎回清单中公告，其计算公式为：

T日现金差额＝T日最小申购赎回单位的基金资产净值－T日申赎现金。一般情况下现金差额为0。

（4）申购赎回清单的格式

基本信息	
最新公告日期	T日
基金名称	金鹰现金增益交易型货币市场基金
基金管理公司名称	金鹰基金管理有限公司
基金代码	xxxxxx
T－1日信息内容	
现金差额（单位：元）	0
最小申购赎回单位资产净值（单位：元）	100.00
基金份额净值（单位：元）	100.00
T日信息内容	
最小申购、赎回单位的预估现金部分(单位:元)	0.00
现金替代比例上限	100%
申购上限	无
赎回上限	无
是否需要公布IOPV	否
最小申购赎回单位（单位：份）	1
申购赎回的允许情况	申购和赎回皆允许

成份券信息内容

股票代码	股票简称	股票数量	现金替代标志	现金替代溢价比例	固定替代金额
SSXJ	申赎现金	1	必须		100.00

说明：上述表格仅为示例。

（五）基金份额收取赎回费的例外情形

出现以下情形之一时，为确保基金平稳运作，避免诱发系统性风险，本基金对当日单个基金份额持有人申请赎回基金份额超过基金总份额（应将每一份E类基金份额折算为100份A类基金份额或B类基金份额）1%以上的赎回申请征收1%的强制赎回费用，并将上述赎回费用全额计入基金财产。基金管理人与基金托管人协商确认上述做法无益于基金利益最大化的情形除外：

（1）在满足相关流动性风险管理要求的前提下，当基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于5%且偏离度为负时，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（2）当本基金前10名基金份额持有人的持有份额合计超过基金总份额50%的，且本基金投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于10%且偏离度为负时，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

十、基金的投资

（一）投资目标

在严格控制风险和保持流动性的基础上，力争获得超越业绩比较基准的稳定收益。

（二）投资范围

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金，期限在一年以内(含一年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单，剩余期限在397天以内(含397天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券，以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

如果法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

（三）投资策略

本基金结合"自上而下"和"自下而上"的研究方法对各类可投资资产进行合理的配置和选择。本基金将综合宏观经济运行状况，货币政策、财政政策等政府宏观经济状况及政策，分析资本市场资金供给状况的变动趋势，预测市场利率水平变动趋势，并审慎考虑各类资产的收益性、流动性及风险性特征，在风险与收益的配比中，力求将各类风险降到最低，并在控制投资组合良好流动性的基础上为投资者获取稳定的收益，具体投资策略包含以下几个层面：

1、整体资产配置策略

首先根据宏观经济形势、央行货币政策、短期资金市场状况等因素对短期利率走势进行综合判断，然后形成利率动态预期，进而调整本基金投资组合的平均剩余期限。

（1）利率分析策略

本基金通过对通货膨胀、GDP 增长、货币供应量、国际利率水平、汇率、政府宏观政策导向等因素进行分析，形成对基本面的宏观研判。同时，对中国人民银行公开市场操作、主流机构投资者的短期投资倾向、债券供给、货币市场与资本市场资金等微观层面的因素进行考察，合理预期货币市场利率曲线动态变化，以此决定基金投资组合平均剩余期限。

（2）久期管理策略

当预期市场利率上升时，基金管理人将通过增加持有剩余期限较短债券并减持剩余期限较长债券等方式降低组合久期，以降低组合跌价风险；在预期市场收益率下降时，通过增持剩余期限较长债券等方式提高组合久期，以分享债券价格上升的收益。

2、类属配置策略

本基金将合理配置各类短期金融工具，如央行票据、国债、金融债、企业短期融资券以及现金等投资品种，通过类属配置满足基金流动性需求并获得投资收益。本基金将对市场资金面、基金申购赎回金额的变化进行动态分析，在高流动性资产和流动性较低资产之间寻找平衡，以满足组合的日常流动性需求；基金管理人通过对各类属的相对收益、利差变化、流动性风险、信用风险等因素的分析来确定类属配置比例，选择具有投资价值的品种，以获取较高回报。

3、债券类资产配置策略

本基金以安全性为第一考量，优先选择央票、短期国债等高信用等级的债券品种以回避信用违约风险。本基金还可配置外部信用评级等级较高（符合法规规定的级别）的企业债、短期融资券等信用类债券。在具体的券种选择上，基金管理人将在正确拟合收益率曲线的基础上，客观分析收益率出现偏离的原因，寻找收益率明显偏高的券种。本基金将重点关注价格被低估品种。

4、流动性管理策略

本基金将对基金的申购赎回情况、季节性资金流动情况和日历效应等因素进行跟踪，对投资组合的现金比例进行结构化管理，使得基金具备较高的流动性。基金管理人将综合平衡基金资产在流动性资产和收益性资产之间的配置比例，通过现金留存、持有高流动性券种、降低组合久期等方式提高基金资产整体的流动性，将回购或债券的到期日进行均衡等量配置，以确保基金资产的变现需求。

5、逆回购策略

基金管理人将密切关注由于季节性需求、新股申购等原因导致短期资金需求激增的机会，通过逆回购的方式融出资金以分享短期资金利率陡升的投资机会。

6、套利策略

本基金根据对货币市场变动趋势、各市场和品种之间的风险收益差异的充分研究和论证，积极把握由于市场短期失衡而带来的套利机会，通过跨市场、跨品种、跨期限等套利策略，力求获得安全的超额收益。

7、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。

（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）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：七天通知存款税后利率

本基金定位为现金管理工具，根据基金的投资标的、投资目标及流动性特征，本基金采用七天通知存款利率（税后）作为本基金的业绩比较基准。

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，或者是市场出现更加适合用于本基金的业绩比较基准，在与基金托管人协商一致后，本基金管理人可以在报中国证监会备案后调整或变更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。

（六）风险收益特征

本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

（七）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2019年3月31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	固定收益投资	8,049,871,114.76	55.07
	其中：债券	8,029,871,114.76	54.94
	资产支持证券	20,000,000.00	0.14
2	买入返售金融资产	3,092,585,747.86	21.16
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	－	－
3	银行存款和结算备付金合计	3,231,210,792.32	22.11
4	其他资产	242,776,445.74	1.66
5	合计	14,616,444,100.68	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、报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	9.14	
	其中：买断式回购融资	0.02	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	1,081,572,765.15	8.11
	其中：买断式回购融资	198,713,946.58	1.49

注：上表中报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金本报告期内没有出现债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的情况。

3、基金投资组合平均剩余期限

（1）投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	85
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	87
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	61

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限无超过120天的情况。

（2）报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30天以内	30.00	8.11
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	－	－
2	30天（含）—60天	17.36	－
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	－	－
3	60天（含）—90天	30.85	－
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	－	－
4	90天（含）—120天	3.70	－
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	－	－
5	120天（含）—397天（含）	25.54	－
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	－	－
	合计	107.46	8.11

4、报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本基金本报告期内无平均剩余存续期超过240天的情况。

5、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	766,558,224.40	5.75
	其中：政策性金融债	766,558,224.40	5.75
4	企业债券	186,490,602.63	1.40
5	企业短期融资券	880,013,639.00	6.60
6	中期票据	－	－
7	同业存单	6,196,808,648.73	46.49
8	其他	－	－
9	合计	8,029,871,114.76	60.24
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	－	－

6、报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	111913011	19浙商银行CD011	3,000,000.00	298,143,571.68	2.24
2	111921098	19渤海银行CD098	3,000,000.00	298,036,027.57	2.24
3	111993333	19广州农村商业银行CD031	3,000,000.00	295,935,664.79	2.22
4	111812222	18北京银行CD222	3,000,000.00	294,101,141.81	2.21
5	180407	18农发07	2,000,000.00	200,343,742.59	1.50
6	111888611	18昆仑银行CD104	2,000,000.00	199,288,230.74	1.50
7	111993044	19成都农商银行CD009	2,000,000.00	198,901,230.05	1.49
8	111883818	18甘肃银行CD096	2,000,000.00	198,868,358.64	1.49
9	111808283	18中信银行CD283	2,000,000.00	197,448,861.39	1.48
10	111993232	19重庆农村商行CD023	2,000,000.00	197,366,747.35	1.48

7、"影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	-次
报告期内偏离度的最高值	0.1176%
报告期内偏离度的最低值	0.0423%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0820%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内无负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	139318	万科31A1	200,000.00	20,000,000.00	0.15

注：本基金本报告期末仅持有一只资产支持证券。

9、投资组合报告附注

（1）基金计价方法说明

本基金目前投资工具的估值方法如下：

1）基金持有的债券（包括票据）购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，按实际利率计算其摊余成本及各期利息收入，每日计提收益；

2）基金持有的回购以成本列示，按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息；合同利率与实际利率差异较小的，也可采用合同利率计算确定利息收入；

3）基金持有的银行存款以本金列示，按实际协议利率逐日计提利息。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

如有新增事项，按国家最新规定估值。

（2）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。

（3）其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	22,422.30
2	应收证券清算款	200,145,364.85
3	应收利息	42,413,690.65
4	应收申购款	194,967.94
5	其他应收款	－
6	待摊费用	－
7	其他	－
8	合计	242,776,445.74

（4）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。

十一、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3月20日，基金合同生效以来（截至2019年3月31日）的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示：

1、金鹰现金增益A:

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
2017.3.20-2017.12.31	3.3252%	0.0011%	1.0615%	0.0000%	2.2637%	0.0011%
2018.1.1-2018.12.31	3.7533%	0.0019%	1.3500%	0.0000%	2.4033%	0.0019%
2017.3.20-2019.3.31	7.9770%	0.0019%	2.7444%	0.0000%	5.2326%	0.0019%

注：本基金收益分配是按日结转份额。

2、金鹰现金增益B:

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
2017.3.20-2017.12.31	3.4791%	0.0011%	1.0615%	0.0000%	2.4176%	0.0011%
2018.1.1-2018.12.31	3.9509%	0.0019%	1.3500%	0.0000%	2.6009%	0.0019%
2017.3.20-2019.3.31	8.3947%	0.0019%	2.7444%	0.0000%	5.6503%	0.0019%

注：本基金收益分配是按日结转份额。

3、金鹰现金增益E:

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
2017.3.20-2017.12.31	3.2606%	0.0021%	1.0615%	0.0000%	2.1991%	0.0021%
2018.1.1-2018.12.31	3.1977%	0.0024%	1.3500%	0.0000%	1.8477%	0.0024%
2017.3.20-2019.3.31	7.0686%	0.0028%	2.7444%	0.0000%	4.3242%	0.0028%

注：本基金收益分配是按日结转份额。

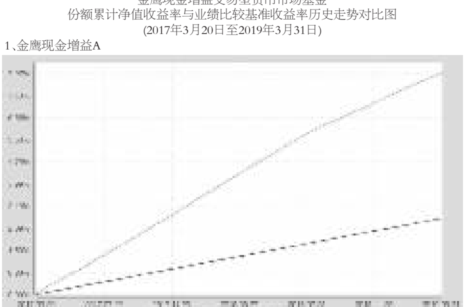
（二）自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

金鹰现金增益交易型货币市场基金

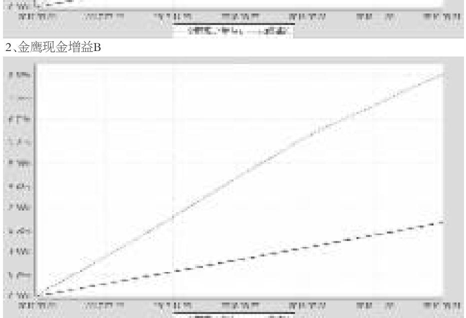
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017年3月20日至2019年3月31日)

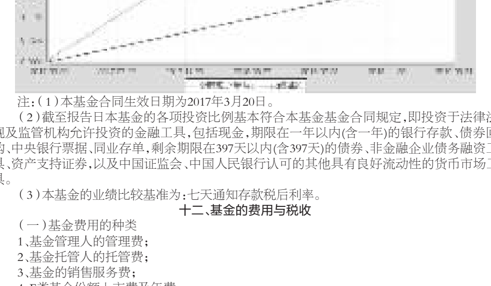
1、金鹰现金增益A



2、金鹰现金增益B



3、金鹰现金增益E



注：（1）本基金合同生效日期为2017年3月20日。

（2）截至报告日本基金的各项投资比例基本符合本基金基金合同规定，即投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金，期限在一年以内(含一年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单，剩余期限在397天以内(含397天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券，以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

（3）本基金的业绩比较基准为：七天通知存款税后利率。

十二、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、基金的销售服务费；

4、E类基金份额上市费及年费；

5、E类基金份额注册登记TA服务费；

6、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

7、《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；

8、基金份额持有人大会费用；

9、基金的证券交易及结算费用；

10、基金的银行汇划费用；

11、基金的账户开户费用和账户维护费用；

12、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0.28%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.28%÷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，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，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0.08%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.08%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

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

3、基金销售服务费

基金销售服务费用于支付销售机构佣金以及本基金的市场推广、销售、服务等活动。本基金A类基金份额的销售服务费年费率为0.2%；本基金B类基金份额的销售服务费年费率为0.01%；本基金E类基金份额的销售服务费年费率为0.2%。对于由B类降级为A类的基金份额，年销售服务费率应自其降级后的下一工作日起适用A类基金份额的费率。对于由A类升级为B类的基金份额，年基金销售服务费率应自其升级后的下一工作日起享受B类基金份额的费率。E类基金份额不适用基金份额升降级规则。各类基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

H＝E×年销售服务费率÷当年天数

H为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，自动在次月起3个工作日内，按照指定的账户路径进行资金支付，基金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。

上述"一、基金费用的种类"中第4、5 项费用，由基金托管人根据有关法律及相应协议的规定，按实际支出金额支付，由E类基金份额持有人承担。第6－12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。

十三、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《金鹰现金增益交易型货币市场基金招募说明书》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）更新基金托管人的主要信息。详见第四部分；

（4）更新代销机构等相关服务机构的信息。详见第五部分；

（5）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。详见第十二部分之第（十）基金投资组合报告，第十三部分基金的业绩；

（6）详细披露了报告期间与本基金有关的公告及重大事项信息。详见第二十五部分其它应披露事项；

金鹰基金管理有限公司

2019年4月30日

宁波太平鸟时尚服饰股份有限公司

2019 第一季度报告

公司代码：603877　　公司简称：太平鸟

一、重要提示

1.1 公司董事会、监事会及董事、监事、高级管理人员保证季度报告内容的真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并承担个别和连带的法律责任。

1.2 公司全体董事出席董事会审议季度报告。

1.3 公司负责人张江平、主管会计工作负责人王青林及会计机构负责人（会计主管人员）陆洁保证季度报告中财务报表的真实、准确、完整。

1.4 本公司第一季度报告未经审计。

二、公司主要财务数据和股东变化

2.1 主要财务数据

单位：元　币种：人民币

	本报告期末	上年度末	本报告期末比上年度末增减(%)
总资产	5,770,359,659.04	6,638,341,513.98	-13.08
归属于上市公司股东的净资产	3,520,699,421.98	3,539,118,846.85	-0.52
	年初至报告期末	上年初至上年报告期末	比上年同期增减(%)
经营活动产生的现金流量净额	-270,566,589.88	-113,263,473.02	不适用
	年初至报告期末	上年初至上年报告期末	比上年同期增减（%）
营业收入	1,659,214,345.00	1,736,669,653.44	-4.46
归属于上市公司股东的净利润	86,589,621.46	133,000,565.28	-34.90
归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润	31,189,238.09	90,063,143.62	-65.37
加权平均净资产收益率（%）	2.48	3.92	减少1.44个百分点
基本每股收益（元/股）	0.18	0.28	-35.71
稀释每股收益（元/股）	0.18	0.28	-35.71

非经常性损益项目和金额

√适用 □不适用

单位：元　币种：人民币

项目	本期金额	说明
非流动资产处置损益	-425,447.87	
计入当期损益的政府补助，但与公司正常经营业务密切相关，符合国家政策规定、按照一定标准定额或定量持续享受的政府补助除外	63,222,348.47	
除同公司正常经营业务相关的有效套期保值业务外，持有交易性金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债、衍生金融负债产生的公允价值变动损益，以及处置交易性金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债、衍生金融负债和其他债权投资取得的投资收益	10,266,413.51	理财产品投资收益
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	736,921.73	
少数股东权益影响额（税后）	146.77	
所得税影响额	-18,399,999.24	
合计	55,400,383.37	

2.2 截止报告期末的股东总数、前十名股东、前十名流通股东（或无限售条件股东）持股情况表

单位：股

股东总数（户）						12,357
前十名股东持股情况						
股东名称（全称）	期末持股数量	比例(%)	持有有限售条件股份数量	质押或冻结情况 股份状态	数量	股东性质
太平鸟集团有限公司	229,362,000	47.71	229,362,000	质押	28,000,000	境内非国有法人
宁波鹏灏投资合伙企业（有限合伙）	52,500,000	10.92	0	质押	52,500,000	境内非国有法人
陈红朝	49,195,500	10.23	0	无		境内自然人
宁波泛美投资管理有限公司	42,168,000	8.77	0	质押	42,168,000	境内非国有法人
宁波禾乐投资股份有限公司	40,488,000	8.42	40,488,000	质押	4,300,000	境内非国有法人
翁江宏	6,491,400	1.35	6,384,000	无		境内自然人
宁波太平鸟时尚服饰股份有限公司回购专用证券账户	5,525,822	1.15	0	无		境内非国有法人
香港中央结算有限公司	2,187,339	0.45	0	无		境外法人
张江平	1,872,200	0.39	0	无		境内自然人
全国社保基金四一四组合	1,705,249	0.35	0	无		其他

前十名无限售条件股东持股情况			
股东名称	持有无限售条件流通股的数量	股份种类及数量 种类	数量
宁波鹏灏投资合伙企业（有限合伙）	52,500,000	人民币普通股	52,500,000
陈红朝	49,195,500	人民币普通股	49,195,500
宁波泛美投资管理有限公司	42,168,000	人民币普通股	42,168,000
宁波太平鸟时尚服饰股份有限公司回购专用证券账户	5,525,822	人民币普通股	5,525,822
香港中央结算有限公司	2,187,339	人民币普通股	2,187,339
张江平	1,872,200	人民币普通股	1,872,200
全国社保基金四一四组合	1,705,249	人民币普通股	1,705,249
陈静波	1,178,100	人民币普通股	1,178,100
宁波鹏源资产管理有限公司	1,025,600	人民币普通股	1,025,600
恒达高投资有限公司	1,000,000	人民币普通股	1,000,000
上述股东关联关系或一致行动的说明	上述股东中，公司控股股东太平鸟集团有限公司由公司实际控制人张江平先生、张江波先生控制，宁波鹏灏投资合伙企业（有限合伙）系太平鸟集团有限公司控制的有限合伙企业，宁波泛美投资管理有限公司、宁波鹏源资产管理有限公司系太平鸟集团有限公司控制的公司，太平鸟集团有限公司系宁波禾乐投资股份有限公司第一大股东。		
表决权恢复的优先股股东及持股数量的说明	不适用		

注：翁江宏与太平鸟集团有限公司实际控制人张江平、张江波兄弟表兄弟关系。

2.3 截止报告期末的优先股股东总数、前十名优先股股东、前十名优先股无限售条件股东持股情况表

□适用 √不适用

三、重要事项

3.1 公司主要会计报表项目、财务指标重大变动的情况及原因

√适用 □不适用

（1）主要会计报表项目、财务指标重大变动的情况及原因

单位：元　币种：人民币

项目名称	本报告期末	上年度末	变动比例（%）	说明
货币资金	378,169,082.69	648,233,776.56	-41.66	主要为支付货款、年终奖金及税费等
应收票据及应收账款	418,013,247.19	590,024,860.88	-29.15	主要为18冬商场及加盟商货款收回
应付票据及应付账款	1,136,417,116.12	1,638,844,936.54	-30.66	主要为支付供应商18冬货款
预收款项	215,122,700.00	125,217,685.25	71.80	主要为预收加盟商货款增加
应付职工薪酬	114,684,018.59	256,261,456.68	-55.25	主要为支付年终奖金
应交税费	82,787,042.66	308,175,250.17	-73.14	主要为本期收入及利润相比上年第四季度减少，导致企业所得税及增值税减少
项目名称	本报告期	上年同期	变动比例（%）	说明
其他收益	63,479,904.74	29,428,965.97	115.71	主要为政府补助比同期增加
资产处置损益	-3,515.14	30,746,744.35	-100.01	主要为上期因宜昌制造转让资产产生较大收益，本期未发生重大资产处置
经营活动产生的现金流量净额	-270,566,589.88	-113,263,473.02	不适用	主要为支付职工薪酬、税费增加
投资活动产生的现金流量净额	127,376,028.30	-47,710,980.47	不适用	主要为理财产品投资净流入增加
筹资活动产生的现金流量净额	-118,431,267.25	44,876,673.94	-363.90	主要为归还借款及回购股份流出增加

（2）主营业务经营情况

①报告期内分行业情况

单位：元　币种：人民币

行业	营业收入	营业成本	毛利率（%）	营业收入比上年增减（%）	营业成本比上年增减（%）	毛利率比上年增减（%）
服饰运营	1,642,452,550.45	696,503,509.68	57.59	-4.40	-9.25	2.27
服饰制造及其他	3,849,479.19	2,787,173.82	27.60	-33.23	-6.25	-20.84
合计	1,646,302,029.64	699,290,683.50	57.52	-4.50	-9.24	2.22

②报告期内分品牌盈利情况

品牌	营业收入	营业成本	毛利率（%）	营业收入比上年增减（%）	营业成本比上年增减（%）	毛利率比上年增减（%）
PEACEBIRD 女装	578,528,605.09	229,319,910.26	60.36	-2.96	-14.97	5.60
PEACEBIRD 男装	580,162,520.69	242,168,321.09	58.26	-11.64	-4.65	-3.06
乐町LEDIN 女装	213,707,369.57	105,044,368.48	50.85	12.07	1.02	5.37
MiniPeace 童装	209,283,401.02	90,702,897.21	56.66	-3.32	-16.05	6.58
其他	60,770,654.08	29,268,012.64	51.84	4.54	-8.08	6.61
合计	1,642,452,550.45	696,503,509.68	57.59	-4.40	-9.25	2.27

注：其他主要包括MATERIAL GIRL女装、贝甜童装和町家居等。

③报告期内直营店和加盟店的盈利情况

单位：元　币种：人民币

门店类型	营业收入	营业成本	毛利率（%）	营业收入比上年增减（%）	营业成本比上年增减（%）	毛利率比上年增减（%）
直营店	872,669,192.40	296,407,477.98	66.03	-0.81	0.05	-0.29
加盟店	312,484,749.24	132,788,194.90	57.51	-17.45	-23.90	3.60
联营店	1,921,062.51	1,573,015.01	18.12	-39.41	-54.50	27.15
合计	1,187,075,004.15	430,768,687.88	63.71	-5.90	-9.16	1.30

注：公司现有联营店为贝甜童装联营店。

④报告期内线上、线下销售渠道的盈利情况

单位：元　币种：人民币

销售渠道	营业收入	营业成本	毛利率（%）	营业收入比上年增减（%）	营业成本比上年增减（%）	毛利率比上年增减（%）
线下销售	1,187,075,004.15	430,768,687.88	63.71	-5.90	-9.16	1.30
线上销售	455,377,546.30	265,734,821.80	41.65	-0.26	-9.41	5.90
合计	1,642,452,550.45	696,503,509.68	57.59	-4.40	-9.25	2.27

报告期末实体门店情况

2019年第一季度，公司结合宏观经济形势和市场变化，不断优化"新四轮立体驱动"的渠道布局，重点关注门店盈利能力的提升和经营质量的改善。本报告期公司门店新开直营店54家，加盟店66家；关闭直营店20家，加盟店186家；净开-86家。截止本报告期末，公司的线下门店数量为4,508家。

3.2 重要事项进展情况及其影响和解决方案的分析说明

√适用 □不适用

公司于2017年8月28日召开第二届董事会第十二次会议、2017年9月13日召开2017年第三次临时股东大会，审议通过了《关于购买朝里中心商铺及办公楼暨关联交易的议案》，同意公司以25,571.00万元人民币购买宁波鹏源物产控股有限公司开发的朝里中心部分商铺、办公楼及配套车位，其中自有资金13,968.00万元购买办公楼、车位，募集资金11,603.00万元购买商铺，具体内容请见公司于指定媒体及上海证券交易所网站披露的公告2017-042。截至本报告期末，上述交易合同双方均已签署，公司已支付朝里中心商铺、办公楼及车位交易款项24,821.00万元，上述朝里中心部分商铺及办公楼尚未完成交付。

3.3 报告期内超期未履行完毕的承诺事项

□适用 √不适用

3.4 预测年初至下一报告期期末的累计净利润可能为亏损或者与上年同期相比发生重大变动的警示及原因说明

□适用 √不适用

公司名称	宁波太平鸟时尚服饰股份有限公司
法定代表人	张江平
日期	2019年4月30日