



金鹰添惠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：广州农村商业银行股份有限公司

## 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]2481 号文注册募集。募集期间为 2017 年 3 月 6 日至 2017 年 3 月 7 日，募集规模为 200,001,982.04 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 3 月 10 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、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。除非另有说明，本招募说明书所载内容截止日为 2017 年 9 月 10 日，有关财务数据截止日为 2017 年 6 月 30 日，净值表现截止日为 2017 年 6 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：广东省珠海市香洲区水湾路 246 号 3 栋 2 单元 3D 房

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：刘岩

设立日期：2002 年 12 月 25 日

联系电话：020-83282855

联系人：潘晓毅

注册资本：人民币 2.5 亿元

股权结构：

发起人名称	出资额（万元）	出资比例
广州证券股份有限公司	12250	49%
广州白云山医药集团股份有限公司	5000	20%
美的集团股份有限公司	5000	20%
东亚联丰投资管理有限公司	2750	11%
总计	25000	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

凌富华先生，董事，经济学学士、会计师，历任苏州航空工业部长风机械总厂财务处会计、广州大同精密机械有限公司会计部经理，广西北海国际信托投资公司所属城市信用社、营业部、信贷部经理助理，香港大同机械企业有限公司驻国内企业会计主任，广东省联谊信诚贸易有限公司财务部经理，长城证券有限责任公司广州营业部财务经理、总部财务中心综合部经理、广州营业部拟任总经理，

广州恒运企业集团股份有限公司财务部副经理、财务部经理兼任财务负责人、财务总监兼任财务负责人，广州证券有限责任公司财务总监兼任财务负责人。现任广州证券股份有限公司副总裁兼任财务总监、财务负责人。经公司第五届董事会第五次会议决议通过，并经中国证券监督管理委员会证监许可[2014]1401号核准，自2015年1月起，担任金鹰基金管理有限公司董事长。

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7日至今，担任金鹰基金管理有限公司总经理。

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合规总监。

黄雪贞，董事，英语语言文学硕士，经济师职称。曾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、证券事务代表等职。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、董事会秘书。

江鹏先生，董事，会计学硕士。江鹏先生自2000年9月参加工作后，先后在广东肇庆星湖生物科技股份有限公司、广东美的电器股份有限公司等担任董事会秘书职务，现任美的集团股份有限公司董事会秘书。

温婉容女士，董事，商科毕业。曾任德盛安联资产管理香港有限公司市场及传媒经理、景顺投资管理亚洲有限公司副总裁、德意志资产管理（香港）有限公司区域销售总监、Societe Generale Asset Management Asia Ltd.高级副总裁、德盛安联资产管理香港有限公司行政总裁、香港财务策划师学会行政总裁等职。2011年7月加入东亚联丰投资管理有限公司，现任东亚联丰投资管理有限公司行政总裁。

殷孟波先生，独立董事。西南财经大学金融学博士。历任西南财经大学金融学院院长、研究生部主任等职务，现任西南财经大学金融学院教授委员会主席。

刘国常先生，独立董事，管理学（会计学）博士、教授、博士生导师，曾在郑州航空工业管理学院、暨南大学管理学院任教。现任广东财经大学会计学院教

授，兼任暨南大学管理学院博士生导师、广东省审计学会副会长、广州市审计学会副会长以及上市公司东凌国际、粤传媒、博济医药、道氏技术的独立董事。

谢石松先生，独立董事，法学博士、教授，历任广州中山大学法学院讲师、副教授，现任中山大学法学院教授，国际法研究所所长。兼任武汉大学法学院、西北政法大学兼职教授，中国国际私法学会副会长；中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员及专家咨询委员会委员，华南国际经济贸易仲裁委员会、上海国际经济贸易仲裁委员会仲裁员，上海、海南、广州、长沙、深圳、厦门、珠海、佛山、肇庆、惠州等仲裁委员会仲裁员以及上市公司艾派克、威创股份、省广股份、阳普医疗的独立董事。

## （2）监事会成员

姚志智，监事，党校本科学历，硕士学位，会计师、经济师职称，高级国际财务管理师、企业法律顾问职业资格。现任广州白云山医药集团股份有限公司财务副总监、财务部部长，广州百特侨光医疗用品有限公司监事，广州医药海马品牌整合传播有限公司监事。

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。

曾长兴先生，副总经理，博士研究生。2004年9月至2006年10月在广东证券公司（原）任研究员职务，2006年10月至2010年5月担任安信证券股份有限公司分析师，2010年5月至2011年10月担任国联安基金管理有限公司产品开发部总监，2011年11月加入金鹰基金管理有限公司，历任产品研发部总监、总经理助理等职务。经公司第五届董事会第二十五次会议审议通过，并已按规定报中国证券投资基金业协会备案，2016年5月12日起担任公司副总经理。

李云亮先生，督察长，博士研究生。先后于重庆理工大学、中国证监会重庆监管局任职，历任西南证券股份有限公司证券资管部总经理、金鹰基金管理有限公司副总经理等职。经第五届董事会第四十七次会议审议通过，报中国证券投资基金业协会备案，于 2017 年 9 月 13 日起任公司督察长。

陈瀚先生，副总经理，董事会秘书，工商管理硕士。1996年6月至2003年6月在湖南省技术进出口股份有限公司任业务经理，2005年6月至2014年9月历任广州越秀集团有限公司审计部主办、办公室高级主管、发展部高级经理，2014年10月加入金鹰基金管理有限公司，任总经理助理、董事会秘书等职务。经公司第五届董事会第四十次会议审议通过，并已按规定报中国证券投资基金业协会备案，2017年6月28日起担任公司副总经理。

### 3、基金经理

刘丽娟女士，中南财经政法大学工商管理硕士，历任恒泰证券股份有限公司交易员，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，任固定收益部总监。现任金鹰货币市场证券投资基金、金鹰添益纯债债券型证券投资基金、金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）、金鹰灵活配置混合型证券投资基金、金鹰元安混合型证券投资基金、金鹰元丰保本混合型证券投资基金、金鹰元祺保本混合型证券投资基金、金鹰元和保本混合型证券投资基金、金鹰添利中长期信用债债券型证券投资基金、金鹰添享纯债债券型证券投资基金、金鹰现金增益交易型货币市场基金、金鹰添荣纯债债券型证券投资基金、金鹰添惠纯债债券型证券投资基金、金鹰民丰回报定期开放混合型证券投资基金基金经理。

### 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；

曾长兴先生， 投资决策委员会委员， 副总经理；

冯俊先生， 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；

于利强先生，投资决策委员会委员，研究部总监，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；

曾长兴先生，权益投资决策委员会委员，副总经理；

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；

陈立先生， 权益投资决策委员会委员，基金经理。

## （3）固定收益投资决策委员会

刘岩先生， 固定收益投资决策委员会主席， 总经理；

曾长兴先生，固定收益投资决策委员会委员，副总经理；

冯俊先生， 固定收益投资决策委员会委员， 总经理助理

刘丽娟女士，固定收益投资决策委员会委员，固定收益部总监，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

### （一）基金托管人基本情况

#### 1、基本情况

名称：广州农村商业银行股份有限公司（简称：广州农村商业银行）

住所：广州市天河区珠江新城华夏路 1 号

办公地址：广州市天河区珠江新城华夏路 1 号

成立时间：2006 年 10 月 27 日

注册资本：81.53 亿元人民币

存续期间：持续经营

法定代表人：王继康

资产托管业务资格批准文号：证监许可[2014]83 号

联系人：杨华

电话：（020）28019492

传真：（020）28019340



### 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：广东省珠海市香洲区水湾路 246 号 3 栋 2 单元 3D 房

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：2.5 亿元人民币

存续期间：持续经营

客户服务中心电话：020-83936180、4006135888

电话：020-83282950

传真：020-83283445

联系人：潘晓毅

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

##### 2、代销机构：

###### (1) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：浦东新区峨山路 613 号 6 幢 551 室

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼

法定代表人：其实

联系人：潘世友

电话：021-54509998

客服电话：400-1818-188

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

(2) 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：张佳琳

联系电话：021-20691831

客服电话：400-820-2899

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

(3) 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

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

(4) 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

联系电话：010-59013707

客服电话：010-59013825

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

(5) 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

网址：<http://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，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：广东省珠海市香洲区水湾路 246 号 3 栋 2 单元 3D 房

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、唐明、张建华

(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]2481 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 7 日，募集规模为 200,001,982.04 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

本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，在基金募集份额总额不少于 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 人的条件下，基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

### （二）基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息；
- 3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

### （三）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，则自动终止基金合同并进入基金财产的清算程序，无须召开基金份额持有人大会审议。法律法规或中国证监会另有规定时，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。在发生巨额赎回或本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。

基金销售机构对申购、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，本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本基金时，赎回最低份额为 10 份，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、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
$T < 3$ 个月	0.10%
$T \geq 3$ 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。）

基金赎回费总额的 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。

（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：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日基金份额净值}$$

2) 申购费用采用固定金额时：

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} - \text{申购费用}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日基金份额净值}$$

3、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：

$$\text{净申购金额} = 100,000 / (1 + 0.80\%) = 99,206.35 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 100,000 - 99,206.35 = 793.65 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 99,206.35 / 1.0500 = 94,482.24 \text{ 份}$$

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：

$$\text{申购费用} = 1,000.00 \text{ 元}$$

$$\text{净申购金额} = 5,000,000.00 - 1,000.00 = 4,999,000.00 \text{ 元}$$

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。

#### 4、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：某投资者赎回本基金 10,000 份，持有期为两个月，则对应的赎回费率为 0.10%，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=10,800×0.10%=10.80 元

净赎回金额=10,800-10.80=10,789.20 元

即：该投资者赎回本基金 10,000.00 份，持有期为两个月，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 10,789.20 元。

例：某投资者赎回本基金 10,000.00 份，持有期为二年，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，持有期为二年，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

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，基金管理人可暂停接受

投资者的申购申请。

3、证券、期货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，从而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、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。

7、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 项暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资者。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。

#### （九）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，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，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。

3、证券、期货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、继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时。

6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，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，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付，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并公告。

#### (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)超过前一开放日的基金总份额的 10%，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) 部分延期赎回：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，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10% 的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资者在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资者在提交赎回申请时未作明确选择，投资者未能赎回部分作自动延期赎回处理。

(3) 暂停赎回：连续 2 日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。

##### 3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，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 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上刊登公告。

#### （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，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。

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》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。

#### （十四）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扣款金额，每期扣款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%。

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%；

(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) 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 个工作日内进行调整（除（9）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、投资策略应当符合本基金合

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) 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 2017 年 6 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

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比
----	----	----	----------

			例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	195,735,000.00	75.23
	其中：债券	195,735,000.00	75.23
	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	49,970,194.96	19.20
	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	13,052,193.25	5.02
7	其他各项资产	1,440,352.38	0.55
8	合计	260,197,740.59	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

本基金本报告期内未进行股票投资。

### (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投资股票。

## 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,904,000.00	9.83
	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	-	-
8	同业存单	175,831,000.00	86.86
9	其他	-	-
10	合计	195,735,000.00	96.70

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	111708171	17 中信银行 CD171	400,000.00	39,552,000.00	19.54
2	111719155	17 恒丰银行 CD155	400,000.00	39,548,000.00	19.54
3	1720011	17 南京银行绿色金融 01	200,000.00	19,904,000.00	9.83
4	111709212	17 浦发银行 CD212	100,000.00	9,888,000.00	4.88
5	111798413	17 厦门农商行 CD059	100,000.00	9,882,000.00	4.88

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

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,440,352.38
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,440,352.38

(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3月10日，基金合同生效以来（截至2017年6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
自基金合同生效至今	1.21%	0.02%	-0.62%	0.06%	1.83%	-0.04%

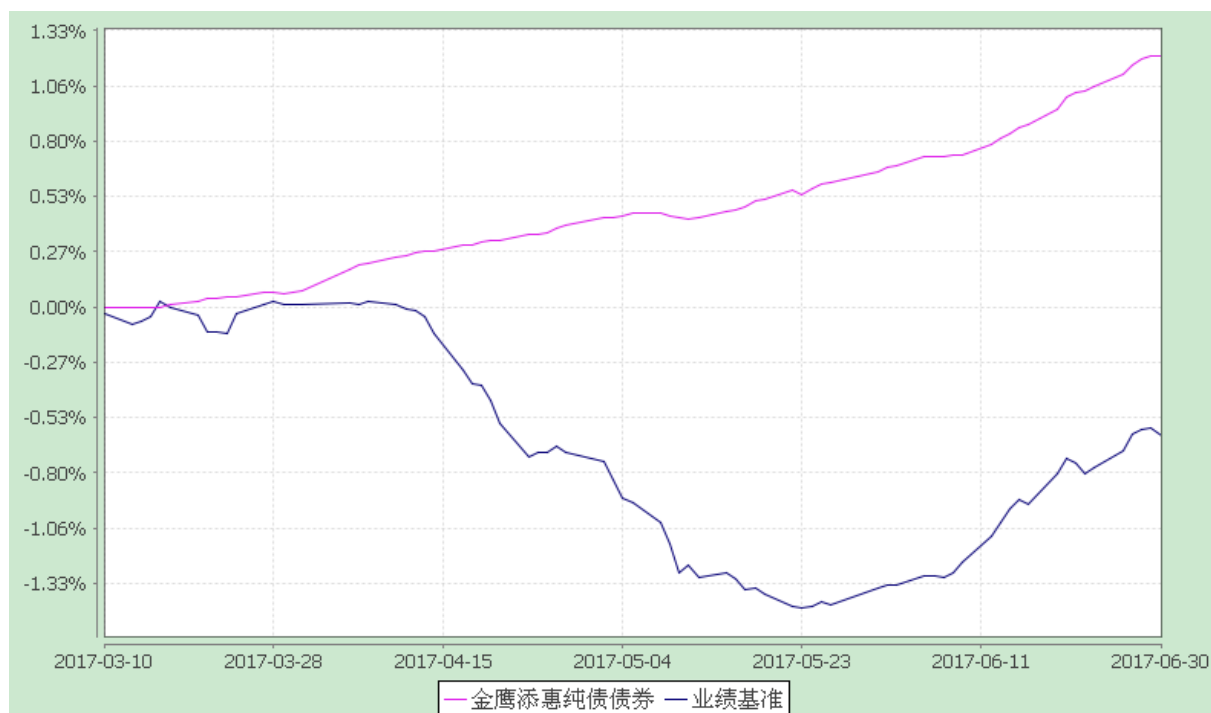
注：本基金业绩比较基准是：中债综合（全价）指数收益率\*80%+一年期定期存款利率（税后）\*20%。

（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

金鹰添惠纯债债券型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2017年3月10日至2017年6月30日）



注：（1）本基金合同于 2017 年 3 月 10 日生效。（2）本基金的投资比例是：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不低于基金资产的 5%。（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的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，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

投资者的现金红利小于一定金额，不足于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、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。以下是主要的服务内容，基金管理人将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### （一）基金份额持有人资料寄送

#### 1、账户确认书

根据客户的需要，为客户寄送开放式基金账户确认书。

#### 2、对账单

基金投资者对账单包括月度、季度与年度对账单。

对账单在每月/季/年度结束后的 15 个工作日内向定制该服务的基金份额持有人以电子方式提供。

如投资者需要重置寄送方式或寄送频率，请致电本公司客服中心或登陆公司网站。

#### 3、其他相关的信息资料

介绍公司最新动态、投资运作、新产品、国内外金融市场动态和投资机会等。

### （二）网络在线服务

通过本基金管理人网站的留言板和客户服务信箱，投资者可以实现在线咨询、投诉、建议和寻求各种帮助。

基金管理人网站提供了基金公告、投资资讯、理财刊物、基金常识等各种信息，投资者可以根据各自的使用习惯非常方便的自行查询或信息定制。

基金管理人网站将为投资者提供基金账户查询、交易明细查询、对账单寄送方式或频率设置、修改查询密码等服务。

公司网址：<http://www.gefund.com.cn>

电子信箱：[csmail@gefund.com.cn](mailto:csmail@gefund.com.cn)

### （三）信息定制服务

基金管理人还可为基金投资者提供通过基金管理人网站、客户服务中心提交信息定制申请，基金管理人通过手机短讯、E-MAIL 和公司微信平台定期为客户发送所定制的信息，内容包括：每笔交易确认查询、每月账户余额与损益查询、最近季度的基金投资组合、分红提示、公司最新公告、新产品信息披露、基金净

值查询等。

#### （四）网上交易服务

投资者可通过销售机构网站办理申购、赎回等交易及进行信息查询。投资者也可通过基金管理人网上直销平台（网址：<http://www.gefund.com.cn>）办理开户、认购、申购、赎回等业务。投资者在选用网上交易服务之前，请向相关机构咨询。

#### （五）客户服务中心（CALL-CENTER）电话服务

呼叫中心自动语音系统提供 7×24 小时交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息查询。

呼叫中心人工座席每个交易日 9:00-17:00 为投资者提供服务，投资者可以通过该热线获得业务咨询，信息查询，服务投诉，信息定制，资料修改等专项服务。

客服电话：020-83936180、4006-135-888

传真：020-83282856

#### （六）投诉受理

投资者可以拨打金鹰基金管理有限公司客户服务中心电话或以书信、电子邮件等方式，对基金管理人和销售网点所提供的服务进行投诉。

对于工作日期间受理的投诉，以“及时回复”为处理原则，对于不能及时回复的投诉，基金管理人承诺在 2 个工作日之内对投资者的投诉做出回复。对于非工作日提出的投诉，基金管理人将在顺延的工作日当日进行回复。

（七）如本招募说明书存在任何您 / 贵机构无法理解的内容，可通过上述方式联系本公司。请确保投资前，您 / 贵机构已经全面理解了本招募说明书。

## 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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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》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，对前期刊登的《金鹰添惠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，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，及内控体系完善信息。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) 增加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（八）基金投资组合报告，第十部分基金的业绩；
- (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。详见第二十二部分其它应披露事项；
- (7) 根据修改重新编排各章节的编号。

金鹰基金管理有限公司

2017 年 10 月 24 日