

金鹰添盈纯债债券型证券投资基金

2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：二〇二〇年八月二十九日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|---|----|
| § 1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| 1.2 目录 | 3 |
| § 2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 5 |
| 2.4 信息披露方式 | 6 |
| 2.5 其他相关资料 | 6 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| § 4 管理人报告 | 8 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 8 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 9 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 9 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 10 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 11 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 13 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 | 13 |
| § 5 托管人报告 | 13 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 13 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 13 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 | 13 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 14 |
| 6.1 资产负债表 | 14 |
| 6.2 利润表 | 15 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 | 16 |
| 6.4 报表附注 | 17 |
| § 7 投资组合报告 | 35 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 35 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 35 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 | 36 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 36 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 36 |
| 7.6 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 | 36 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 | 37 |
| 7.8 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贵金属投资明细 | 37 |
| 7.9 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 | 37 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 37 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 37 |

| | |
|---|-----------|
| 7.12 本报告期投资基金情况..... | 37 |
| 7.13 投资组合报告附注..... | 38 |
| § 8 基金份额持有人信息..... | 39 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 39 |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人..... | 39 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 39 |
| 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况..... | 39 |
| 8.5 发起式基金发起资金持有份额情况..... | 40 |
| § 9 开放式基金份额变动..... | 40 |
| § 10 重大事件揭示..... | 40 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 40 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动..... | 40 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 40 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 40 |
| 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件..... | 41 |
| 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 41 |
| 10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况..... | 41 |
| 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 41 |
| 10.9 其他重大事件..... | 42 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 44 |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况..... | 44 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 45 |
| § 12 备查文件目录..... | 45 |
| 12.1 备查文件目录..... | 45 |
| 12.2 存放地点..... | 45 |
| 12.3 查阅方式..... | 45 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|-----------------|
| 基金名称 | 金鹰添盈纯债债券型证券投资基金 |
| 基金简称 | 金鹰添盈纯债债券 |
| 基金主代码 | 003384 |
| 交易代码 | 003384 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2017 年 1 月 11 日 |
| 基金管理人 | 金鹰基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,541,513.37 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 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。 |
| 投资策略 | <p>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。</p> <p>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。</p> |
| 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% |
| 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。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|-------------|------|----------------------|-------------------|
| 名称 | | 金鹰基金管理有限公司 | 交通银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 徐娇娇 | 陆志俊 |
| | 联系电话 | 020-83936180 | 95559 |
| | 电子邮箱 | csmail@gefund.com.cn | luzj@bankcomm.com |

| | | |
|--------|--------------------------------|-----------------------|
| 客户服务电话 | 4006135888 | 95559 |
| 传真 | 020-83282856 | 021-62701216 |
| 注册地址 | 广东省广州市南沙区滨海路171号11楼自编1101之一J79 | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号 |
| 办公地址 | 广州市天河区珠江东路28号越秀金融大厦30层 | 中国（上海）长宁区仙霞路18号 |
| 邮政编码 | 510623 | 200336 |
| 法定代表人 | 王铁 | 任德奇 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《中国证券报》 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | http://www.gefund.com.cn |
| 基金中期报告备置地点 | 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 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------|----------------------------|
| 注册登记机构 | 金鹰基金管理有限公司 | 广州市天河区珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期（2020年1月1日至2020年6月30日） |
|---------------|---------------------------|
| 本期已实现收益 | 71,778.43 |
| 本期利润 | 61,909.91 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0146 |
| 本期加权平均净值利润率 | 1.38% |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.54% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2020年6月30日) |
| 期末可供分配利润 | 135,855.09 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0535 |
| 期末基金资产净值 | 2,677,368.46 |
| 期末基金份额净值 | 1.0535 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2020年6月30日) |

| | |
|-------------|--------|
| 基金份额累计净值增长率 | 18.27% |
|-------------|--------|

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额；

2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

3、期末可供分配利润，指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | -0.60% | 0.13% | -0.72% | 0.10% | 0.12% | 0.03% |
| 过去三个月 | -0.43% | 0.13% | -0.75% | 0.10% | 0.32% | 0.03% |
| 过去六个月 | 1.54% | 0.12% | 0.79% | 0.09% | 0.75% | 0.03% |
| 过去一年 | 3.89% | 0.09% | 1.81% | 0.07% | 2.08% | 0.02% |
| 过去三年 | 15.55% | 0.06% | 5.42% | 0.06% | 10.13% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 18.27% | 0.06% | 3.82% | 0.06% | 14.45% | 0.00% |

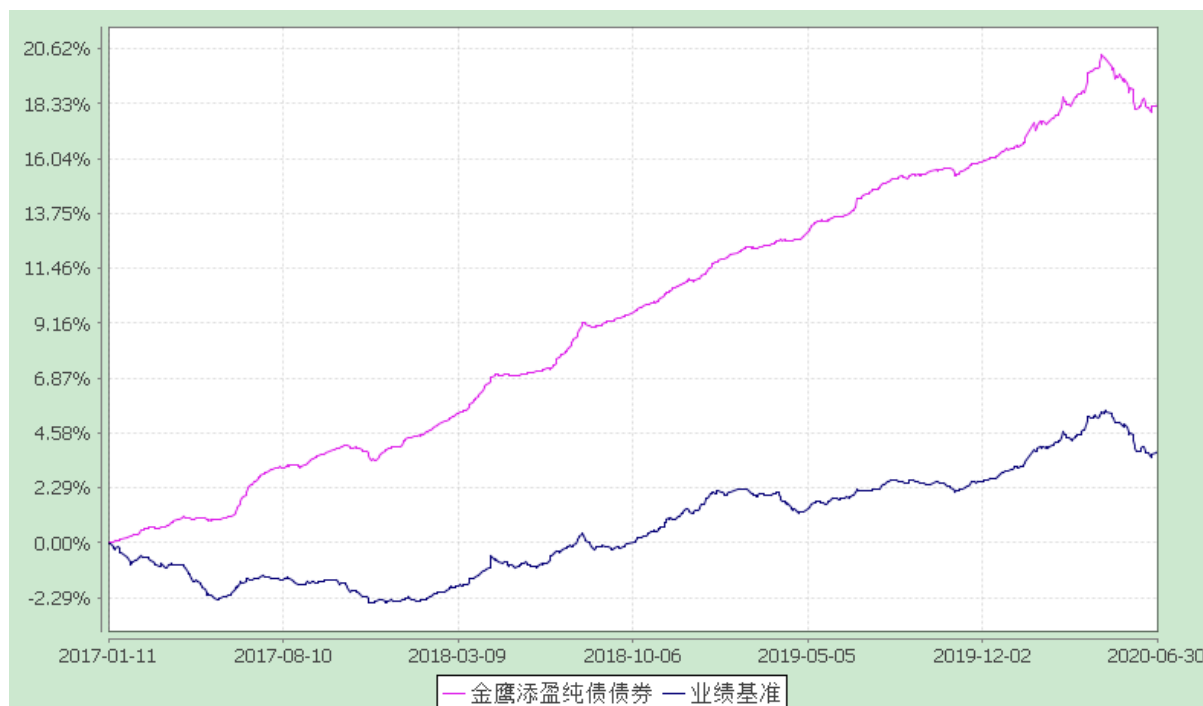
注：本基金业绩比较基准是：中债综合（全价）指数收益率*80%+一年期定期存款利率（税后）*20%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

金鹰添盈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1月11日至2020年6月30日）



注：（1）截至本报告期末，本基金的各项投资比例已符合基金合同约定。

（2）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%

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基字[2002]97号文批准，金鹰基金管理有限公司于2002年12月25日成立。2011年12月公司获得特定客户资产管理计划业务资格，2013年7月子公司——广州金鹰资产管理有限公司成立。2015年12月，获得受托管理保险资金投资管理人资格。

“以人为本、互信协作；创新谋变、挑战超越”是金鹰人的核心价值观。公司坚持价值投资为导向，着力打造高水准的投研团队，努力为投资者创造丰厚回报。金鹰基金拥有一支经验丰富，风格多元的投资团队。

公司秉承开放、包容、多元的投资文化，采取基金经理负责制，将产品契约与基金经理风格有机结合，鼓励基金经理个人风格的充分展现，强化产品投资风格的稳定性，逐步形成了风险收益特征多元，投资研究体系有机互补的整体投研平台和基金产品线。截至报告期末，合计管理公募基金46支。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的 基金经理（助 理）期限 | | 证券 从业 年限 | 说明 |
|-----|----------|-------------------------|----------|----------------|--|
| | | 任职 日期 | 离任 日期 | | |
| 黄倩倩 | 本基金的基金经理 | 2018-07-07 | - | 8 | 黄倩倩女士，西南财经大学金融学硕士研究生，历任广州证券股份有限公司资产管理总部债券交易员，2014年11月加入金鹰基金管理有限公司，担任固定收益部债券交易员、基金经理助理，现任固定收益部基金经理。 |

注：1、任职日期和离任日期指公司公告聘任或解聘日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》和其他有关法律法规及其各项实施准则、《金鹰添盈纯债债券型证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无出现重大违法违规或违反基金合同的行为，无损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现。同时通过投资交易系统内的公平交易功能执行交易，以尽可能确保公平对待各投资组合。

报告期，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年以来，受新冠肺炎疫情影响，大部分行业 2 月处于停工状态；3 月以后，国内疫情得到有效控制，各大企业开始陆续复工复产，国内 GDP 一季度呈负增长，同比下降 6.8%；随着逆周期政策的加码，企业复产速度加快，国内宏观经济从二季度开始逐步缓慢修复，整体经济基本上半年呈 V 形走势。生产端，工业增加值同比从 4 月恢复正增长，并在 5 月回升至 4.4%，表现较好。内需方面，土地成交景气度在 3 月开始率先回升，地产销售面积低位反弹，带动地产投资逐步回升；基建投资方面，受益于财政政策的发力也表现抢眼；制造业投资受库存积压和盈利不足等影响表现较弱。外需方面，3 月海外疫情爆发并持续恶化，防疫物资出口创历史新高，对出口构成支撑；二季度海外陆续复工复产，订单量弱回升，出口表现超预期。通胀方面，食品项，受春节因素和疫情所带来的农产品产销秩序受阻的叠加影响，CPI 食品方面 1、2 月都保持在 5 以上的高位，3 月以后随天气转暖以及农产品产销秩序恢复等利好因素影响逐步回落；非食品项，国际原油价格受海外疫情影响急速大跌，月均价格环比下跌幅度最高达 40%左右，后缓慢回升，仍处于低位空间。PPI 方面，受疫情影响，大宗商品价格继续下行，南华工业品指数持续下滑，PPI 呈现一定程度的负增长；二季度大宗商品价格回升，而 PPI 表现滞后，依然处于筑底期。汇率方面，前期受美国流动性恐慌的影响，美元指数飙升；叠加美国重启对华为制裁等事件，造成人民币兑美元短期贬值，后美国宣布取消对华为更为严厉制裁，加之国内经济逐步企稳，人民币逐步回升。

货币政策方面，为应对疫情对经济的负面影响，全球呈现降准降息格局，央行上半年也实施了更加积极的货币政策，前后三次定向降准并下调了 OMO 利率。1 月 1 日下午，央行便公布了今年以来的第一个利好，将于 1 月 6 日下调金融机构存款准备金率 0.5%，约释放长期资金 8000 多亿元。为应对春节提现压力和企业所得税缴税期，央行又多次通过 OMO 释放流动性。新冠肺炎疫情之后，3 月 16 日，央行再次实施普惠金融定向降准，对达到考核标准的银行定向降准 0.5 至 1 个百分点，另对符合条件的股份制商业银行再额外定向降准 1 个百分点，支持发放普惠金融领域贷款，共释放长期资金 5500 亿元左右。3 月 30 日，央行重启公开市场逆回购操作，并下调公开市场 7 天逆回购利率 20bp，降幅创 2015 年来新高。4 月 3 日央行公告于 2020 年 4 月 15 日和 5 月 15 日分两次对中小银行定向降准，每次下调 0.5 个百分点，共释放资金约 4000 亿元；并于 4 月 7 日下调金融机构在央行超额存款准备金利率 37 个基点至 0.35%。5 月，鉴于资金面有所收紧，央行于 5 月底重启公开市场操作，主要以开展 7 天逆回购为主，累计释放了 6700 亿资金，但价格尚未调降，略超预期。

债券市场上半年总体表现呈 V 型态势。1-4 月受疫情带来的市场风险偏好降低叠加货币政策放

松的利好，债券收益率震荡下行，10 年国债总体下行 65bp 左右。受新冠疫情先后于国内外爆发并蔓延的影响，市场风险偏好下行，全球呈降准降息格局，美股大跌，美国十年国债持续下行，债券收益率陆续下行约 55bp 左右，从 3.1% 下行到 2.52%；3 月 9 日晚间，美股首次熔断，随后两周内陆续再熔断了 3 次；市场的恐慌情绪蔓延到极致，对于流动性危机的担忧引发作为避险资产的债券、黄金和日元等资产跟随大跌，除美元以外的资产表现一片狼藉；加之国内市场对央行的降准预期迟迟未到，国内债券收益率跟随上行。为应对流动性危机，美国陆续购买 5000 亿美元的美债和 2000 亿美元的 MBS、2 万亿美元刺激计划等一系列积极的货币政策，而市场均未买单继续狂跌；直到 3 月中旬美国通过无限量 QE 草案，市场流动性危机有所缓解，避险资产反弹，债券收益开始向下回调，期间振幅最大 10bp 左右。4 月 3 日闭市后，央行公告对中小银行实施定向降准 100bp，并将超额准备金率从 0.72% 下调至 0.35%，超额准备金率的下调超出市场预期，长短端集体下行，1 年国开下行 40bp，10 年国开下行 10bp，曲线依然陡峭。到 5 月开始呈现震荡上行的格局，主要系货币政策未能进一步宽松略超市场预期，叠加前期债券下行过多回调的因素，10 年国债转而上行约 25bp 左右；短端从 5 月下旬开始亦随资金面的收紧而逐步上行，1 年利率较 4 月末上行 20bp 左右，1 年国股存单上行 20bp 左右。6 月市场延续纠结态势，央行反复放话“将进一步降准，引导实体经济融资成本降低”，给予了市场期望却又迟迟未兑现；加之特别国债和专项债的集中发行让供给端承压，10 年国开进一步大幅上行，最高上行 20bp 有余，后小幅回调 5bp 左右。整个二季度长端利率债上行约 35bp，200210 季末收于 3.15 左右，已回到今年降准前的位置。

上半年我们维持利率债为主要配置的策略不变，待疫情状况有所好转择机卖出落袋为安；而海外疫情蔓延所带来的极度恐慌情绪连累避险资产下跌，本基金再次买入了部分做交易，充分享受了宽松货币政策所带来的投资收益，增厚了组合回报；二季度再逐步降低仓位，以短久期利率债为主，维持一定票息的同时弱化波动，在保障流动性安全的前提下提高收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金截至 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0535 元，本报告期份额净值增长 1.54%，同期业绩比较基准增长率为 0.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观经济将延续渐进式修复，疫情可能反复的不确定性依旧对生产活动和生活带来一定制约，经济修复速度仍存在一定不确定性。从投资方面来看，基建投资方面，地方政府债的发行以及基建信托的规模逐渐增大，对基建投资增速构成支撑，下半年或将继续大幅上行；总地产投资方面，地产销售该季度以来保持着较好的增速，加之土地购置费或将持续回升，对地产投资构

成短期支撑，“住房不炒”和“因城施策”的原则或对后续地产投资增速的持续回升构成制约；制造业投资预计修复较弱，主要归因于国内经济的不确定性犹存，政策支持力度也并未显著增大，叠加需求较弱，企业主动补库存意向较弱。进出口方面，随着海外陆续复工复产以及疫情持续恶化，医疗物资出口仍然较多，叠加之前出口订单和供给的转移，出口或保持较好增速；而进口方面主要受海外供给不足所拖累，总体或将延续贸易顺差的态势。CPI 方面，受暴雨天气的持续影响，蔬菜肉等价格或将有所抬升，影响食品项方面短期内或将走高；而非食品项方面，则主要受油价企稳的影响而不再下跌，总体通胀将小幅抬升。PPI 方面，虽然 5 月较 4 月有所回落，但随着油价大幅走高及黑色等工业品价格回升等，PPI 跌幅后续或将明显收窄，并将保持上行趋势。货币政策方面，为配合财政政策更快更好的修复实体经济，货币政策难言退出之时；但为避免资金淤积非实体空转套利，货币政策总体将保持中性，短期内更进一步的宽松政策难见。但若三季度经济修复速度难以为继，央行进一步宽松的政策仍然可期。

综合以上分析，本基金依然保持短期谨慎长期看多的观点，预计三季度债市将保持震荡趋势，短期内维持低仓位低久期的策略，密切观察疫情发展情况以及宏观高频数据变化以修正预期，并寻求一些交易性机会以及数据证伪所带来的配置性机会，在确保组合良好流动性和安全性的前提下，竭力为持有人带来更高的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会由基金估值业务分管领导、督察长、基金估值核算负责人、基金会计、合规风控部人员及相关投研人员等组成。在特殊情况下，公司召集估值委员会会议，讨论和决策特殊估值事项，估值委员会集体决策，需到会的三分之二估值委员会成员表决通过。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理、投资经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行，一切以维护基金持有人利益为准则。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场债券品种的估值数据及交易所交易的债券品种的估值数据、流通受限股票流动性折扣。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金资产净值已发生连续超过 60 个工作日低于 5000 万元的情形，本基金管理人已按法规要求向证监会报送解决方案。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2020 年上半年，基金托管人在金鹰添盈纯债债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2020 年上半年，金鹰基金管理有限公司在金鹰添盈纯债债券型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本基金本报告期内未进行利润分配，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2020 年上半年，由金鹰基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关金鹰添盈纯债债券型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：金鹰添盈纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2020 年 6 月 30 日 | 上年度末 2019 年 12 月 31 日 |
|-----------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 4,583.62 | 18,003.84 |
| 结算备付金 | | 27,079.98 | 10,108.44 |
| 存出保证金 | | 481.57 | 24,194.30 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 2,591,234.60 | 4,576,166.00 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 2,591,234.60 | 4,576,166.00 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | 90,000.00 | - |
| 应收证券清算款 | | 100,015.10 | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 27,446.95 | 108,284.03 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 82.93 | 8,453.23 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 2,840,924.75 | 4,745,209.84 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2020 年 6 月 30 日 | 上年度末 2019 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | 90,000.00 | - |
| 应付赎回款 | | 55,522.17 | 538.90 |
| 应付管理人报酬 | | 788.33 | 1,258.79 |
| 应付托管费 | | 262.77 | 419.61 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | - | - |

| | | | |
|---------------|----------|--------------|--------------|
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 16,983.02 | 157,180.34 |
| 负债合计 | | 163,556.29 | 159,397.64 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 2,541,513.37 | 4,420,234.10 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 135,855.09 | 165,578.10 |
| 所有者权益合计 | | 2,677,368.46 | 4,585,812.20 |
| 负债和所有者权益总计 | | 2,840,924.75 | 4,745,209.84 |

注：截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.0535 元，基金份额总额为 2,541,513.37 份。

6.2 利润表

会计主体：金鹰添盈纯债债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|----------|--|---|
| 一、收入 | | 92,019.07 | 26,711,823.52 |
| 1.利息收入 | | 88,508.02 | 25,087,968.62 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 936.68 | 48,039.46 |
| 债券利息收入 | | 86,618.34 | 24,908,184.26 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 953.00 | 131,744.90 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 12,158.31 | -1,605,150.54 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | - | - |
| 基金投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.14 | 12,158.31 | -1,605,150.54 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.16 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.17 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.18 | - | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.19 | -9,868.52 | 3,227,757.68 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |

| | | | |
|----------------------------|----------|------------------|----------------------|
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.20 | 1,221.26 | 1,247.76 |
| 减：二、费用 | | 30,109.16 | 2,331,618.85 |
| 1. 管理人报酬 | | 6,658.35 | 1,526,471.37 |
| 2. 托管费 | | 2,219.43 | 508,823.77 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.21 | 19.00 | 3,360.00 |
| 5. 利息支出 | | 1,603.51 | 10,454.71 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 1,603.51 | 10,454.71 |
| 6. 税金及附加 | | - | 83,645.46 |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.22 | 19,608.87 | 198,863.54 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 61,909.91 | 24,380,204.67 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 61,909.91 | 24,380,204.67 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金鹰添盈纯债债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 | | |
|--|--|-------------|---------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 4,420,234.10 | 165,578.10 | 4,585,812.20 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 61,909.91 | 61,909.91 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | -1,878,720.73 | -91,632.92 | -1,970,353.65 |
| 其中：1.基金申购款 | 3,716,240.84 | 212,043.40 | 3,928,284.24 |
| 2.基金赎回款 | -5,594,961.57 | -303,676.32 | -5,898,637.89 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | - | - |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 2,541,513.37 | 135,855.09 | 2,677,368.46 |
| 项目 | 上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |

| | | | |
|--|------------------|----------------|------------------|
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 1,008,954,566.32 | 21,147,659.02 | 1,030,102,225.34 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 24,380,204.67 | 24,380,204.67 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | 1,128,721.19 | 24,526.76 | 1,153,247.95 |
| 其中：1.基金申购款 | 4,341,865.75 | 75,590.21 | 4,417,455.96 |
| 2.基金赎回款 | -3,213,144.56 | -51,063.45 | -3,264,208.01 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | -31,290,062.14 | -31,290,062.14 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 1,010,083,287.51 | 14,262,328.31 | 1,024,345,615.82 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：姚文强，主管会计工作负责人：刘盛，会计机构负责人：谢文君

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

金鹰添盈纯债债券型证券投资基金(简称"本基金")经中国证券监督管理委员会（简称"中国证监会"）机构部函[2017]105 号文《关于金鹰添盈纯债债券型证券投资基金备案确认的函》批准，于 2017 年 1 月 11 日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为 500,712,567.55 份基金份额。本基金的基金管理人为金鹰基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

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》和基金合同等有关规定，本基金的投资范围为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。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则(以下简称“企业会计准则”)要求，并按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在会计核算和信息

披露方面亦参考了中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及其发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会及基金业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策与上年度会计报表一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1. 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后

月份的增值税应纳税额中抵减。

2. 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

3. 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。

4. 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5. 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

6. 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

7. 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 4,583.62 |
| 定期存款 | - |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | - |
| 存款期限 1-3 个月 | - |
| 存款期限 3 个月以上 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计 | 4,583.62 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 |
|----|-----|
|----|-----|

| | | 2020 年 6 月 30 日 | | |
|---------------|-------|-----------------|--------------|-----------|
| | | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | - | - | - |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 2,600,722.42 | 2,591,234.60 | -9,487.82 |
| | 银行间市场 | - | - | - |
| | 合计 | 2,600,722.42 | 2,591,234.60 | -9,487.82 |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 2,600,722.42 | 2,591,234.60 | -9,487.82 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期内未投资衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020 年 6 月 30 日 | |
|-------|------------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 90,000.00 | - |
| 银行间市场 | - | - |
| 合计 | 90,000.00 | - |

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息 | 1.56 |
| 应收定期存款利息 | - |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | 12.21 |
| 应收债券利息 | 27,432.98 |
| 应收资产支持证券利息 | - |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 应收出借证券利息 | - |

| | |
|----|-----------|
| 其他 | 0.20 |
| 合计 | 27,446.95 |

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 33.83 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 审计费用 | 16,949.19 |
| 合计 | 16,983.02 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|---------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 4,420,234.10 | 4,420,234.10 |
| 本期申购 | 3,716,240.84 | 3,716,240.84 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -5,594,961.57 | -5,594,961.57 |
| 本期末 | 2,541,513.37 | 2,541,513.37 |

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|-------------|-------------|-------------|
| 上年度末 | 637,199.69 | -471,621.59 | 165,578.10 |
| 本期利润 | 71,778.43 | -9,868.52 | 61,909.91 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -300,909.59 | 209,276.67 | -91,632.92 |
| 其中：基金申购款 | 561,524.83 | -349,481.43 | 212,043.40 |
| 基金赎回款 | -862,434.42 | 558,758.10 | -303,676.32 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 408,068.53 | -272,213.44 | 135,855.09 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

| | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 720.20 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 176.01 |
| 其他 | 40.47 |
| 合计 | 936.68 |

6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期内未投资股票。

6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期内未投资基金。

6.4.7.14 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-------------------------|----------------------|
| | 2020年1月1日至2020年6月30日 |
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 6,733,673.36 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 6,588,729.78 |
| 减：应收利息总额 | 132,785.27 |
| 买卖债券差价收入 | 12,158.31 |

6.4.7.15 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内未投资资产支持证券。

6.4.7.16 贵金属投资收益

本基金无贵金属投资。

6.4.7.17 衍生工具收益**6.4.7.17.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金无衍生工具投资。

6.4.7.17.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金无衍生工具投资。

6.4.7.18 股利收益

本基金本报告期内无股票投资。

6.4.7.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|----------------------------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产 | -9,868.52 |
| ——股票投资 | - |
| ——债券投资 | -9,868.52 |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——基金投资 | - |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2.衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| 3.其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税 | - |
| 合计 | -9,868.52 |

6.4.7.20 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 1,221.26 |
| 合计 | 1,221.26 |

6.4.7.21 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 19.00 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 合计 | 19.00 |

6.4.7.21.1 持有基金产生的费用

本基金本报告期内未投资基金。

6.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用 | 9,068.87 |
| 信息披露费 | - |
| 证券出借违约金 | - |
| 汇划手续费 | 1,240.00 |
| 其他 | 300.00 |

| | |
|-------|-----------|
| 帐户维护费 | 9,000.00 |
| 合计 | 19,608.87 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无重大需披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

经基金管理人 2019 年第一次临时股东会审议通过，并经中国证券监督管理委员会批复核准（证监许可[2019]2306），基金管理人原股东中信证券华南股份有限公司（原广州证券股份有限公司）将其持有的本公司 24.01%股权转让给广州越秀金融控股集团股份有限公司。本次股权转让后，基金管理人股权结构变更为：东旭集团有限公司 66.19%，广州越秀金融控股集团股份有限公司 24.01%，广州白云山医药集团股份有限公司 9.80%。基金管理人已完成股权变更事项的工商变更登记。上述事项已于 2020 年 1 月 4 日在证监会规定媒介披露。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|------------|------------|
| 金鹰基金管理有限公司 | 基金管理人、销售机构 |
| 交通银行股份有限公司 | 基金托管人 |

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行任何交易，无应支付关联方交易佣金。

上述佣金按市场佣金率计算，以扣除中国证券登记结算公司收取的证管费、经手费和使用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月 30日 | 上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月 30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 6,658.35 | 1,526,471.37 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 3,078.88 | 499,025.61 |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.3% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

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，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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月 30日 | 上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月 30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,219.43 | 508,823.77 |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 计提。托管费的计算方法如下：

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

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，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。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金无销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未参与转融通出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未参与转融通出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 | | 上年度可比期间 | |
|------------|----------------------|--------|----------------------|-----------|
| | 2020年1月1日至2020年6月30日 | | 2019年1月1日至2019年6月30日 | |
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 交通银行股份有限公司 | 4,583.62 | 720.20 | 3,943,787.71 | 47,403.25 |

注：本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息，在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示。本基金本报告期末清算备付金余额 27,079.98 元，本期清算备付金利息收入 176.01 元，上年度可比期间清算备付金余额 0.00 元，清算备付金利息收入 622.27 元。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间不存在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

本基金本报告期及上年度可比期间未投资基金。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2020 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末无认购/新发股票或债券流通受限情况。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期内未投资股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末未持有未到期的银行间市场卖出回购证券款。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有未到期的交易所市场卖出回购证券款。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期内未参与转融通出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险等。基金成立以来，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，致力于内控机制的建立和完善，公司内部管理制度及业务规范流程的制定和完善，加强内部风险的控制与有效防范，以保证各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

为保证公司规范化运作，有效地防范和化解经营风险，确保基金和公司财务和其他信息真实、准确、完整、及时，从而最大程度地保护基金持有人的合法权益，本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了科学合理、控制严密、运行高效的各项管理制度：

1、风险管理控制制度

风险控制制度由总则、风险控制的目标和原则、风险控制的机构设置、风险控制的程序、风险类型的界定、风险控制的主要措施、风险控制的具体制度、风险控制制度的监督与评价等部分组成。

风险控制的具体制度主要包括投资风险管理制度、交易风险控制制度、财务风险控制制度、公司资产管理制度等业务风险控制制度，以及岗位分离制度、业务空间隔离制度、作业规则、岗位职责、反馈制度、资料保全制度、保密制度、员工行为守则等程序性风险管理制度。

2、投资管理制度

投资管理制度包括研究业务管理制度、投资决策管理制度、基金交易管理制度等。

制订研究业务管理制度的目的是保持研究工作的独立、客观。研究业务管理制度包括：建立严

密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法；根据基金合同要求，在充分研究的基础上建立和维护投资对象备选库；建立研究与投资的业务交流制度，保持通畅的交流渠道；建立研究报告质量评价体系。

制订投资决策业务管理制度的目的是严格遵守法律法规的有关规定，确保基金的投资符合基金合同所规定的投资目标、投资范围、投资策略、投资组合和投资限制等要求。投资决策业务管理制度包括投资决策授权制度；投资决策支持制度，重要投资要有详细的研究报告和风险分析支持；投资风险评估与管理制度，在设定的风险权限额度内进行投资决策；投资管理业绩评价制度等。

制订基金交易管理制度的目的是保证基金投资交易的安全、有效、公平。基金交易管理制度包括基金交易的集中交易制度；交易监测、预警、反馈机制；投资指令审核制度；投资指令公平分配制度；交易记录保管制度；交易绩效评价制度等。

3、监察稽核制度

监察稽核制度包括检查公司业务部门和工作人员是否遵守法律、法规、规章的有关规定；检查公司业务部门和工作人员对公司内部控制制度、各项管理制度、业务规章的执行情况；对公司各部门作业流程的遵守合规性和有效性的检查、监督、评价及建议等。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2020年6月30日 | 上年度末 2019年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1 | 0.00 | 0.00 |
| A-1 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 0.00 | 0.00 |

注：本统计数据未包含国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债、同业存单。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2020年6月30日 | 上年度末 2019年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1 | 0.00 | 0.00 |
| A-1 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 0.00 | 0.00 |

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2020年6月30日 | 上年度末 2019年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1 | 0.00 | 0.00 |
| A-1 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 0.00 | 0.00 |

注：以上数据按照最新发行人评级填列。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2020年6月30日 | 上年度末 2019年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA | 0.00 | 0.00 |
| AAA 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 0.00 | 0.00 |

注：本统计数据未包含国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债、同业存单。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2020年6月30日 | 上年度末 2019年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA | 0.00 | 0.00 |
| AAA 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 0.00 | 0.00 |

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2020年6月30日 | 上年度末 2019年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA | 0.00 | 0.00 |
| AAA 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |

| | | |
|----|------|------|
| 合计 | 0.00 | 0.00 |
|----|------|------|

注：以上数据按照最新发行人评级填列。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自于投资品种流动性不足，导致金融资产不能在合理价格变现。本基金采用分散投资、监控流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时基金管理人通过分析持有人结构、申购赎回行为分析、变现比例、压力测试等方法评估组合的流动性风险。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限资产投资比例等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间市场进行交易，除本报告所列示的期末本基金持有的流通受限证券暂时不能自由转让外，本基金持有的其余资产均能及时变现。评估结果显示本基金的组合持仓变现能力较好，流动性风险可控。

6.4.13.4 市场风险

市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2020年6月 30日 | 1个月 以内 | 1-3 个月 | 6个月 以内 | 3个月 -1年 | 6个月 -1年 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|-----------------------|-----------|-----------|-----------|------------|------------|------|------|------|-----|----------|
| 资产 | | | | | | | | | | |
| 银行存款 | 4,583.62 | - | - | - | - | - | - | - | - | 4,583.62 |

| | | | | | | | | | | |
|-----------|------------|---|---|---|------------|--------------|------------|------------|---|--------------|
| 结算备付金 | 27,079.98 | - | - | - | - | - | - | - | - | 27,079.98 |
| 存出保证金 | 481.57 | - | - | - | - | - | - | - | - | 481.57 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | 270,135.00 | 2,140,025.40 | 181,074.20 | - | - | 2,591,234.60 |
| 买入返售金融资产 | 90,000.00 | - | - | - | - | - | - | - | - | 90,000.00 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | - | - | 100,015.10 | - | 100,015.10 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | - | - | 27,446.95 | - | 27,446.95 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | - | - | 82.93 | - | 82.93 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 122,145.17 | - | - | - | 270,135.00 | 2,140,025.40 | 181,074.20 | 127,544.98 | - | 2,840,924.75 |
| 负债 | | | | | | | | | | |
| 短期借款 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | - | - | 90,000.00 | - | 90,000.00 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | - | - | 55,522.17 | - | 55,522.17 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | - | - | 788.33 | - | 788.33 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | - | - | 262.77 | - | 262.77 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付利息 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | - | - | 16,983.02 | - | 16,983.02 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | - | - | 163,556.29 | - | 163,556.29 |
| 利率敏感度缺口 | 122,145.17 | - | - | - | 270,135.00 | 2,140,025.40 | 181,074.20 | -36,011.31 | - | 2,677,368.46 |

| 上年度末 2019 年 12 月 31 日 | 1 个月 以内 | 1-3 个月 | 6 个月 以内 | 3 个月 -1 年 | 6 个月 -1 年 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|-----------------------------|--------------|-----------|------------|--------------|--------------|-------|--------------|-----------|------------|--------------|
| 资产 | | | | | | | | | | |
| 银行存款 | 18,003.84 | - | - | - | - | - | - | - | - | 18,003.84 |
| 结算备付金 | 10,108.44 | - | - | - | - | - | - | - | - | 10,108.44 |
| 存出保证金 | 24,194.30 | - | - | - | - | - | - | - | - | 24,194.30 |
| 交易性金融资产 | 2,001,600.00 | - | - | - | - | - | 2,484,550.00 | 90,016.00 | - | 4,576,166.00 |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | - | - | - | 108,284.03 | 108,284.03 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | - | - | - | 8,453.23 | 8,453.23 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 2,053,906.58 | - | - | - | - | - | 2,484,550.00 | 90,016.00 | 116,737.26 | 4,745,209.84 |
| 负债 | | | | | | | | | | |
| 短期借款 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | - | - | - | 538.90 | 538.90 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | - | - | - | 1,258.79 | 1,258.79 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | - | - | - | 419.61 | 419.61 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付利息 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | | | | |
|---------|--------------|---|---|---|---|--------------|-----------|------------|--------------|---|
| 应付利润 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | - | - | 157,180.34 | 157,180.34 | |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | - | - | 159,397.64 | 159,397.64 | |
| 利率敏感度缺口 | 2,053,906.58 | - | - | - | - | 2,484,550.00 | 90,016.00 | -42,660.38 | 4,585,812.20 | |

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
|-------------|-------------|-----------------------------|---------------------|
| | | 本期末 2020年6月30日 | 上年度末 2019年12月31日 |
| | 利率上升 25 个基点 | -12,321.16 | -14,675.80 |
| 利率下降 25 个基点 | 12,597.83 | 15,252.60 | |

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020年6月30日 | | 上年度末 2019年12月31日 | |
|---------------|-------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------|
| | 公允价值 | 占基金 资产净 值比例 (%) | 公允价值 | 占基金 资产净 值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—债券投资 | 2,591,234.60 | 96.78 | 4,576,166.00 | 99.79 |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | - | - | - | - |

| | | | | |
|-------------|--------------|-------|--------------|-------|
| 衍生金融资产—权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 2,591,234.60 | 96.78 | 4,576,166.00 | 99.79 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| | | | |
|----|--|-----------------------------|---------------------|
| 假设 | 市场其他变量保持不变，只有业绩比较基准所对应的市场组合价格发生合理、可能的变动； | | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末 2020年6月30日 | 上年度末 2019年12月31日 |
| | 业绩比较基准变动+5% | 156,622.14 | 107,139.72 |
| | 业绩比较基准变动-5% | -156,622.14 | -107,139.72 |

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1. 公允价值

(1) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

(2) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层次可分为：

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第二层级的余额为 2,591,234.60 元。无属于第一层级和第三层级的金额。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

本基金本报告期内无公允价值所属层级间的重大变动。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

2. 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 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 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 2,591,234.60 | 91.21 |
| | 其中：债券 | 2,591,234.60 | 91.21 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 90,000.00 | 3.17 |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 31,663.60 | 1.11 |
| 8 | 其他各项资产 | 128,026.55 | 4.51 |
| 9 | 合计 | 2,840,924.75 | 100.00 |

注：其他各项资产包括：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。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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。

7.2.2 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期内未进行股票投资。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票投资。

7.5 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 | 270,135.00 | 10.09 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 2,321,099.60 | 86.69 |
| | 其中：政策性金融债 | 2,321,099.60 | 86.69 |
| 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 | 2,591,234.60 | 96.78 |

7.6 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 | 018006 | 国开 1702 | 19,380.00 | 1,988,000.40 | 74.25 |

| | | | | | |
|---|--------|----------|----------|------------|-------|
| 2 | 019627 | 20 国债 01 | 2,700.00 | 270,135.00 | 10.09 |
| 3 | 018003 | 国开 1401 | 1,420.00 | 170,059.20 | 6.35 |
| 4 | 108604 | 国开 1805 | 1,500.00 | 152,025.00 | 5.68 |
| 5 | 018009 | 国开 1803 | 100.00 | 11,015.00 | 0.41 |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期内未投资贵金属。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 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。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

无。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

本基金本报告期内未投资基金。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 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。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 481.57 |
| 2 | 应收证券清算款 | 100,015.10 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 27,446.95 |
| 5 | 应收申购款 | 82.93 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 128,026.55 |

7.13.4 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。

7.13.5 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。

7.13.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数(户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | | | |
|----------|---------------|-------|------------|--------------|------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额 比例 | 持有份额 | 占总份额 比例 |
| 312 | 8,145.88 | 0.00 | 0.00% | 2,541,513.37 | 100.00% |

8.2 期末上市基金前十名持有人

本基金非上市交易型基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 59.78 | 0.00% |

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金非发起式基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2017年1月11日）基金份额总额 | 500,712,567.55 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 4,420,234.10 |
| 本报告期基金总申购份额 | 3,716,240.84 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 5,594,961.57 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 2,541,513.37 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会，无会议决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期，本基金管理人法定代表人、董事长、总经理、副总经理等进行了调整。截至报告日，王铁先生担任公司法定代表人及董事长、姚文强先生担任公司总经理，徐娇娇女士担任公司督察长，刘盛先生担任公司副总经理及首席信息官职务。

2、本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金报告期内没有改变基金投资策略。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金报告期内未持有基金。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期未改聘会计师事务所。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|------|--------------|-----------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 银河证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 财通证券 | 2 | - | - | - | - | - |

注：本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单位作为本基金的专用交易单位。本基金专用交易单位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

本基金专用交易单位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单位的证券经营机构。

(2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单位租用协议。

10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|--------------|--------------|---------------|----------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 银河证券 | 664,009.90 | 7.62% | 1,470,000.00 | 5.77% | - | - |
| 财通证券 | 8,050,545.10 | 92.38% | 24,000,000.00 | 94.23% | - | - |

10.9 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|---|---------|------------|
| 1 | 金鹰基金管理有限公司关于旗下基金参加中国工商银行 AI 投服务基金申购费率优惠活动的公告 | 证监会规定媒介 | 2020-01-02 |
| 2 | 金鹰基金管理有限公司关于旗下基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告 | 证监会规定媒介 | 2020-01-02 |
| 3 | 金鹰基金管理有限公司关于旗下基金参加中国工商银行“2020 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告 | 证监会规定媒介 | 2020-01-02 |
| 4 | 金鹰基金高级管理人员变更公告 | 证监会规定媒介 | 2020-01-04 |
| 5 | 金鹰基金管理有限公司关于公司股权变更的公告 | 证监会规定媒介 | 2020-01-04 |
| 6 | 金鹰基金高级管理人员变更公告 | 证监会规定媒介 | 2020-01-04 |
| 7 | 金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与万家财富基金销售(天津)有限公司定投及费率优惠活动的公告 | 证监会规定媒介 | 2020-01-09 |
| 8 | 金鹰基金改聘会计师事务所公告 | 证监会规定媒介 | 2020-01-14 |
| 9 | 金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订基金合同、托管协议的提示性公告 | 证监会规定媒介 | 2020-01-20 |
| 10 | 金鹰添盈纯债债券型证券投资基金招募说明书更新 | 证监会规定媒介 | 2020-01-20 |

| | | | |
|----|--|---------|------------|
| 11 | 金鹰添盈纯债债券型证券投资基金招募说明书摘要更新 | 证监会规定媒介 | 2020-01-20 |
| 12 | 金鹰添盈纯债债券型证券投资基金基金合同更新 | 证监会规定媒介 | 2020-01-20 |
| 13 | 金鹰添盈纯债债券型证券投资基金托管协议更新 | 证监会规定媒介 | 2020-01-20 |
| 14 | 金鹰添盈纯债债券型证券投资基金修改基金合同的公告 | 证监会规定媒介 | 2020-01-20 |
| 15 | 金鹰添盈纯债债券型证券投资基金 2019 年四季度报告 | 证监会规定媒介 | 2020-01-21 |
| 16 | 金鹰基金管理有限公司关于调整旗下基金产品 2020 年春节假期相关安排的提示性公告 | 证监会规定媒介 | 2020-01-30 |
| 17 | 金鹰基金管理有限公司关于新增安信证券股份有限公司为本公司旗下部分基金代销机构的公告 | 证监会规定媒介 | 2020-02-27 |
| 18 | 金鹰基金管理有限公司关于董事变更的公告 | 证监会规定媒介 | 2020-03-11 |
| 19 | 金鹰基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告 | 证监会规定媒介 | 2020-03-13 |
| 20 | 金鹰基金管理有限公司关于董事会成员变更的公告 | 证监会规定媒介 | 2020-03-13 |
| 21 | 金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国国际期货股份有限公司定投及费率优惠活动的公告 | 证监会规定媒介 | 2020-03-18 |
| 22 | 金鹰基金管理有限公司关于延期披露旗下基金 2019 年年度报告的公告 | 证监会规定媒介 | 2020-03-27 |
| 23 | 金鹰基金行业高级管理人员变更公告 | 证监会规定媒介 | 2020-03-28 |
| 24 | 金鹰基金管理有限公司关于网上交易系统升级暂停服务的公告 | 证监会规定媒介 | 2020-04-11 |
| 25 | 金鹰基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告 | 证监会规定媒介 | 2020-04-17 |
| 26 | 金鹰添盈纯债债券型证券投资基金 2020 年一季度报告 | 证监会规定媒介 | 2020-04-21 |
| 27 | 金鹰基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告 | 证监会规定媒介 | 2020-04-21 |
| 28 | 金鹰基金管理有限公司董事长变更公告 | 证监会规定媒介 | 2020-04-24 |
| 29 | 金鹰基金管理有限公司关于新增中信证券华南股份有限公司为本公司旗下部分基金代销机构的公告 | 证监会规定媒介 | 2020-04-30 |
| 30 | 金鹰添盈纯债债券型证券投资基金 2019 年年度报告 | 证监会规定媒介 | 2020-04-30 |
| 31 | 金鹰关于公司法定代表人变更公告 | 证监会规定媒介 | 2020-05-06 |
| 32 | 金鹰关于网上交易系统升级暂停服务的公告 | 证监会规定媒介 | 2020-05-08 |
| 33 | 金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增深圳腾元基金销售有限公司为代销机构并开通 | 证监会规定媒介 | 2020-05-27 |

| | | | |
|----|-----------------------------|---------|------------|
| | 基金转换、基金定投业务及费率优惠的公告 | | |
| 34 | 金鹰基金管理有限公司关于网上交易系统升级暂停服务的公告 | 证监会规定媒介 | 2020-05-29 |

注：相关信息披露文件请登录本基金管理人网站查询。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|----------------|------------------------|------------|------|------|------------|--------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 个人 | 1 | 2020年1月15日至2020年2月6日 | 812,080.37 | 0.00 | 0.00 | 812,080.37 | 31.95% |
| | 2 | 2020年2月19日至2020年2月26日 | 812,080.37 | 0.00 | 0.00 | 812,080.37 | 31.95% |
| | 3 | 2020年5月28日至2020年6月30日 | 812,080.37 | 0.00 | 0.00 | 812,080.37 | 31.95% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>本基金在报告期内，存在报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情形，可能会存在以下风险：</p> <p>1) 基金净值大幅波动的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，因巨额赎回、份额净值小数保留位数与方式、管理费及托管费等费用计提等原因，可能会导致基金份额净值出现大幅波动；</p> <p>2) 巨额赎回的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能触发本基金巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额；</p> <p>3) 流动性风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致本基金的流动性风险；</p> <p>4) 基金提前终止、转型或与其他基金合并的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，可能导致本基金面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p> <p>5) 基金规模过小导致的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。</p> <p>6) 份额占比较高的投资者申购申请被拒绝的风险：当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金总份额的50%时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金总份额50%的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的50%，该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。</p> | | | | | | | |

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会注册的金鹰添盈纯债债券型证券投资基金发行及募集的文件。
- 2、《金鹰添盈纯债债券型证券投资基金基金合同》。
- 3、《金鹰添盈纯债债券型证券投资基金托管协议》。
- 4、金鹰基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程。
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照。
- 6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、季度报告、年度报告、更新的招募说明书及其他临时公告。

12.2 存放地点

广东省广州市天河区珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅或按工本费购买复印件，也可登录本基金管理人网站查阅，本基金管理人网址：<http://www.gefund.com.cn>。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人客户服务中心，客户服务中心电话：4006-135-888 或 020-83936180。

金鹰基金管理有限公司

二〇二〇年八月二十九日