金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金更新的招募说明书（摘要）

基金管理人:金鹰基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司
时间:二〇二〇年二月

重要提示

本基金经2019年6月17日中国证券监督管理委员会证监许可[2019]1057号文注册募集。

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投资价值和市场前景作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

投资有风险。投资者在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,自主作出投资决策,自行承担基金投资中出现的各类风险,包括因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、流动性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、基金投资过程中产生的操作风险、因交收违约和投资债券引发的信用风险、基金投资对象与投资策略引致的特有风险等等。本基金的特定风险详见招募说明书"风险揭示"章节。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的债券、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定),在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。在特殊市场条件下,如证券市场的成交量发生急剧萎缩、基金发生巨额赎回以及其他未能预见的特殊情形下,可能导致基金资产变现困难或变现对证券资产价格造成较大冲击,发生基金份额净值波动幅度较大、无法进行正常赎回业务、基金不能实现既定的投资决策等风险。

本基金投资资产支持证券,可能带来以下风险:1、信用风险:基金所投资的资产支持证券的债务人出现违约,或在交易过程中发生交收违约,或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降,造成基金财产损失。2、利率风险:市场利率波动会导致资产支持证券的收益率和价格的变动,一般而言,如果市场利率上升,本基金持有资产支持证券将面临价格下降、本金损失的风险,而如果市场利率下降,资产支持证券利息的再投资收益将面临下降的风险。3、流动性风险:受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响,资产支持证券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出,存在一定的流动性风险。4、提前偿付风险:债务人可能会由于利率变化等原因进行提前偿付,从而使基金资产面临再投资风险。5、其他风险:包括政策风险、操作风险、法律风险和技术风险等。

本基金还投资于股指期货、国债期货等金融工具,而股指期货、国债期货属于是高风险投资工具,相应市场的波动也可能给基金财产带来较高风险,将面临市场风险、标的物风险、基差风险、流动性风险和保证金风险等。

本基金为混合型证券投资基金,其预期收益和风险水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。

投资者应充分考虑自身的风险承受能力,并对于认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。

基金的过往业绩并不预示其未来表现,基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的"买者自负"原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负责。

本招募说明书中基金投资组合报告和基金业绩中的数据已经本基金托管人复核。除非另有说明,本招募说明书所载内容截止日为2019年12月31日(其中基金管理人信息截止日为2020年2月20日),有关财务数据截止日为2019年12月31日,净值表现截止日为2019年12月31日,本报告中财务数据未经审计。

本招募说明书约定的基金产品资料概要的编制、披露与更新要求,自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

一、基金管理人

(一)基金管理人简况:
名称:金鹰基金管理有限公司
注册地址:广东省广州市南沙区海滨路171号11楼自编1101之一J79
办公地址:广东省广州市天河区珠江东路28号越秀金融大厦30楼
设立日期:2002年12月25日
批准设立机关及批准设立文号:中国证监会、证监基金字[2002]97号
组织形式:有限责任公司
注册资本:5.102亿元人民币
存续期限:持续经营
联系电话:020-83936180
股权结构:

发起人名称	出资额(万元)	出资比例
东旭集团有限公司	33770	66.19%
广州越秀金融控股集团股份有限公司	12250	24.01%
广州白云山医药集团股份有限公司	5000	9.8%
总计	51020	100%

(二)主要人员情况

1、董事会成员

李兆廷先生,董事长,北京交通大学软件工程硕士。曾任石家庄市柴油机厂技术员、车间主任、总经理助理、副总经理等职务。现任东旭集团有限公司董事长、西藏金融租赁有限公司董事长、中国生产力学会副会长。

王中女士,董事,中国科学院大学工商管理硕士,现任东旭集团有限公司高级副总经理、东旭资本控股集团常务副总经理、东旭光电科技股份有限公司董事。

刘志刚先生,董事,数量经济学博士,历任工银瑞信基金管理有限公司产品开发经理,安信基金管理有限责任公司产品部总监,东方基金管理有限责任公司量化投资部总经理、基金经理,金鹰基金管理有限公司副总经理、总经理等职务。

苏丹先生,董事,管理学硕士,历任华为技术有限公司人力资源部绩效考核岗、韬睿惠悦咨询有限公司咨询顾问、德勤咨询公司咨询经理、越秀集团人力资源部高级主管、广州证券股份有限公司人力资源部副总经理,现任广州证券股份有限公司战略管理部总经理。

王毅先生,董事,工商管理硕士、经济师,历任广州证券有限责任公司营业部经理、营业部总经理助理、营业部副总经理,办公室副主任(主持全面工作)、合规总监、董事会秘书。现任广州证券股份有限公司副总裁兼任董事会秘书、首席风险官、合规总监。

黄雪贞女士,董事,英语语言文学硕士,历任深圳高速公路股份有限公司董事会秘书助理和证券事务代表、广州药业股份有限公司董事会秘书处副主任、主任、证券事务代表。现任广州白云山医药集团股份有限公司董事会秘书室主任、证券事务代表、董事会秘书。

刘金全先生,独立董事,数量经济学博士。历任吉林大学经济管理学院讲师、商学院教授、院长,现任广州大学经济与统计学院特聘教授。

杨之曙先生,独立董事,数量经济学博士。历任云南航天工业总公司财务处助理经济师,现任清华大学经济管理学院教授。

王克玉先生,独立董事,法学博士。历任山东威海高技术开发区进出口公司法务、山东宏安律师事务所律师、北京市重光律师事务所律师,现中央财经大学法学院副院长、博士生导师。

2、监事会成员

姚志智女士,监事,党校本科学历、会计师、经济师。历任郴州电厂职员、郴州市农业银行储蓄代办员、飞虹营业所副主任、国北所主任、广州天河保德交通物资公司主管会计、广州珠江啤酒集团财务部主管会计、广州荣鑫容器有限公司财务部经理、总经理助理、广州白云山侨光制药有限公司财务部副部长、广州白云山制药有限公司财务部副部长、广州白云山化学制药创新中心财务负责人、广州白云山医药集团股份有限公司财务部高级经理、财务部部长、广州医药海马品牌整合传播有限公司监事,现任广州白云山医药集团股份有限公司财务副总监。

赖德昌先生,监事,本科学历,历任广东证券有限责任公司审计员、广发基金管理有限公司交易员,现任金鹰基金管理有限公司集中交易部总监。

姜慧斌先生,监事,管理学硕士。曾任宇龙计算机通信科技(深圳)有限公司人力资源部组织发展经理,现任金鹰基金管理有限公司综合管理部总监。

3、公司高级管理人员

姚文强先生,副总经理,经济学硕士,历任上海中央登记结算公司深圳代办处财务部负责人,上海中央登记结算公司深圳代办处主管,浙江证券深圳营业部投资咨询部经理、大成基金管理公司市场部高级经理,汉唐证券有限责任公司市场总监,招商基金营销管理部总经理助理,国投瑞银基金管理有限公司华南总经理,博时基金管理有限公司零售南方总经理,金鹰基金管理有限公司总经理助理等职务。经公司第五届董事会第四十二次会议审议通过,并已按规定报中国证券投资基金业协会及广东证监局备案,现任金鹰基金管理有限公司副总经理。经公司第六届董事会第五十六次会议审议通过,自2020年1月3日起代行金鹰基金管理有限公司总经理职责。

徐娇娇女士,督察长,法学硕士研究生,历任南京证券股份有限公司投资银行部项目经理、中国证券业协会会员服务三部高级主办、第一创业证券股份有限公司总裁办公室新业务/产品管理组负责人、第一创业证券股份有限公司资产管理运营部负责人。经公司第六届董事会第四十六次会议审议通过,并已按规定报中国证券投资基金业协会及广东证监局备案,现任金鹰基金管理有限公司督察长。

刘盛先生,副总经理,首席信息官,化学工程硕士,历任长江证券有限公司电脑主管、平安证券有限公司电脑主管、巨田证券有限公司总裁助理、宏源证券股份有限公司技术总监、广州证券股份有限公司副总裁、天源证券有限公司总经理、广州证券股份有限公司副总裁等职务。经公司第六届董事会第四十八次会议、第五十六次会议审议通过,并已按规定报中国证券投资基金业协会及广东证监局备案,现任金鹰基金管理有限公司副总经理兼首席信息官职务。

4、基金经理

林龙军,曾任兴全基金管理有限公司产品经理、研究员、基金经理助理、投资经理兼固收投委会委员等职务。2018年3月加入金鹰基金管理有限公司。2018年5月起担任金鹰持久增利债券型证券投资基金(LOF)、金鹰添裕纯债债券型证券投资基金、金鹰鑫益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、金鹰元丰债券型证券投资基金基金经理。2018年6月起任金鹰元祺信用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。2019年8月起任金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金基金经理。

5、投资决策委员会成员有:

本公司采取集体投资决策制度,相关投资决策委员会成员有:

(1)公司投资决策委员会
姚文强,投资决策委员会主席,副总经理(代行总经理职责);
王超伟先生,投资决策委员会委员,总经理助理;
王喆先生,投资决策委员会委员,权益投资部投资总监,基金经理;
陈颖先生,投资决策委员会委员,权益投资部总经理,基金经理;
林龙军先生,投资决策委员会委员,绝对收益投资部总经理,基金经理;
陈立先生,投资决策委员会委员,权益投资部副总经理,基金经理;
刘丽娟女士,投资决策委员会委员,固定收益部总经理,基金经理。

(2)权益投资决策委员会
姚文强,权益投资决策委员会主席,副总经理(代行总经理职责);
王超伟先生,权益投资决策委员会副主席,总经理助理;
王喆先生,权益投资决策委员会委员,权益投资部投资总监,基金经理;
陈立先生,权益投资决策委员会委员,权益投资部副总经理,基金经理;
陈颖先生,权益投资决策委员会委员,权益投资部总经理,基金经理。

(3)固定收益投资决策委员会
姚文强,固定收益投资决策委员会主席,副总经理(代行总经理职责);
林龙军先生,固定收益投资决策委员会委员,绝对收益投资部总经理,基金经理;
林暐先生,固定收益投资决策委员会委员,基金经理;
龙悦芳女士,固定收益投资决策委员会委员,固定收益部副总经理,基金经理;
戴骏先生,固定收益投资决策委员会委员,固定收益部副总经理,基金经理。上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

名称:中国民生银行股份有限公司(以下简称"中国民生银行")
住所:北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人:洪崎
成立时间:1996年2月7日
基金托管业务批准文号:证监基金字[2004]101号
组织形式:其他股份有限公司(上市)
注册资本:28,365,585,227元人民币
存续期间:持续经营
电话:010-58560666
联系人:罗菲菲

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、直销机构
名称:金鹰基金管理有限公司
注册地址:广东省广州市南沙区海滨路171号11楼自编1101之一J79
办公地址:广东省广州市天河区珠江东路28号越秀金融大厦30楼
成立时间:2002年12月25日
批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基金字[2002]97号
组织形式:有限责任公司
注册资本:5.102亿元人民币
存续期间:持续经营
联系人:蔡晓燕
联系电话:020-83282925
传真电话:020-83283445
客户服务及投诉电话:4006-135-888
电子邮箱:csmail@gefund.com.cn
网址:www.gefund.com.cn

2、代销机构:

(1)名称:诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
办公地址:上海市杨浦区秦皇岛路32号c栋
法定代表人:汪静波
联系人:余翼飞
电话:021-80359115
客服电话:400-821-5399
公司网址:www.noah-fund.com

(2)名称:深圳众禄基金销售股份有限公司
注册地址:深圳罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
办公地址:深圳罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
法定代表人:薛峰
联系人:童彩平
电话:0755-33227950
客服电话:4006-788-887
公司网址:www.zlfund.cn

(3)名称:蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路969号3幢5层599室
办公地址:浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F
法定代表人:祖国明
联系人:韩爱彬
客服电话:4000-766-123
公司网址:www.fund123.cn

(4)名称:南京苏宁基金销售有限公司
注册地址:南京玄武区苏宁大道1-5号
办公地址:南京玄武区苏宁大道1-5号
法定代表人:王锋
联系人:张慧
电话:025-66996699
客服电话:95177
公司网址:https://www.snjijin.com/fsws/index.htm

(5)名称:一路财富(北京)信息科技有限公司
注册地址:北京市西城区车公庄大街9号院5号楼702室
办公地址:北京市西城区阜城门内大街2号万通大厦22层2208室
法定代表人:吴雪秀
联系人:徐越
电话:010-88128877
客服电话:400-001-1566
公司网址: www.yilucaifu.com

(6)名称:中信建投证券股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市东城区朝内大街188号
法定代表人:王常青
联系人:刘芸
电话:010-85156310
客服电话:4008-888-108
网址:www.csc108.com

(7)名称:国泰君安证券股份有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区商城路618号
办公地址:上海市静安区新闸路669号博华广场21层
法定代表人:杨德红
联系人:钟伟镇
电话:021-38032284
客服电话:95521
网址:www.gtja.com

(8)名称:光大证券股份有限公司
地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:周健男
联系人:李晓皙
电话:021-22169111
客服电话:95525
网址:www.ebscn.com

(9)名称:西部证券股份有限公司
地址:陕西省西安市新城区东新街319号8幢10000室
法定代表人:徐朝晖
联系人:梁承华
电话:029-87406168
客服电话:95582
网址:www.westsecu.com

(10)名称:北京唐鼎耀华基金销售有限公司
注册地址:北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路38号院1号泰康金融中心38层
法定代表人:张冠宇
联系人:王国壮
电话:010-85934903
客服电话:400-819-9868
公司网址:www.tdyhfund.com

(11)名称:北京肯特瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15
办公地址:北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院a座17层
法定代表人:江卉
联系人:韩锦星
电话:010-89181356
公司网址:www.fund.jd.com
客服电话:95118

(12)名称:中民财富基金销售(上海)有限公司
注册地址:上海市黄浦区中山南路100号7层05单元
办公地址:上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼27层
法定代表人:弭洪军
联系人:茅旦青
电话:021-33355392
客服电话:400-876-5716
公司网址:www.cmiwm.com

(13)名称:华福证券有限责任公司
地址:福州市鼓楼区温泉街道五四路157号7-8层
法定代表人:黄金琳
联系人:王虹
电话:021-20655183
网址:www.hfzq.com.cn

(14)名称:海银基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路8号402室
办公地址:上海市浦东新区银城中路8号4楼
法定代表人:刘惠
联系人:毛林
电话:021-80133597
客服电话:400-808-1016
公司网址:www.fundhaiyin.com

(15)名称:上海证券有限责任公司
地址:上海市黄浦区四川中路213号7楼
法定代表人:李俊杰
联系人:魏熠珲
电话:021-53686278
客服电话:4008918918
网址:www.shzq.com

(16)名称:平安证券股份有限公司
地址:深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
法定代表人:何之江
联系人:周一涵
电话:021-38637436
客服电话:95511转8
网址:www.stock.pingan.com

(17)名称:华龙证券股份有限公司
地址:兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼
法定代表人:陈牧原
联系人:范坤
电话:0931-4890208
客服电话:400-6898888
网址:www.hlzq.com

(18)名称:嘉实财富管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期53层5312-15单元
办公地址:北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层
法定代表人:赵学军
联系人:李雯
电话:010-60842306
客服电话:400-021-8850
公司网址:www.harvestwm.cn

(19)名称:奕丰基金销售有限公司
办公地址:深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室
法定代表人:TEO WEE HOWE
联系人:叶健
电话:0755-89460507
客服电话:400-684-0500
公司网址:www.ifastps.com.cn

(20)名称:东吴证券股份有限公司
地址:苏州工业园区星阳街5号
法定代表人:范力
联系人:陆晓
电话:0512-62938690
客服电话:95330
网址:www.dwzq.com.cn

(21)名称:国联证券股份有限公司
注册地址: 江苏省无锡市金融一街8号
办公地址:江苏省无锡市金融一街8号国联大厦702
法定代表人:姚志勇
联系人:祁昊
电话:0510-82831662
客服电话:95570
网址:www.glsc.com.cn

(22)名称:阳光人寿保险股份有限公司
注册地址:海南省三亚市迎宾路360-1号三亚阳光金融广场16层
办公地址:北京市朝阳区朝外大街乙12号昆泰国际大厦12层
法定代表人:李科
联系人:王超
电话:010-85632771
客服电话:95510
网址:fund.sinosig.com

(23)名称:华融证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街8号
办公地址:北京市朝阳区朝阳门北大街18号中国人保寿险大厦12层
法定代表人:张海文
联系人:孙燕波
电话:010-85556048
客服电话:95390;400-898-9999
网址:www.hrsec.com.cn

(24)名称:上海挖财基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
法定代表人:冷飞
联系人:孙琦
电话:021-50810687
客服电话:4000256569
公司网址:www.wacai.com

(25)名称:北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路甲19号嘉盛SOHO中心30层
法定代表人:周斌
联系人:侯艳红
电话:010-53572363
客服电话:4008980618
网址:www.chtwm.com

(26)名称:宜信普泽投资顾问(北京)有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
办公地址:北京市朝阳区建国路88号楼soho现代城C座18层1809
法定代表人:戎兵
联系人:魏晨
电话:010-52413385
客服电话:400-6099-200
网址:www.yixinfund.com

(27)名称:济安财富(北京)基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307
办公地址:北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307
法定代表人:杨健
联系人:李海燕
电话:010-65309516
客服电话: 400-673-7010
公司网址:www.jianfortune.com

(28)名称:北京植信基金销售有限公司
注册地址:北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106室-67
办公地址:北京市朝阳区惠河南路盛世龙源10号
法定代表人:于龙
联系人:吴鹏
电话:010-56075718
客服电话:4006-802-123
公司网址: www.zhixin-inv.com

(29)名称:中泰证券股份有限公司
注册(办公)地址:山东省济南市市中区经七路 86 号
法定代表人:李玮
联系人:陈曦
电话:021-20315086
客服电话:95538(全国)
公司网址:www.qlzq.com.cn

(30)名称:世纪证券有限责任公司
注册地址:深圳市前海深港合作区南山街道桂湾五路128号前海深港基金小镇对冲基金中心406
办公地址:深圳市福田区深南大道招商银行大厦40-42层
法定代表人:李强
联系人:王雯
电话:0755-83199511
客服电话:400-8323-000
网址:www.csco.com.cn

(31)名称:东北证券股份有限公司
注册地址:长春市生态大街6666号
办公地址:长春市生态大街6666号
法定代表人:李福春
联系人:安岩岩
电话:0431-85096517
客服电话:95360
网址:www.nesc.cn

(32)名称:大同证券有限责任公司
注册地址:山西省大同市城区迎宾街15号桐城中央21层
办公地址:山西省太原市小店区长治路世贸中心12层
法定代表人:董祥
联系人:薛津
电话:0351-4130322
客服电话:4007-121212
网址:www.dtsbc.com.cn

(33)名称:安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层
法定代表人:王连志
联系人:彭洁联
电话:0755-82558266
客服电话: 95517
网址:www.essence.com.cn

(34)名称:爱建证券有限责任公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1600号1幢32楼
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1600号1幢32楼
法定代表人:祝健
联系人:姚盛盛
电话:021-32229888
客服电话:4001-962-502
网址:www.ajzq.com

(35)名称:江苏汇林保大基金销售有限公司
注册地址:南京市高淳区经济开发区古檀大道47号
办公地址:南京市鼓楼区中山北路2号绿地紫峰大厦2005室
法定代表人:吴言林
联系人:林伊灵
电话:025-66046166-810
客服电话:025-66046166
网址:www.huilinbd.com

(36)名称:上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区宛平南路88号金座东方财富大厦26楼
法定代表人:其实
联系人:黄妮娟
电话:021-54509998
客服电话:400-1818-188
公司网址:www.1234567.com.cn

(37)名称:浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:杭州市文二西路1号903室
办公地址:杭州市余杭区五常街道同顺街18号同花顺大楼
法定代表人:凌顺平
联系人:吴强
电话:0571-88911818
客服电话:4008-773-772
公司网址:www.5ifund.com

(38)名称:上海陆金所基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人:王之光
联系人:宁博宇
电话:021-20665952
客服电话:4008219031
公司网址:www.lufunds.com

(39)名称:中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦2-6层
办公地址:北京市西城区金融大街35号国企大厦C座
法定代表人:陈共炎
联系人:辛国政
电话:010-83574507
客服电话:4008888888或95551
网址:www.chinastock.com.cn

(40)名称:北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
办公地址:北京市朝阳区望京SOHO塔2,B座2507
法定代表人:钟斐斐
联系人:王悦
电话:010-61840688
客服电话:400-0618-518
公司网址:www.danjuanapp.com

(41)名称:平安银行股份有限公司
注册地址:广东省深圳市罗湖区深南东路5047号
办公地址:广东省深圳市罗湖区深南东路5047号
法定代表人:谢永林
联系人:汤俊劼
电话:0755-22168301
客服电话:95511
公司网址:www.bank.pingan.com

(42)名称:上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
办公地址:上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906室
法定代表人:杨文斌
联系人:王诗玙
电话:021-20613643
客服电话:400-700-9665
公司网址:www.ehowbuy.com

(43)名称:联储证券有限责任公司
注册地址:广东省深圳市福田区华强北路圣廷苑酒店B 座26 楼
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路333 号金砖大厦8 楼
法定代表人:沙常明
联系人:丁倩云
联系方式:010-56177851
客服电话: 400 - 620 - 6868
公司网址: www.lczq.com

(44)名称:中国民生银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人: 洪崎
联系人:穆婷
电话:010-56367136
客服电话:95568
公司网址:www.cmbc.com.cn

(45)名称:深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园四栋10层1006
法定代表人:洪弘
联系人:文雯
电话:010-83363101
客服电话:4001661188
网址:www.xinlande.com.cn

(46)名称:珠海盈米基金销售有限公司
注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔1201-1203室
法定代表人:肖雯
联系人:熊艳芳
电话:020-89629066
客服电话:020-89629066
公司网址:https://www.yingmi.cn/

(47)名称:信达证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:肖林
联系人:付婷
电话:010-83252185
客服电话:95321
网址:www.cindasc.com

(48)名称:新时代证券股份有限公司
注册地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
办公地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
法定代表人:叶顺德
联系人:田芳芳
电话:010-83561146
客服电话:4006989898或95399
网址:www.xsdzq.cn

(49)名称:粤开证券股份有限公司
注册地址:惠州市江北东江三路55号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层
办公地址:深圳市福田区深南中路2002号中广核大厦北楼10层
法定代表人:严亦斌
联系人:彭莲
电话:0755-83331195
客服电话:95564
网址:www.ykzq.com

基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构销售本基金。代销机构信息,以基金管理人网站公示为准。

(二)登记机构名称:
名称:金鹰基金管理有限公司
注册地址:广东省广州市南沙区海滨路171号11楼自编1101之一J79
办公地址:广东省广州市天河区珠江东路28号越秀金融大厦30楼
电话:020-38283037
传真:020-83282856
联系人:张盛

(三)律师事务所和经办律师
名称:广东岭南律师事务所
住所:广州市海珠区阅江西路370号广报中心北塔15楼
法定代表人:邓柏涛
电话:020-81836088
传真:020-31952316
经办律师:欧阳兵、谢洁、伍瑞祥

(四)会计师事务所和经办注册会计师
名称:毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:中国北京东长安街1号东方广场毕马威大楼8层
法定代表人:邹俊
电话:+86(10)85085000
传真:+86(10)85085111
邮编:100738
经办注册会计师:叶云晖,刘西茜

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2019年6月17日中国证监会证监许可[2019]1057号文件准予募集注册。

(一)基金的类型及存续期间
1、基金类型:混合型证券投资基金
2、基金运作方式:契约型定期开放式
3、存续期间:不定期

(二)募集方式和募集场所

通过各销售机构的基金销售网点公开发售,各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。

(三)募集期限

募集期间为自2019年8月5日至2019年8月23日止,金鹰民安回报定开A类份额募集规模为511,619,626.46份;金鹰民安回报定开C类份额募集规模为97,278,091.88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)基金备案及合同的生效

金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金募集期间为自2019年8月5日至2019年8月23日止,基金募集达到基金备案条件,2019年8月29日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,《基金合同》生效。

(二)基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

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

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,并在基金管理人网站公示。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

(二)申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

本基金封闭运作期及开放运作期的具体规定,见基金合同第三部分"基金的基本情况"之"三、基金的运作方式"。

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

本基金在封闭运作期内,不开放申购与赎回。除法律法规或《基金合同》另有约定外,自首个封闭期结束之后第一个工作日起(包括该日),本基金进入首个开放期,开始办理申购和赎回等业务。本基金每个封闭期结束之后第一个工作日(包括该日)起进入下一个开放期。开放期以及开放期办理申购与赎回业务的具体事宜见《招募说明书》及基金管理人届时发布的相关公告。如发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放或需依据基金合同暂停申购或赎回业务的,基金管理人有权合理调整申购或赎回业务的办理期间并予以公告。

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

(三)申购与赎回的原则

1、"未知价"原则,即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的某一类别基金份额净值为基准进行计算;
2、"金额申购、份额赎回"原则,即申购以金额申请,赎回以份额申请;
3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销;
4、赎回遵循"先进先出"原则,即按照投资者认购、申购的先后次序进行顺序赎回。
5、办理申购、赎回业务时,应当遵循基金份额持有人利益优先原则,确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。

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,投资者在规定时间前全额交付申购款项,申购申请成立;基金份额登记机构确认基金份额时,申购生效。

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

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

3、申购和赎回申请的确认

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

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回申请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。

(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),单笔最低金额为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本基金时,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。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和基金管理人直销中心柜台赎回份额的,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余额不足1份的需全部赎回。

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

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

4、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时,基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施,切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要,可采取上述措施对基金规模予以控制。具体请参见相关公告。

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

(六)申购费用和赎回费用

本基金C类份额不收取申购费,A类份额申购费为:

申购金额M(元)	申购费率
M＜100万	0.80%
100万≤M＜300万	0.60%
300万元≤M＜500万	0.30%
M≥500万	1000元/笔

本基金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。

本基金的申购费用在投资者申购基金份额时收取。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。

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A、C类份额赎回费为:

持有基金份额期限(Y)	A类份额赎回费率	C类份额赎回费率
Y＜7日	1.50%	1.5%
7天≤Y＜1个月	0.75%	0.5%
1个月≤Y＜6个月	0.50%	0.00%
6个月≤Y	0.00%	0.00%

(注:1个月按30天计算,6个月按180天计算以此类推。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。)

对持续持有期少于30日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产;对持续持有期少于3个月的投资者收取的赎回费不低于赎回费总额的75%计入基金财产;对持续持有期长于3个月但少于6个月的投资者收取的赎回费不低于赎回费总额的50%计入基金财产;对持续持有期长于6个月的投资者,应当将不低于赎回费总额的25%计入基金财产。赎回费中计入基金财产之余的费用用于支付登记费和其他必要的手续费。

3、本基金份额净值的计算,均保留到小数点后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。基金合同生效后,在开始办理基金份额申购或者赎回前,基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。在开始办理基金份额申购或者赎回后,T日的基金份额净值和基金份额累计净值在当天收市后计算,并在T+1日内公告。遇特殊情况,经履行适当程序,可以适当延迟计算或公告。

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

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

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

(七)申购份额与赎回金额的计算

1、本基金份额的申购金额包括申购费用和净申购金额,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,计算公式:

申购费用采用比例费率时:
净申购金额=申购金额/(1+申购费率)
申购费用=申购金额-净申购金额
申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值
申购费用采用固定金额时:
申购费用=固定金额
净申购金额=申购金额-申购费用
申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值

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元申购本基金A类份额,假设申购当日基金A类份额净值为1.0500元,则可得到的申购份额为:
净申购金额=100,000/(1+0.80%)=99,206.35元
申购费用=100,000-99,206.35=793.65元
申购份额=99,206.35/1.0500=94,482.24份

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

2、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(如有),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份基金份额,且持续持有期为5日,则对应的赎回费率为1.50%,假设赎回当日基金份额净值是1.0800元,则其可得到的赎回金额为:
赎回总金额=10,000.00×1.0800=10,800.00元
赎回费用=10,800×1.50%=162.00元
净赎回金额=10,800-162=10,638.00元

即:该投资者赎回本基金10,000份基金份额,且持续持有期为5日,假设赎回当日基金份额净值是1.0800元,则其可得到的赎回金额为10,638.00元。

(八)拒绝或暂停申购的情形

在开放期内发生下列情况时,基金管理人可拒绝或暂停接受投资者的申购申请:
1、因不可抗力导致基金无法正常运作。
2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接受投资者的申购申请。
3、证券交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。
5、基金资产规模过大,使基金管理人无法找到合适的投资品种,或其他可能对基金业绩产生负面影响,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、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%,或者变相规避50%集中度的情形时。
8、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时,经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当暂停接受基金申购申请。
9、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限的。
10、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

在开放期内发生上述第1、2、3、5、6、8、10项暂停申购情形之一时且基金管理人决定暂停申购的,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,开放期相应顺延。

(九)暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

在开放期内发生下列情形时,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、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时,经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。
6、发生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,基金管理人可暂停接受基金份额持有人的赎回申请。
7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

在开放期内发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项时,基金管理人应在规定期限内在指定媒介上刊登公告。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,开放期相应顺延。

(十)巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一开放日的基金总份额的20%,即认为是发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

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

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

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

(3)在开放期内,若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的单日赎回申请超过前一工作日基金总份额40%的,基金管理人认为支付该基金份额持有人的全部赎回申请有困难或者因支付该基金份额持有人的全部赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时,在当日接受该基金份额持有人的全部赎回的比例不低于前一工作日基金总份额的40%的前提下,其余赎回申请可以延期办理,当日未获受理的赎回申请将与下一开放日的赎回申请一并处理,但延期办理的期限不得超过20个工作日,如延期办理期限超过开放期的,开放期相应延长,延长的开放期内不办理申购,亦不接受新的赎回申请,即基金管理人仅为原开放期内因提交赎回申请超过前一工作日基金总份额40%而被延期办理赎回的单个基金份额持有人办理赎回业务。

3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期支付时,基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在3个交易日内通知基金份额持有人,说明有关处理方法,并在2日内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,基金管理人应在规定期限内在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个开放日两类基金份额净值。
3、若发生暂停的时间超过1日,则基金管理人自行确定公告增加次数,并根据《信息披露管理办法》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基金合同的规定制定并公告,并提前告知基金托管人与相关机构。

(十三)基金份额的转让

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

(十四)基金的非交易过户

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

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

(十五)基金的转托管

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

(十六)定期定额投资计划

基金管理人可以为投资者办理定期定额投资计划,具体规则由基金管理人另行规定。投资者在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额,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,基金管理人可办理基金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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(含国债、地方政府债、金融债、公司债、企业债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

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

本基金投资组合中股票资产占基金资产的比例为0-40%,但在每次开放期的前20个交易日、开放期及开放结束后20个交易日的期间内,基金投资不受上述比例限制;开放期内,每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,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%,在封闭期内,本基金不受上述5%的限制,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

当法律法规的相关规定变更时,基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。

(三)投资策略

1、封闭期投资策略

(1)资产配置策略

本基金将从宏观经济、财政货币政策、经济景气度和货币资金供求等多个维度进行综合分析,主动判断市场时机,在严格控制投资组合风险的前提下,进行积极灵活的资产配置,合理确定基金在股票类、债券类、现金类等大类资产上的投资比例,最大限度地提高基金资产的收益。

(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

本基金以研究宏观经济运行趋势、经济周期位置和宏观政策动向等为出发点,预测市场未来债券收益率曲线的变化趋势,及对收益率曲线形态和期限结构变动进行分析,结合信用债投资以构建债券组合确定最优的期限结构,并据此积极调整债券组合的平均久期及期限分布,以有效提高债券组合的总投资收益。

3)收益率曲线策略

通过对财政货币政策取向、流动性、债券供求、市场风险偏好等因素进行综合分析,在此基础上预测利率期限结构及收益率曲线的变化趋势以进行积极资产配置;并根据收益率曲线上不同年限收益率的息差特征,通过骑乘策略,投资于具备潜在价值的债券。

4)套利策略

本基金在对债券基本面分析的基础上,利用市场定价偏误,收益率曲线偏移、流动性、息差、久期、限制条款等差异因素,积极运用各类套利方法对固定收益资产投资组合进行管理与调整,捕捉交易机会,力争获取超额收益。

5)相对价值投资策略

本基金将综合运用利率预期、收益率曲线估值、信用风险分析、流动性分析等方法来评估个券的投资价值,在基本关注一定利率区间范围内具有较高票面利率的个券,以及具有较好流动性的个券,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投资价值和收益率。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债券品种及个券。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。

7)可转债投资策略

对于可转换公司债券(包括分离交易可转债),本基金在对债券发债公司基本面进行深入分析的基础上,利用到期收益率来判别可转债的纯债价值,选择纯债价值被低估的可转债提升本基金投资的安全性;通过对发债公司未来经营绩效的预测、股票估值模型、未来宏观经济走势以及股票市场运行趋势,来判别可转债的期权价值,优先选择期权价值被低估的可转债。

(3)股票投资策略

本基金将充分发挥基金管理人的研究优势,根据不同市场环境灵活运用成长、主题、动量、事件驱动等多种投资策略积极进行股票投资。通过对以上策略的综合运用,力争实现基金资产的稳健增值。

1)成长策略

本基金所指的成长策略主要指本基金对新兴产业、行业景气度较高或处于上升阶段的转型行业及实现革新转型、持续增长的传统产业中具有成长风格的上市公司的投资策略。对于新兴行业和处于转型阶段的行业,重点投资能够体现行业发展方向、拥有关键技术、创新意识领先并已经形成明确盈利模式、预期利润及销售收入持续增长的企业;对于实现转型革新、持续增长的传统产业,通过关注产业增长的持续性、核心竞争力、发展战略布局以及市场空间等层面,重点投资具有清晰商业模式、业绩持续增长且具有不可复制性的上市公司。本基金将精选上述行业中代表性较强、成长性良好、估值具有吸引力,预期业绩持续增长的成长型个股进行投资。

2)主题策略

本基金所指的主题是指国内外实体经济、政府政策、科学技术、社会变迁、金融市场等层面已经发生或预期将发生的,将导致行业或企业竞争力提升、盈利水平改善的驱动因素,涵盖但不限于内需增长、消费提振与消费升级、经济与产业结构优化、投资结构与布局改善、社会保障与医疗改革、节能减排、环保、产业转移、产业链优化、新能源与新材料、技术革新、城镇化、资源要素改革、金融财税改革等所带来的投资主题。本基金将通过分析研究上述投资主题对经济结构、产业结构和商业运作模式的影响力度,发掘和把握投资主题;通过对投资主题的分析评估,明确投资主题所对应的行业及板块,从而确定受益于上述相关主题的上市公司。同时,本基金将积极挖掘和研究新的投资主题,对投资主题进行动态跟踪,从而准确把握新旧投资主题的转换时机,分享不同投资主题所伴随的投资机遇。

3)动量策略

本基金所指的动量策略是指市场在一定时间内呈现"强者恒强"的特征,通过买入过去一段时期的表现强势的个股以获得超越市场平均水平的收益的投资策略。本基金将综合分析各股票价格走势及价格动量特征,选择动量特征明显和价格趋势强劲的个股纳入投资组合。

4)事件驱动策略

本基金所指的事件驱动策略是指在提前挖掘和深入分析可能造成股价异常波动的事件基础上,通过充分把握交易时机获取超额投资回报的投资策略。本基金的事件驱动策略中涵盖的事件是指具有较明确的时间和内容,能够对部分投资者的投资行为产生一定的影响进而对股价走势产生影响的事件性因素,包括但不限于资产重组(重组、兼并、收购等)、股权变更、股权激励、管理层变动、控股股东更替、股份解禁、发布重大公告或推出新业务新产品、业绩预增等。事件驱动策略是一个系统的投资策略体系,通过分析特定事件对上市公司价值和股价的影响,寻求投资机会,获取由该事件带来的收益。

(4)资产支持证券投资策略

本基金将综合运用资产配置、久期管理、收益率曲线、信用管理和个券α策略等策略积极主动进行资产支持证券产品投资。本基金管理人将坚持风险调整收益最大化的原则,通过信用资质研究和流动性管理,遵守法律法规和基金合同的约定,严格控制投资风险,确保本基金相对安全和基金资产具有良好流动性,以期获得长期稳定收益。

(5)股指期货投资策略

本基金以套期保值为目的,参与股指期货交易。

本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素,结合定性和定量方法,确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模,以及中国证监会的相关限定和要求,确定参与股指期货交易的投资比例。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。若相关法律法规发生变化时,基金管理人期货投资管理从其最新规定,以符合上述法律法规和监管要求的变化。

(6)国债期货投资策略

国债期货作为利率衍生品的一种,有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。管理人将按照相关法律法规的规定,结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系,对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控,在最大限度保证基金资产安全的基础上,力求实现基金资产的长期稳定增值。

2、开放期投资策略

在开放期内,本基金为保持较高的组合流动性,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种,防范流动性风险,满足开放期流动性的需求。

(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)本基金投资组合中股票资产占基金资产的比例为0-40%,但在每次开放期的前20个交易日、开放期及开放结束后20个交易日的期间内,基金投资不受上述比例限制;

(2)开放期内,每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等,在封闭期内,本基金不受上述5%的限制;

(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)基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

(11)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;

(12)封闭期内,本基金资产总值不得超过基金资产净值的200%;开放期内,本基金资产总值不得超过基金资产净值的140%;

(13)本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的15%;

(14)本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的30%;

(15)开放期内,本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的15%。

因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。

(16)基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应与基金合同约定的投资范围保持一致;

(17)本基金参与股指期货、国债期货交易,应当遵守下列要求:
1)本基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的10%;
2)在任何交易日日终持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的95%,其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;
3)在任何交易日日终,持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%;
4)在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%;
5)本基金所持有的股票市值、买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;
6)本基金在任何交易日日终,持有的买入国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;
7)持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%;
8)本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的30%;
9)本基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定;

(18)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券/期货市场波动、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,除上述第(2)、(9)、(15)、(16)项规定的情形外,基金管理人应当在10个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。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6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。期间,基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。

基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:
(1)承销证券;
(2)违反规定向他人贷款或者提供担保;
(3)从事承担无限责任的投资;
(4)买卖其他基金份额,但是中国证监会另有规定的除外;
(5)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)法律、行政法规和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承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循基金份额持有人利益优先原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

如法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。

(六)业绩比较基准

本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率×20%+中债总财富(总值)指数收益率×80%

本基金选择上述业绩比较基准主要是因为本基金为混合型基金。沪深300指数对A股市场总体走势具有较强代表性,适合作为本基金股票投资部分的业绩比较基准。中债总财富(总值)指数收益率是反映境内利率类债券整体价格走势情况的分类指数,是债券组合投资管理业绩评价的有效工具。此外,本基金还参考预期的大类资产配置比例设置了业绩比较基准的权重,采用上述业绩比较基准能够[illegible]。

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业绩比较基准的指数时,本基金管理人可以在保护基金份额持有人合法权益的原则下,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

本基金为混合型证券投资基金,其预期收益和风险水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。

(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)基金投资组合报告

本投资组合报告所载数据截止日为2019年12月31日,本报告中所列财务数据未经审计。

本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金的托管人根据基金合同的规定,复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	192,247,390.16	21.85
	其中:股票	192,247,390.16	21.85
2	固定收益投资	626,697,385.60	71.24
	其中:债券	584,992,385.60	66.50
	资产支持证券	41,705,000.00	4.74
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	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	26,517,459.90	3.01
7	其他各项资产	34,243,000.12	3.89
8	合计	879,705,235.78	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

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	7,779,975.00	1.20
C	制造业	103,581,818.92	15.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,128,310.42	0.33
J	金融业	34,011,685.82	5.24
K	房地产业	44,745,600.00	6.90
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	192,247,390.16	29.63

(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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000002	万科A	700,000	22,526,000.00	3.47
2	601601	中国太保	540,000	20,433,600.00	3.15
3	000895	双汇发展	635,000	18,434,050.00	2.84
4	600048	保利地产	970,000	15,694,600.00	2.42
5	600885	宏发股份	350,000	12,057,500.00	1.86
6	300124	汇川技术	379,987	11,642,801.68	1.79
7	300470	中密控股	429,887	11,615,546.74	1.79
8	000425	徐工机械	1,894,100	10,360,727.00	1.60
9	300450	先导智能	230,000	10,336,200.00	1.59
10	002850	科达利	209,850	9,548,175.00	1.47

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	1,856,000.00	0.29
2	央行票据	-	-
3	金融债券	322,595,000.00	49.72
	其中:政策性金融债	69,853,000.00	10.77
4	企业债券	70,581,000.00	10.88
5	企业短期融资券	40,081,000.00	6.18
6	中期票据	49,623,800.00	7.65
7	可转债(可交换债)	100,255,585.60	15.45
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	584,992,385.60	90.16

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	190210	19国开10	700,000.00	69,853,000.00	10.77
2	143652	18光证G3	500,000.00	50,805,000.00	7.83
3	112690	18广发01	500,000.00	50,760,000.00	7.82
4	143229	17国君G1	500,000.00	50,430,000.00	7.77
5	112386	16申宏01	400,000.00	40,216,000.00	6.20

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

序号	证券代码	证券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	159867	锦安1A4	150,000.00	15,009,000.00	2.31
2	139767	龙光10A	100,000.00	10,068,000.00	1.55
3	139760	联易融13	100,000.00	10,060,000.00	1.55
4	165028	恒信19A1	100,000.00	6,568,000.00	1.01

注:本基金本报告期末仅持有四只资产支持证券。

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于股指期货。

(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)报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

(2)本期国债期货投资评价

无。

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之一的广发证券股份有限公司因存在对境外子公司管控不到位、以低于成本价格参与公司债券项目投标的等行为,于2019年3月27日、4月25日被中国证券监督管理委员会广东监管局采取责令改正的行政监管措施、2019年8月6日被中国证券监督管理委员会采取限制业务规模、限制增加新业务6个月的行政监管措施。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

本基金投资的前十名证券的发行主体之一的上海浦东发展银行股份有限公司因成都分行授信业务及整改情况严重失察、重大审计发现未向监管部门报告、轮岗制度执行不力的违规行为于2019年10月14日被中国银行保险监督管理委员会罚款130万元。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

(2)本基金本报告期内投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

(3)其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	282,858.31
2	应收证券清算款	24,327,557.00
3	应收股利	-
4	应收利息	9,632,584.81
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	34,243,000.12

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110054	通威转债	32,251,167.60	4.97
2	113011	光大转债	20,693,560.00	3.19
3	113508	新凤转债	709,115.20	0.11
4	123011	德尔转债	7,498,196.10	1.16
5	127005	长证转债	6,072,000.00	0.94
6	128032	双环转债	3,014,400.00	0.46
7	132006	16皖新EB	1,710,400.00	0.26

(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

(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、基金的业绩

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2019年8月29日,基金合同生效以来(截至2019年12月31日)的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示:

1、金鹰民安回报定开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
2019.8.29-2019.12.31	6.58%	0.34%	2.56%	0.16%	4.02%	0.18%

注:本基金收益分配是按日结转份额。

2、金鹰民安回报定开C:

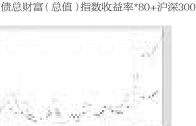
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2019.8.29-2019.12.31	6.44%	0.34%	2.56%	0.16%	3.88%	0.18%

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

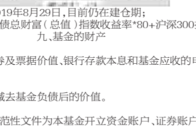
金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2019年8月29日至2019年12月31日)

1. 金鹰民安回报定开A:



注:(1)本基金合同生效日期为2019年8月29日,目前仍在建仓期;
(2)本基金的业绩比较基准是:中债总财富(总值)指数收益率*80+沪深300指数收益率*20%。

2. 金鹰民安回报定开C:



注:(1)本基金合同生效日期为2019年8月29日,目前仍在建仓期;
(2)本基金的业绩比较基准是:中债总财富(总值)指数收益率*80+沪深300指数收益率*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注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

(四)基金财产的保管和处分

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

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

十、基金资产的估值

(一)估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

(二)估值对象

基金所拥有的股票、债券、期货合约和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

(三)估值原则

基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时,应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

1、对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种,在估值日有报价的,除会计准则规定的例外情况外,应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的,应对报价进行调整,确定公允价值。

与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2、对不存在活跃市场的投资品种,应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时,应优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才可以使用不可观察输入值。

3、如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件,使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的,应对估值进行调整并确定公允价值。

(四)估值方法

1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1)交易所上市的有价证券(含股票等),以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值;估值日无交易的,且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,以最近交易日的市价(收盘价)估值;如最近交易日后发生影响公允价值计量的重大事件的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格。

(2)对在交易所市场上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种(另有规定的除外),选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。

(3)交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种,选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值。

(4)对在交易所市场上市交易的可转换债券、可交换债券,实行全价交易的,按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息后得到的净价进行估值;实行净价交易的,按估值日收盘价进行估值。估值日没有交易的,且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,实行全价交易的,按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值;实行净价交易的,按最近交易日债券收盘价估值。如最近交易日后发生了影响公允价值计量的重大事件的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格。

(5)对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券,选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值,对第三方估值机构未提供估值价的,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

(6)交易所上市不存在活跃市场的有价证券,采用估值技术确定公允价值。

(7)对在交易所市场上市交易或未挂牌转让的固定收益品种,对存在活跃市场的情况下,应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值;对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下,应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值;对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

2、银行间市场交易的固定收益品种的估值

(1)对银行间市场上不含权的固定收益品种,按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种,按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资者回售权的固定收益品种,回售登记截止日(含当日)后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。

(2)对银行间市场未上市,且第三方估值机构未提供估值价格的固定收益品种,在发行利率与二级市场利率不存在明显差异,未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下,按成本估值。

3、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的,按债券所处的市场分别估值。

4、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:

(1)送股、转增股、配股和公开增发的新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值;

(2)首次公开发行未上市的股票、债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值;

(3)在发行时明确一定期限限售期的股票,包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等,不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

5、期货合约,一般以估值当日期货的结算价格进行估值,估值当日无结算价的,且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,采用最近交易日结算价估值。当日结算价及结算规则以《中国金融期货交易所结算细则》为准。如法律法规今后另有规定的,从其规定。

6、当发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可以采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性。

7、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。

8、相关法律法规以及监管部门有强制规定的,从其规定。如有新增事项,按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时,应立即通知对方,共同查明原因,双方协商解决。

根据有关法律法规,基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任,因此,就与本基金有关的会计问题,如经相关各方在平等基础上充分讨论后,仍无法达成一致的意见,按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

(五)估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后,基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算,精确到0.0001元,小数点后第5位四舍五入。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的,从其规定。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及两类基金份额净值,并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后,将两类基金份额净值结果发送基金托管人,经基金托管人复核无误后,由基金管理人对外公布。

(六)估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生估值错误时,视为基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理:

1、估值错误类型

本基金运作过程中,如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资者自身的过错造成估值错误,导致其他当事人遭受损失的,过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人("受损方")的直接损失按下述"估值错误处理原则"给予赔偿,承担赔偿责任。

上述估值错误的主要类型包括但不限于:资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。

2、估值错误处理原则

(1)估值错误已发生,但尚未给当事人造成损失时,估值错误责任方应及时协调各方,及时进行更正,因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担;由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误,给当事人造成损失的,由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任;若估值错误责任方已经积极协调,并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正,则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认,确保估值错误已得到更正。

(2)估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责,不对间接损失负责,并且仅对估值错误的有关直接当事人负责,不对第三方负责。

(3)因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失("受损方"),则估值错误责任方应赔偿受损方的损失,并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利;如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方,则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

(4)估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

3、估值错误处理程序

估值错误被发现后,有关的当事人应当及时进行处理,处理的程序如下:
(1)查明估值错误发生的原因,列明所有的当事人,并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方;
(2)根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估;
(3)根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失;
(4)根据估值错误处理的方法,需要修改基金登记机构交易数据的,由基金登记机构进行更正,并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下:

(1)基金份额净值计算出现错误时,基金管理人应当立即予以纠正,通报基金托管人,并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2)错误偏差达到基金份额净值的0.25%时,基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案;错误偏差达到基金份额净值的0.5%时,基金管理人应当公告,并报中国证监会备案。

(3)前述内容如法律法规或者监管部门另有规定的,从其规定。如果行业另有通行做法,双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

(七)暂停估值的情形
1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;
2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;
3、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时,经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当暂停基金估值;
4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

(八)基金净值的确认

基金资产净值和两类基金份额净值由基金管理人负责计算,基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金净值信息并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人,由基金管理人对基金净值予以公布。

(九)特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按本部分第三条有关估值方法规定的第7项条款进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力,或证券交易所、登记结算机构及存款银行等第三方机构发送的数据错误,或国家会计政策变更、市场规则变更等非基金管理人与基金托管人原因,基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但未能发现错误的,由此造成的基金资产估值错误,基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

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、C类基金份额的销售服务费;
4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费;
6、基金份额持有人大会费用;
7、基金的相关账户的开户费用、账户维护费用;
8、基金的证券交易及结算费用;
9、基金的银行汇划费用;
10、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1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$H=E\times1.00\%\div当年天数$

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,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等,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0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$H=E\times0.15\%\div当年天数$

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,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5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。

3、销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额收取销售服务费。

本基金销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.40%年费率计提,销售服务费的计算方法如下:

$H=E\times0.40\%\div当年天数$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费
E为C类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给登记结算机构,由登记结算机构代付给销售机构。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4-10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。

基金财产投资的相关税收,由基金份额持有人承担,基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

十二、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其它有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对前期披露的《金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金招募说明书》进行了更新,主要更新的内容如下:

(1) 更新基金管理人的相关信息,详见第三部分;
(2) 更新基金托管人的主要信息。详见第四部分;
(3) 更新代销机构等相关服务机构的信息,详见第五部分;
(4) 更新了本报告期末基金投资组合、基金业绩比较基准及基金成立以来累计净值增长率趋势等相关投资业绩信息。详见:第九部分之第(九)基金投资组合报告,第十部分基金的业绩;
(5) 详细披露了报告期间与本基金有关的公告。详见第二十二部分其它应披露事项;
(6) 依据本基金修改后的基金合同,更新了"第一部分绪言"、"第二部分释义"、"第八部分基金份额的申购、赎回与转换"、"第十三部分基金的收益分配"、"第十四部分基金费用与税收"、"第十五部分基金的会计与审计"、"第十六部分基金的信息披露"、"第十九部分基金合同的内容摘要"、"第二十部分基金托管协议的内容摘要"等相关内容。

金鹰基金管理有限公司
2020年2月28日