信达澳银基金管理有限公司信达澳银安盛纯债债券型证券投资基金在直销柜台开展赎回费率优惠活动的公告

公告送出日:2020 年 1 月 20 日

为了更好地向投资者提供服务,满足投资者的理财需求,信达澳银基金管理有限公司(以下简称"本公司")决定自 2020 年 1 月 20 日起至 2020 年 1 月 31 日期间,对通过本公司直销柜台申请赎回下列基金的投资者开展赎回费率优惠活动,具体安排如下:

1.适用基金

信达澳银安盛纯债债券型证券投资基金(基金代码:007768)

2.适用渠道

信达澳银基金管理有限公司直销柜台

办公地址:广东省深圳市南山区科苑南路(深圳湾段)3331 号阿里巴巴大厦 T1 座第 8 层和第 9 层

电话:0755-82858168/83077068

传真:0755-83077038

联系人:王丽燕

公司网址:www.fscinda.com

邮政编码:518054

3.优惠活动期限

自 2020 年 1 月 20 日起实施,优惠活动截止时间为 2020 年 1 月 31 日。

4.费率优惠情况说明

优惠活动期间,投资者通过本公司直销柜台赎回上述基金,将享受如下赎回费率优惠:

持有基金份额期限(T)	原赎回费率	优惠后的赎回费率
T<7 日	1.5%	1.5%
7 日≤T<30 日	0.1%	0.025%
T≥30 日	0	0

优惠后的赎回费将 100%归入基金资产,归入基金资产的部分不低于基金《招募说明书》中相对应需计入基金资产部分的比例规定。此次费率优惠不会对基金份额持有人利益造成不利影响。

本次活动仅适用于在优惠活动期限内通过本公司直销柜台赎回上述基金业务,不适用于基金份额的转换转出业务。

5.重要提示

(1)本公告涉及相关费率优惠活动的最终解释权归本公司,优惠活动期间,业务办理的相关规则及流程以本公司的安排和规定为准。

(2)投资者可通过以下途径咨询有关详情:

信达澳银基金管理有限公司

客户服务电话:400-8888-118/ 0755-83160160

网站:www.fscinda.com

(3)风险提示: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,也不保证最低收益。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的《基金合同》、《招募说明书》。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

信达澳银基金管理有限公司

2020 年 1 月 20 日

天弘基金管理有限公司关于调整天弘沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金交易结算模式的公告

根据《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》和《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》相关规定,天弘基金管理有限公司(以下简称"本公司")决定自 2020 年 1 月 20 日起,调整天弘沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金交易结算模式并对招募说明书中相关内容进行修订。详情如下:

一、适用范围

天弘沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(基金代码:515330,以下简称"本基金")。

二、调整内容

调整跨市场股票 ETF 申购未卖出份额、申购赎回过程中涉及深市组合证券现金替代的结算模式。具体内容详见本基金修订后的招募说明书。

三、重要提示

1、本次调整系因相关业务规则发生变动而进行的修改,符合相关法律法规及基金合同的规定,且对基金份额持有人利益无实质性不利影响,无需经基金份额持有人大会表决。

2、本公告仅对本次交易结算模式调整的有关事项进行说明,本基金招募说明书中涉及的内容已进行相应调整。

3、投资者如有疑问可登录本公司官方网站(www.thfund.com.cn)或拨打我公司客户服务热线(95046)进行详细咨询。

风险提示:本公司承诺以诚实信用、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,也不保证最低收益。投资者投资本公司管理的基金时,应认真阅读基金合同、招募说明书等法律文件,并注意投资风险。

特此公告。

天弘基金管理有限公司

二〇二〇年一月二十日

(上接 D63 版)

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

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

9、个人投资者的公开申购。

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

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形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)超过前一工作日的基金总份额的 20%,即认为是发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时,基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或延缓支付。

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

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

(3)在开放期内,若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的单日赎回申请超过前一工作日基金总份额 50%的,基金管理人认为支付该基金份额持 有人的全部赎回申请有困难或者因支付该基金份额持有人的全部赎回申请而进 行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时,在当日接受该基金份额持 有人的全部赎回的比例不低于前一工作日基金总份额 50%的前提下, 其余赎回申请可以延期办理,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 50%而被延期办理赎回的单个基金份额持有人办理赎回业务。

3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延缓支付时,基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人,说明有关处理方法,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 个开放日的两类基金份额净值。

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、解冻与质押

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,以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

基金份额被冻结的,被冻结部分产生的权益一并冻结,被冻结部分份额仍然参与收益分配。法律法规或监管机构另有规定的除外。

如相关法律法规允许基金管理人办理基金份额的质押业务或其他基金业务,基金管理人将制定和实施相应的业务规则。

(十八)基金份额的折算

基金管理人有权根据市场情况对本基金进行份额折算,折算前后基金持有人持有的基金资产不变。基金管理人将在份额折算前 3 个工作日就折算方案、折算时间等内容进行相应公告。

如相关法律规允许基金管理人办其他基金业务,基金管理人将制定和实施相应的业务规则。

(十九) 在不违反相关法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下, 基金管理人可根据具体情况对上述申购和赎回以及相关业务的安排进行补充和调整并提前公告,无需召开基金份额持有人大会审议。

七、基金的投资

(一)投资目标

本基金在追求基金资产长期稳健增值的基础上,力争为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的稳定收益。。

(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国债、金融债、公司债、企业债、地方政府债、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券、中期票据、同业存单、资产支持证券、债券回购、央行票据、银行存款(包括协议存款、定期存款以及其他银行存款)、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具 (但须符合中国证监会相关规定)。

本基金不投资股票、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。

基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%;但在每个开放期的前 10 个工作日和后 10 个工作日以及开放期间不受前述投资组合比例的限制。本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占资产净值的比例不受限制, 但在开放期本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,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

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。

(一)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。

(二)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。。

(三)中小企业私募债券投资策略

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)资产支持证券投资策略

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

(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)本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%;但在每个开放期的前 10 个工作日和后 10 个工作日以及开放期间不受前述投资组合比例的限制;

(2)本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占资产净值的比例不受限制, 但在开放期本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等;

(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)封闭期内,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)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%;

(12)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本基金资产净值的 15%;

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

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

(14)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。

除上述第(2)、(9)、(12)、(13)项以外,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 10 个交易日内进行调整, 但法律法规或中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

如果法律法规及监管政策等对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的,本基金可相应调整投资比例限制规定,不需经基金份额持有人大会审议。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、行政法规或者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:

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。

如果指数编制单位停止计算编制以上指数或更改指数名称、或今后法律法规发生变化、或有更适当的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,本基金管理人在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下, 可以根据本基金的投资范围和投资策略,调整基金的业绩比较基准,但应在取得基金托管人同意后报中国证监会备案,并及时公告,无须召开基金份额持有人大会审议。

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)基金投资组合报告(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基金合同的规定,已复核了本报告中的内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告有关数据截止日为 2019 年 9 月 30 日,本报告中所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	1,300,160,012.10	98.44
	其中:债券	1,226,037,012.10	92.83
	资产支持证券	74,123,000.00	5.61
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	3,078,508.17	0.23
7	其他各项资产	17,500,178.11	1.33
8	合计	1,320,738,698.38	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、待摊费用。

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投资股票。

(2)报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期内未通过港股通投资股票。

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	93,658,012.10	8.84
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,132,379,000.00	106.87
	其中:政策性金融债	1,132,379,000.00	106.87
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	1,226,037,012.10	115.71

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	180208	18 国开 08	2,100,000.00	213,633,000.00	20.16
2	180409	18 农发 09	1,500,000.00	153,180,000.00	14.46
3	170206	17 国开 06	1,000,000.00	102,260,000.00	9.65
4	180313	18 进出 13	1,000,000.00	101,340,000.00	9.56
5	170209	17 国开 09	1,000,000.00	101,230,000.00	9.55

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(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	139100	18 侨鑫 A	700,000.00	74,123,000.00	7.00

注:本基金本报告期末仅持有一只资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

(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

本基金本报告期末未投资国债期货。

(3)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本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(2)报告期内基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

(3)其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	30,314.47
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	17,469,863.64
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,500,178.11

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

(6)投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

八、基金的业绩

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。

本基金合同生效日为 2018 年 9 月 26 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:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2018.9.26-2018.12.31	1.50%	0.04%	1.81%	0.04%	-0.31%	0.00%
2019.1.1-2019.12.31	4.51%	0.05%	1.35%	0.04%	3.16%	0.01%
2018.9.26-2019.12.31	6.08%	0.05%	3.19%	0.04%	2.89%	0.01%

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

金鹰添盛定期开放债券型发起式证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018 年 9 月 26 日至 2019 年 12 月 31 日)

注:1.1 本基金合同于 2018 年 9 月 26 日生效;

1.2 本基金业绩比较基准为:中债综合(全价)指数收益率×80%+1 年期银行定期存款利率(税后)×20%;

九、基金的财产

一、基金资产总值

基金资产总值是指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。

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

基金所拥有的债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

(三)估值方法

1、证券交易所交易的固定收益品种的估值

(1)对在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(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;

(2)交易所上市实行全价交易的债券(可转债除外),选取第三方估值机构提供的对应债券当日估值全价减去估值全价中所含的债券(税后)应收利息得到的净价进行估值。

(3)对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券,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。

(4)对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的固定收益品种,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债券,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、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。

5、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。

6、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。

(四)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。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,由基金管理人按规定对外公布。

(五)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