

金鹰添利中长期信用债债券型证券投资基金

2018 年年度报告摘要

2018 年 12 月 31 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：二〇一九年三月二十六日

§ 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。本年度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 2019 年 3 月 25 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经审计。中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	金鹰添利信用债债券	
基金主代码	002586	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 2 月 22 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	17,397,927.12 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	金鹰添利信用债债券 A	金鹰添利信用债债券 C
下属分级基金的交易代码	002586	002587
报告期末下属分级基金的份额总额	14,867,479.39 份	2,530,447.73 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的前提下，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>（一）资产配置策略</p> <p>本基金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> <p>（二）信用债投资策略</p> <p>本基金主要投资中长期信用债券，通过承担适度的信用风险来获取信用溢价，在信用类固定收益工具中精选个债，构造和优化组合。本基</p>

	<p>金信用债配置策略主要包含信用利差曲线配置、个券精选策略、信用调整策略等方面。</p> <p>(三) 其他债券投资策略</p> <p>1、类属配置策略；2、久期配置策略； 3、收益率曲线策略； 4、套利策略；5、相对价值投资策略</p>
业绩比较基准	中债信用债总财富（3-5 年）指数收益率*90%+一年期定期存款利率(税后)*10%
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。

注：本基金业绩比较基准自 2017 年 5 月 22 日由原“中证全债指数收益率*80%+一年期定期存款利率(税后)*20%”变更为“中债信用债总财富（3-5 年）指数收益率*90%+一年期定期存款利率(税后)*10%”。

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	曾长兴	陆志俊
	联系电话	020-38898996	95559
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		4006135888,020-83936180	95559
传真		020-83282856	021-62701216

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gefund.com.cn
基金年度报告备置地点	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、基金净值表现及利润分配情况

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	2018 年		2017 年 2 月 22 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日	
	金鹰添利信 用债债券 A	金鹰添利信 用债债券 C	金鹰添利信 用债债券 A	金鹰添利信用债债券 C
本期已 实现收 益	-53,592.96	-31,393.32	2,865,538.72	1,420,183.49
本期利 润	1,689,639.2 7	263,718.39	1,610,645.10	1,137,390.43
加权平 均基金 份额本 期利润	0.0706	0.0509	0.0141	0.0207
本期基 金份额 净值增 长率	6.57%	6.59%	0.40%	0.20%
3.1.2 期末 数据和指 标	2018 年末		2017 年末	
	金鹰添利信用 债债券 A	金鹰添利信用 债债券 C	金鹰添利信用 债债券 A	金鹰添利信用债债券 C
期末可 供分配 基金份 额利润	0.0396	0.0382	0.0040	0.0023
期末基 金资产 净值	15,906,477. 16	2,703,688.67	57,706,289.7 8	14,839,173.56
期末基 金份额 净值	1.070	1.068	1.004	1.002

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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2、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、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、本基金合同生效日为 2017 年 2 月 22 日，上年度可比期间为 2017 年 2 月 22 日至 2017 年 12 月 31 日，无上上年度可比数据（下同）。

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

金鹰添利信用债债券 A

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
过去三个月	1.23%	0.08%	2.40%	0.04%	-1.17%	0.04%
过去六个月	2.88%	0.09%	4.58%	0.05%	-1.70%	0.04%
过去一年	6.57%	0.09%	8.15%	0.06%	-1.58%	0.03%
自基金合同生效起至今	7.00%	0.09%	9.79%	0.06%	-2.79%	0.03%

金鹰添利信用债债券 C

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
过去三个月	1.14%	0.09%	2.40%	0.04%	-1.26%	0.05%
过去六个月	2.79%	0.09%	4.58%	0.05%	-1.79%	0.04%
过去一年	6.59%	0.09%	8.15%	0.06%	-1.56%	0.03%
自基金合同生效起至今	6.80%	0.09%	9.79%	0.06%	-2.99%	0.03%

1、本基金业绩比较基准自 2017 年 5 月 22 日由原“中证全债指数收益率*80%+一年期定期存款利率(税后)*20%”变更为“中债信用债总财富（3-5 年）指数收益率*90%+一年期定期存款利率(税后)*10%”。

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

金鹰添利中长期信用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 2 月 22 日至 2018 年 12 月 31 日)

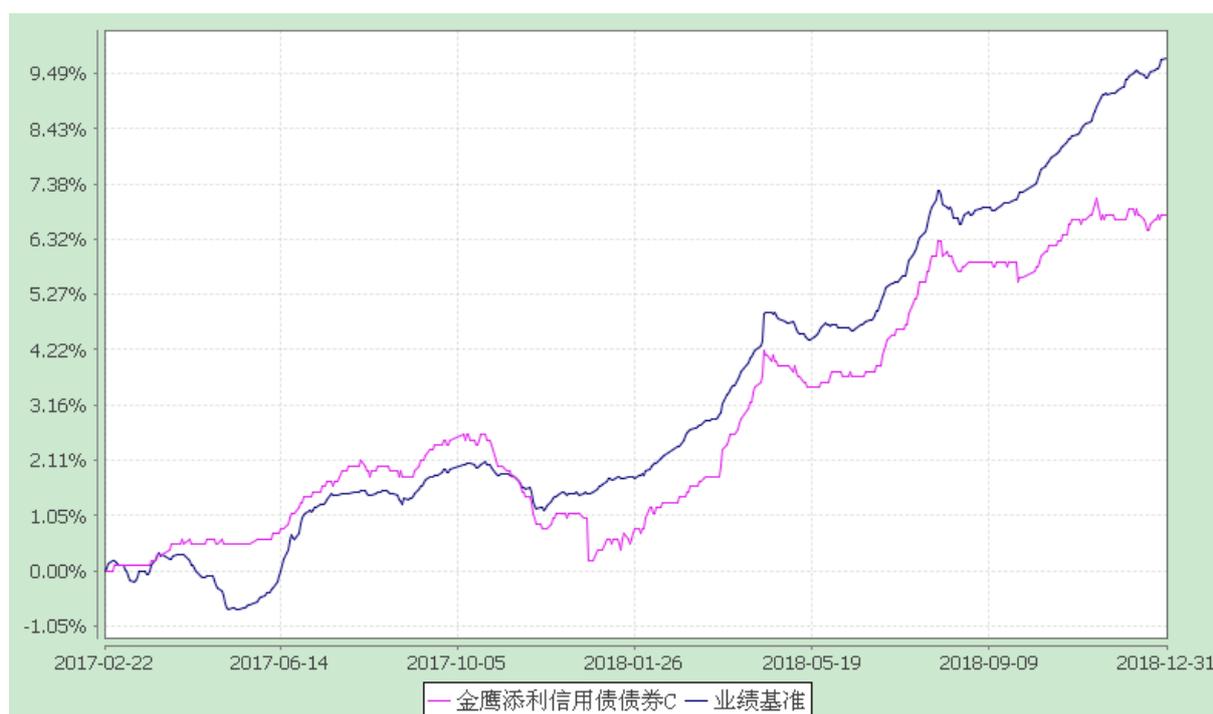
金鹰添利信用债债券 A

(2017 年 2 月 22 日至 2018 年 12 月 31 日)



金鹰添利信用债债券 C

(2017 年 2 月 22 日至 2018 年 12 月 31 日)



注：

- 1、本基金 2017 年 2 月 22 日成立。
- 2、截至本报告期末，各项投资比例符合基金合同的约定。
- 3、本基金业绩比较基准自 2017 年 5 月 22 日由原“中证全债指数收益率*80%+一年期定期存款利率(税后)*20%”变更为“中债信用债总财富（3-5 年）指数收益率*90%+一年期定期存款利率(税后)”。

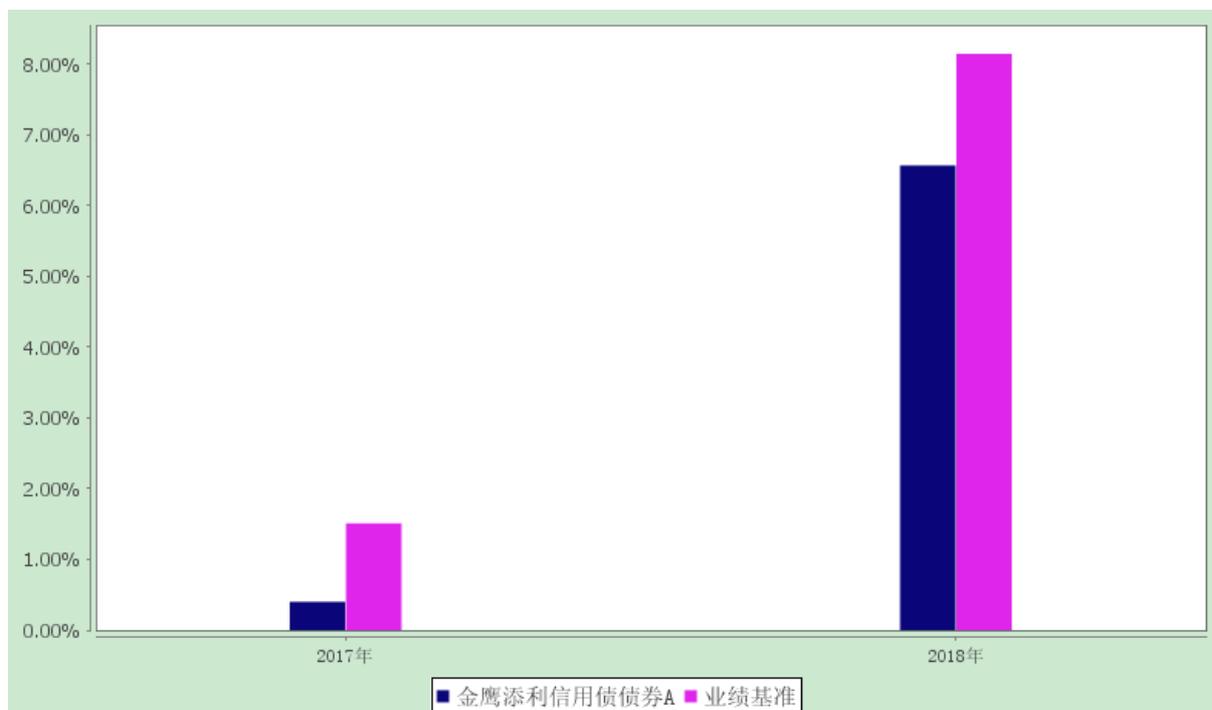
*10%“。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

金鹰添利中长期信用债债券型证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图

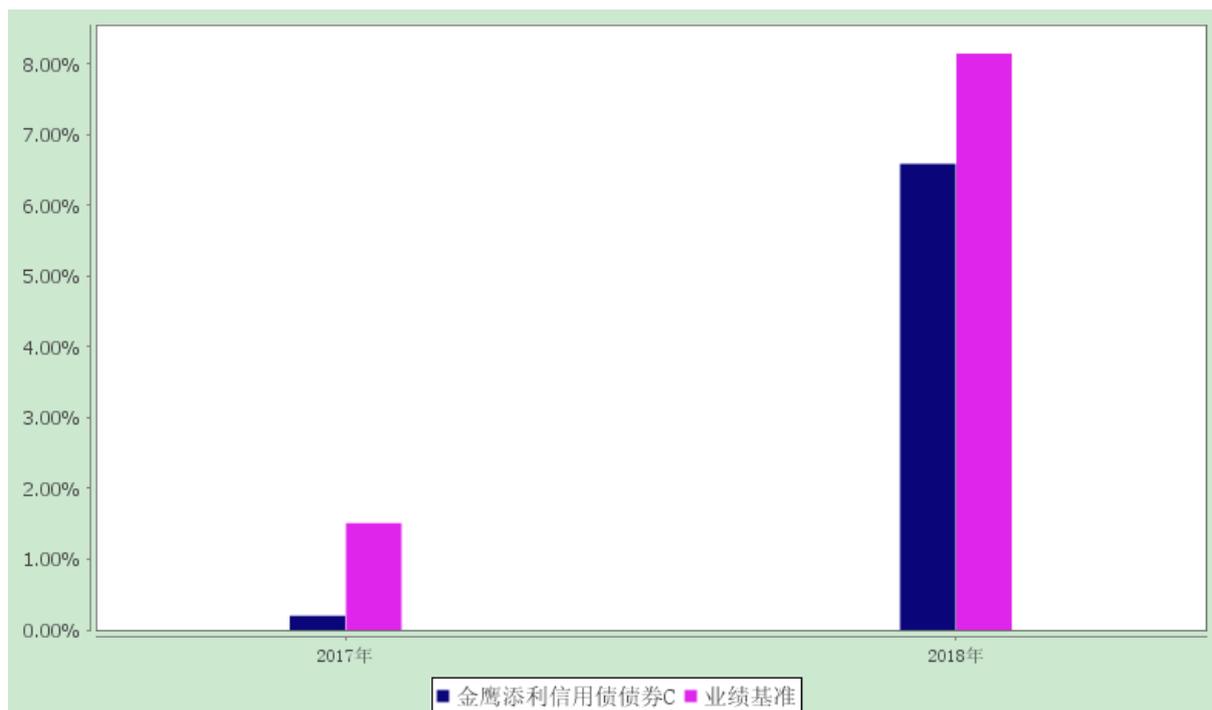
金鹰添利信用债债券 A



注：

(1) 本基金 2017 年 2 月 22 日成立。

金鹰添利信用债债券 C



注：

(1) 本基金 2017 年 2 月 22 日成立。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自合同生效无利润分配情况。

§ 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。

“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。截至报告期末，公司共有 45 只公募基金，管理规模 601.09 亿元。

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		
刘丽娟	固定收益部总监, 基金经理	2017-02-22	2018-07-07	11	刘丽娟女士, 中南财经政法大学工商管理硕士, 历任恒泰证券股份有限公司交易员, 投资经理, 广州证券股份有限公司资产管理总部固定收益投资总监。2014 年 12 月加入金鹰基金管理有限公司, 任固定收益部总监。现任金鹰货币市场证券投资基金、金鹰元和灵活配置混合型证券投资基金、金鹰添享纯债债券型证券投资基金、金鹰现金增益交易型货币市场基金、金鹰添荣纯债债券型证券投资基金基金经理。
戴骏	基金经理	2017-06-21	2018-07-07	7	戴骏先生, 美国密歇根大学金融工程硕士研究生, 历任国泰基金管理有限公司基金经理助理、东兴证券股份有限公司债券交易员等职务, 2016 年 7 月加入金鹰基金管理有限公司, 现任金鹰元禧混合型证券投资基金、金鹰添瑞中短债债券型证券投资基金、金鹰元盛债券型发起式证券投资基金 (LOF) 基金经理, 金鹰鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金等基金的基金经理助理。
汪伟	基金经理	2018-01-24	-	5	汪伟先生, 2013 年 7 月至 2014 年 9 月曾任广州证券股份有限公司交易员、投资经理等职务, 2014 年 9 月至 2016 年 2 月曾任金鹰基金管理有限公司交易主管, 2016 年 3 月至 2017 年 7 月曾任广东南粤银行股份有限公司交易员、宏观分析师等职务, 2017 年 7 月加入金鹰基金管理有限公司, 现任金鹰元安混合型证券投资基金、金鹰鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金、金鹰民丰回报定期开放混合型证券投资基金、金鹰添利中长期信用债债券型证券投资

					资基金、金鹰元祺信用债债券型证券投资基金、金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）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，严格遵守本基金的基金合同、托管协议、招募说明书等法律文件的规定，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，为基金份额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，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了保证本基金管理人管理的不同投资组合得到公平对待，本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，以及公司内控大纲的要求，制定了《金鹰基金管理有限公司公平交易管理规定》并严格执行，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。本基金管理人通过投资交易系统公平交易功能，对不同投资组合进行公平交易事前控制。同时，本基金管理人引入公平交易分析系统，定期或不定期对公司旗下投资组合在一定期间内买卖相同证券的情况进行监控和分析。

4.3.2 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。

报告期内，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。

4.3.3 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

2018 年宏观经济在内忧外患交织下再度承压放缓，全年增速回落至 6.6%，四季度单季回落至 6.4%。内部环境的压力主要来自信用收缩造成的融资失速。而社融增速的断崖式跳水，又加剧企业（尤其是中小民企）外部融资环境恶化，信用违约事件常态化。尽管年中政策开始向宽信用转向，但机构表内资本金约束、表外理财整改规范、机构风险偏好较低、微观激励机制不到位等，均导致资金淤积在银行间市场而无法有效传导到实体，宽信用效果迟迟未能见效。外部环境的制约主要来自贸易摩擦加剧经济下滑和产业链调整预期。

市场风险偏好在融资失速和贸易摩擦的双重打压下，始终难有提振。加之流动性宽松（全年四次降准），利率债成为全年表现最好的资产，尤其是中长端利率。信用债上半年在信用违约事件的冲击下，仅高等级品种市场认可。下半年在宽信用政策的引导下，信用利差逐步收敛，行情进一步向中等级别迁移。但市场对于低评级债券仍偏谨慎，评级利差仍处分化。

金鹰添利坚持高评级产业债优选策略，有效回避了信用风险。组合持仓期限以中等久期为主，在利率下行过程中通过把握久期贡献的资本利得，进一步增强组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 12 月 31 日，基金 A 类份额净值 1.070，本报告期份额净值收益率为 6.57%，同期业绩比较基准收益率为 8.15%；C 类份额净值 1.068，本报告期份额净值收益率为 6.59%，同期业绩比较基准收益率为 8.15%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 广义流动性收缩造成的信用环境恶化，随着宽信用效果的显现有望显著缓解。当前市场对信用债已经显现出偏好修复，但还是预期修复层面。未来在信用利差收缩的过程中，社融增速有望逐步企稳，信用环境将继续改善。M1 的企稳回升，会是信用环境进一步改善的信号，因为企业流动性出现实质性改善。在信用环境从预期改善到实质改善的过程中，信用利差压缩，评级利差逐步收敛，信用债将在今年享受更多溢价，信用债的票息收益和杠杆息差将是主要的债市 β 收益。但需注意的是，过渡下沉评级仍不可取，违约常态化下，信用甄选仍需审慎。同时伴随融资环境的修复及贸易摩擦的缓和，市场风险偏好有望阶段提升，可转债价值凸显，可作为固收 α 收益的主要增强品种。

金鹰添利将继续坚持高评级策略，以 AAA 品种的票息及价差收益为主要收益贡献，并通过杠杆部位把握转债波段行情，增厚组合收益。

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 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

本报告期，会计师事务所未对本基金出具非标准审计报告。

4.9 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

2018 年度，基金托管人在金鹰添利中长期信用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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2018 年度，金鹰基金管理有限公司在金鹰添利中长期信用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。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2018 年度，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利中长期信用债债券型证券投资基金的年度报告中财务指标、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 审计报告

中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）审计了 2018 年 12 月 31 日的资产负债表、2018 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注，并出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：金鹰添利中长期信用债债券型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	100,704.78	159,941.87
结算备付金	151,584.55	6,818.18
存出保证金	2,193.80	3,163.90
交易性金融资产	19,897,210.00	76,756,752.20
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-

债券投资	19,897,210.00	76,756,752.20
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	14,193,130.04
应收证券清算款	-	935,891.86
应收利息	395,821.89	1,456,302.59
应收股利	-	-
应收申购款	160.20	16,184.15
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	20,547,675.22	93,528,184.79
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2018 年 12 月 31 日	2017 年 12 月 31 日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	1,700,000.00	20,159,769.76
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	7,244.68	474,207.44
应付管理人报酬	11,778.09	46,244.32
应付托管费	2,523.92	9,909.49
应付销售服务费	506.45	2,623.70
应付交易费用	500.00	12,229.28
应交税费	1,612.05	-
应付利息	1,341.36	12,573.61
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-

其他负债	212,002.84	265,163.85
负债合计	1,937,509.39	20,982,721.45
所有者权益：		
实收基金	17,397,927.12	72,281,230.13
未分配利润	1,212,238.71	264,233.21
所有者权益合计	18,610,165.83	72,545,463.34
负债和所有者权益总计	20,547,675.22	93,528,184.79

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额总额 17,397,927.12 份；其中金鹰添利信用债债券 A 基金份额净值 1.070 元，份额总额 14,867,479.39 份，金鹰添利信用债债券 C 基金份额净值 1.068 元，份额总额 2,530,447.73 份。

7.2 利润表

会计主体：金鹰添利中长期信用债债券型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 2 月 22 日（基金 合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日
一、收入	2,589,669.58	5,467,043.56
1.利息收入	1,406,869.58	7,751,291.36
其中：存款利息收入	11,887.04	49,418.14
债券利息收入	1,380,795.45	6,343,230.98
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	14,187.09	1,358,642.24
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-878,864.31	-791,725.84
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-878,864.31	-791,725.84

资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	2,038,343.94	-1,537,686.68
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	23,320.37	45,164.72
减：二、费用	636,311.92	2,719,008.03
1. 管理人报酬	212,501.84	1,023,155.57
2. 托管费	45,536.15	219,247.59
3. 销售服务费	10,772.51	94,813.94
4. 交易费用	2,678.83	9,374.21
5. 利息支出	107,385.30	1,072,167.27
其中：卖出回购金融资产支出	107,385.30	1,072,167.27
6. 税金及附加	4,576.38	-
7. 其他费用	252,860.91	300,249.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	1,953,357.66	2,748,035.53
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	1,953,357.66	2,748,035.53

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金鹰添利中长期信用债债券型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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	72,281,230.13	264,233.21	72,545,463.34

(基金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,953,357.66	1,953,357.66
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)	-54,883,303.01	-1,005,352.16	-55,888,655.17
其中：1.基金申购款	19,773,130.08	952,922.33	20,726,052.41
2.基金赎回款	-74,656,433.09	-1,958,274.49	-76,614,707.58
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)	17,397,927.12	1,212,238.71	18,610,165.83
项目	上年度可比期间		
	2017年2月22日(基金合同生效日)至2017年12月31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)	354,199,224.41	-	354,199,224.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,748,035.53	2,748,035.53
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)	-281,917,994.28	-2,483,802.32	-284,401,796.60
其中：1.基金申购款	3,622,236.63	57,837.76	3,680,074.39

2.基金赎回款	-285,540,230.91	-2,541,640.08	-288,081,870.99
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）	72,281,230.13	264,233.21	72,545,463.34

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：李兆廷，主管会计工作负责人：王亮，会计机构负责人：谢文君

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

金鹰添利中长期信用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《关于金鹰添利中长期信用债债券型证券投资基金备案确认的函》批准，于 2017 年 2 月 22 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 354,199,224.41 份基金份额。其中，金鹰添利信用债债券 A 为 163,431,996.69 份，金鹰添利信用债债券 C 为 190,767,227.72 份。

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。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则(以下简称“企业会计准则”)和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

7.4.3 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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 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。

7.4.5 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。

7.4.6 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；2018年1月1日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为，以基金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。

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. 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳，从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
东旭集团有限公司	基金管理人股东
广州证券股份有限公司	基金管理人股东
广州白云山医药集团股份有限公司	基金管理人股东
广州金鹰资产管理有限公司	基金管理人子公司
金鹰基金管理有限公司	基金管理人
交通银行股份有限公司	基金托管人

美的集团股份有限公司	原基金管理人股东
东亚联丰投资管理有限公司	原基金管理人股东

注：经基金管理人 2016 年第三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[2017]2135），公司原股东美的集团股份有限公司、东亚联丰投资管理有限公司分别将其持有的本公司 20%和 11%股权转让给东旭集团有限公司。公司股东东旭集团有限公司向本公司增资人民币 260,200,000 元。本次股权转让及增资后，公司股权结构变更为：东旭集团有限公司 66.19%，广州证券股份有限公司 24.01%，广州白云山医药集团股份有限公司 9.80%，本公司注册资本由人民币 250,000,000 元增加至人民币 510,200,000 元。公司《公司章程》的有关条款已根据本次股权变更情况进行了相应修改。本公司已完成注册资本及股权变更事项的工商变更登记。上述事项已于 2018 年 1 月 30 日在证监会指定媒体披露。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 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。

7.4.8.1.2 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。

7.4.8.1.3 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。

7.4.8.1.4 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。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

1、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。

2、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、经手费和适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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年 12月31日	2017年2月22日（基金合同 生效日）至2017年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	212,501.84	1,023,155.57
其中：支付销售机构的客户维护费	122,155.14	549,041.37

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.7%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$$

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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年 12月31日	2017年2月22日（基金合同 生效日）至2017年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	45,536.15	219,247.59

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15%计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各 关联方名称	本期		
	2018年1月1日至2018年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	金鹰添利信用债债券 A	金鹰添利信用债债券 C	合计

交通银行	-	4,096.47	4,096.47
金鹰基金管理有限公司	-	275.35	275.35
合计	-	4,371.82	4,371.82
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年2月22日（基金合同生效日）至2017年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	金鹰添利信用债债券A	金鹰添利信用债债券C	合计
交通银行	-	39,106.71	39,106.71
金鹰基金管理有限公司	-	22,535.65	22,535.65
合计	-	61,642.36	61,642.36

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.2%。在通常情况下，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.2% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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提，按月支付，于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性划出，由基金管理人代收，基金管理人收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金行销广告费、促销活动费、基金份额持有人服务费等。

7.4.8.3 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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年2月22日（基金合同生效日）至 2017年12月31日	
	金鹰添利信用债债券A	金鹰添利信用债债券C	金鹰添利信用债债券A	金鹰添利信用债债券C
基金合同生效日（2017年2月22日）持有的基金份额	0.00	-	-	-
报告期初持有的基	-	-	-	-

金份额				
报告期间申购/买入总份额	465,835.62	0.00	-	-
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00	-	-
报告期末持有的基金份额	465,835.62	-	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.13%	-	-	-

7.4.8.5 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 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年2月22日（基金合同生效日） 至2017年12月31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	100,704.78	8,285.37	159,941.87	29,909.69

注：本基金本报告期末清算备付金余额 151,584.55 元，本期清算备付金利息收入 3,539.89 元；上年度可比期间的清算备付金余额 6,818.18 元，清算备付金利息收入 19,473.75 元。

7.4.8.6 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内均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

7.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.8.7.2 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。

7.4.9 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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。

7.4.9.2 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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末，持有未到期的交易所市场卖出回购证券款余额为 1,700,000.00 元，于 2019 年 1 月 3 日到期。

7.4.10 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。公允价值计量层级参见附注 7.4.4.5。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层及的余额为 503,950.00 元，第二层级的余额为 19,393,260.00 元。无属于第三层级的金额。

(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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	19,897,210.00	96.83
	其中：债券	19,897,210.00	96.83
	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	-	-
	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	252,289.33	1.23
8	其他各项资产	398,175.89	1.94
9	合计	20,547,675.22	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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。

8.2.2 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投资股票。

8.3 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

本基金本报告期内未进行股票投资。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票投资。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票投资。

8.4.3 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。

8.5 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,205,280.00	6.48
	其中：政策性金融债	1,205,280.00	6.48
4	企业债券	18,187,980.00	97.73
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	503,950.00	2.71
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	19,897,210.00	106.92

8.6 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	127244	15 中关村	20,000.00	1,599,000.00	8.59
2	136335	16 北汽集	14,000.00	1,370,180.00	7.36
3	018005	国开 1701	12,000.00	1,205,280.00	6.48
4	124616	14 鄂交 01	10,000.00	1,098,100.00	5.90
5	122150	12 石化 02	10,000.00	1,032,200.00	5.55

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期内未投资资产支持证券。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.11.1 本期国债期货投资政策**

无

8.11.2 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。

8.12 本报告期投资基金情况**8.12.1 投资政策及风险说明**

本基金本报告期内未投资基金。

8.12.2 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。

8.13 投资组合报告附注

8.13.1 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。

8.13.2 本基金报告期末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。

8.13.3 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	2,193.80
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	395,821.89
5	应收申购款	160.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	398,175.89

8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	132009	17 中油 EB	503,950.00	2.71

8.13.5 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。

8.13.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
金鹰添利信用债债券 A	235	63,265.87	465,835.62	3.13%	14,401,643.77	96.87%
金鹰添利信用债债券 C	124	20,406.84	0.00	0.00%	2,530,447.73	100.00%
合计	359	48,462.19	465,835.62	2.68%	16,932,091.50	97.32%

9.2 期末上市基金前十名持有人

本基金非上市基金

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	金鹰添利信用债债券 A	0.00	0.00%
	金鹰添利信用债债券 C	0.00	0.00%

	合计	0.00	0.00%
--	----	------	-------

9.4 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	份额级别	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	金鹰添利信用债债券 A	0
	金鹰添利信用债债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	金鹰添利信用债债券 A	0
	金鹰添利信用债债券 C	0
	合计	0

9.5 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金非发起式基金。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	金鹰添利信用债债券 A	金鹰添利信用债债券 C
基金合同生效日（2017 年 2 月 22 日）基金份额总额	163,431,996.69	190,767,227.72
本报告期期初基金份额总额	57,475,595.00	14,805,635.13
本报告期基金总申购份额	4,490,659.96	15,282,470.12
减：本报告期基金总赎回份额	47,098,775.57	27,557,657.52
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	14,867,479.39	2,530,447.73

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 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、经本基金管理人股东会或董事会审议通过，报中国证券监督管理委员会广东监管局备案：

2018 年 1 月 18 日在中国证监会指定媒体披露，聘请李兆廷先生担任公司董事长，凌富华先生不再担任公司董事长。

2018 年 8 月 25 日在中国证监会指定媒体披露，聘请曾长兴先生担任公司督察长，聘请满黎先生担任公司副总经理，李云亮先生不再担任公司督察长，曾长兴先生不再担任公司副总经理。

2018 年 9 月 22 日在中国证监会指定媒体披露，免去陈瀚先生副总经理职务。

自 2018 年 11 月 5 日起免去李兆廷先生公司董事职务，自 2018 年 11 月 16 日起聘请李兆廷先生担任公司董事、董事长，上述事项已在中国证监会指定媒体披露。

2018 年 12 月 5 日在中国证监会指定媒体披露，公司董事长李兆廷先生代行总经理（法定代表人）职务。

2018 年 12 月 22 日在中国证监会指定媒体披露，聘请刘志刚先生担任公司副总经理。

2018 年 12 月 29 日在中国证监会指定媒体披露，免去刘岩先生总经理职务，免去满黎先生副总经理职务。

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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金审计的会计师事务所为中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）。

本报告期内实际应支付会计师事务所的审计费为 22400 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金报告期内无管理人、托管人的托管业务部门及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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、个股分析的报告及丰富全面的信息；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。

11.7.2 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	3,974,400.00	4.30%	-	-	-	-
财通证券	88,500,311.90	95.70%	478,600,000.00	100.00%	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 影响投资者决策的其他重要信息

经本基金管理人董事会审议通过，报中国证券监督管理委员会广东监管局备案，并于 2019 年 3 月 5 日在中国证监会指定媒体披露，聘请刘志刚先生担任公司总经理。

金鹰基金管理有限公司

二〇一九年三月二十六日