（上接 C385 版）

法定代表人：王春峰
联系人：王星
电话：022-28451922
客服电话：400-651-5988
网址：www.ewww.com.cn
（114）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
（115）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
（116）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
（117）名称：北京汇成基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108号
办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108号
法定代表人：王伟刚
联系人：丁向坤
电话：010-56282140
客服电话：4006199059
公司网址：www.hcjijim.com
（118）名称：上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址：上海市浦东新区东方路1267号11层
法定代表人：张跃伟
联系人：苗明
电话：021-20691923
客服电话：400-820-2899
公司网址：www.erichfund.com
（119）名称：上海利得基金销售有限公司
注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室
办公地址：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼
法定代表人：李兴春
联系人：郑茂
电话：021-50583533
传真：021-60195218
客服电话：400-921-7755
公司网址：www.leadfund.com.cn
（120）名称：上海江付基金销售有限公司
注册地址：上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼
办公地址：上海市宜山路700号普天信息产业园c5栋
法定代表人：金佶
联系人：臧静
电话：021-54647888
客服电话：400-820-2819
公司网址：www.tty.chinapnr.com
（121）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/
（122）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
（123）名称：华安证券股份有限公司
注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号财智中心B1座
法定代表人：章宏韬
联系人：范超
电话：0551-65161821
客服电话：95318
网址：www.hazq.com.cn
（124）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
（125）名称：中山证券有限责任公司
注册地址：深圳市南山区创业路1777号海信南方大厦21、22层
办公地址：深圳市南山区创业路1777号海信南方大厦21、22层
法定代表人：林炳城
联系人：罗艺琳
电话：0755-82943755
客服电话：95329
网址：www.zszq.com
（126）名称：国融证券股份有限公司
注册地址：内蒙古自治区呼和浩特市武川县腾飞大道1号四楼
办公地址：北京市西城区宣武门西大街甲129号金隅大厦16层
法定代表人：张智河
联系人：叶密林
电话：010-83991888
客服电话：95385
网址：www.grzq.com
（127）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
（128）名称：江海证券有限公司
注册地址：哈尔滨市香坊区赣水路56号
办公地址：哈尔滨市松北区创新三路833号
法定代表人：赵洪波
联系人：姜志伟
电话：0451-87765732
客服电话：400-666-2288
网址：www.jhzq.com.cn

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

3、场内交易
深圳证券交易所具有场内基金交易的会员机构。
（二）登记机构名称：
名称：中国证券登记结算有限责任公司
注册地址：北京西城区金融大街27号投资广场
办公地址：北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人：周明
联系人：任瑞新
电话：（010）59378835
传真：（010）59378907
（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：中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：武汉市武昌区东湖路169号众环海华大厦2-9层
法定代表人：石文先
电话：027 86770549
传真：027 85424329
邮编：430077
经办注册会计师：王兵、董晓敏

一、 基金的历史沿革

金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）由金鹰中证500指数分级证券投资基金转型而来。

金鹰中证500指数分级证券投资基金经中国证监会证监许可【2012】247号文批准，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。

金鹰中证500指数分级证券投资基金自2012年4月23日至2012年5月29日公开募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认，《金鹰中证500指数分级证券投资基金基金合同》于2012年6月5日生效。

自2016年6月14日至2016年6月27日，金鹰中证500指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，大会审议并通过了《关于金鹰中证500指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》，内容包括金鹰中证500指数分级证券投资基金变更名称和基金类别、修改基金投资目标、投资范围、投资策略、估值、费用和修订基金合同等事项。持有人大会决议自通过之日起生效，决议生效后，基金管理人实施基金转型。转型完成后，由《金鹰中证500指数分级证券投资基金基金合同》修订而成的《金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）基金合同》正式生效，原《金鹰中证500指数分级证券投资基金基金合同》自同一日起失效。

二、 基金合同的存续

（一）基金份额的变更登记

自金鹰中证500指数分级证券投资基金基金合同失效且本基金基金合同生效后，本基金登记机构将办理基金份额的变更登记，对基金份额更名并进行必要的信息变更。

（二）基金份额期内的基金份额持有人数量和资金数额

基金合同生效后，连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续六十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。

法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。

三、 基金份额的上市交易

（一）上市交易的基金份额

基金合同生效后，在本基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，基金管理人将根据有关规定，申请本基金的基金份额上市交易。

（二）上市交易的地点
深圳证券交易所。
（三）上市交易的时间
自金鹰中证500指数分级证券投资基金份额转换基准日次日（即2016年8月25日）起，《金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）基金合同》生效。

基金合同生效后，在本基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，基金管理人将根据有关规定，申请本基金的基金份额上市交易。

（四）上市交易的规则
本基金上市交易遵循《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、《深圳证券交易所交易规则》及其他相关规定。

（五）上市交易的费用
本基金上市交易的费用按照深圳证券交易所相关规则及有关规定执行。

（六）上市交易的行情揭示
本基金在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示本基金前一交易日的基金份额净值。

（七）上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市
本基金的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所的相关规定执行。

（八）其他事项
相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，基金合同相应予以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会，并在本基金更新的招募说明书中列示。

（九）若深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司增加了基金上市交易的新功能，基金管理人可以在履行适当的程序后增加相应功能。

四、 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。

投资者可使用开放式基金账户，通过基金管理人的直销中心和其他场外销售机构，办理基金份额的场外申购与赎回业务。投资者也可使用深圳证券账户，通过深圳证券交易所系统办理基金份额的场内申购与赎回业务。场内申购和赎回业务的销售机构为具有基金销售业务资格、经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位。

具体的销售网点将由基金管理人在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，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
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
基金管理人自基金合同生效之日起不超过三个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过三个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

（三）申购与赎回的原则
1、"未知价"原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；
2、"金额申购、份额赎回"原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；
3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；
4、场外赎回遵循"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、场内申购与赎回业务遵循深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司相关业务规定。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

（四）申购与赎回的程序
1、申购和赎回的申请方式
投资者必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。
2、申购和赎回的款项支付
投资者申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资者交付申购款项，申购成立；基金份额登记机构确认基金份额时，申购生效。
基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；基金份额登记机构确认赎回时，赎回生效。投资者赎回申请成功后，基金管理人将在T＋7日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。
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，投资者应在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）申购和赎回的数量限制
1、投资者通过各代销机构申购本基金时（含定期定额申购），申购最低金额为1元（含申购费，如有），超过部分不设最低级差限制。赎回本基金时，赎回最低份额为1份，基金份额余额不得低于1份，赎回后导致基金份额不足1份的需全部赎回。
2、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、投资者通过本公司直销中心柜台申购赎回的，申购最低金额（含申购费，如有）为5万元（含申购费，如有），赎回本基金时，赎回最低份额为1份，持有基金份额不足1份时发起赎回需全部赎回。
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。具体请参见相关公告。
5、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。
6、对于场内申购、赎回及持有场内份额的数量限制，深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则有规定的，从其最新规定办理。
7、基金管理人可与其他销售机构约定，对投资者通过其他销售机构办理基金申购与赎回的，其他销售机构可以按照委托协议的相关规定办理，不必遵守以上限制。

（六）申购费用和赎回费用
1、申购费用
本基金的申购费率如下：

项目	申购金额A(元)	费率
场外申购费率	A <100 万	1.50%
	100 万≤A<200 万	0.80%
	200 万≤A<500 万	0.30%
	A≥500 万	1000 元/笔
场内申购费率	由基金场内销售机构参照场外申购费率执行	

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。
本基金的申购费用应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。
本基金的赎回费率如下：

项目	申购金额A(元)，T为持有期	费率
场外赎回费率	T<7 天	1.50%
	7 天≤T<1 年	0.50%
	1 年≤T<2 年	0.30%
	T≥2 年	0
场内赎回费率	T<7 天	1.50%
	T≥7 天	0.5%

本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，其中对于持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产；持续持有期大于等于7日的投资者收取的赎回费中不低于25%的部分归基金财产所有，其余部分用于支付注册登记费和其他必要的手续费。
3、本基金份额净值的计算，保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经履行适当程序，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根据市场情况制定基金促销计划，包括但不限于针对认购特定交易方式（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、办理基金份额的场内申购、赎回业务应遵守深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，基金合同相应予以修改，并按照新规定执行，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。
7、本基金暂不采用摆动定价机制，基金管理人可结合基金实际运作情况，根据相关法律法规在履行适当程序并提前公告后增加摆动定价机制。

五、基金的投资

（一）投资目标
运用多种量化模型方法，精选股票进行投资，力争有效控制风险的基础上，实现基金资产的长期稳定增值。

（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（包括创业板、中小板以及其他经中国证监会批准上市的股票）、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货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。
基金的投资组合比例为：本基金投资组合中股票资产占基金资产的80%-95%；权证投资占基金资产净值的比例不高于3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的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、应收申购款等；股指期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。
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）业绩比较基准
沪深300指数收益率×80%＋中证全债指数收益率×20%

（四）风险收益特征
本基金为股票型基金，属于证券投资基金中较高预期收益、较高预期风险的品种，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

（五）投资组合（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相关法律法规及本基金合同的规定，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	9,695,081.00	93.58
	其中：股票	9,695,081.00	93.58
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	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	653,423.05	6.31
7	其他各项资产	11,346.22	0.11
8	合计	10,359,850.27	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

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	208,208.00	2.03
B	采矿业	234,722.00	2.29
C	制造业	3,936,541.00	38.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	227,550.00	2.22
E	建筑业	187,878.00	1.83
F	批发和零售业	66,675.00	0.65
G	交通运输、仓储和邮政业	298,784.00	2.91
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	216,561.00	2.11
J	金融业	3,339,365.00	32.58
K	房地产业	846,741.00	8.26
L	租赁和商务服务业	83,754.00	0.82
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	16,270.00	0.16
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	32,032.00	0.31
S	综合	-	-
	合计	9,695,081.00	94.58

（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

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	601318	中国平安	9,600	835,584.00	8.15
2	600519	贵州茅台	500	575,000.00	5.61
3	600036	招商银行	10,800	375,300.00	3.66
4	600048	保利地产	21,600	308,880.00	3.01
5	002415	海康威视	9,200	297,160.00	2.90
6	000333	美的集团	5,800	296,380.00	2.89
7	600276	恒瑞医药	3,500	282,380.00	2.75
8	600016	民生银行	35,400	213,108.00	2.08
9	300498	温氏股份	5,600	208,208.00	2.03
10	000858	五粮液	1,600	207,680.00	2.03

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期内未投资债券。
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
本基金本报告期内未投资债券。
6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期内未投资资产支持证券。
7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期内未投资贵金属。
8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期内未投资权证。
9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
（1）报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期内未投资股指期货。
（2）本基金投资股指期货的投资政策
无。
10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
（1）本期国债期货投资政策
无。
（2）报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期内未投资国债期货。
11、投资组合报告附注
（1）本基金投资的前十名证券的发行主体之一的民生银行，因内控管理严重违反审慎经营规则、贷后管理不到位等原因，于2018年12月7日、2019年4月2日、2019年4月3日、2019年4月16日被中国银行保险监督管理委员会处以罚款。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策的程序。
（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	6,369.62
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	128.14
5	应收申购款	4,848.46
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,346.22

（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处于转股期的可转换债券。
（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期内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。

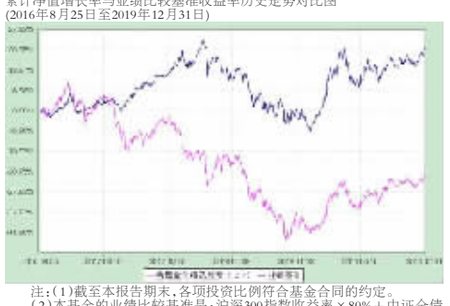
六、 基金的业绩

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。
本基金的托管人交通银行股份有限公司根据基金合同的规定，复核了本报告中的内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

（一）基金净值表现
本报告期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	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
2016.8.25-2016.12.31	2.05%	0.98%	-0.70%	0.56%	2.75%	0.42%
2017.1.1-2017.12.31	-17.62%	1.02%	17.08%	0.51%	-34.70%	0.51%
2018.1.1-2018.12.31	-29.36%	1.52%	-19.17%	1.07%	-10.19%	0.45%
2019.1.1-2019.12.31	30.66%	1.17%	29.59%	0.99%	1.07%	0.18%
2016.8.25-2019.12.31	-22.40%	1.23%	21.78%	0.87%	-44.18%	0.36%

（二）累计净值增长率与业绩比较基准收益率比较
金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2016年8月25日至2019年12月31日）



注：（1）截至本报告期末，各项投资比例符合基金合同的约定。
（2）本基金的业绩比较基准是：沪深300指数收益率×80%＋中证全债指数收益率×20%。

七、 基金的收益分配

（一）基金利润的构成
基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额。基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

（二）基金可供分配利润
基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

（三）基金收益分配原则
1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的10%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；
2、本基金场外份额的收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资；投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金场外份额的默认的收益分配方式是现金分红；本基金场内份额的收益分配方式仅能为现金分红；
3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
4、每一基金份额享有同等分配权；
5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（四）收益分配方案
基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

（五）收益分配方案的确定、公告与实施
本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。
基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过15个工作日。

（六）基金收益分配中发生的费用
基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足于支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

八、 基金的费用与税收

（一）基金费用的种类
1、基金管理人的管理费；
2、基金托管人的托管费；
3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
5、基金份额持有人大会费用；
6、基金的相关账户的开户费用、账户维护费用；
7、基金的证券交易、期货交易及结算费用；
8、基金的银行汇划费用；
9、基金上市费及年费；
10、基金注册登记TA服务费；
11、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1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：
H＝E×1.5%÷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2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。
2、基金托管人的托管费
本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：
H＝E×0.25%÷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2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。
上述"一、基金费用的种类中第3－11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。

一、 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》、《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《金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）的招募说明书》进行了更新，主要更新的内容如下：
（1）在"三、基金管理人"部分，更新了基金管理人的情况。

金鹰基金管理有限公司
2020年4月30日

南方宏元定期开放债券型发起式证券投资基金开放申购、赎回及转换业务的公告

公告送出日期：2020 年 4 月 30 日

1 公告基本信息

基金名称	南方宏元定期开放债券型发起式证券投资基金	
基金简称	南方宏元	
基金主代码	004180	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 12 月 26 日	
基金管理人名称	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人名称	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
基金登记机构名称	南方基金管理股份有限公司	
公告依据	《南方宏元定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》《南方宏元定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》	
申购起始日	2020 年 5 月 8 日	
赎回起始日	2020 年 5 月 8 日	
转换转入起始日	2020 年 5 月 8 日	
转换转出起始日	2020 年 5 月 8 日	
下属分类基金的基金简称	南方宏元 A	南方宏元 C
下属分类基金的交易代码	004180	004181
该分类基金是否开放	是	是

注：1、本基金为定期开放基金，本次开放期时间为 2020 年 5 月 8 日至 2020 年 5 月 14 日。开放期内本基金接受申购、赎回及转换申请。
2、本基金自 2020 年 5 月 15 日起进入封闭期，封闭期内本基金不接受申购、赎回及转换申请。

2 申购、赎回、转换业务的办理时间

本基金基金合同生效后，每 3 个月开放一次。开放期指本基金每一个封闭期结束之日后第一个工作日起（含该日）进入开放期，开放期不少于 5 个工作日并且最长不超过 20 个工作日。开放期内，投资人可以根据相关业务规则申购、赎回基金份额，或办理转换业务。

基金管理人在开放日办理基金份额的申购、赎回、转换业务，具体办理时间为开放期内上海证券交易所、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时除外。封闭期内，本基金不办理申购、赎回、转换业务，也不上市交易。

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。

本基金本次开放期时间为 2020 年 5 月 8 日至 2020 年 5 月 14 日，并自 2020 年 5 月 15 日起进入封闭期，封闭期内本基金不接受申购、赎回及转换申请。

为保护基金份额持有人利益，在开放期间，本基金管理人有权依据本基金的规模情况和市场变化情况，根据基金合同的约定，暂停或提前结束申购和转换转入业务，赎回和转换转出业务不受影响。届时本基金管理人将在指定媒介上公告。

3 申购业务

3.1 申购金额限制

1、本基金首次申购和追加申购的最低金额均为 500 万元，各销售机构在符合上述规定的前提下，可根据情况调高首次申购和追加申购的最低金额，具体以销售机构公布的为准，投资人需遵循销售机构的相关规定；
2、本基金不对单个投资人累计持有的基金份额上限进行限制，但法律法规或监管要求另有规定的除外；
3、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述申购金额的数量限制，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公告。

3.2 申购费率

对于申购本基金 A 类份额的投资人，本基金申购费率最高不高于 0.8%，且随申购金额的增加而递减，如下表所示：

A 类份额申购金额(M)	申购费率
M<100 万	0.8%
100 万≤M<500 万	0.5%
500 万≤M<1000 万	0.3%
M≥1000 万	每笔 1,000 元

对于申购本基金 C 类份额的投资人，申购费率为零。
投资人重复申购，须按每次申购所对应的费率档次分别计费。
销售机构可参考上述标准对申购费用实施优惠。申购费用由投资人承担，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。

3.3 其他与申购相关的事项

1、基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购申请的当天作为申购申请日（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，投资人应在 T+2 日后(包括该日)及时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人。基