

# 金鹰添悦60天滚动持有短债债券型证券投资基金（金鹰添悦60天滚动持有短债C）基金产品资料概要更新

编制日期：2024年5月30日

送出日期：2024年5月31日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

## 一、产品概况

|         |                   |                |                                 |
|---------|-------------------|----------------|---------------------------------|
| 基金简称    | 金鹰添悦 60 天滚动持有短债   | 基金代码           | 016088                          |
| 下属基金简称  | 金鹰添悦 60 天滚动持有短债 C | 下属基金代码         | 016089                          |
| 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                      |
| 基金合同生效日 | 2022-12-20        |                |                                 |
| 基金类型    | 债券型               | 交易币种           | 人民币                             |
| 运作方式    | 其他开放式             | 开放频率           | 每个开放日开放申购，但对每份基金份额设定 60 天的滚动运作期 |
| 基金经理    | 邹卫                | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2024-01-12                      |
|         |                   | 证券从业日期         | 2011-05-01                      |

注：本基金单一投资者单日认购、申购（含定期定额申购）金额不超过 1,000 万元（公募资产管理产品除外）。

## 二、基金投资与净值表现

### （一）投资目标与投资策略

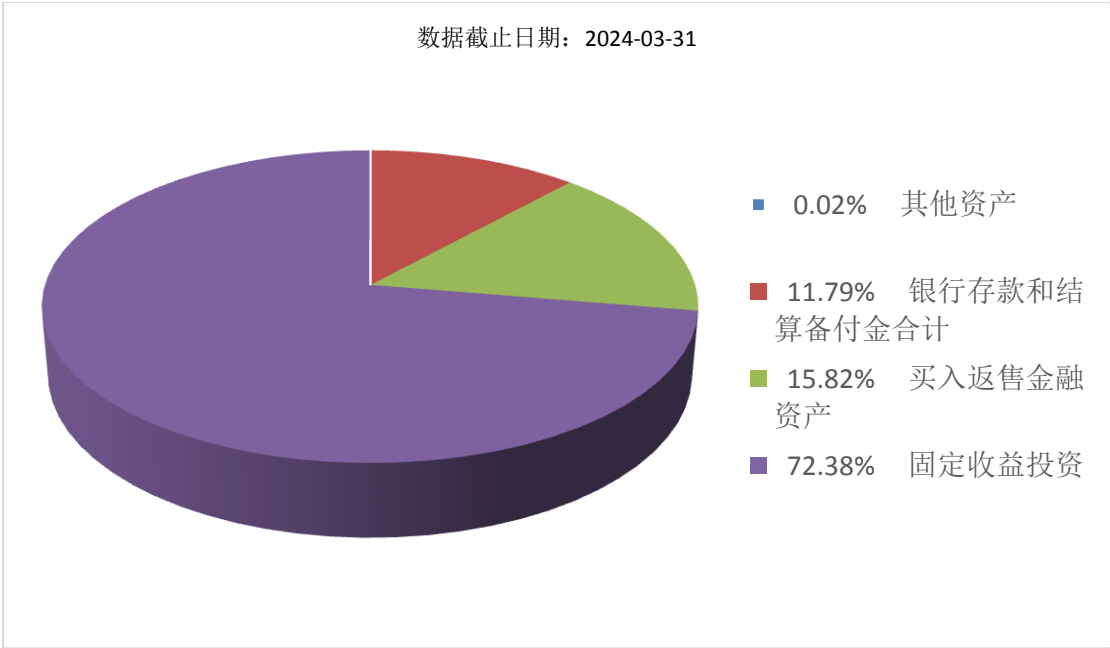
请阅读《招募说明书》第九部分了解详细情况。

|      |                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 在严格控制风险、保持较高流动性的前提下，重点投资于短期债券资产，力争为投资者获取超越业绩比较基准的投资回报和基金资产的长期稳健增值。                                                                                                                                                                                                |
| 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，包括国债、央行票据、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债（含证券公司短期公司债）、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款（含协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、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（但须符合中国证监会的相关规定）。<br>本基金不投资于股票等权益类资产，也不投资于可转换债券、可交换债券。<br>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 |

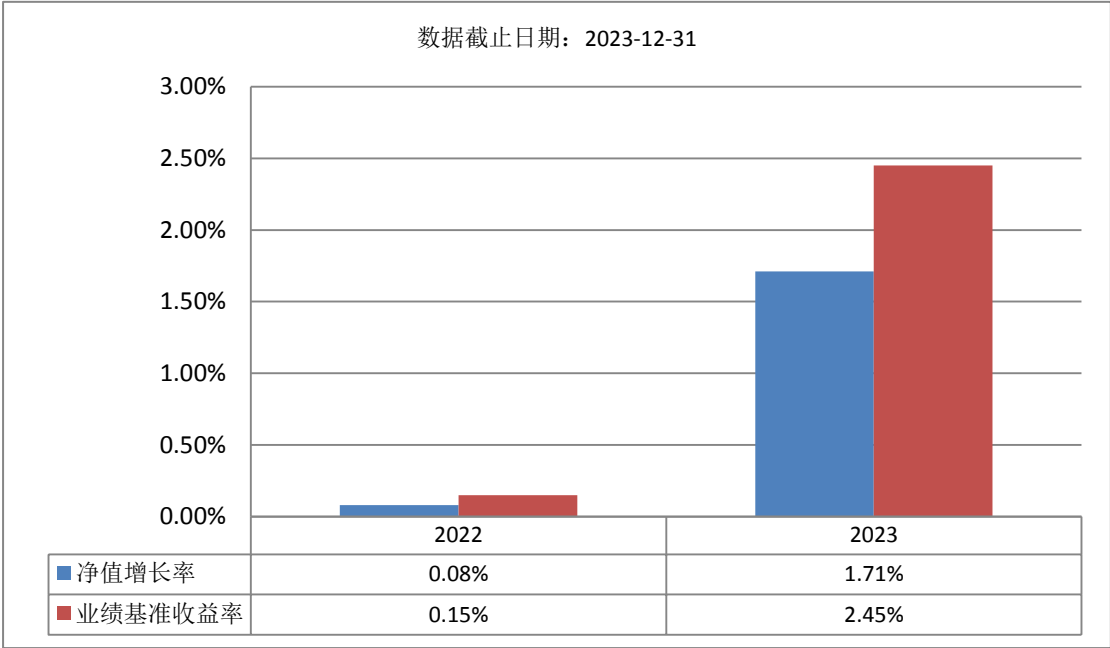
|               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|---------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|               | <p>行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，其中投资于短期债券资产的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终，在扣除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。</p> <p>本基金所指的短期债券是指剩余期限或距下一个行权日不超过397天（含）的债券资产，主要包括国债、央行票据、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债（含证券公司短期公司债）、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券等金融工具。</p> <p>如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后可调整上述投资品种的投资比例。</p>     |
| <b>主要投资策略</b> | <p>本基金将密切关注债券市场的运行状况与风险收益特征，分析宏观经济运行状况和金融市场运行趋势，在保证投资低风险的基础上谨慎投资，力争实现组合的稳健增值。</p> <p>在债券投资方面，本基金以长期利率趋势分析为基础，结合经济变化趋势、货币政策、不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，综合运用久期配置、类属配置、期限结构配置以及个券选择等多种积极管理策略，深入挖掘价值被低估的债券和市场投资机会，构建收益稳定、流动性良好的债券组合。</p> <p>在信用债（含资产支持证券，下同）投资方面，本基金将投资信用评级不低于AA+级的信用债。其中，投资于AA+级信用债的比例不高于信用债资产的50%，投资于AAA级信用债的比例不低于信用债资产的50%。</p> <p>本基金其他投资策略还包括：证券公司短期公司债投资策略、国债期货投资策略。</p> |
| <b>业绩比较基准</b> | 中证短债指数收益率*85%+一年期定期存款利率(税后)*15%                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| <b>风险收益特征</b> | 本基金为债券型基金，预期风险和预期收益高于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |

## （二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

### 投资组合资产配置图表



(三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图



注：基金的过往业绩不代表未来表现。基金合同生效当年净值增长率计算区间为2022年12月20日至2022年12月31日。

三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

| 费用类型 | 份额（S）或金额（M）<br>/持有期限（N） | 收费方式/费率 | 备注           |
|------|-------------------------|---------|--------------|
| 认购费  | -                       | 0.00%   | 本基金C类基金份额不收取 |

|          |   |       |                                                |
|----------|---|-------|------------------------------------------------|
|          |   |       | 认购费。                                           |
| 申购费（前收费） | - | 0.00% | 本基金C类基金份额不收取申购费。                               |
| 赎回费      | - | 0.00% | 本基金对每份基金份额设定60天的滚动运作期，每个运作到期日投资者可申请赎回，不收取赎回费用。 |

## （二）基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

| 费用类别  | 收费方式/年费率或金额 | 收取方        |
|-------|-------------|------------|
| 管理费   | 0.20%       | 基金管理人、销售机构 |
| 托管费   | 0.05%       | 基金托管人      |
| 销售服务费 | 0.20%       | 销售机构       |
| 审计费用  | 20,000.00   | 会计师事务所     |
| 信息披露费 | 0.00        | 规定披露报刊     |

注：1.本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

2.审计费用、信息披露费为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

## （三）基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

|              |
|--------------|
| 基金运作综合费率（年化） |
| 0.55%        |

注：基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

## 四、风险揭示与重要提示

### (一) 风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》、《基金产品资料概要》等销售文件。

本基金的风险主要包括：

1、市场风险。主要包括政策风险、经济周期风险、利率风险、信用风险、购买力风险、债券收益率曲线变动的风险、再投资风险。

2、管理风险。

3、流动性风险。

4、本基金特有的风险。

#### (1) 与基金类型相关的风险

本基金为债券型基金，债券资产占基金资产的比例为 80%以上，债券资产占比相对较高。资产组合受债券市场的波动影响较大，如果债券市场出现整体下跌，本基金的净值表现将受到较大影响。

#### (2) 国债期货投资风险

本基金的投资范围包括国债期货，可能面临市场风险、基差风险、流动性风险。市场风险是因期货市场价格波动使所持有的期货合约价值发生变化的风险。基差风险是期货市场的特有风险之一，是指由于期货与现货间的价差的波动，影响套期保值或套利效果，使之发生意外损益的风险。流动性风险可分为两类：一类为流通量风险，是指期货合约无法及时以所希望的价格建立或了结头寸的风险，此类风险往往是由市场缺乏广度或深度导致的；另一类为资金量风险，是指资金量无法满足保证金要求，使得所持有的头寸面临被强制平仓的风险。

#### (3) 资产支持证券投资风险

本基金的投资范围包括资产支持证券，资产支持证券的投资风险主要包括流动性风险、利率风险及评级风险等。由于资产支持证券的投资收益来自于基础资产产生的现金流或剩余权益，因此资产支持证券投资还面临基础资产特定原始权益人的破产风险及现金流预测风险等与基础资产相关的风险。

#### (4) 滚动持有运作方式的特定风险

1) 对于每份基金份额，基金管理人仅在该基金份额的每个运作期到期日为基金份额持有人办理赎回，每个运作期到期日前，基金管理人不能为基金份额持有人办理赎回，因此基金份额持有人需承担运作期到期日前无法赎回的风险。

2) 如果基金份额持有人在当期运作期到期日未申请赎回或赎回被确认失败，则自该运作期到期日次一日起该基金份额进入下一个运作期，基金份额持有人将面临错过当期运作期到期日可赎回的机会而自动进入下一运作期的风险。

3) 本基金对每份基金份额设定 60 天的滚动运作期，但是考虑到周末、法定节假日等因素，每份基金份额的每个实际运作期限或有不同，可能长于或短于 60 天。

投资者应当在熟悉并了解本基金运作规则的基础上，结合自身投资目标、投资期限等情况审慎作出投资决策，及时行使赎回权利。本基金的运作期和申购赎回安排请参见本招募说明书“基金份额的申购与赎回”部分的相关约定。

5、本法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险。

6、其他风险。

### (二) 重要提示

中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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。

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息

发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站：<http://www.gefund.com.cn/> 客服电话：400-6135-888

- 基金合同、托管协议、招募说明书
- 定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 基金份额净值
- 基金销售机构及联系方式
- 其他重要资料

## 六、其他情况说明

无