

# 金鹰中小盘精选证券投资基金

## 基金契约 招募说明书

## 目录

一、金鹰中小盘精选证券投资基金基金契约	1-44
二、金鹰中小盘精选证券投资基金招募说明书	47 -115

# 金鹰中小盘精选证券投资基金

# 基金契约

基金发起人：金鹰基金管理有限公司

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：交通银行

契约签订日：2003 年 12 月

金鹰中小盘精选证券投资基金  
基金契约

---

一、释义 .....	5
二、前言 .....	7
三、基金契约当事人及权利和义务 .....	7
四、基金持有人大会 .....	14
五、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序 .....	17
六、基金的基本情况 .....	19
七、基金单位的发行 .....	19
八、基金的成立 .....	20
九、基金的申购、赎回 .....	21
十、基金间转换 .....	27
十一、基金交易 .....	27
十二、基金的托管 .....	28
十三、基金认购、申购、赎回等业务 .....	28
十四、基金的注册登记业务 .....	29
十五、基金的投资 .....	30
十六、基金资产 .....	33
十七、基金资产估值 .....	34
十八、基金费用与税收 .....	37
十九、基金收益与分配 .....	39
二十、基金的会计与审计 .....	41
二十一、基金的信息披露 .....	41
二十二、基金的终止和清算 .....	46
二十三、违约责任 .....	48
二十四、争议的处理 .....	48
二十五、基金契约的效力 .....	48
二十六、基金契约的修改和终止 .....	49
二十七、其他事项 .....	49
二十八、契约当事人盖章及法定代表人签字、签约地、签订日 .....	50

## 一、释义

在本基金契约中除非文另有所指，下列词语具有以下含义：

基金或本基金：	指金鹰中小盘精选证券投资基金
基金契约：	指《金鹰中小盘精选证券投资基金契约》
招募说明书：	指《金鹰中小盘精选证券投资基金招募说明书》
发行公告：	指《金鹰中小盘精选证券投资基金发行公告》
《暂行办法》：	指《证券投资基金管理暂行办法》
《试点办法》：	指《开放式证券投资基金试点办法》
中国证监会：	指中国证券监督管理委员会
基金发起人：	指金鹰基金管理有限公司
基金托管人：	指交通银行
基金管理人：	指金鹰基金管理有限公司
销售机构：	指直销机构及销售代理机构
直销机构：	指金鹰基金管理有限公司
销售代理机构：	指依据有关销售代理协议办理本基金认购、申购、赎回和其他基金业务的代理机构
注册登记业务：	指本基金登记存管清算和交收业务，具体内容包括投资人基金账户管理，基金单位注册登记、清算、及基金交易确认、代理发放红利、建立并保管基金持有人名册等
注册登记机构：	指办理本基金注册登记业务的机构，本基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司
投资者：	指个人投资者者/或机构投资者
个人投资者：	指依据中华人们共和国有关法律法规及其他有关规定可以投资于证券投资基金的自然人投资者
机构投资者：	指在中华人民共和过境内合法注册登记或经有关政府部门批准设立的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织
基金持有人：	指依法取得和持有依据本基金契约发行的基金单位的投资者
基金成立日：	指基金达到成立条件后，基金发起人宣告基金成立的日

期

设立募集期：指自招募说明书公告之日起到基金成立日的时间段，最长不超过3个月

认购：指在本基金设立未满3个月，投资者申请购买本基金基金单位的行为

申购：指在本基金存续期间内，投资者申请购买本基金基金单位的行为

赎回：指基金持有人按本基金契约规定的条件，要求基金管理人购回本基金基金单位的行为

基金间转换：本基金转换为基金管理人管理的其他基金的行为

基金交易：指经中国证监会批准，本基金可在证券交易所系统买卖的行为

基金账户：指注册登记机构为基金投资者开立的记录其持有的由该注册登记机构办理注册的本基金或基金管理人管理的其他开放式基金份额及其变动情况的账户

交易账户：指销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构买卖本基金或基金管理人管理的其他开放式基金份额变动及结余情况的账户

存续期：指基金成立并存续的不定期期限

开放日：指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日

工作日：指上海证券交易所和深圳证券交易所的交易日

T日：申购、赎回或其他交易的申请日

基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入

基金资产总值：指基金购买的各类证券、银行存款本息、基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和

基金资产净值：指基金资产总值减去负债后的价值

基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金单位净值的过程

指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报纸和互联网站

## 二、前言

### （一）订立本基金契约的目的、依据和原则

- 1、订立本基金契约的目的是保护基金投资者合法权益、明确基金契约当事人的权利与义务，规范基金运作；
- 2、订立本基金契约的依据是《暂行办法》、《试点办法》及其他有关法律、法规和中国证监会的有关规定
- 3、基金发起人、基金管理人和基金托管人依据资源平等。诚实信用、充分保护投资者权益的原则，协商一致共同订立本基金契约。

（二）本基金由发起人依照《暂行办法》、《试点办法》基金契约及其有关法律、法规和中国证监会的有关规定发起，须经中国证监会批准方可募集设立。该批准并不表明中国证监会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。基金管理人依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

（三）基金契约是规范基金契约当事人之间基金权利义务关系的法律文件，对所有当事人都具备约束力。基金发起人、基金管理人和基金托管人自本基金契约签订并正式生效之日起成为本基金契约的当事人，按照《暂行办法》、《试点办法》、基金契约及其有关法律、法规和中国证监会的有关规定享有权利，承担义务。

（四）基金投资者自取得以本基金契约所发行的基金单位后，即成为基金持有人和本基金契约的当事人，其持有基金单位的行为本身即表明其对基金契约的承认和接受，并按照《暂行办法》、《试点办法》、基金契约及其有关法律、法规和中国证监会的有关规定享有权利，承担义务。

## 三、基金契约当事人及权利和义务

### （一）基金发起人：金鹰基金管理有限公司

#### 1、基金发起人简况

注册地址：广东省珠海市吉大九州大道东段商业银行大厦 7 楼

## 16 单元

办公地址: 广东省广州市沿江中路 298 号江湾商业中心 22 层

法定代表人: 吴张

成立时间: 2002 年 12 月 25 日

批准设立机关及文号: 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: 人民币 1 亿元

存续期限: 持续经营

## 2、基金发起人的权利和义务

### 1) 基金发起人的权利

根据《暂行办法》、《试点办法》、本《基金契约》和其他有关法规, 基金管理人享有如下权利:

(1) 申请发起设立基金;

(2) 法律、法规、中国证监会及《基金契约》规定的其他权利。

### 2) 基金发起人的义务

根据《暂行办法》、《试点办法》、本《基金契约》和其他有关法规, 基金管理人负有如下义务:

(1) 遵守《基金契约》

(2) 编制并公告招募说明书, 并保证其陈述内容真实、准确、完整;

(3) 自开放式基金设立申请获得批准之日起 6 个月内进行设立募集; 超过 6 个月尚未开始设立募集的, 原申请内容如有实质性改变, 应当向中国证监会报告; 原申请内容没有实质性改变的, 应当向中国证监会备案;

(4) 不得从事任何有损基金及其他基金当事人合法权益的活动;

(5) 在基金不能成立时承担基金全部募集费用, 并在发行期结束后 30 天内把已募集到的资金加计同期银行活期存款利息退还基金投资者;

(6) 法律、法规、中国证监会及《基金契约》规定的其他义务。

## (二) 基金管理人: 金鹰基金管理有限公司

### 1、基金管理人简况

同基金发起人。

## 2、基金管理人的权利义务

### 1) 基金管理人的权利

根据《暂行办法》、《试点办法》、本《基金契约》和其他有关法规，基金管理人享有如下权利：

- 1) 自本基金成立之日起，根据法律、法规和本《基金契约》的规定管理运作基金资产；
- 2) 按照《基金契约》固定，获得基金管理报酬；
- 3) 销售基金单位，办理其他基金交易业务
- 4) 选择、更换基金销售代理人，对基金销售代理人的相关行为进行监督。如认为基金销售代理人违反本《基金契约》、《基金销售代理协议》或国家法律、法规的有关规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- 5) 依照《暂行办法》、《试点办法》及其他有关规定，代表基金行使因基金投资而获得的相应权利；
- 6) 根据法律法规、《基金契约》及《托管协议》的有关规定，监督基金托管人的托管行为，如认为基金托管人违反了法律法规、《基金契约》及《托管协议》的有关规定，应呈报中国证监会和中国人民银行，并采取必要措施保护基金投资人的利益；
- 7) 在《基金契约》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回和转换申请；
- 8) 法律、法规、中国证监会及《基金契约》规定的其他权利。

### 2) 基金管理人的义务

根据《暂行办法》、《试点办法》本《基金契约》和其他有关法规，基金管理人负有如下义务

- (1) 遵守《基金契约》；
- (2) 自基金成立日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产；
- (3) 配备足够的具有专业知识的人员进行基金投资分析、决策，以专业化经营方式管理和运作基金资产；

- (4) 配备足够专业人员办理基金单位的认购、申购和赎回业务或委托其他机构代理该项业务；
- (5) 配备足够专业的人员进行基金的注册登记或委托其他机构代理该项业务；
- (6) 建立健全内部风险控制、监察稽核、财务管理及人事管理制度，保证基金资产与基金管理人的资产相互独立，保证不同基金在资产运作、财务管理等方面的相对独立；
- (7) 除依据《暂行办法》、《试点办法》、基金契约及其他有关规定外，不得利用基金资产为自己及除基金持有人以外的任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金资产；
- (8) 依法接受基金托管人的监督；
- (9) 按照规定计算并公告基金资产净值及基金单位资产净值；
- (10) 严格按照《暂行办法》、《试点办法》、基金契约及其他有关规定，履行信息披露及报告业务；
- (11) 保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等。除暂行办法》、《试点办法》、基金契约及其他有关规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
- (12) 开放式基金成立后存续期间内，其有效持有人数量连续 20 个工作日达不到 100 人，或者连续 20 个工作日最低基金资产净额低于 5,000 万元的，基金管理人应当及时向中国证监会报告，说明出现上述情况的原因以及解决方案；
- (13) 按照规定向基金持有人分配基金收益；
- (14) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回、分红款项；
- (15) 不谋求对上市公司的控股和直接管理；
- (16) 按照《暂行办法》、《试点办法》、基金契约及其他有关规定召集基金持有人大会；
- (17) 负责编制基金财务会计报告，保存基金的会计账册、报表、记录 15 年以上；
- (18) 确保需要向基金投资人提供的各项文件或资料在规定时间发出；并且保证基金投资人能够按照基金契约固定的时间和方式，查阅到与基金有关的公

开信息，并得到有关资料的复印件；

(19) 参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；

(20) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

(21) 因过错导致基金资产的损失或投资人的损失，应承担赔偿责任，其过错责任不因退任而免除；

(22) 因估值错误导致基金持有人的损失，应承担赔偿责任，该过错责任不因其退任而免除；

(23) 采取是适当、合理的方式向基金投资人进行赔偿；

(24) 基金托人因过错造成基金资产损失时，应为基金向基金托管人追偿；

(25) 法律、法规、中国证监会及《基金契约》规定的其他义务。

### (三) 基金托管人：交通银行

#### 1、基金托管人概括

名称：交通银行

注册地址：上海市仙霞路 18 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：方城国

批注设立机关：中国人民银行

组织形式：国有股份制商业银行

实收资本：170 亿元

存续期限：持续经营

#### 2、基金托管人的权利和义务

##### 1) 基金托管人的权利

根据《暂行办法》、《试点办法》本《基金契约》和其他有关法规，基金托管人享有如下权利：

(1) 依法持有并保管本基金资产；

(2) 依据本《基金契约》约定获得基金托管费；

(3) 依据法律法规、本《基金契约》及《托管协议》的有关规定，监督

基金管理人本基金的运作，如认为基金管理人违反了法律法规、本《基金契约》及《托管协议》的有关规定，应呈报中国证监会和中国人民银行，并采取必要措施保护基金投资人的利益；

- (4) 在更换基金管理人时，提名新任基金管理人；
- (5) 在跟换基金管理人、审议与基金管理人可能构成利益冲突时的事项或基金管理人未能行使召集权的情况下，负责召集基金持有人大会；
- (6) 法律、法规、中国证监会及《基金契约》规定的其他权利。

## 2) 基金托管人的义务

根据《暂行办法》、《试点办法》本《基金契约》和其他有关法规，基金托管人负有如下义务：

- (1) 遵守《基金契约》
- (2) 依法持有基金资产；
- (3) 以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金资产；
- (4) 设置专业的基金托管部门和符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金资产托管事宜；
- (5) 建立健全的内部风险控制、监察稽核、财务管理及人事管理制度，保证基金资产与基金托管人自有资产相对独立；保证不同的基金资产相对独立，对不同的基金分别设置账户，独立核算、分账管理；保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相对独立；
- (6) 除依据根据《暂行办法》、《试点办法》、基金契约及其他有关规定外，不得利用基金资产为自己及除基金持有人外的任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金资产；
- (7) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- (8) 基金托管人应当代表基金，以托管人和基金联名的方式开设证券账户，以托管人的名义开立资金结算账户，代理基金的资金结算业务，执行基金管理人的投资指令；
- (9) 保守基金商业秘密。除根据《暂行办法》、《试点办法》、基金契约及其他有关规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人透露；

- (10) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值或基金单位价格;
- (11) 采取适当、合理的措施，使开放式基金单位的认购、申购、赎回等事项符合基金契约等有关法律文件的规定;
- (12) 采取适当、合理的措施，使基金投资和融资的条件符合基金契约等法律文件的规定;
- (13) 按规定出具基金业绩和基金托管情况的报告，并报中国证监会和中国人民银行;
- (14) 在基金定期报告内出具基金托管人的意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金契约的规定进行；如果基金管理人有未执行基金契约规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了相应的措施；
- (15) 建立并保存基金持有人名册；
- (16) 按有关规定，保存基金的会计账册、报表和记录等 15 年以上；
- (17) 按规定制作相关账册与基金管理人核对；
- (18) 依据基金管理人的指令或有关规定将基金持有人基金收益和赎回款项划拨至专用账户；
- (19) 参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (20) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，应及时报告中国证监会和中国人民银行，并通知基金管理人；
- (21) 因过错导致基金资产的损失，应承担赔偿责任。其过错责任不因其退任而免除；
- (22) 基金管理人因过错造成基金资产损失时，应为基金向基金管理人追偿；
- (23) 法律、法规、中国证监会及《基金契约》规定的其他义务。

#### (四) 基金持有人

##### 1、基金持有人的权利

根据《暂行办法》、《试点办法》本《基金契约》和其他有关法规，基金持有人享有如下权利：

- 1) 取得基金收益；

- 2) 出席或者委派代表出席基金持有人大会，并行使表决权；
- 3) 获取本基金业务及财务状况的资料；
- 4) 按本基金契约的规定赎回、转换基金单位，并在规定的时间取得有效申请的款项或基金单位；
- 5) 监督基金经营情况；
- 6) 取得基金清算后的剩余资产；
- 7) 因基金管理人、托管人、销售机构、注册登记机构的过错导致基金持有人损失的偿权；
- 8) 法律、法规、中国证监会及《基金契约》规定的其他权利；
- 9) 每份基金单位具有同等的合法权益。

## 2、基金持有人的义务

根据《暂行办法》、《试点办法》本《基金契约》和其他有关法规，基金持有人负有如下义务：

- 1) 遵守《基金契约》；
- 2) 缴纳基金认购、申购款项及规定的费用；
- 3) 承担基金亏损或者终止的有限责任；
- 4) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
- 5) 法律、法规、中国证监会及《基金契约》规定的其他义务。

## 四、基金持有人大会

### （一）召开事由

有以下情形之一的，应召开基金持有人大会：

- 1、提前终止基金契约；
- 2、转换基金运作方式；
- 3、提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- 4、更换基金管理人、基金托管人；
- 5、基金契约约定的其他事项。

以下情况不需要召开基金持有人大会：

- 1、调低基金管理费、基金托管费；

- 2、 在本基金契约规定的范围变更本基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
- 3、 因相应的法律、法规发生变动必须对基金契约进行修改；
- 4、 对基金契约的修改不涉及本基金契约当事人权利义务关系发生变化或对就持有人利益无实质性不利影响；
- 5、 按照法律法规或《基金契约》规定不需要召开基金持有人大会的其他情形。

#### （二）募集方式

- 1、 基金持有人大会由基金管理人召集；基金管理人未按照召集或者不能召集时，由基金托管人召集；
- 2、 代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额百分之三以上的基金份额持有人有权自行召集，并报中国证监会备案。

#### （三）通知

召开基金持有人大会，召集人应当至少提前三十日公告基金持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

采取通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表达方式，并在会议通知中说明本次基金持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见的寄交和收取方式。

#### （四）召开方式

会议的召开方式由召集人确定，基金份额持有人大会可以采取现场方式召开，也可以采取通讯等方式召开。

更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方式召开基金持有人大会。

基金份额持有人大会应当代表百分之五十以上基金份额的持有人参加，方可召开。

- 1、 现场开会。由基金持有人本人出席或以代理投票授权委托书委派代表出席。
- 2、 通讯方式开会。通讯方式开会应以书面方式进行表决。

#### （五）议事内容与程序

## 1、意识内容及提案

议事内容为关系基金持有人利益的重大事项，如修改基金契约、决定终止基金、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并以及召集人认为须提交基金持有人大会讨论的其他事项。

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权利登记日基金总份额 10%或以上的基金持有人可以在大会召集人发出会议通知后 10 个工作日内向大会召集人提交议事内容提案。

## 2、议事程序

### 现场开会

在现场开会的方式下，由大会支持人按照规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读审议事项，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人有大会召集人选定。

### 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，由召集人提前三十日通知审议事项，在所通知的表决截止日期第二天统计全部有效表决，在公证机构监督下形成决议。

根据有感规定，若采用通讯方式卡会，会议召集人应在发出会议通知前向中国证监会备案。

## （六）表决

1、每一基金份额具有一票表决权，基金持有人可以委托代理人出席基金持有人大会并行使表决权。

### 2、基金持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

一般决议，一般决议须经出席会议的基金持有人所表决权的半数以上（不含半数）通过方为有效；特别决议应当经参加大会的基金持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、提前终止基金契约必须经过特别决表。

### 3、基金持有人大会采取记名方式进行投票表决。

4、采取通讯方式进行表决时，除非有充分相反证据证明，否则其表面符合法律法规和会议规定的书面表决意见视为有效表决。意见模糊或相互矛盾的视为无效表决。

5、基金持有人大会的各项议题应当分开审议、表决。

6、基金持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。

#### (七) 计票

##### 1、现场开会

由大会召集人组织在出席会议的基金持有人中选举两名基金持有人代表与大会召集人

授权的一名监督员共同担任监票人。

监票人应当在基金持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

如果出席会议的 10%以上的基金持有人对于提交的表决结果有怀疑，可以要求大会召集人对所投票数进行重新清点。

##### 2、通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

#### (八) 生效与公告

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案。

经中国证监会核准或者备案无异议的基金持有人大会决议对全体基金持有人及相关当事人均由法律的约束力。

基金持有人大会决议自生效之日起 5 个工作日内在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

(九) 法律法规或中国证监会对基金持有人大会有关事项另有规定的，从其规定。

## 五、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序

### (一) 基金管理人、基金托管人的更换条件

#### 1、基金管理人的更换条件

有下列情形之一的，经中国证监会批准，基金管理人必须退任：

- 1) 基金管理人解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产；
- 2) 基金托管人有充分理由认为更换基金管理人符合基金持有人利益，并提

请基金持有人大会表决通过；

- 3) 代表 50%以上基金单位的基金持有人要求基金管理人退任；
- 4) 中国证监会有充分理由认为基金管理人不能继续履行基金管理职责。

2、有下列情形之一的，经中国证监会和中国人民银行批准，基金托管人必须退

任：

- 1) 基金托管人解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产；
- 2) 基金管理人由充分理由认为更换基金托管人符合基金持有人利益，并提请基金持有人大会表决通过；

- 3) 代表 50%以上基金单位的基金持有人要求基金托管人退任；
- 4) 中国人民银行由充分理由认为基金托管人不能进行履行基金托管职责。

## （二）基金托管人和基金管理人更换程序

更换基金托管人和基金管理人应按照如下程序：

1、提名：若代表 50%以上基金单位的基金持有人要求更换基金托管人或基金管理人，由代表 10%以上基金单位的基金持有人共同提名新任基金管理人；更换基金托管人时，由基金管理人提名新任基金托管人。

2、决议：基金持有人大会对被提名的新任基金管理人或新任基金托管人形成决议。

3、批准：原任基金管理人退任与新任基金管理人继任均须经中国证监会审查批准；原任基金托管人退任与新任基金托管人继任须经中国人民银行和中国证监会审查批准。

4、公告：更换基金管理人时，由基金托管人在中国证监会批准后 5 个工作日内在至少一种指定媒体上公告。更换基金托管人时，由基金管理人在中国证监会和中国人民银行批准后 5 个工作日内在至少一种媒体上公告。前后两人基金管理人或基金托管人应办理资产管理的交接手续，并核对资产总值。如果基金管理人和基金托管人同时更换，由新任的基金管理人和基金托管人在批准后的 5 个工作日内在至少一种指定媒体上联合刊登公告。

5、基金管理人或托管人职责终止的，基金持有人大会应当在六个月内选任新基金管理人或托管人；新基金管理人或托管人产生前，由中国证监会指定临时

基金管理人或托管人。

## 六、基金的基本情况

- (一) 名称: 金鹰基金管理有限公司
- (二) 基金类型: 契约型开放式
- (三) 投资目标: 本基金投资具有较高成长性和良好基本面的中小盘股票, 通过积极的投资组合管理, 在控制风险的前提下谋求基金资产的长期稳定增值。
- (四) 基金单位发行规模: 不低于 2 亿元人民币
  
- (五) 每份基金单位面值: 人民币 1.00 元
- (六) 存续期限: 不定期

## 七、基金单位的发行

除基金发起人认购的份额外, 任何与基金单位发行有关的当事人不得预留和提前发售基金单位。

- (一) 发行方式  
采取直销和代销相结合的方式, 通过直销机构和代销机构的代理销售网点公开发售。经中国证监会及授权机构批准, 本基金科在证券交易所系统发型和交易, 相关的证券交易所或机构将作为本基金的代销机构。
- (二) 发行时间  
自招募说明书公告之日起不超过 3 个月。
- (三) 发行对象  
中华人民共和国境内自然人及法人 (法律、法规及其他有关规定禁止购买者除外)
- (四) 设立募集规模  
本基金不设固定的募集靠规模。
- (五) 投资者认购原则  
1、投资认购前, 须按销售机构规定的方式备足认购的资金;  
2、设立募集期内, 投资者可多次认购基金单位;

3、认购申请受理完成后，投资不的撤销。

#### （六）认购和费用

本基金的认购费率按照认购金额递减，既认购金额越大，所使用的认购费率越低，认购费用等于认购金额乘以所使用的认购费率。详细的认购费率可参见招募说明书的有关内容。

#### （七）认购资金利息的处理

认购资金利息在本基金成立后归入基金资产。

#### （八）认购份额的计算

本基金采用金额认购方法，计算方式如下：

认购份额 = (认购金额 - 认购费用) / 认购价格

认购价格 = 基金单位面值 (1 元人民币)

认购份额计算结果保留到小数点后两位，小数点两位以后的部分四舍五入。

#### （九）认购限制

1、投资者通过代销机构的单笔最低认购金额均不得低于 500 元，详情请见当地销售机构公告。

2、首次通过直销机构的认购最低限额为 10 万元，后续每笔认购金额不低于 500 元。

3、认购期间单个投资者的累计认购规模没有限制。

## 八、基金的成立

#### （一）基金成立的条件

本基金在设立募集期内，如基金净认购额达到或超过 2 亿元人民币，且基金单位认购者人数不低于 100 人，则基金发起人可依据《试点办法》及招募说明书停止发行，宣告本基金成立；如果在设立募集期满时实际募集资金不足 2 亿元人民币或认购者人数不足 100 人，本基金不能成立。

本基金成立前，已收取的认购款项必须存入指定商业银行中本基金的临时认购账户，不得挪作他用。

#### （二）基金设立失败

1、设立募集期满，未达到基金成立条件，或设立募集期内发生不可抗力使

基金无法设立，则基金设立失败。

2、本基金不成立时，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。

基金管理人、基金托管人及销售机构为本基金支付之一切费用应由各方各自承担。

### （三）基金不能成立时已募集资金的处理方式

本基金不能成立时，基金发起人承担全部基金募集费用，已募集的资金加计中国人民银行公布的同期银行活期存款利息必须在发行期结束后 30 天内退还基金认购人。

### （四）基金存续期内基金持有人数量和资产净值的限制

本基金成立后的存续期间内，有效基金持有人数量连续 20 个工作日达不到 100 人，或连续 20 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元人民币，基金管理人应及时向中国证监会报告，说明出现上述情况的原因及解决方案。若有效基金持有人数量连续 60 个工作日达不到 100 人，或连续 60 个工作日基金资产净值低于人民币 5,000 万元，基金管理人可宣布本基金终止。

（五）本基金若依法成立，基金管理人应于基金成立日在至少一种中国证监会指定的全国性报刊上刊登成立公告书。

（六）本基金若依法不能成立，基金管理人应根据有关规定进行公告。

## 九、基金的申购、赎回

### （一）申购与赎回办理的场所

投资者应当在销售机构办理开放式基金业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购与赎回。

本基金的销售机构包括金鹰基金管理有限公司及其委托的代销机构。

金鹰基金管理有限公司可以根据情况变化增加或者减少代销机构，并另行公告。

销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市（网点），并另行公告。

### （二）申购与赎回办理的时间

#### 1、开放日及开放时间

本基金为投资者办理申购与赎回等基金业务的工作日，即开放日，为上海证

券交易所、深圳证券交易所的交易日。具体业务办理时间由基金管理人与销售代理人约定。

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具体业务办理时间进行相应的调整并公告，报中国证监会备案。

## 2、申购的开始时间

本基金自成立日后不超过 30 个工作日的时间起开始办理申购。

## 3、赎回的开始时间

本基金自成立日后不超过 30 个工作日的时间起开始办理赎回。

4、在确定申购开始时间与赎回开始时间后，由基金管理人最迟于开放日前 3 个工

作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

### （三）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即本基金的申购、赎回价格以受理申请当日收市后计算的基金单位净值为基准进行计算。

2、本基金采用金额申购和份额赎回的方式，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前撤销。

4、基金管理人在不损害基金持有人权益的情况下可更改上述原则。基金管理人最迟于新规则开始实施日前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

5、投资者赎回基金份额时，将首先赎回其持有时间最长的基金份额。

### （四）申购与赎回的程序

#### 1、申购与赎回的申请方式

基金投资者须按销售机构规定的手续，在规定的申购赎回日的业务办理时间提出申购或赎回的申请。

投资人申购本基金，须按销售机构规定的方式备足申购资金。

投资人提交赎回申请时，其在销售机构（网点）必须有足够的基金单位余额。

#### 2、申购与赎回申请的确认

基金管理人应以收到申购或赎回申请的当天(T日)作为申购或赎回申请日，并在收到申请后的1个工作日内对该交易的有效性进行确认。投资者可在2个工作日之后(包括该日)向基金代销网点查询申购与赎回的成交情况。

### 3、申购与赎回申请的款项支付

申购采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，申购不成功或无效款项将退回投资者账户。投资者赎回申请成交后，基金管理人应指示基金托管人按有关规定将赎回款项在自受理基金投资人有效赎回申请之日起不超过7个工作日内划往管理人汇总清算账户，再由管理人划往赎回人银行账户。在发生巨额赎回时，款项的支付办法按本基金的基金契约有关规定处理。

#### (五) 申购与赎回的数额限制

1、代销网点每个账户每次申购的最低金额为500元人民币，具体数额请留意当地代销网点；

2、直销中心每个账户首次申购的最低金额为10万元人民币，追加申购的最低金额为500元人民币；已在直销中心有认购本基金记录的投资者不受首次申购最低金额的限制；

3、基金持有人可将其全部或部分基金单位赎回；

4、基金管理人可根据市场情况，调整申购的金额和赎回的份额的数量限制，基金管理人必须在调整前3个工作日至少在一种中国证监会指定的媒体上刊登公告并报中国证监会备案；

5、申购份额、余额的处理方式：申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日基金单位资产净值为基准计算，保留到小数点后两位，两位以后四舍五入；

6、赎回金额的处理方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金单位资产净值为基准并扣除相应的费用，保留到小数点后两位，两位以后四舍五入。

#### (六) 本基金的申购费与赎回费

1、本基金申购费率按照申购金额递减，即申购金额越大，所适用的申购费率越低，申购费用等于申购金额乘以所适用的申购费率。详细的申购费率可参见

招募说明书的有关内容。

本基金的申购费用由申购人承担，用于市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金资产。

2、赎回费率按照持有时间递减，即持有时间越长，所适用的赎回费率越低，赎回费用等于赎回金额乘以所适用的赎回费率。详细的赎回费率可参见招募说明书的有关内容。

本基金的赎回费用由基金持有人承担，赎回费用的 80%用于注册登记费及相关手续费，20%归于基金资产。

3、基金管理人可以调整申购费率和赎回费率。基金管理人必须在调整前报中国证监会备案，并在调整实施前 3 个工作日内至少在一种中国证监会指定的媒体上刊登公告。

#### （七）申购份额与赎回金额的计算方式

##### 1、申购份额的计算

申购份额=（申购金额—申购费用） $\div$ T 日基金单位净值  
基金单位份额保留小数点后两位。

##### 2、赎回费和赎回金额的计算

赎回费=赎回份额 $\times$ 赎回日基金单位资产净值 $\times$ 赎回费率  
赎回金额=赎回份额 $\times$ 赎回日基金单位资产净值 — 赎回费

3、T 日的基金单位净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告。遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

4、本基金的申购费率和/或赎回费率如发生调整，则调整后的申购费率和/或赎回费率在报中国证监会备案生效之日起第一个工作日起实施。

#### （八）申购与赎回的注册登记

投资者申购基金成功后，注册登记机构在 T+1 日为投资者办理增加权益的登记手续，投资者自 T+2 日起有权赎回该部分基金单位。

投资者赎回基金成功后，注册登记机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益的登记手续。

基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体

公告。

### （九）巨额赎回的认定及处理方式

#### 1、巨额赎回的认定

单个开放日基金净赎回申请(有效赎回申请总份额扣除有效申购申请总份额后的余额)超过上一日基金总份额的 10%时，为巨额赎回。

#### 2、巨额赎回的处理方式

出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况接受全额赎回或部分赎回。

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

2) 部分赎回：当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金单位资产净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额的 10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；未受理部分可延迟至下一个开放日办理。转入第二个开放日的赎回申请不享有优先权并以该开放日的基金单位资产净值为依据计算赎回金额，依此类推，直到全部赎回为止。投资者在申请赎回时可选择将当日未获受理部分予以撤销。

当发生巨额赎回并部分延期赎回时，基金管理人应立即向中国证监会备案并在 3 个工作日内在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告，并说明有关处理方法。

本基金连续两个开放日发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，并应当在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

### （十）拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

1) 不可抗力；

2) 证券交易场所交易时间非正常停市；

3) 法律、法规规定或经中国证监会批准的其他情形。

2、在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资人的赎回申请：

- 1) 不可抗力；
- 2) 证券交易场所交易时间非正常停市；
- 3) 因市场剧烈波动或其他原因而出现连续巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难时，基金管理人可以暂停接受基金的赎回申请；
- 4) 法律、法规规定或经中国证监会批准的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应当在当日立即向中国证监会备案。已接受的赎回申请，基金管理人应当足额兑付；如暂时不能足额兑付，应当按单个账户已被接受的赎回申请量占已接受的赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分在后续开放日予以兑付，并以后续开放日的基金单位净值为依据计算赎回金额。投资者在申请赎回时可选择将当日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。

3、发生基金契约、招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人有正当理由认为需要暂停接受基金申购、赎回申请的，报经中国证监会批准后可以暂停接受投资人的申购、赎回申请。

4、暂停基金的申购、赎回，基金管理人应及时在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

5、暂停期间结束基金重新开放时，基金管理人应予公告。

如果发生暂停的时间为一天，基金管理人将于重新开放日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告并公告最新的基金单位净值。

如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人将提前 1 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最新的基金单位净值。

如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体连续刊登基金重新开放申购或赎回

的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最新的基金单位净值。

### 基金转换

## 十、基金间转换

在同一注册登记机构的前提下，本基金可以转换为本基金管理人管理的其他基金，转换的原则如下：

（一）基金转换的计算采用“未知价”原则，即基金转换价格以受理申请当日收市后计算的转出及转入基金的基金单位资产净值为基准进行计算。

（二）采用份额转换的方式，即基金转换以份额申请。

（三）基金转换收取适当的基金转换费。

（四）在发生基金转换时，转出基金必须为允许赎回状态，转入基金必须为允许申购状态。

（五）在发生转入基金限制申购或转出基金巨额赎回的情况下，所涉及到的基金转换按比例确认。

（六）由于本基金和转入基金的认购、申购、赎回费率结构不一致，需支付的转换费率也有区别，具体转换程序及转换费率本基金管理人另行公告。

基金管理人在不损害基金持有人利益的情况下可更改上述转换程序及转换费率，并按照有关规定在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上公告。

## 十一、基金交易

经中国证监会批准，本基金可在证券交易所系统发行。通过证券交易所系统认购本基金的基金持有人可按照证券交易所的有关规定，进行本基金的交易。通过直销和代销系统认/申购的本基金，须将基金转托管到国内任意一家证券公司的营业部后，才可在交易所交易。通过证券交易所系统买入的本基金亦可以转托管到本基金的销售代理机构，然后申请赎回。关于本基金在证券交易所系统中的交易、分红处理及跨市场转托管等业务将遵循证券交易场所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则。

## 十二、基金的托管

本基金管理人与本基金托管人本息按照《暂行办法》、《试点办法》和法律、法规及中国证监会的有关规定，订立《交易中小盘精选证券投资基金托管协议》，以明确基金托管人与基金管理人之间的基金持有人名册保管、基金资产的保管和运作及相互监督等相关事宜的权利、义务及职责，确保基金资产的安全，保护基金持有人的合法权益。

根据《暂行办法》、《试点办法》、《基金契约》和有关证券法规的规定，基金托管人对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金的申购与赎回、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反《暂行办法》、《试点办法》和《基金契约》和有关证券法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，积极管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在期限内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人由重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

## 十三、基金认购、申购、赎回等业务

本基金的销售业务包括本基金的认购、申购、赎回、转换及定期定额投资等业务。

本基金的销售业务由基金管理人及基金管理人委托的其他符合条件的机构办理。基金管理人委托其他机构办理本基金销售业务的，应与代理人签订委托销售代理协议，以明确基金管理人和销售代理人之间在基金单位认购、申购、赎回等事宜中的权利和义务，确保基金资产的安全，保护基金投资者和基金持有人合法权益。

基金管理人有权选择和更换销售代理人，并对其销售代理行为进行必要的

监督和处理；如发现基金销售代理人违反有关法律、法规和《基金契约》、委托销售代理协议的有关规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益。

## 十四、基金的注册登记业务

本基金的注册登记业务指本基金登记，存管，清算和交收业务，具体的内容包括投资人基金账户管理、基金单位注册登记、清算及基金交易确认、代理发红利、建立并保管基金持有人名册等。

基金管理人委托中国证券登记结算有限责任公司办理本基金注册登记业务的，并与其签订委托代理协议，以明确基金管理人和代理机构在投资人基金账户管理、基金单位注册登记、清算及基金交易确认、代理发放红利、建立并保管基金持有人名册等事宜中的权利和义务，保护基金投资者和基金持有人的合法权益。

### （一）注册登记人的权利和义务

#### 1、注册登记人的权利

基金契约各当事人确认，基金的注册登记人享有如下权利：

- 1) 取得注册登记费；
- 2) 保管基金持有人开户资料、交易资料、基金持有人名册等；
- 3) 在法律、法规允许的范围内，对注册登记业务的办理时间进行调整，并最迟于开始实施前 3 个工作日在至少一种指定媒体上公告；
- 4) 法律、法规规定的其他权利。

#### 2、注册登记人的义务

基金契约各当事人确认，注册登记人必须履行如下义务：

- 1) 配备足够的专业人员办理本基金的注册登记业务；
- 2) 严格按照法律法规和本基金契约规定的条件办理本基金的注册登记业务；
- 3) 保管基金持有人名册及相关的申购、赎回、买入、卖出等业务记录 15 年以上；
- 4) 对基金持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查及法律、法规规定的

其它情形除外；

- 5) 按本基金契约及招募说明书、公开说明书规定为投资人办理非交易过户业务、提供其他必要的服务；
- 6) 法律、法规规定的其他义务。

## （二）基金管理人对注册登记人的监督程序和方法

本基金管理人对注册登记人的本基金注册登记业务进行监督，监督程序和方法如下：

发现基金注册登记人的违反《暂行办法》、《试点办法》和《基金契约》和有关证券法规规定的行为，基金管理人应及时以书面形式通知基金注册登记人限期纠正，基金注册登记人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金注册登记人改正。基金注册登记人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。

基金管理人发现基金注册登记人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金注册登记人限期纠正。

# 十五、基金的投资

## 一、投资目标

本基金投资具有较高成长性和良好基本面的中小盘股票，通过积极的投资组合管理，在控制风险的前提下谋求基金资产的长期稳定增值。

## 二、投资范围

本基金的投资对象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、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金的股票投资主要投资于具有较高成长性和良好基本面的、流通市值在市场平均水平之下的中小盘股票（流通市值排名前 20%（含 20%）的新上市股票一年内不列入流通市值市场平均值的计算）。本基金的其他股票投资还包括新股申购、股票增发申购等。

本基金的债券投资包括国内依法公开发行、上市的国家债券、金融债、企业（公司）债（包括可转债）等债券。

本基金的股票投资占基金资产总值的比例为 50%到 80%，债券投资占基金资产总值的比例为 20%到 40%，现金占基金资产总值的比例不超过 10%。

### 三、投资策略

#### 1、决策依据

本基金的投资决策依据包括：

- 1) 宏观经济形势及前景、有关政策趋向；
- 2) 行业发展现状及前景；
- 3) 上市公司基本面及发展前景；
- 4) 证券市场走势及预期；
- 5) 股票、债券等类别资产的预期收益率及风险水平。

#### 2、决策程序

- 1) 本基金管理人的研究部门基于对宏观经济、政策及证券市场的现状和发展趋势的深入分析研究，和对各类别资产收益率和风险水平的合理预期，向投资决策委员会提交投资建议，投资建议包括总体资产配置建议、类别资产配置建议、个股/券种投资建议等；
- 2) 投资决策委员会根据本基金的投资目标，结合对本基金投资相关因素的全局考虑，确定本基金的投资策略，制定总体资产配置计划；
- 3) 本基金基金经理根据投资决策委员会制定的基金的总体资产配置计划，考虑研究部门的相关建议，拟定投资计划，报投资决策委员会批准；
- 4) 本基金基金经理根据投资决策委员会批准的投资计划，制定具体投资方案。

#### 3、组合原则

本基金的投资组合必须符合以下比例规定：

- 1) 本基金投资于股票、债券的比例，不得低于基金资产总值的 80%；
- 2) 本基金投资于国家债券的比例，不得低于基金资产净值的 20%；
- 3) 本基金持有一家上市公司的股票，不得超过基金资产净值的 10%；
- 4) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，不得超过该证券的 10%；
- 5) 运用基金资产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产。

产，本基金所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司该次的股票发售总量；

- 6) 本基金投资于中小盘股的比例不低于本基金股票投资总额的 80%；
- 7) 有关法律法规、中国证监会及本基金契约所规定的其他比例限制；
- 8) 法律法规或监管部门对上述比例另有规定时从其规定；
- 9) 本基金将于成立日后三个月内达到符合规定的比例限制。

#### 4、本基金股票投资策略

本基金采取主动的股票投资策略，在专业化研究的基础上，将系统的选股方法与积极的投资操作相结合，选择具有较高成长性、基本面良好的股票构建股票投资组合，把握投资机会，实现收益。

股票投资组合包括中小盘股票组合和其他股票组合。中小盘股票组合通过选择具有较高成长性、基本面良好的中小盘股，依据有效充分分散的原则构建。其他股票投资主要是参与有较高投资价值的新股申购、股票增发申购以及根据市场情况的短期股票投资。

#### 5、本基金债券投资策略

采取稳健的混合管理投资策略，根据对利率、收益率走势的预测，考虑债券信用等级、期限、品种、流动性等因素，依据修正久期、凸性等指标，构建债券组合。

#### （四）选股标准

本基金主要选择具有较高成长性和良好基本面的、流通市值在市场平均水平之下的中小盘股票进行投资。基金选股采用 PEG（其中 PE 是股票的静态市盈率，G 是预期净利润增长率）作为定量指标，采用公司素质和财务状况作为定性指标。

#### （五）本基金业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为 75%的股票投资比较基准加上 25%的债券投资比较基准。

股票投资比较基准采用 50%的中信中盘指数收益率加 50%的中信小盘指数收益率。债券投资比较基准采用中信国债指数。

#### （六）投资限制

本基金投资遵守《暂行办法》等关法律法规和中国证监会的有关规定，以及本基金契约规定的投资限制，本基金禁止从事下列行为：

- 1、投资于其他基金；
- 2、将基金资产用于抵押、担保、资金拆借或者贷款；
- 3、以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券；
- 4、从事证券信用交易；
- 5、以基金资产进行房地产投资；
- 6、从事可能使基金资产承担无限责任的投资；
- 7、将基金资产投资于与基金托管人或者基金管理人有利害关系的公司发行的证券；
- 8、法律、法规、中国证监会及本基金契约规定禁止从事的其他行为。

法律法规或监管部门对上述限制另有规定时从其规定。

#### （七）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则和方法

基金管理人接受基金持有人的委托，为基金持有人的利益管理和运用基金资产，必须恪尽职守，履行法律、法规、中国证监会及基金契约规定的义务。

基金管理人有权按照法律、法规及中国证监会的规定，代表基金对所投资公司行使股东权利，但不得谋求对上市公司的控股和直接管理。在基金契约授权范围内，基金管理人有权代表基金签订与基金有关的合同、协议，并处理与基金有关的法律纠纷。

基金管理人不得通过关联交易为其自身、雇员、授权代理人或任何与其存在利害关系的第三人牟取不当利益。

## 十六、基金资产

### （一）基金资产总值

基金资产总值包括基金持有的各类证券价值、银行存款、清算备付金、交易保证金、证券清算款、应收款项、待摊费用、投资估值增值等价值总和。

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### （三）基金资产的账户

基金托管人以托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开设证券账户，以托管人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备

付金一级账户，并在托管人处为本基金开立二级账户，办理本基金的证券资金清算；以基金名义在中央国债登记结算有限责任公司开立国债托管账户，用于本基金的国债交易和清算。基金资产的账户与基金发起人、基金管理人和基金托管人的自有资产账户以及其他基金资产账户相独立。

#### （四）基金资产的处分

本基金的资产独立于基金管理人和基金托管人的资产，并由基金托管人保管。基金管理人和基金托管人以其自有资产承当相应的法律责任，其债权人不得对基金资产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依据《暂行办法》等法律法规及本基金契约有关规定处分外，基金资产不得被处分。

### 十七、基金资产估值

#### （一）估值目的

基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金资产的价值以及基金资产是否增值、保值。

#### （二）估值原则

##### 1、真实性原则

基金管理人对基金资产的估值应通过规定的程序，内容必须保证真实性和可靠性，禁止任何形式的弄虚作假。

##### 2、及时性原则

基金资产的估值要严格按照有关法律、法规及中国证监会规定期限及时办理，不得无故拖延。

##### 3、完整性原则

基金资产估值的内容要完整详实，对要求揭示的所有事项不得遗漏或回避。

##### 4、公允性原则

基金资产估值必须采用公允价值原则，公允价值是指基金资产投资在有意愿成交的交易对手间的现行交易价格，不包括强制性出售或破产出售的情况。

##### 5、公开性原则

有关基金资产估值的内容除在招募说明书列明外，基金资产估值的主要方法还必须在本基金的基金契约、发行公告、上市公告书、年度报告、半年度报告等

文件中列示。

## 6、准确性原则

基金资产估值必须准确，若净值计算错误大于 0.5%则应报中国证监会备案并公告。

### （三）估值日

本基金成立后，每个工作日对基金资产进行估值。

### （四）估值对象

基金依法拥有的各类资产。

### （五）估值方法

1、上市证券按估值日其所在证券交易所挂牌的收盘价估值，估值日无交易的，以最近交易日的收盘价计算。

2、未上市的股票应区分以下情况：

1) 送股、配股、转增股和增发新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；

2) 首次公开发行的股票，按成本估值。

3、未上市债券、银行间债券市场交易的债券以成本价加计至估值日为止的应计利息额估值，银行存款以本金加计至估值日为止的应计利息额估值，派发的股息、红利、以至估值日为止的实际获得额计算。

4、配股权证，从配股除权除息日起到配股确认日止，按市价高于配股价的差额估值。

5、基金资产估值不包括出售资产时估计的券商佣金、印花税及可能发生的其他交易费用。

6、如有确凿证据表明按上述方法对基金资产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，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

7、如有新增事项或变更事项，则按有关规定进行估值。

### （六）估值程序

本基金估值由基金管理人进行。

本基金估值程序分为正常情况下和特殊情况下的估值程序。正常情况下的估

值由本基金的基金会计根据上述的基金估值方法进行。特殊情况下的估值程序是指本基金所持有的有价证券出现停牌或暂停交易(属于公布信息而暂停交易的除外)等情况，特殊情况下的估值按照以下程序进行：

- 1、由基金经理对需要进行特殊估值程序的有价证券的价值趋势作出判断，并根据判断出具对该有价证券的初步估值意见，报运作保障部；
- 2、运作保障部及时将基金经理的报告送达资产估值委员会，资产估值委员会由基金管理人总经理、分管副总经理或总经理助理、研究发展部、运作保障部、投资管理部负责人、基金经理、基金会计等相关人员组成；
- 3、资产估值委员会开会确定需要进行特殊估值程序的有价证券的估值标准、程序和方法，并作出估值的决定，该等决定应由全体资产估值委员会委员的三分之二以上出席并经与会委员的过半数通过方为有效；
- 4、如有必要，资产估值委员会可邀请有关专家为其决策提供专业意见；
- 5、运作保障部按照资产估值委员会的决定，具体实施特殊估值程序；
- 6、资产估值委员会认为有必要时，可报告本基金管理人董事会，提请董事会决定该等资产的估值与定价。

基金管理人完成基金资产估值后，将估值结果以书面形式报送基金托管人，基金托管人按照本基金契约规定的估值方法、时间、程序进行复核；基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人；月末、年中和年末估值复核与基金会计帐目的核对同时进行。

#### （七）估值差错的处理

基金管理人和基金托管人应采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性和及时性。当基金单位净值计算出现差错时，基金管理人应当并予以纠正，尽快采取合理的措施防止损失进一步扩大。估值差错达到基金资产净值的0.5%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案并公告。

基金管理人按估值方法的第7条规定方法进行估值调整时，所造成的误差不作为估值差错处理。

因基金单位估值错误给基金投资者或基金造成损失的，由基金管理人统一支付赔偿，在支付赔偿后，有权向有关责任方追偿。其赔偿原则如下：

赔偿仅限于因差错而导致的基金持有人或基金的直接损失；

基金管理人代表基金保留要求返还不当得利的权利；  
基金管理人仅负责赔偿在单次交易时给单一当事人造成 10 元人民币以上的损失。

前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，按其规定处理。

由于证券交易所或登记结算公司发送的数据错误，以及战争、火灾、地震、洪水等不可抗力原因，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可以免除赔偿责任。基金管理人和基金托管人应当积极采取一切必要的措施消除由此造成的影响。

#### （八）暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停交易时；  
2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时。

#### （九）基金单位净值的确认

基金单位净值的计算精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入，国家另有规定的，从其规定。基金管理人和基金托管人进行估值及复核时，由此造成的误差不作为估值差错处理。

#### （十）特殊情况的处理

1、基金管理人按照估值方法的第 6 条进行估值时，所造成的误差不作为基金单位净值错误处理；  
2、由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或由于不可抗力原因，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，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 十八、基金费用与税收

### （一）基金费用的种类

基金费用从基金资产中支付，包括：

- 1、基金管理人的报酬；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、证券交易费用；
- 4、基金信息披露费用(基金认购期所发生的此类费用从基金发行费用中列支，不另从基金资产支付)；
- 5、基金持有人大会费用；
- 6、与基金相关的会计费、律师等中介机构费用(基金认购期所发生的此类费用从基金发行费用中列支，不另从基金资产支付)；
- 7、基金分红手续费；
- 8、法律、法规、中国证监会规定可以列入的其他费用。

## (二) 基金费用、费率的调整、计提方法、计提标准和支付方式

### 1、基金管理人的报酬

基金管理人的报酬按基金资产净值的 1.5% 年费计提。

基金管理人的报酬费率将根据有关法律、法规的规定及时调整。

在通常情况下，基金管理人报酬按前一日基金资产净值的 1.5% 年费计提。

计算方法：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理人报酬

E 为前一日基金资产净值

基金管理人报酬每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理人报酬划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇节假日、休息日等，支付日期顺延。

### 2、基金托管人的托管费

基金托管人的托管费按基金资产净值的 2.5‰ 的年费率计提。

在通常情况下，基金托管人的托管费按前一日的基金资产净值的 2.5‰ 的年费率计提。计算方法：

$$H = E \times 2.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管人的托管费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付，若遇节假日、休息日等，支付日期顺延。

3、本契约第十七节第（一）款中 3—8 项费用由基金托管人根据有关规定进行核算，发生的费用如果影响基金单位净值小数点后第五位的，即发生的其他费用大于基金净值十万分之一，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。发生的其他费用如果不影响基金单位净值小数点后第五位的，即发生的其他费用小于基金净值十万分之一，应于发生时直接计入基金损益。

### （三）不列入基金费用的项目

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资产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

### （三）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，此项调整不需要召开基金持有人大会。

## （五）税收

本基金及基金持有人依照法律、法规的有关规定履行纳税义务。

## 十九、基金收益与分配

### （一）基金收益的构成

- 1、基金投资所得红利、股息、债券利息；
- 2、买卖证券价差；
- 3、存款利息；
- 4、法律、法规、中国证监会及本基金契约规定的其他收入。

因运用基金资产带来的成本或费用的节约计入收益。

### （二）基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按照有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

### （三）收益分配原则

- 1、基金当年收益分配比例不得低于当年基金净收益的 90%;
- 2、基金收益分配每年至少分配一次，但若本基金成立至基金会计年度结束不足三个月可不进行收益分配，年度分配在基金会计年度结束后的四个月内完成；
- 3、基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；
- 4、基金投资亏损，或者基金当年虽有收益但基金单位净值低于面值，则不进行收益分配；
- 5、基金收益分配后基金单位净值不能低于面值；
- 6、基金持有人可以选择取得现金或将所获红利再投资于本基金；选择采取红利再投资形式的，分红现金按红利发放日的基金单位净值转成相应的基金单位；本基金分红的默认方式为红利再投资；
- 7、红利分配时所发生的银行转帐或其他注册登记费用由投资者自行承担，若基金管理人收取该项费用，具体提取标准和方法应予以公告；
- 8、每份基金单位享有同等分配权；
- 9、法律、法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

#### （四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益的范围、基金净收益、分配对象、分配原则、分配基准日、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

#### （五）收益分配方案的确定与公告

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，由基金托管人核实后确定，在报中国证监会备案后五个工作日内公告。

#### （六）收益分配中发生的费用

- 1、收益分配采用红利再投资方式免收再投资的申购费用；采用现金分红方式，则可从分红现金中提取一定的数额或者比例用于支付注册登记作业手续费或按照国家规定的银行资金汇划费用，如收取该项费用，具体提取标准和方法在招募说明书中规定。
- 2、如果基金持有人所获现金红利不足支付前述银行资金汇划费用或注册登记作业手续费，注册登记机构自动将该基金持有人的现金红利按红利发放日的基金单位净值转为基金单位。

## 二十、基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

- 1、基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日；
- 2、基金核算以人民币为记帐本位币，以人民币元为记帐单位；
- 3、执行《中华人民共和国会计法》、《证券投资基金会计核算办法》、《金融企业会计制度》等国家有关的法律和会计制度；
- 4、本基金为会计核算主体，独立建帐、独立核算；
- 5、基金管理人及托管人必须各自保留完整的会计帐目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表和会计报表附注；
- 6、基金管理人为本基金的基金会计核算责任人；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### （二）基金审计

- 1、本基金管理人聘请与基金发起人、基金管理人和基金托管人独立的会计师事务所及其注册会计师对基金财务会计报告进行年度审计并出具审计报告。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，须事先征得基金管理人和基金托管人同意，并报中国证监会备案。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须经基金托管人和基金管理人三分之二以上的独立董事同意，并报中国证监会备案。更换会计师事务所需在 5 个工作日内公告。

## 二十一、基金的信息披露

### （一）总则

本基金发起人、管理人、托管人等基金信息披露义务人，按照《暂行办法》、《试点办法》等法律、法规及中国证监会和《基金契约》的有关规定披露本基金信息，保证公开披露文件的内容真实、准确、完整，并就其保证承担连带责任。

公开披露基金信息涉及财务会计、法律等事项的，应当根据有关规定由会计师事务所、律师事务所等专业机构审查验证，并出具书面意见。相关专业机构及其人员保证其所出具文件的内容真实、准确、完整，并就其保证承担连带责任。

一个基金会计年度内的信息披露事项必须固定在至少一种中国证监会指定的全国性报刊上公告。

基金信息披露义务人应当确保披露信息在规定时间内发出，并保证投资人能够按照《招募说明书》规定的时间和方式查阅或者复制与基金有关的公开资料。

#### （二）本基金的信息披露内容包括：

- 1、招募说明书；
- 2、发行公告；
- 3、成立公告书；
- 4、定期报告；
- 5、临时报告；
- 6、澄清公告与说明；
- 7、法律、法规以及中国证监会规定应予披露的其他信息。

#### （三）招募说明书

基金募集前，基金发起人根据《暂行办法》、《试点办法》及其他有关规定编制招募说明书，并向社会公开披露有关信息。

基金发起人编制完成招募说明书后，将经签署的招募说明书及其摘要随其他设立申请文件一并报送中国证监会审核。基金获准设立后，基金管理人应当在基金募集前三日内将招募说明书及其摘要刊登在至少一种中国证监会指定的全国性报刊上，并将招募说明书正文放置在基金管理人所在地、各销售网点，供公众查阅，同时一式二份报送中国证监会备案。

本基金成立后，基金管理人应于每 6 个月结束后的 1 个月内更新招募说明书及其摘要，更新内容的截至日为每 6 个月的最后 1 日，招募说明书更新后，应在公告时间 15 日前报中国证监会审核。

#### （四）发行公告和成立公告书

基金发起人按照《暂行办法》及其实施准则、《试点办法》编制并公告发行公告。

本基金募集满足《暂行办法》、《试点办法》规定的成立条件的，基金管理人应于基金成立日在至少一种中国证监会指定的全国性报刊上刊登基金成立公告书。

## （五）定期公告

本基金定期报告包括年度报告、半年度报告、季度报告、基金净值公告。由基金管理人根据《暂行办法》、《试点办法》的规定和中国证监会颁布的有关证券投资基金信息披露内容与格式的相关文件进行编制并公告，同时报中国证监会备案。

### 1、年度报告

基金管理人在本基金每个会计年度结束后九十日内编制完成年度报告，并将年度报告正文登载于基金管理人的国际互联网站上，将年度报告摘要刊登在至少一种中国证监会指定的全国性报刊上，年度报告正文一式二份报送中国证监会备案。基金年度报告的财务报告须经具有从事证券相关业务资格的会计师事务所审计并出具审计报告。

### 2、半年度报告

基金管理人在本基金每个会计年度的前六个月结束后六十日内编制完成半年度报告，并将半年度报告正文登载于基金管理人的国际互联网站上，将半年度报告摘要刊登在至少一种由中国证监会指定的全国性报刊上，半年度报告正文一式二份报送中国证监会备案。

### 3、季度报告

基金管理人应当在每个季度结束后十五个工作日内编制完成季度报告，并刊登在基金管理人的国际互联网站及至少一种由中国证监会指定的全国性报刊上，同时一式二份报送中国证监会备案。

### 4、基金净值公告

基金管理人应于本基金每个开放日的第二天计算基金单位资产净值，并登载于基金管理人国际互联网站、中国证监会指定的全国性报刊及其他披露媒介上。

## （六）临时公告

基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当于第一时间报告中国证监会，并编制临时报告，经中国证监会核准后公告。

重大事件是指可能对基金持有人权益及基金单位的交易价格产生重大影响的事件，包括但不限于下列情况：

- 1、基金持有人大会决议；
- 2、基金管理人或基金托管人变更；
- 3、基金管理人的董事长、总经理、基金经理、基金托管人的总经理变动；
- 4、基金管理人的董事一年内变更超过 50%；
- 5、基金管理人或基金托管部主要业务人员一年内变更超过 30%；
- 6、基金管理人或基金托管人受到重大处罚；
- 7、重大关联事项；
- 8、重大诉讼、仲裁事项；
- 9、基金单位估值差错超过基金单位资产净值的 0.5%；
- 10、基金发生巨额赎回并延期支付；
- 11、基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- 12、基金暂停接受申购、赎回申请或基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 13、基金费用的调整；
- 14、基金转换等业务的推出；
- 15、基金投资限额的调整；
- 16、增减销售代理机构；
- 17、变更基金的注册登记机构；
- 18、为基金提供相关服务的机构出现有关事项，有可能影响投资人对基金风险或业绩的评估或判断；
- 19、基金所重点投资的上市公司或企业、金融债发行人经营状况或财务状况出现严重恶化，从而对基金的投资业绩产生较大影响；
- 20、基金所重点投资的股票或债券的价格出现连续跌停或非正常原因持续停牌，从而对基金的投资业绩产生较大影响；
- 21、基金提前终止；
- 22、其他重要事项。

## （七）澄清公告与说明

- 1、在任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动时，相关的信息披露义务人知悉后应当立即对该

消息进行公开澄清，并将有关情况立即报送中国证监会。

2、有关基金信息公布后，基金信息披露义务人可根据中国证监会要求对公告内容作进一步公开说明。

#### （八）申购、赎回等业务公告书

本基金管理人将按照《暂行办法》及其实施准则、《试点办法》编制公告书，同时报中国证监会备案。

在日常申购开始日的三个工作日前，在指定媒体公告申购公告书；

在日常赎回开始日的三个工作日前，在指定媒体公告赎回公告书；

在日常基金间转换开始日的三个工作日前，在指定媒体公告转换公告书；

#### （九）信息披露管理

1、基金管理人、基金托管人应当指定专人负责信息披露事务。

2、基金托管人须对基金管理人编制的定期报告中有关内容进行复核，并就此向基金管理人出具书面文件。

3、基金管理人应建设、维护信息披露的国际互联网站，并及时更新国际互联网站披露的信息。

4、基金管理人可选择中国证监会指定的全国性报刊披露信息，所选择的报刊在一个基金会计年度内不得更换。

5、基金管理人除在其国际互联网站及中国证监会指定的全国性报刊上披露信息外，还可以根据需要在其他报刊或销售资料中披露信息，但应当保证：

1) 国际互联网站及指定报刊上披露的同一信息应在同一天披露；

2) 国际互联网站及指定报刊不晚于非指定报刊或销售资料披露信息；

3) 在不同宣传媒介上披露同一信息的内容一致；

4) 在不同宣传媒介上披露信息不应影响投资人作出决策。

6、基金管理人、托管人及其委托的机构通过新闻媒体披露与本基金有关的信息后，应当将相关的披露宣传材料报告中国证监会备案。

#### （十）信息披露文件的存放与查阅

本基金的信息披露文件文本存放在基金管理人、基金托管人和基金销售代理人的办公场所和营业场所，投资者可在办公时间免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

基金管理人和基金托管人应保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 二十二、基金的终止和清算

### (一) 基金终止

有下列情形之一的，基金应当终止：

- 1 存续期间内，基金持有人数量连续 60 个工作日达不到 100 人，或连续 60 个工作日基金资产净值低于人民币 5,000 万元；
- 2、基金经基金持有人大会表决终止；
- 3、因重大违法、违规行为，基金被中国证监会责令终止；
- 4、基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任本基金的管理人，而无其他适当的基金管理机构承接其权利及义务；
- 5、基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任本基金的托管人，而无其他适当的基金托管机构承接其权利及义务；
- 6、由于投资方向变更引起的基金合并、撤销；
- 7、法律、法规规定或中国证监会允许的其他情况。

自基金终止之日起，与基金有关的所有交易应立即停止。在基金清算小组组成并接管基金资产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金契约和托管协议的规定继续履行保护基金资产安全的职责。

### (二) 基金清算小组

- 1、自基金终止之日起 30 个工作日内成立基金清算小组，基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算，在基金清算小组接管基金资产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金契约和托管协议的规定继续履行保护基金资产安全的职责。
- 2、基金清算小组成员由基金发起人、基金管理人、基金托管人、具有相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。
- 3、基金清算小组负责基金资产的保管、清理、估价、变现和分配，编制基金清算报告，并将清算结果上报中国证监会。基金清算小组可以依法进行必要的民事活动。

### （三）清算程序

- 1、基金终止后，由基金清算小组统一接管基金资产；
- 2、基金清算小组对基金资产进行清理和确认；
- 3、对基金资产进行评估和变现；
- 4、将基金清算结果报告中国证监会；
- 5、公布基金清算公告；
- 6、对基金资产进行分配。

### （四）基金清算小组的工作内容

- 1、基金终止后，发布基金清算公告；
- 2、基金清算小组统一接管基金资产；
- 3、对基金资产进行清理和确认；
- 4、对基金资产进行估价；
- 5、对基金资产进行变现；
- 6、将基金清算结果报告中国证监会；
- 7、以自身名义参加与基金有关的民事诉讼；
- 8、公布基金清算结果公告；
- 9、进行基金剩余资产的分配。

### （五）清算费用

清算费用是指清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由清算小组优先从基金资产中支付。

### （六）基金资产按下列顺序清偿

- 1、支付清算费用；
- 2、交纳所欠税款；
- 3、清偿基金债务；
- 4、按基金持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金资产未按前款（1）至（3）项规定清偿前，不分配给基金持有人。

### （七）基金清算的公告

基金清算公告于基金终止并报中国证监会备案后5个工作日内公告；清算过程中的有关重大事项将及时公告；基金清算结果公告由基金清算小组经中国证监

会批准后在 3 个工作日内公告。

#### （八）基金清算账册及文件的保存

基金清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

### 二十三、 违约责任

（一）由于《基金契约》一方当事人的过错，造成基金契约不能履行或不能完全履行的，由有过错的一方承担违约责任；如属基金契约双方或多方当事人的过错，根据实际情况，由双方或多方分别承担各自应付的违约责任。但是发生下列情况的，基金契约当事人可以免责：

- 1、不可抗力因素；
- 2、基金管理人及基金托管人按照当时有效的法律、法规或中国证监会的有关规定作为或不作为而造成的损失；
- 3、在没有过失的情况下，基金管理人按照《基金契约》规定的 原则，由于行使或不行使其投资权而造成的损失。

（二）基金契约当事人违反基金契约，给其他当事人造成直接经济损失的，必须承担赔偿责任。

（三）在发生一方或几方当事人违约的情况下，基金契约能继续履行的，应当继续履行。

### 二十四、争议的处理

本基金契约各方当事人因基金契约而产生的或与基金契约有关的一切争议，应当通过协商或调解解决。基金契约当事人不愿通过协商或调解解决，以及协商、调解解决不成的，可根据事后达成的仲裁协议向仲裁机构申请仲裁；事后没有达成仲裁协议的，可以向有管辖权的人民法院起诉。

### 二十五、基金契约的效力

（一）本基金契约经基金发起人、基金管理人和基金托管人三方盖章以及法定代表人（或其授权代表人）签字并经中国证监会批准后生效。基金契约的有效期自生效之日起至该基金清算结束报中国证监会批准并公告之日止。基金持有人

根据本基金契约的规定合法持有本基金单位即表示对本基金契约的承认和接受。

(二) 本基金契约自生效之日起对本基金契约各方当事人具有同等的法律约束力。

(三) 本基金契约正本一式五份，其中上报中国证监会和中国人民银行各一份，基金发起人、基金管理人及基金托管人各持一份，每份具有同等的法律效力。

(四) 本基金契约可印制册，供基金投资者在基金管理人、基金托管人、销售代理人的办公场所和营业场所查阅；基金投资者也可按工本费购买本基金契约复印件，但内容应以本基金契约正本为准。

## 二十六、基金契约的修改和终止

### (一) 基金契约的修改

1、本基金契约的修改应经基金契约当事人同意。  
2、修改基金契约应召开基金持有人大会，基金契约修改的内容须经基金持有人大会决议通过。但如果相应的法律、法规及中国证监会的有关规定发生变化并致使本基金契约必须遵照进行修改，或者基金契约的修改事项对基金持有人的利益并无实质性不利影响的，可不经基金持有人大会决议，而由基金管理人和基金托管人协商同意后修改。

3、基金契约的修改应报中国证监会批准，自批准之日起生效。

### (二) 基金契约的终止

本基金终止后，须按法律、法规和《基金契约》的有关规定对基金进行清算。

中国证监会对清算结果批准并予以公告后《基金契约》方能终止。

## 二十七、其他事项

本基金契约如有未尽事宜，由本基金契约当事人各方共同协商解决。

## 二十八、契约当事人盖章及法定代表人签字、签约地、签订日

(本页为签署页, 无正文)

基金发起人: 金鹰基金有限公司 (法人盖章)

法定代表人或授权代表: 林金腾 签字:

签订地: 中国广州市

签署日期: 2003 年 月 日

基金管理人: 金鹰基金管理有限公司 (法人盖章)

法定代表人或授权代表: 林金腾 签字:

签订地: 中国广州市

签署日期: 2003 年 月 日

基金托管人: 交通银行 (法人盖章)

法定代表人或授权代表: 签字:

签订地: 中国上海市

签署日期: 2003 年 月 日

金鹰中小盘精选证券投资基金  
招募说明书

- 一、 招募说明书封面
- 二、 产品说明书摘要
- 三、 招募说明书正文
- 四、 招募说明书备查文件目录
- 五、 招募说明书摘要

金鹰基金管理有限公司

2004 年 4 月

基金中小盘精选证券投资基金

**招募说明书**

**重要提示**

本基金发起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审核同意，但中国证监会对本基金作出的任何决定，均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。

投资有风险，投资人认购本基金应认真阅读本招募说明书。

**基金资料摘要**

基金名称: 金鹰中小盘精选证券投资基金

基金类型: 契约型开放式

批准文号: 中国证监会, 证监基金字[2004]25号

单位面值: 人民币1, 00元

认购费率: 根据认购规模递减(最高不超过1.2%)

发行对象: 中华人民共和国境内的个人投资者和机构投资者(法律、法规及有关规定禁止购买者除外)

发行方式: 通过基金管理人的直销网点和销售代理人的代销网点向社会公众公开发行

发行期限: 自本基金招募说明书公告之日起不超过3个月

发行时间: 2004年4月12日至2004年5月20日

申购开始时间: 自本基金成立日后不超过30个工作日的时间起开始办理申购

赎回开始时间: 自本基金成立日后超过30个工作日的时间起开始办理赎回

基金发起人: 金鹰基金管理有限公司

基金管理人: 金鹰基金管理有限公司

基金托管人: 交通银行

注册登记人: 中国证券登记结算有限责任公司

直销机构: 金鹰基金管理有限公司

代销机构: 交通银行  
海通证券股份有限公司  
国泰君安证券股份有限公司  
华夏证券有限公司  
广发证券股份有限公司  
国信证券有限责任公司  
湘财证券有限责任公司

招商证券股份有限公司

兴业证券股份有限公司

闽发证券有限责任公司

东吴证券有限责任公司

天和证券经纪有限公司

广东证券股份有限公司

广州证券有限责任公司

签署日期： 2004 年 4 月

## 金鹰中小盘精选证券投资基金产品说明书摘要

### 一、投资目标

本基金投资具有较高成长性和良好基本面的中小盘股票，通过积极的投资组合管理，在控制风险的前提下谋求基金资产的长期稳定增值。

### 二、投资范围

本基金的投资对象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、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金的股票投资主要投资于具有较高成长性和良好基本面的、流通市值在市场平均水平之下的中小盘股票（流通市值排名前 20% (含 20%) 的新上市股票一年内不列入流通市值市场平均值的计算）。本基金的其他股票投资还包括新股申购、股票增发申购等。

本基金的债券投资包括国内依法公开发行、上市的国家债券、金融债、企业（公司）债（包括可转债）等债券。

本基金的股票投资占基金资产总值的比例为 50% 到 80%，债券投资占基金资产总值的比例为 20% 到 40%，现金占基金资产总值的比例不超过 10%。

### 三、投资策略

本基金的股票投资占基金投资组合的比例不超过 80%，其中投资于中小盘股的比例不低于本基金股票投资总额的 80%。

本基金采取主动的股票投资策略，在专业化研究的基础上，通过定量、定性相结合的选股方法，选择具有较高成长性、基本面良好的股票依据有效充分分散的原则构建股票投资组合，把握投资机会，实现收益。

本基金的债券投资采取稳健的混合管理投资策略，根据对利率、收益率走势的预测，考虑债券信用等级、期限、品种、流动性等因素，依据修正久期、凸性等指标，构建债券组合。

### 四、选股标准

本基金主要选择具有较高成长性和良好基本面的、流通市值在市场平均水平之下的中小盘股票进行投资。基金选股采用 PEG（其中 PE 是股票的静态市盈率，G 是预期净利润增长率）作为定量指标，采用公司素质和财务状况作为定性指标。

### 五、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为 75%的股票投资比较基准加上 25%的债券投资比较基准。

股票投资比较基准采用 50%的中信中盘指数收益率加 50%的中信小盘指数收益率。债券投资比较基准采用中信国债指数。

### 六、风险收益特征

属于风险适中、收益较高的基金品种。

### 七、风险管理

均衡管理策略；对于股票及股票组合的风险管理工具采用  $\beta$  系数，对债券的风险管理工具采用修正久期和凸性指标；对于投资组合的总体风险价值评估采用 VaR 来进行评估。

## 招募说明书正文

一、绪言	56
二、释义	56
三、基金设立	58
四、管理与组织	58
五、本次发行安排	60
六、基金成立	62
七、基金管理	63
八、基金管理人的风险管理和内部控制制度	67
九、基金托管	71
十、基金的投资	74
十一、风险揭示	77
十二、费用概览	79
十三、基金资产	81
十四、基金资产估值	82
十五、基金税收	85
十六、基金收益与分配	85
十七、基金的会计与审计	87
十八、申购与赎回	87
十九、基金转换	93
二十、基金交易	94
二十一、基金持有人	94
二十二、基金的信息披露	99
二十三、基金终止	104
二十四、基金清算	104
二十五、基金专用交易席位的选择	106
二十六、招募说明书存放及查阅方式	107

## 一、绪言

本基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

本基金单位是根据本招募说明书所载明的资料申请发行的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金契约编写，并经中国证监会核准。基金契约是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。投资人取得依基金契约所发行的基金单位，即成为基金持有人，其认购基金单位的行为本身即表明其对基金契约的承认和接受，并按照《证券投资基金管理暂行办法》、《开放式证券投资基金试点办法》、《金鹰中小盘精选证券投资基金契约》及其他有关规定享有权利、承担义务；基金投资人欲了解基金持有人的权利和义务，应详细查阅《金鹰中小盘精选

## 二、释义

在本招募说明书中除非文义另有所指，下列词语具有以下含义：

基金或本基金：指金鹰中小盘精选证券投资基金

基金契约：指《金鹰中小盘精选证券投资基金基金契约》

招募说明书：指《金鹰中小盘精选证券投资基金招募说明书》

发行公告：指《金鹰中小盘精选证券投资基金发行公告》

《暂行办法》：指《证券投资基金管理暂行办法》

《试点办法》：指《开放式证券投资基金试点办法》

中国证监会：指中国证券监督管理委员会

基金发起人：指金鹰基金管理有限公司

基金托管人：指交通银行

基金管理人：指金鹰基金管理有限公司

销售机构：指直销机构及销售代理机构

直销机构：指金鹰基金管理有限公司

销售代理机构：指依据有关销售代理协议办理本基金认购、申购、赎回和其他基金业务的代理机构

注册登记业务：指本基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资人基金账户管理、基金单位注册登记、清算及基金交易确认、代理发放红利、建立并保管基金持有人名册等

注册登记机构：指办理本基金注册登记业务的机构，本基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司

投资者：指个人投资者和/或机构投资者

个人投资者：指依据中华人民共和国有关法律法规及其他有关规定可以投资于证券投资基金的自然人投资者

机构投资者：指在中华人民共和国境内合法注册登记或经有关政府部门批准设立的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

基金持有人：指依法取得和持有依据本基金契约发行的基金单位的投资者

基金成立日：指基金达到成立条件后，基金发起人宣告基金成立的日期

设立募集期：指自招募说明书公告之日起到基金成立日的时间段，最长不超过3个月

认购：指在本基金设立募集期内，投资者申请购买本基金基金单位的行为

申购：指在本基金存续期间内，投资者申请购买本基金基金单位的行为

赎回：指基金持有人按本基金契约规定的条件，要求基金管理人购回本基金基金单位的行为

转换：指本基金转换为基金管理人管理的其他基金的行为

基金交易：经中国证监会批准，本基金可在证券交易所系统买卖的行为

基金账户：指注册登记机构为基金投资者开立的记录其持有的由该注册登记机构办理注册登记的本基金或基金管理人管理的其他开放式基金份额及其变动情况的账户

交易账户：指销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构买卖本基金或基金管理人管理的其他开放式基金份额变动及结余情况的账户

存续期：指基金成立并存续的不定期期限

开放日：指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日

工作日：指上海证券交易所和深圳证券交易所的交易日

T 日：申购、赎回或其他交易的申请日

基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入

基金资产总值：指基金购买的各类证券、银行存款本息、基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和

基金资产净值：指基金资产总值减去负债后的价值

基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金单位净值的过程

指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报纸和互联网站

### 三、基金设立

#### （一）基金设立的依据

本基金由本基金管理人依照《暂行办法》、《试点办法》、基金契约及其它有关规定发起设立，并经中国证监会证监基金字[2004] 25号文批准。

#### （二）基金存续期间及基金类型

1、基金类型：契约型开放式

2、基金存续期间：不定期

### 四、管理与组织

#### （一）基金管理人

名 称：金鹰基金管理有限公司

注 册 地址：广东省珠海市吉大九洲大道东段商业银行大厦 7 楼 16 单元

办 公 地址：广东省广州市沿江中路 298 号江湾商业中心 22 层

法定代表人：吴张

电 话：(020) 83282610

传 真：(020) 83282856

联 系 人：李毅坚

## (二) 基金托管人

名 称：交通银行

注 册 地址：上海市仙霞路 18 号

办 公 地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：方诚国

电 话：(021) 58781234

传 真：(021) 58408836

联 系 人：王玮

## (三) 基金发起人

同基金管理人。

## (四) 基金销售机构

### 1、直销机构

名 称：金鹰基金管理有限公司

注 册 地址：广东省珠海市吉大九洲大道东段商业银行大厦 7 楼 16 单元

办 公 地址：广东省广州市沿江中路 298 号江湾商业中心 22 层

法定代表人：吴张

电 话：(020) 83282950

传 真：(020) 83282856

联 系 人：陈海燕

### 2、代理销售机构（见附录：代销机构名录）

## (五) 注册登记机构

名 称：中国证券登记结算有限责任公司

地 址：北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

法定代表人：陈耀光

电 话：(0755) 25938095

传 真：(0755) 25987538 联 系 人：任瑞新

(六) 律师事务所和经办律师

名 称： 广东智洋律师事务所

住 所： 广州市环市东路 371-375 号广州世界贸易中心北塔  
1501-1502 室

法定代表人： 曾报春

电 话： (020) 87690508

传 真： (020) 87698480

经 办 律师： 谢俊林

(七) 会计师事务所和经办注册会计师

名 称： 安永华明会计师事务所

住 所： 北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城东三办公楼  
16 层

法定代表人： 葛明

电 话： (010) 65246688

传 真： (010) 85188298

经办注册会计师： 葛明、 金馨

## 五、本次发行安排

(一) 募集方式

采取直销和代销相结合的方式。经中国证监会及授权机构批准，本基金可在证券交易所系统发行和交易，相关的证券交易所或机构将作为本基金的代理销售机构。

(二) 募集期限

自本招募说明书公告之日起不超过 3 个月。

自 2004 年 4 月 12 日起至 2004 年 5 月 20 日止，本基金同时对个人投资者和机构投资者发售。

根据《试点办法》的规定，如果本基金在上述时间段内未达到基金成立的法定条件，本基金可在设立募集期内继续销售。

在本基金募集期内，基金管理人根据认购的情况可适当延长发行时间，但发行

期不超过本基金的设立募集期。如遇突发事件，以上安排可以适当调整。

具体发行时间以发行公告为准，请投资者就发行和认购事宜仔细阅读本基金的发行公告。

### （三）募集对象

中华人民共和国境内的个人投资者和机构投资者（法律、法规和有关规定禁止购买者除外）。个人投资者指依据中华人民共和国有关法律法规及其他有关规定可以投资于证券投资基金的自然人投资者。机构投资者指在中华人民共和国境内合法注册登记或经有关政府部门批准设立的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织。

### （四）募集场所

通过直销网点和销售代理机构的代销网点公开发售，具体城市（或网点）详见发行公告（或当地代销机构公告）。

### （五）募集规模

本基金募集不设预期规模。

### （六）认购费用

认购本基金为前端收费模式，即投资者在认购基金时缴纳认购手续费。本基金的认购费率按照认购金额递减，即认购金额越大，所适用的认购费率越低，认购费用等于认购金额乘以所适用的认购费率。

认购金额在 100 万元人民币以下的，认购费率为 1.2%。

认购金额在 100 万元人民币以上（含 100 万元人民币）、1000 万元人民币以下的，认购费率为 1.0%。

认购金额在 1000 万元人民币以上（含 1000 万元人民币），认购费率不超过 1.0%。

举例：

例 1：投资者认购了 1 万份基金单位，则适用认购费率为 1.2%，认购费为  $10,000 \times 1.2\% = 120$  元

例 2：投资者认购了 100 万份基金单位，则适用认购费率为 1.0%，认购费为  $1,000,000 \times 1.2\% = 10000$  元。

### （七）首次募集期间认购资金利息的处理方式

认购资金利息在本基金成立后归入基金资产。

#### （八）基金认购份额的计算

本基金采用金额认购方法，计算公式如下：

认购份额=（认购金额—认购费用）/认购价格

认购价格= 基金单位面值（1元人民币）

认购份额计算结果保留到小数点后两位，小数点两位以后的部分四舍五入。

例 3：某投资者投资 100,000 元认购本基金，则其可得到的认购份额计算如下：

认购费用=100,000×1.2% = 1200 元

认购份额=（100,000 —1200）/ 1 = 98,800 份

#### （九）投资人对基金单位的认购

##### 1、认购程序

投资人认购时间安排、投资人认购应提交的文件和办理的手续，请详细查阅本基金的发行公告。

2、投资者在募集期内可以多次认购基金单位，但认购申请一旦被受理，即不得撤销。

##### 3、认购确认

销售网点（包括直销中心和代销网点）受理申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了认购申请。申请是否有效应以基金注册登记与过户机构的确认登记为准。投资者可在基金正式宣告成立后到各销售网点查询最终成交确认情况和认购的份额。

#### （十）认购限额

1、投资者通过代销机构的单笔最低认购金额均不得低于 500 元，详情请见当地销售机构公告。

2、首次通过直销机构的认购最低限额为 10 万元，后续每笔认购金额不低于 500 元。

3、认购期间单个投资者的累计认购规模没有限制。

## 六、基金成立

#### （一）基金成立的条件

本基金在设立募集期内，如基金净认购额达到或超过 2 亿元人民币，且基金单位认购者人数不低于 100 人，则基金发起人可依据《试点办法》及招募说明书停止发行，宣告本基金成立；如果在设立募集期满时实际募集资金不足 2 亿元人民币或认购者人数不足 100 人，本基金不能成立。

本基金成立前，已收取的认购款项必须存入指定商业银行中本基金的临时认购账户，不得挪作他用。

## （二）基金设立失败

1、设立募集期满，未达到基金成立条件，或设立募集期内发生不可抗力使基金无法设立，则基金设立失败。

2、本基金不成立时，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。

基金管理人、基金托管人及销售机构为本基金支付之一切费用应由各方各自承担。

## （三）基金不能成立时已募集资金的处理方式

本基金不能成立时，基金发起人承担全部基金募集费用，已募集的资金加计中国人民银行公布的同期银行活期存款利息必须在发行期结束后 30 天内退还基金认购人。

## （四）基金存续期内基金持有人数量和资产净值的限制

本基金成立后的存续期间内，有效基金持有人数量连续 20 个工作日达不到 100 人，或连续 20 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元人民币，基金管理人应及时向中国证监会报告，说明出现上述情况的原因及解决方案。若有效基金持有人数量连续 60 个工作日达不到 100 人，或连续 60 个工作日基金资产净值低于人民币 5,000 万元，基金管理人可宣布本基金终止。

（五）本基金若依法成立，基金管理人应于基金成立日在至少一种中国证监会指定的全国性报刊上刊登成立公告书。

（六）本基金若依法不能成立，基金管理人应根据有关规定进行公告。

# 七、基金管理

## （一）基金管理人概况

注 册 地址： 广东省珠海市吉大九洲大道东段商业银行大厦 7 楼 16 单元

办公地址： 广东省广州市沿江中路 298 号江湾商业中心 22 层  
法定代表人： 吴张  
注册资本： 人民币壹亿元  
经营范围： 基金管理业务，发起设立基金，中国证监会或其授权机构批准的其他业务

组织形式： 有限责任公司

营业期限： 持续经营

## （二）主要人员情况

### 1、董事、经理及其他高级管理人员

吴张先生，董事长，1957 年出生，工商管理硕士。历任中国银行珠江分行国际结算处副处长、香港越秀财务有限公司和香港越秀证券有限公司董事、副总经理、广州证券有限责任公司董事长。

林金腾先生，董事，总经理，1958 年出生，金融学硕士，高级会计师。历任香港安永会计师事务所审计师、广东国际信托投资公司副总会计师、广信基金（现改名为科讯基金）法人代表兼总经理、中华商业基金管理公司董事、金鹰基金管理公司筹备组负责人。

李晓东先生，董事，1968 年出生，在读硕士研究生。历任中国航空油料西南公司副处长、深圳承祥实业股份有限公司总经理助理，现任新希望集团金融事业部总经理、中国民生银行股份有限公司董事、北京双鹤药业股份有限公司执行董事、中联实业股份有限公司董事、福建联华信托投资公司总裁。

周跃进先生，董事，1958 年出生，经济学硕士，高级经济师、执业药师。历任广州何济公制药厂厂长、香港保联拓展有限公司董事、副总经理，广州药业集团有限公司投资部部长，现任广州药业股份有限公司董事、总经理。

栗建伟先生，董事，1966 年 9 月出生，工商管理硕士。历任中国长城铝业公司供销处干部、广东美的集团股份有限公司企划投资部科长、董事会秘书，现任广东美的集团资本运营部部长。

高宝明先生，独立董事，1958 年出生，工商管理学士。历任新鸿基银行助理主任、东洋信托银行信贷主任、香港上海汇丰银行项目信贷经理、百富勤融资有限公司董事总经理、BNP 百富勤融资有限公司董事长、总经理，现任香港金榜

投资公司董事长。

魏明海先生，独立董事，1964 年出生，管理学博士，博士生导师、教授。历任江西财经大学助教、中山大学会计系主任、中山大学管理学院副院长，现任中山大学管理学院院长、南方航空股份有限公司独立董事。

何小锋先生，独立董事，1955 年出生，经济学硕士、教授、博士生导师。历任北京大学经济学院讲师、新华社香港分社分析员、北京大学经济学院副教授、中国建设银行深圳分行处级干部，现任北京大学经济学院教授、北京大学首都发展研究院副院长。

苏祖耀先生，独立董事，1963 年出生，法学博士、高级律师、高级经济师。曾任广东对外经济律师事务所律师，现任广东经纶律师事务所合伙人、首席律师。

邓志盛先生，副总经理，1957 年出生，研究生，历任广州证管办机构二处处长、广东证监会信息部部长、广东电台证券栏目副总编辑。

冯科先生，总经理助理，1971 年生，经济学博士，历任广州证券有限责任公司宏观研究所所长，广州开发区国投发展研究室主任，广东汕头证券报价交易中心市场部经理，南方证券交易中心资金主管。

## 2、本基金基金经理

汪旻杰先生，基金经理，1971 年出生，管理学硕士。历任广信基金投资部经理、广东证券股份有限公司研究中心研究员，现任金鹰基金管理有限公司投资管理部总监。

### （三）基金管理人的职责

- 1、按照基金契约的规定运用基金资产投资并管理基金资产；
- 2、及时、足额向基金持有人支付基金收益；
- 3、保存基金的会计帐册、记录 15 年以上；
- 4、编制基金财务报告，及时公告，并向中国证监会报告；
- 5、计算并公告基金资产净值及每一基金单位资产净值；
- 6、基金契约规定的其他职责。

### （四）基金管理人的承诺

1、本基金管理人承诺严格遵守《证券法》，并建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生。

2、本基金管理人承诺严格遵守《证券投资基金暂行管理办法》，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

- 1) 基金之间相互投资；
- 2) 以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券；
- 3) 从事任何形式的证券承销或者从事除国家债券以外的其他证券自营业务；
- 4) 从事资金拆借业务；
- 5) 动用银行信贷资金从事基金投资；
- 6) 将基金资产用于抵押、担保、资金拆借或者贷款；
- 7) 从事证券信用交易；
- 8) 以基金资产进行房地产投资；
- 9) 从事可能使基金资产承担无限责任的投资；
- 10) 将基金资产投资于与基金托管人或者基金管理人有利害关系的公司发行的证券；
- 11) 中国证监会规定禁止从事的其他行为。

3、本基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

- 1) 越权或违规经营；
- 2) 违反基金契约或托管协议；
- 3) 故意损害基金持有人或其他基金相关机构的合法利益；
- 4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- 5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- 6) 玩忽职守、滥用职权；
- 7) 泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- 8) 除为公司进行基金投资外，直接或间接进行其他股票交易；
- 9) 协助、接受委托或以其它任何形式为其它组织或个人进行证券交易；
- 10) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

4、基金管理人关于履行诚信义务的承诺

本基金管理人承诺勤勉尽责、诚实信用、安全有效地管理和运作本基金资产，

为基金持有人谋求最大利益。

### 5、基金经理承诺

- 1) 依照有关法律、法规和基金契约的规定，本着谨慎的原则为基金持有人谋取最大利益；
- 2) 不为自己、其代理人、代表人、受雇人或任何第三人谋取利益；
- 3) 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- 4) 不协助、接受委托或以其它任何形式为其它组织或个人进行证券交易

## 八、基金管理人的风险管理和内部控制制度

### (一) 内部控制制度概述

为保证公司规范化运作，有效地防范和化解经营风险，确保基金和公司财务和其他信息真实、准确、完整、及时，从而最大程度地保护基金持有人的合法权益，本基金管理人建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制制度。

内部控制制度是指公司为实现内部控制目标而建立的一系列组织机制、管理办法、操作程序与控制措施的总称。内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等部分组成。

公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是对各项基本管理制度的总揽和指导，内部控制大纲明确了内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等内容。

基本管理制度包括内部会计控制制度、风险控制制度、投资管理制度、监察稽核制度、基金会计制度、信息披露制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案管理制度、业绩评估考核制度和灾难恢复制度等。

部门业务规章是在基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任、操作守则等的具体说明。

公司完善内控机制遵循以下原则：

健全性原则。内部控制机制必须覆盖公司的各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节。

有效性原则。通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控

制度的有效执行。

独立性原则。公司必须在精简的基础上设立能充分满足公司经营运作需要的机构、部门和岗位，各机构、部门和岗位职能上保持相对独立性。

相互制约原则。内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互牵制，并通过切实可行的相互制衡措施来消除内部控制的盲点。

防火墙原则。公司投资、研究、交易等相关部门，应当在物理上和制度上适当隔离。对因业务需要知悉内幕信息的人员，应制定严格的批准程序和监督处罚措施。

成本效益原则。公司应充分发挥各机构、各部门及广大职员的工作积极性，尽量降低经营运作成本，保证以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

公司制定内部控制制度遵循以下原则：

合法合规原则。公司内控制度应当符合国家法律、法规、规章和各项规定。

全面性原则。内部控制制度必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节，并普遍适用于公司每一个职员。

审慎性原则。内部控制的核心是风险控制，内部控制制度的制定要以审慎经营、防范和化解风险为出发点。

适时性原则。内部控制制度的制定应具有前瞻性，并且必须随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修改和完善。

## 1、内部会计控制制度

公司依据《中华人民共和国会计法》、《金融企业会计制度》、《证券投资基金管理核算办法》、《企业财务通则》等国家有关法律、法规制订了基金会计制度、公司财务制度、会计工作操作流程和会计岗位工作手册，并针对各个风险控制点建立严密的会计系统控制。

内部会计控制制度包括凭证制度、账务组织和账务处理程序、复核制度、基金估值制度和程序、基金财务清算制度和程序、成本控制和业绩考核制度、会计档案保管和财务交接制度、财产登记保管和实物资产盘点制度、统一采购和工程招标制度、财务收支审批制度和费用报销管理办法等。

## 2、风险管理控制制度

风险控制制度由风险控制委员会组织各部门拟订，报公司总经理办公会议审议通过后实施。风险控制制度由总则、风险控制的目标和原则、风险控制的机构设置、风险控制的程序、风险类型的界定、风险控制的主要措施、风险控制的具体制度、风险控制制度的监督与评价等部分组成。

风险控制的具体制度主要包括投资风险管理制度、交易风险控制制度、财务风险控制制度、公司资产管理制度等业务风险控制制度，以及岗位分离制度、业务空间隔离制度、作业规则、岗位职责、反馈制度、资料保全制度、保密制度、员工行为守则等程序性风险管理制度。

### 3、投资管理制度

投资管理制度包括研究业务管理制度、投资决策管理制度、基金交易管理制度等。

制订研究业务管理制度的目的是保持研究工作的独立、客观。研究业务管理制度包括：建立严密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法；根据基金契约要求，在充分研究的基础上建立和维护投资对象备选库；建立研究与投资的业务交流制度，保持通畅的交流渠道；建立研究报告质量评价体系。

制订投资决策业务管理制度的目的是严格遵守法律法规的有关规定，确保基金的投资符合基金契约所规定的投资目标、投资范围、投资策略、投资组合和投资限制等要求。投资决策业务管理制度包括投资决策授权制度；投资决策支持制度，重要投资要有详细的研究报告和风险分析支持；投资风险评估与管理制度，在设定的风险权限额度内进行投资决策；投资管理业绩评价制度等。

制订基金交易管理制度的目的是保证基金投资交易的安全、有效、公平。基金交易管理制度包括基金交易的集中交易制度；交易监测、预警、反馈机制；投资指令审核制度；投资指令公平分配制度；交易记录保管制度；交易绩效评价制度等。

### 4、监察稽核制度

公司设立督察员，负责监察稽核工作，督察员由董事长提名，经董事会聘任，对董事会负责，报中国证监会核准。

除应当回避的情况外，督察员可以列席公司相关会议，调阅公司相关档案，就内部控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能。

督察员应当定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况，董事会应当对督察员的报告进行审议。

公司设立监察稽核部门，具体执行监察稽核工作。公司明确规定了监察稽核部门及内部各岗位的具体职责，严格审查监察稽核人员的专业任职条件，配备了充足的合格的监察稽核人员，明确规定了监察稽核的操作程序和组织纪律。

监察稽核制度包括检查公司各业务部门和工作人员是否遵守法律、法规、规章的有关规定；检查公司各业务部门和工作人员对公司内部控制制度、各项管理制度、业务规章的执行情况；对公司各部门作业流程的遵守合规性和有效性的检查、监督、评价及建议等。

## （二）内部控制制度的要素

内部控制制度具备控制环境、控制的性质与范围、实施、检查和报告等五个要素：

### 1、控制环境

公司已经建立了一种保证其具备内部会计控制和风险管理控制的制度，并建立起由高级管理层监督的控制且已明确规定控制的责任。

公司从影响控制环境的因素，例如公司组织结构、各项控制制度及其对公司各项业务的牵制力、公司管理层和员工对内部控制的认识和态度等方面加强控制意识，并致力于从公司文化、组织结构、管理制度等方面营造良好的控制环境氛围。

### 2、控制的性质和范围

内部会计控制包括对帐簿、记录的规定和职责分类的控制，以保护基金资产。风险管理控制包括限额交易、市场风险、操作风险、流动性风险等风险的控制。

### 3、实施

本基金管理人制订了详细、合理的书面化内部控制指引。内部控制指引提出了内部风险控制的目标、原则、基本要求和实施程序。

### 4、检查

本基金管理人建立了一套科学的控制检验程序，根据市场环境、金融工具、技术应用、法律法规等因素的变化及发展情况，不断测试和调整风险控制制度，以确保风险控制制度持续运作并充分有效的制度。

## 5、报告

本基金管理人建立了控制报告制度,即督察员和监察稽核部及时将风险控制制度的实质性缺陷或失控向公司董事会和总经理报告的制度。本基金管理人具备完善的信息系统确保报告程序的有效性和保密性,保证以及时可靠的方式取得准确详细的信息。

监察稽核部定期和不定期检查和指导各部门的风险管理工作,形成风险管理报告书与建议书,上报公司管理层和风险控制委员会。实施重点管理的原则,对投资管理部、研究发展部、财务部门、基金会计等重要的业务部门和人员进行重点监督与防范。

### (三) 基金管理人内部控制制度声明书

基金管理人关于内部控制制度的声明如下:

- 1、本基金管理人承诺以上关于内部风险控制的披露真实、准确;
- 2、本基金管理人承诺根据市场变化和公司业务发展不断完善内部控制制度

## 九、基金托管

### (一) 基金托管人情况

#### 1、基本情况

发展概况: 交通银行是中国第一家全国性国有股份制商业银行, 1987 年重新组建, 1998 年被《欧洲货币》评为中国最佳银行, 1999 年被《环球金融》评为中国最佳银行。

财务状况: 截至 2002 年末, 交通银行资产总额为 7668.74 亿元, 年内实现利润总额为 15.55 亿元。

#### 2、基金托管部的部门设置及员工情况

交通银行总部设证券投资基金管理部, 下设托管运营处、内控综合处、客户服务处、科技开发处、资产委托处, 现有员工 46 人。

#### 3、托管的其他基金情况

基金托管人担任普惠基金、安顺基金、汉兴基金、华夏债券基金、普天系列开放式基金等证券投资基金的托管人。

#### 4、基金托管人的内部控制制度说明

### 1) 内部控制目标

交通银行证券投资基金托管部内部控制的目标和方向是：加强内部管理，保证证券投资基金托管部业务规章的健全和各项规章的贯彻执行，通过对各种风险的梳理、评估、监控，有效地实现对信用风险、市场风险、流动风险的监控和管理。

### 2) 内部控制组织结构

内部风险控制委员会、稽核部是主管交通银行风险和内部控制的职能部门。此外，交通银行在证券投资基金托管部下设立了内控综合处，作为专门的内部风险控制管理处室，独立于其他处室，对总经理负责，客观、公允地对基金托管业务的合规、合法性进行控制和监督，以确保基金资产的完整和安全，保证基金托管业务的稳健运行。

### 3) 内部控制原则

(1) 全面性原则：通过各个部门自我监控和专门内控部门巡查监督相结合，内部控制机制覆盖各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节，建立全面的风险管理监督机制。

(2) 独立性原则：交通银行证券投资基金托管部独立负责受托基金资产的保管，保证基金资产与交通银行的自有资产相互独立，对不同的受托基金分别设置帐户，独立核算，分帐管理。

(3) 制衡性原则：贯彻适当授权、相互制约的原则，从组织结构的设置上确保各部门和各岗位权责分明、相互牵制，并通过有效的相互制衡措施消除内部控制中的盲点。

(4) 有效性原则：在岗位、处室和内控部门三级内控管理模式的基础上，形成科学合理的内部控制决策机制、执行机制和监督机制，通过行之有效的控制流程、控制措施，建立合理的内控程序，保障内控管理的有效执行。

(5) 效益性原则：内部控制与基金托管规模、业务范围和业务运作环节的风险控制要求相适应，尽量降低经营运作成本，以合理的控制成本实现最佳的内部控制目标。

### 4) 内部控制制度及措施

根据《证券投资基金管理暂行办法》及其实施准则、《中华人民共和国商业

银行法》等法律法规，基金托管人制定了一整套严密、高效的证券投资基金管理规章制度，确保基金托管业务运行的规范、安全、高效，包括《交通银行证券投资基金托管业务管理暂行办法》、《交通银行证券投资基金托管部基金信息披露制度》、《交通银行证券投资基金托管部保密工作制度》、《交通银行证券投资基金托管业务从业人员守则》、《交通银行证券投资基金托管部电脑系统管理制度》、《交通银行证券投资基金托管部业务资料管理制度》、《交通银行证券投资基金托管部内部风险控制制度》、《交通银行证券投资基金托管部监察守则》等，并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。

基金托管人通过基金托管业务各环节风险的事前揭示、事中控制和事后稽核的动态管理过程来实施内部风险控制，为了保障内控管理的有效执行，还聘请了国际著名会计师事务所对基金托管业务运行进行内部控制评审。

## 5、其他事项

最近一年内基金托管人及其负责基金托管业务的高级管理人员无重大违法违规行，未受到中国证监会、中国人民银行及其他有关机关的处罚。基金托管人高级管理人员没有在基金管理公司兼职的情况。

### （二）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《暂行办法》、《试点办法》、《基金契约》和有关证券法规的规定，基金托管人对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金的申购与赎回、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反《暂行办法》、《试点办法》和《基金契约》和有关证券法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

## 十、基金的投资

### （一）投资目标

本基金投资具有较高成长性和良好基本面的中小盘股票，通过积极的投资组合管理，在控制风险的前提下谋求基金资产的长期稳定增值。

### （二）投资范围

本基金的投资对象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、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金的股票投资主要投资于具有较高成长性和良好基本面的、流通市值在市场平均水平之下的中小盘股票（流通市值排名前 20%（含 20%）的新上市股票一年内不列入流通市值市场平均值的计算）。本基金的其他股票投资还包括新股申购、股票增发申购等。

本基金的债券投资包括国内依法公开发行、上市的国家债券、金融债、企业（公司）债（包括可转债）等债券。

本基金的股票投资占基金资产总值的比例为 50%到 80%，债券投资占基金资产总值的比例为 20%到 40%，现金占基金资产总值的比例不超过 10%。

### （三）投资策略

#### 1、决策依据

本基金的投资决策依据包括：

- 1) 宏观经济形势及前景、有关政策趋向；
- 2) 行业发展现状及前景；
- 3) 上市公司基本面及发展前景；
- 4) 证券市场走势及预期；
- 5) 股票、债券等类别资产的预期收益率及风险水平。

#### 2、决策程序

1) 本基金管理人的研究部门基于对宏观经济、政策及证券市场的现状和发展趋势的深入分析研究，和对各类别资产收益率和风险水平的合理预期，向投资决策委员会提交投资建议，投资建议包括总体资产配置建议、类别资产配置建议、个股/券种投资建议等；

2) 投资决策委员会根据本基金的投资目标，结合对本基金投资相关因素的

全局考虑，确定本基金的投资策略，制定总体资产配置计划；

- 3) 本基金基金经理根据投资决策委员会制定的基金的总体资产配置计划，考虑研究部门的相关建议，拟定投资计划，报投资决策委员会批准；
- 4) 本基金基金经理根据投资决策委员会批准的投资计划，制定具体投资方案。

### 3、组合原则

本基金的投资组合必须符合以下比例规定：

- 1) 本基金投资于股票、债券的比例，不得低于基金资产总值的 80%；
- 2) 本基金投资于国家债券的比例，不得低于基金资产净值的 20%；
- 3) 本基金持有一家上市公司的股票，不得超过基金资产净值的 10%；
- 4) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，不得超过该证券的 10%；
- 5) 运用基金资产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司该次的股票发售总量；
- 6) 本基金投资于中小盘股的比例不低于本基金股票投资总额的 80%；
- 7) 有关法律法规、中国证监会及本基金契约所规定的其他比例限制；
- 8) 法律法规或监管部门对上述比例另有规定时从其规定；
- 9) 本基金将于成立日后三个月内达到符合规定的比例限制。

### 4、本基金股票投资策略

本基金采取主动的股票投资策略，在专业化研究的基础上，将系统的选股方法与积极的投资操作相结合，选择具有较高成长性、基本面良好的股票构建股票投资组合，把握投资机会，实现收益。

股票投资组合包括中小盘股票组合和其他股票组合。中小盘股票组合通过选择具有较高成长性、基本面良好的中小盘股，依据有效充分分散的原则构建。其他股票投资主要是参与有较高投资价值的新股申购、股票增发申购以及根据市场情况的短期股票投资。

### 5、本基金债券投资策略

采取稳健的混合管理投资策略，根据对利率、收益率走势的预测，考虑债券信用等级、期限、品种、流动性等因素，依据修正久期、凸性等指标，构建债券

组合。

#### （四）选股标准

本基金主要选择具有较高成长性和良好基本面的、流通市值在市场平均水平之下的中小盘股票进行投资。基金选股采用 PEG（其中 PE 是股票的静态市盈率，G 是预期净利润增长率）作为定量指标，采用公司素质和财务状况作为定性指标。

#### （五）本基金业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为 75%的股票投资比较基准加上 25%的债券投资比较基准。

股票投资比较基准采用 50%的中信中盘指数收益率加 50%的中信小盘指数收益率。债券投资比较基准采用中信国债指数。

#### （六）投资限制

本基金投资遵守《暂行办法》等关法律法规和中国证监会的有关规定，以及本基金契约规定的投资限制，本基金禁止从事下列行为：

- 1、投资于其他基金；
- 2、将基金资产用于抵押、担保、资金拆借或者贷款；
- 3、以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券；
- 4、从事证券信用交易；
- 5、以基金资产进行房地产投资；
- 6、从事可能使基金资产承担无限责任的投资；
- 7、将基金资产投资于与基金托管人或者基金管理人有利害关系的公司发行的证券；
- 8、法律、法规、中国证监会及本基金契约规定禁止从事的其他行为。

法律法规或监管部门对上述限制另有规定时从其规定。

#### （七）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则和方法

基金管理人接受基金持有人的委托，为基金持有人的利益管理和运用基金资产，必须恪尽职守，履行法律、法规、中国证监会及基金契约规定的义务。

基金管理人有权按照法律、法规及中国证监会的规定，代表基金对所投资公司行使股东权利，但不得谋求对上市公司的控股和直接管理。在基金契约授权范围内，基金管理人有权代表基金签订与基金有关的合同、协议，并处理与基金有

关的法律纠纷。

基金管理人不得通过关联交易为其自身、雇员、授权代理人或任何与其存在利害关系的第三人牟取不当利益。

#### （八）基金投资组合报告

基金管理人在每个季度结束后十五个工作日内编制完成并公告投资组合公告，投资组合公告列明按市值排名的基金所持有的前十名股票名称及数量。

### 十一、风险揭示

#### （一）投资于本基金的主要风险有：

##### 1、市场风险

本基金投资于证券市场，证券市场价格受各种因素影响而波动，从而对本基金的证券投资带来风险。市场风险主要包括以下：

###### 1) 政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等政府政策的变化对证券市场产生影响，从而导致市场价格波动，影响基金收益。

###### 2) 经济周期风险

证券市场是国民经济的晴雨表，而国民经济运行则具有周期性的特点。随着宏观经济运行的周期性变化，本基金所投资的债券和股票的收益水平也会随之变化。

###### 3) 利率风险

利率的变化直接影响着债券的价格和收益率，同时也影响到证券市场资金供求关系，并在一定程度上影响上市公司的盈利水平和上市公司的股票价格。

###### 4) 上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等都会导致公司盈利发生变化，给基金的投资带来风险。

###### 5) 购买力风险

基金的收益主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而使购买力下降，从而使基金的实际投资收益下降。

##### 2、信用风险

指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失。

### 3、管理风险

在基金管理运作过程中，基金管理人的知识、经验、技术等会影响其对信息的分析以及对经济形势、证券价格走势的判断，影响基金管理人的投资决策，从而影响基金收益水平。

### 4、流动性风险

指基金资产不能迅速转变成现金，或者不能应付可能出现的投资者大额赎回的风险。在开放式基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响基金单位净值。

### 5、基金所投资的特定投资对象可能引起的特定风险

#### 1) 中小盘股票的投资风险

本基金主要投资具有较高成长性和良好基本面的、流通市值在市场平均水平之下的中小盘股票进行投资，虽然可以通过分散投资策略和组合管理降低风险，但单个中小盘股票和大盘股票比较，具有相对较高的价格波动性。

#### 2) 流动性风险和价格冲击风险

中小盘股票的平均流通市值相对较小，本基金投资这些股票时存在一定的流动性风险，即对买卖成交的及时性带来不利影响。此外，本基金投资这些股票会对其价格产生一定的冲击，从而有可能增加买入成本或减少投资盈利。

#### 3) 股票选择风险

随着股票平均市值的增大，本基金可以选择投资的样本股票数量将增加，样本股票数量的偏多，对基金选股可能带来一定困难。

依据 PEG 指标的定量选股，需要对上市公司的未来成长性进行预期，预期的错误会影响股票选择的合理性、准确性，从而影响本基金的收益水平。

此外，本基金的定性选股也需要对上市公司的素质和财务状况进行预期或判断，预期或判断的错误会影响股票选择的合理性、准确性，从而影响本基金的收益水平。

### 6、操作或技术风险

指相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素

造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT系统故障等风险。

在开放式基金的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、注册登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。

#### 7、法律风险

指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者基金投资违反法规及基金契约有关规定的风险。

#### 8、其他风险

战争、动乱、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产的损失，影响基金的收益水平，从而带来风险。金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管行违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金持有人利益受损。

### （二）声明

1、本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。投资人自愿投资于本基金，须自行承担投资风险。

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过代销机构代理销售，但是，基金并不是代销机构的存款或负债，也没有经代销机构担保或者背书，代销机构并不能保证其收益或本金安全。

## 十二、费用概览

### （一）基金费用的种类

基金费用从基金资产中支付，包括：

- 1、基金管理人的报酬；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、证券交易费用；
- 4、基金信息披露费用（基金认购期所发生的此类费用从基金发行费用中列支，不另从基金资产支付）；

- 5、基金持有人大会费用；
- 6、与基金相关的会计师、律师等中介机构费用（基金认购期所发生的此类费用从基金发行费用中列支，不另从基金资产支付）；
- 7、基金分红手续费；
- 8、法律、法规、中国证监会及本基金契约规定可以列入的其他费用。

## （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### 1、基金管理人的报酬

基金管理人的报酬按基金资产净值的 1.5% 年费率计提。

在通常情况下，基金管理人报酬按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。计算方法为：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理人报酬

E 为前一日基金资产净值

基金管理人报酬每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理人报酬划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇节假日、休息日等，支付日期顺延。

### 2、基金托管人的托管费

基金托管人的托管费按基金资产净值的 2.5% 的年费率计提。

在通常情况下，基金托管人的托管费按前一日的基金资产净值的 2.5% 的年费率计提。计算方法为：

$$H = E \times 2.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管人的托管费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付，若遇节假日、休息日等，支付日期顺延。

3、本招募说明书第十二节第（一）款中第 3—8 项费用由基金托管人根据有关规定进行核算，发生的费用如果影响基金单位净值小数点后第五位的，即发生

的其他费用大于基金净值十万分之一，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。发生的其他费用如果不影响基金单位净值小数点后第五位的，即发生的其他费用小于基金净值十万分之一，应于发生时直接计入基金损益。

### （三）不列入基金费用的项目

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资产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

### （四）申购和赎回费用（详见十八、申购与赎回）

### （五）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，此项调整不需要召开基金持有人大会。

## 十三、基金资产

### （一）基金资产总值

基金资产总值包括基金持有的各类证券价值、银行存款、清算备付金、交易保证金、证券清算款、应收款项、待摊费用、投资估值增值等价值总和。

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### （三）基金资产的帐户

基金托管人以托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开设证券账户，以托管人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金一级帐户，并在托管人处为本基金开立二级账户，办理本基金的证券资金清算；以基金名义在中央国债登记结算有限责任公司开立国债托管账户，用于本基金的国债交易和清算。基金资产的帐户与基金发起人、基金管理人和基金托管人的自有资产帐户以及其他基金资产帐户相独立。

### （四）基金资产的处分

本基金资产独立于基金管理人和基金托管人的资产，并由基金托管人保管。基金管理人和基金托管人以其自有资产承担相应的法律责任，其债权人不得对基金资产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依据《暂行办法》等法律法规及本基金契约有关规定处分外，基金资产不得被处分。

## 十四、基金资产估值

### （一）估值目的

基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金资产的价值以及基金资产是否增值、保值。

### （二）估值原则

#### 1、真实性原则

基金管理人对基金资产的估值应通过规定的程序，内容必须保证真实性和可靠性，禁止任何形式的弄虚作假。

#### 2、及时性原则

基金资产的估值要严格按照有关法律、法规及中国证监会规定期限及时办理，不得无故拖延。

#### 3、完整性原则

基金资产估值的内容要完整详实，对要求揭示的所有事项不得遗漏或回避。

#### 4、公允性原则

基金资产估值必须采用公允价值原则，公允价值是指基金资产投资在有意愿成交的交易对手间的现行交易价格，不包括强制性出售或破产出售的情况。

#### 5、公开性原则

有关基金资产估值的内容除在招募说明书列明外，基金资产估值的主要方法还必须在本基金的基金契约、发行公告、上市公告书、年度报告、半年度报告等文件中列示。

#### 6、准确性原则

基金资产估值必须准确，若净值计算错误大于 0.5%则应报中国证监会备案并公告。

### （三）估值日

本基金成立后，每个工作日对基金资产进行估值。

### （四）估值对象

基金依法拥有的各类资产。

### （五）估值方法

1、上市证券按估值日其所在证券交易所挂牌的收盘价估值，估值日无交易

的，以最近交易日的收盘价计算。

2、未上市的股票应区分以下情况：

1) 送股、配股、转增股和增发新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；

2) 首次公开发行的股票，按成本估值。

3、未上市债券、银行间债券市场交易的债券以成本价加计至估值日为止的应计利息额估值，银行存款以本金加计至估值日为止的应计利息额估值，派发的股息、红利、以至估值日为止的实际获得额计算。

4、配股权证，从配股除权除息日起到配股确认日止，按市价高于配股价的差额估值。

5、基金资产估值不包括出售资产时估计的券商佣金、印花税及可能发生的其他交易费用。

6、如有确凿证据表明按上述方法对基金资产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，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

7、如有新增事项或变更事项，则按有关规定进行估值。

#### （六）估值程序

本基金估值由基金管理人进行。

本基金估值程序分为正常情况下和特殊情况下的估值程序。正常情况下的估值由本基金的基金会计根据上述的基金估值方法进行。特殊情况下的估值程序是指本基金所持有的有价证券出现停牌或暂停交易（属于公布信息而暂停交易的除外）等情况，特殊情况下的估值按照以下程序进行：

1、由基金经理对需要进行特殊估值程序的有价证券的价值趋势作出判断，并根据判断出具对该有价证券的初步估值意见，报运作保障部；

2、运作保障部及时将基金经理的报告送达资产估值委员会，资产估值委员会由基金管理人总经理、分管副总经理或总经理助理、研究发展部、运作保障部、投资管理部负责人、基金经理、基金会计等相关人员组成；

3、资产估值委员会开会确定需要进行特殊估值程序的有价证券的估值标准、程序和方法，并作出估值的决定，该等决定应由全体资产估值委员会委员的三分

之二以上出席并经与会委员的过半数通过方为有效；

- 4、如有必要，资产估值委员会可邀请有关专家为其决策提供专业意见；
- 5、运作保障部按照资产估值委员会的决定，具体实施特殊估值程序；
- 6、资产估值委员会认为有必要时，可报告本基金管理人董事会，提请董事会决定该等资产的估值与定价。

基金管理人完成基金资产估值后，将估值结果以书面形式报送基金托管人，基金托管人按照本基金契约规定的估值方法、时间、程序进行复核；基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人；月末、年中和年末估值复核与基金会计帐目的核对同时进行。

#### （七）估值差错的处理

基金管理人和基金托管人应采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性和及时性。当基金单位净值计算出现差错时，基金管理人应当并予以纠正，尽快采取合理的措施防止损失进一步扩大。估值差错达到基金资产净值的0.5%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案并公告。

基金管理人按估值方法的第7条规定方法进行估值调整时，所造成的误差不作为估值差错处理。

因基金单位估值错误给基金投资者或基金造成损失的，由基金管理人统一支付赔偿，在支付赔偿后，有权向有关责任方追偿。其赔偿原则如下：

赔偿仅限于因差错而导致的基金持有人或基金的直接损失；

基金管理人代表基金保留要求返还不当得利的权利；

基金管理人仅负责赔偿在单次交易时给单一当事人造成10元人民币以上的损失。

前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，按其规定处理。

由于证券交易所或登记结算公司发送的数据错误，以及战争、火灾、地震、洪水等不可抗力原因，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可以免除赔偿责任。基金管理人和基金托管人应当积极采取一切必要的措施消除由此造成的影响。

#### （八）暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停交易时；
- 2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时。

#### （九）基金单位净值的确认

基金单位净值的计算精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入，国家另有规定的，从其规定。基金管理人和基金托管人进行估值及复核时，由此造成的误差不作为估值差错处理。

#### （十）特殊情况的处理

- 1、基金管理人按照估值方法的第 6 条进行估值时，所造成的误差不作为基金单位净值错误处理；
- 2、由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或由于不可抗力原因，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，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

### 十五、基金税收

本基金及基金持有人依照法律、法规的有关规定履行纳税义务。按照国家现行税收法律、法规规定，个人投资者投资本基金所获增值部分免税，机构投资者投资本基金所获增值部分应按相关规定缴纳企业所得税。

### 十六、基金收益与分配

#### （一）基金收益的构成

- 1、基金投资所得红利、股息、债券利息；
- 2、买卖证券价差；
- 3、存款利息；
- 4、法律、法规、中国证监会及本基金契约规定的其他收入。

因运用基金资产带来的成本或费用的节约计入收益。

#### （二）基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按照有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

### （三）收益分配原则

- 1、基金当年收益分配比例不得低于当年基金净收益的 90%；
- 2、基金收益分配每年至少分配一次，但若本基金成立至基金会计年度结束不足三个月可不进行收益分配，年度分配在基金会计年度结束后的四个月内完成；
- 3、基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；
- 4、基金投资亏损，或者基金当年虽有收益但基金单位净值低于面值，则不进行收益分配；
- 5、基金收益分配后基金单位净值不能低于面值；
- 6、基金持有人可以选择取得现金或将所获红利再投资于本基金；选择采取红利再投资形式的，分红现金按红利发放日的基金单位净值转成相应的基金单位；本基金分红的默认方式为红利再投资；
- 7、红利分配时所发生的银行转帐或其他注册登记费用由投资者自行承担，若基金管理人收取该项费用，具体提取标准和方法应予以公告；
- 8、每份基金单位享有同等分配权；
- 9、法律、法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

### （四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益的范围、基金净收益、分配对象、分配原则、分配基准日、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

### （五）收益分配方案的确定与公告

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，由基金托管人核实时确定，在报中国证监会备案后五个工作日内公告。

### （六）收益分配中发生的费用

- 1、收益分配采用红利再投资方式免收再投资的申购费用；采用现金分红方式，则可从分红现金中提取一定的数额或者比例用于支付注册登记作业手续费或按照国家规定的银行资金汇划费用，如收取该项费用，具体提取标准和方法在招募说明书中规定。

2、如果基金持有人所获现金红利不足支付前述银行资金汇划费用或注册登记作业手续费，注册登记机构自动将该基金持有人的现金红利按红利发放日的基金单位净值转为基金单位。

## 十七、基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

- 1、基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日；
- 2、基金核算以人民币为记帐本位币，以人民币元为记帐单位；
- 3、执行《中华人民共和国会计法》、《证券投资基金会计核算办法》、《金融企业会计制度》等国家有关的法律和会计制度；
- 4、本基金为会计核算主体，独立建帐、独立核算；
- 5、基金管理人及托管人必须各自保留完整的会计帐目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表和会计报表附注；
- 6、基金管理人为本基金的基金会计核算责任人；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### （二）基金审计

- 1、本基金管理人聘请与基金发起人、基金管理人和基金托管人独立的会计师事务所及其注册会计师对基金财务会计报告进行年度审计并出具审计报告。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，须事先征得基金管理人和基金托管人同意，并报中国证监会备案。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须经基金托管人和基金管理人三分之二以上的独立董事同意，并报中国证监会备案。更换会计师事务所需在 5 个工作日内公告。

## 十八、申购与赎回

### （一）申购与赎回办理的场所

投资者应当在销售机构办理开放式基金业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购与赎回。

本基金的销售机构包括金鹰基金管理有限公司及其委托的代销机构。

金鹰基金管理有限公司可以根据情况变化增加或者减少代销机构，并另行公告。

销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市（网点），并另行公告。

## （二）申购与赎回办理的时间

### 1、开放日及开放时间

本基金为投资者办理申购与赎回等基金业务的工作日，即开放日，为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易日。具体业务办理时间由基金管理人与销售代理人约定。

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具体业务办理时间进行相应的调整并公告，报中国证监会备案。

### 2、申购的开始时间

本基金自成立日后不超过 30 个工作日的时间起开始办理申购。

### 3、赎回的开始时间

本基金自成立日后不超过 30 个工作日的时间起开始办理赎回。

4、在确定申购开始时间与赎回开始时间后，由基金管理人最迟于开放日前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

## （三）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即本基金的申购、赎回价格以受理申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算。

2、本基金采用金额申购和份额赎回的方式，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前撤销。

4、基金管理人在不损害基金持有人权益的情况下可更改上述原则。基金管理人最迟于新规则开始实施日前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

5、投资者赎回基金份额时，将首先赎回其持有时间最长的基金份额。

## （四）申购与赎回的程序

### 1、申购与赎回的申请方式

基金投资者须按销售机构规定的手续，在规定的申购赎回日的业务办理时间提出申购或赎回的申请。

投资人申购本基金，须按销售机构规定的方式备足申购资金。

投资人提交赎回申请时，其在销售机构（网点）必须有足够的基金单位余额。

### 2、申购与赎回申请的确认

基金管理人应以收到申购或赎回申请的当天（T 日）作为申购或赎回申请日，并在收到申请后的 1 个工作日内对该交易的有效性进行确认。投资者可在 2 个工作日之后（包括该日）向基金代销网点查询申购与赎回的成交情况。

### 3、申购与赎回申请的款项支付

申购采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，申购不成功或无效款项将退回投资者账户。投资者赎回申请成交后，基金管理人应指示基金托管人按有关规定将赎回款项在自受理基金投资人有效赎回申请之日起不超过 7 个工作日内划往管理人汇总清算账户，再由管理人划往赎回人银行账户。在发生巨额赎回时，款项的支付办法按本基金的基金契约有关规定处理。

## （五）申购与赎回的数额限制

1、代销网点每个账户每次申购的最低金额为 500 元人民币，具体数额请留意当地代销网点；

2、直销中心每个账户首次申购的最低金额为 10 万元人民币，追加申购的最低金额为 500 元人民币；已在直销中心有认购本基金记录的投资者不受首次申购最低金额的限制；

3、基金持有人可将其全部或部分基金单位赎回；

4、基金管理人可根据市场情况，调整申购的金额和赎回的份额的数量限制，基金管理人必须在调整前 3 个工作日至少在一种中国证监会指定的媒体上刊登公告并报中国证监会备案；

5、申购份额、余额的处理方式：申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日基金单位资产净值为基准计算，保留到小数点后两位，两位以后四舍五入；

6、赎回金额的处理方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金单位资产净值为基准并扣除相应的费用，保留到小数点后两位，两位以后四舍五入。

#### （六）本基金的申购费与赎回费

1、申购本基金为前端收费模式，即投资者在申购基金时缴纳申购手续费。本基金申购费率按照申购金额递减，即申购金额越大，所适用的申购费率越低，申购费用等于申购金额乘以所适用的申购费率。

申购金额在 100 万元人民币以下的，申购费率为 1.5%。

申购金额在 100 万元人民币以上（含 100 万元人民币）、1000 万元人民币以下的，申购费率为 1.2%。

申购金额在 1000 万元人民币以上（含 1000 万元人民币），申购费率不超过 1.0%。

本基金的申购费用由申购人承担，用于市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金资产。

2、赎回费率按照持有时间递减，即持有时间越长，所适用的赎回费率越低，赎回费用等于赎回金额乘以所适用的赎回费率。

持有时间在一年以内的，赎回费率为 0.5%。

持有时间在一年以上（含一年）两年以内的，赎回费率为 0.4%。

持有时间在两年以上（含两年）三年以内的，赎回费率为 0.3%。

持有时间在三年以上（含三年）的，赎回费率为 0.2%。

赎回费用由基金持有人承担，赎回费用的 80%用于注册登记费及相关手续费，20%归基金资产。

3、基金管理人可以调整申购费率和赎回费率，基金管理人必须在调整前报中国证监会备案，并在调整实施前 3 个工作日内至少在一种中国证监会指定的媒体上刊登公告。

#### （七）申购份额与赎回金额的计算方式

##### 1、申购份额的计算

申购份额=（申购金额—申购费用） $\div$ T 日基金单位净值  
基金单位份额保留小数点后两位。

例 4：假定 T 日的基金单位净值为 1.1 元，申购金额 10,000 元，那么申购份额为： $10,000 - 10,000 \times 1.5\% \div 1.1 = 8,954.54$  份

## 2、赎回费和赎回金额的计算

赎回费=赎回份额×赎回日基金单位资产净值×赎回费率

赎回金额=赎回份额×赎回日基金单位资产净值 - 赎回费

例 5：假如某一天，基金单位资产净值为 1.2 元，某投资者申请赎回 10,000 份基金单位，该投资者持有基金份额的时间为 2 年又 3 个月，则其适用的赎回费率为 0.3%，赎回费为  $10,000 \times 1.2 \times 0.3\% = 36$  元，赎回金额为： $10,000 \times 1.2 - 36 = 11964$  元。

（以上例子中数据皆为假设，并不能作为判断基金可能收益的依据。）

3、T 日的基金单位净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告。遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

4、本基金的申购费率和/或赎回费率如发生调整，则调整后的申购费率和/或赎回费率在报中国证监会备案生效之日后第一个工作日起实施。

## （八）申购与赎回的注册登记

投资者申购基金成功后，注册登记机构在 T+1 日为投资者办理增加权益的登记手续，投资者自 T+2 日起有权赎回该部分基金单位。

投资者赎回基金成功后，注册登记机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益的登记手续。

基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前 3 个工作日至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

## （九）巨额赎回的认定及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

单个开放日基金净赎回申请（有效赎回申请总份额扣除有效申购申请总份额后的余额）超过上一日基金总份额的 10% 时，为巨额赎回。

### 2、巨额赎回的处理方式

出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况接受全额赎回或部分赎回。

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

2) 部分赎回：当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金单位资产净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额的 10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；未受理部分可延迟至下一个开放日办理。转入第二个开放日的赎回申请不享有优先权并以该开放日的基金单位资产净值为依据计算赎回金额，依此类推，直到全部赎回为止。投资者在申请赎回时可选择将当日未获受理部分予以撤销。

当发生巨额赎回并部分延期赎回时，基金管理人应立即向中国证监会备案并在 3 个工作日内在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告，并说明有关处理方法。

本基金连续两个开放日发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，并应当在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

#### （十）拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1) 不可抗力；
- 2) 证券交易场所交易时间非正常停市；
- 3) 法律、法规规定或经中国证监会批准的其他情形。

2、在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资人的赎回申请：

- 1) 不可抗力；
- 2) 证券交易场所交易时间非正常停市；
- 3) 因市场剧烈波动或其他原因而出现连续巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难时，基金管理人可以暂停接受基金的赎回申请；
- 4) 法律、法规规定或经中国证监会批准的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应当在当日立即向中国证监会备案。已接受的赎回申请，基金管理人应当足额兑付；如暂时不能足额兑付，应当按单个账

户已被接受的赎回申请量占已接受的赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分在后续开放日予以兑付，并以后续开放日的基金单位净值为依据计算赎回金额。投资者在申请赎回时可选择将当日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。

3、发生基金契约、招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人有正当理由认为需要暂停接受基金申购、赎回申请的，报经中国证监会批准后可以暂停接受投资人的申购、赎回申请。

4、暂停基金的申购、赎回，基金管理人应及时在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

5、暂停期间结束基金重新开放时，基金管理人应予公告。

如果发生暂停的时间为一天，基金管理人将于重新开放日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告并公告最新的基金单位净值。

如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人将提前 1 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最新的基金单位净值。

如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最新的基金单位净值。

#### （十一）交易所发行基金的赎回

经中国证监会批准，本基金可在证券交易所系统发行。在交易所发行的本基金需要赎回时，须将基金的托管转到本基金任一销售机构后，才能申请赎回。

## 十九、基金转换

在同一注册登记机构的前提下，本基金可以转换为本基金管理人管理的其他基金，转换的原则如下：

(一) 基金转换的计算采用“未知价”原则，即基金转换价格以受理申请当日收市后计算的转出及转入基金的基金单位资产净值为基准进行计算。

(二) 采用份额转换的方式，即基金转换以份额申请。

(三) 基金转换收取适当的基金转换费。

(四) 在发生基金转换时，转出基金必须为允许赎回状态，转入基金必须为允许申购状态。

(五) 在发生转入基金限制申购或转出基金巨额赎回的情况下，所涉及到的基金转换按比例确认。

(六) 由于本基金和转入基金的认购、申购、赎回费率结构不一致，需支付的转换费率也有区别，具体转换程序及转换费率本基金管理人另行公告。

基金管理人在不损害基金持有人利益的情况下可更改上述转换程序及转换费率，并按照有关规定在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上公告。

## 二十、基金交易

经中国证监会批准，本基金可在证券交易所系统发行。通过证券交易所系统认购本基金的基金持有人可按照证券交易所的有关规定，进行本基金的交易。通过直销和代销系统认/申购的本基金，须将基金转托管到国内任意一家证券公司的营业部后，才可在交易所交易。通过证券交易所系统买入的本基金亦可以转托管到本基金的销售代理机构，然后申请赎回。关于本基金在证券交易所系统中的交易、分红处理及跨市场转托管等业务将遵循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。

## 二十一、基金持有人

### (一) 基金持有人的权利和义务

#### 1、基金持有人的权利

根据《暂行办法》、《试点办法》、《基金契约》及其他有关法律法规的规定，基金持有人享有如下权利：

- 1) 分享基金财产收益；
- 2) 参与分配清算后的剩余基金财产；

- 3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额;
- 4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会;
- 5) 对基金份额持有人大会审议事项行使表决权;
- 6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料;
- 7) 对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼;
- 8) 法律、法规、中国证监会及《基金契约》规定的其他权利;

每份基金单位具有同等的合法权益。

## 2、基金持有人的义务

根据《暂行办法》、《试点办法》、《基金契约》及其他有关法律法规的规定，基金持有人负有如下义务：

- 1) 遵守《基金契约》；
- 2) 缴纳基金认购、申购款项及规定的费用；
- 3) 承担基金亏损或者终止的有限责任；
- 4) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
- 5) 法律、法规、中国证监会及《基金契约》规定的其他义务。

### （二）基金持有人大会

#### 1、召开事由

有以下情形之一的，应召开基金持有人大会：

- 1) 提前终止基金契约；
- 2) 转换基金运作方式；
- 3) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- 4) 更换基金管理人、基金托管人；
- 5) 基金契约约定的其他事项。

以下情况不需召开基金持有人大会：

- 1) 调低基金管理费、基金托管费；
- 2) 在本基金契约规定的范围内变更本基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
- 3) 因相应的法律、法规发生变动必须对基金契约进行修改；

4) 对基金契约的修改不涉及本基金契约当事人权利义务关系发生变化或对基金持有人利益无实质性不利影响;

5) 按照法律法规或《基金契约》规定不需召开基金持有人大会的其他情形。

## 2、召集方式

1) 基金持有人大会由基金管理人召集; 基金管理人未按规定召集或者不能召集时, 由基金托管人召集;

2) 代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会, 而基金管理人、基金托管人都不召集的, 代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人有权自行召集, 并报中国证监会备案。

## 3、通知

召开基金持有人大会, 召集人应当至少提前三十日公告基金持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

采取通讯方式开会并进行表决的情况下, 由召集人决定通讯方式和书面表决方式, 并在会议通知中说明本次基金持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见的寄交和收取方式。

## 4、召开方式

会议的召开方式由召集人确定, 基金份额持有人大会可以采取现场方式召开, 也可以采取通讯等方式召开, 根据有关规定, 若采用通讯方式开会, 会议召集人应在发出会议通知前向中国证监会备案。

更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方式召开基金持有人大会。

基金份额持有人大会应当有代表百分之五十以上基金份额的持有人参加, 方可召开;

1) 现场开会。由基金持有人本人出席或以代理投票授权委托书委派代表出席。

2) 通讯方式开会。通讯方式开会应以书面方式进行表决。

## 5、议事内容与程序

### 1) 议事内容及提案

议事内容为关系基金持有人利益的重大事项, 如修改基金契约、决定终止基金、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并以及召集人认为需提交

基金持有人大会讨论的其他事项。

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权利登记日基金总份额 10%或以上的基金持有人可以在大会召集人发出会议通知后 10 个工作日内向大会召集人提交议事内容提案。

基金持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。

## 2) 议事程序

### 现场开会

在现场开会的方式下，由大会主持人按照规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读审议事项，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人由大会召集人选定。

### 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，由召集人提前三十日通知审议事项，在所通知的表决截止日期第二天统计全部有效表决，在公证机构监督下形成决议。

## 6、表决

1) 每一基金份额具有一票表决权，基金持有人可以委托代理人出席基金持有人大会并行使表决权。

2) 基金持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

一般决议，一般决议须经出席会议的基金持有人所持表决权的半数以上（不含半数）通过方为有效；特别决议应当经参加大会的基金持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、提前终止基金契约必须经过特别表决。

3) 基金持有人大会采取记名方式进行投票表决。

4) 采取通讯方式进行表决时，除非有充分相反证据证明，否则其表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见视为有效表决。意见模糊或相互矛盾的视为无效表决。

5) 基金持有人大会的各项议题应当分开审议、逐项表决。

## 7、计票

### 1) 现场开会

由大会召集人组织在出席会议的基金持有人中选举两名基金持有人代表与

大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人。

监票人应当在基金持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

如果出席会议的 10%以上的基金持有人对于提交的表决结果有怀疑，可以要求大会召集人对所投票数进行重新清点。

## 2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

## 8、生效与公告

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案。

经中国证监会核准或者备案无异议的基金持有人大会决议对全体基金持有人及相关当事人均有法律约束力。

基金持有人大会决议自生效之日起 5 个工作日内在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

9、法律法规或中国证监会对基金持有人大会有关事项另有规定的，从其规定。

## （三）基金持有人服务

基金管理人承诺为基金持有人提供一系列的服务。基金管理人根据基金持有人的需要和市场的变化，有权增加或变更服务项目。目前主要服务内容如下：

### 1、持有人注册与过户登记服务

基金管理人配备安全完善的电脑系统及通讯系统，准确及时地为基金投资者办理基金账户汇总和存储基金的所有申购与赎回信息，确保基金持有人的注册与过户登记工作。

### 2、定期、定额投资计划

本基金未来可为投资者提供定期定额投资计划服务，通过定期定额投资计划，投资者可通过固定的渠道采用定期定额的方式申购基金单位。

### 3、资料寄送服务

#### 1) 对账单寄送

注册登记人在每个季度结束后 10 个工作日内向该季度有交易的基金持有人

以书面或电子文件形式寄送对账单。

注册登记人在每年度结束后 15 个工作日内向所有基金持有人以书面或电子文件形式寄送对账单。

## 2) 其他相关的信息资料

### 4、红利再投资服务

本基金收益分配时,基金持有人可以选择将当期分配所得的红利再投资于本基金,再投资红利按权益登记日的基金单位资产净值自动转为基金单位,并免收申购费用。

### 5、咨询、查询服务

#### 1) 客户服务电话

投资者如果想了解申购与赎回的交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息,可拨打金鹰基金管理有限公司如下电话:

客户服务中心: (020) 83936180

传真: (020) 83282856

#### 2) 互联网站

公司网址: <http://www.gefund.com.cn>

电子邮箱: [investor@gefund.com.cn](mailto:investor@gefund.com.cn)

### 6、投诉受理

投资人可以拨打金鹰基金管理有限公司客户服务中心电话投诉直销机构和代销机构的人员和服务。

## 二十二、基金的信息披露

### (一) 总则

本基金发起人、管理人、托管人等基金信息披露义务人,按照《暂行办法》、《试点办法》等法律、法规及中国证监会和《基金契约》的有关规定披露本基金信息,保证公开披露文件的内容真实、准确、完整,并就其保证承担连带责任。

公开披露基金信息涉及财务会计、法律等事项的,应当根据有关规定由会计师事务所、律师事务所等专业机构审查验证,并出具书面意见。相关专业机构及其人员保证其所出具文件的内容真实、准确、完整,并就其保证承担连带责任。

一个基金会计年度内的信息披露事项必须固定在至少一种中国证监会指定的全国性报刊上公告。

基金信息披露义务人应当确保披露信息在规定时间内发出，并保证投资人能够按照《招募说明书》规定的时间和方式查阅或者复制与基金有关的公开资料。

#### （二）本基金的信息披露内容包括：

- 1、招募说明书；
- 2、发行公告；
- 3、成立公告书；
- 4、定期报告；
- 5、临时报告；
- 6、澄清公告与说明；
- 7、法律、法规以及中国证监会规定应予披露的其他信息。

#### （三）招募说明书

基金募集前，基金发起人根据《暂行办法》、《试点办法》及其他有关规定编制招募说明书，并向社会公开披露有关信息。

基金发起人编制完成招募说明书后，将经签署的招募说明书及其摘要随其他设立申请文件一并报送中国证监会审核。基金获准设立后，基金管理人应当在基金募集前三日内将招募说明书及其摘要刊登在至少一种中国证监会指定的全国性报刊上，并将招募说明书正文放置在基金管理人所在地、各销售网点，供公众查阅，同时一式二份报送中国证监会备案。

本基金成立后，基金管理人应于每 6 个月结束后的 1 个月内更新招募说明书及其摘要，更新内容的截至日为每 6 个月的最后 1 日，招募说明书更新后，应在公告时间 15 日前报中国证监会审核。

#### （四）发行公告和成立公告书

基金发起人按照《暂行办法》及其实施准则、《试点办法》编制并公告发行公告。

本基金募集满足《暂行办法》、《试点办法》规定的成立条件的，基金管理人应于基金成立日在至少一种中国证监会指定的全国性报刊上刊登基金成立公告书。

## （五）定期公告

本基金定期报告包括年度报告、半年度报告、季度报告、基金净值公告。由基金管理人根据《暂行办法》、《试点办法》的规定和中国证监会颁布的有关证券投资基金信息披露内容与格式的相关文件进行编制并公告，同时报中国证监会备案。

### 1、年度报告

基金管理人在本基金每个会计年度结束后九十日内编制完成年度报告，并将年度报告正文登载于基金管理人的国际互联网站上，将年度报告摘要刊登在至少一种中国证监会指定的全国性报刊上，年度报告正文一式二份报送中国证监会备案。基金年度报告的财务报告须经具有从事证券相关业务资格的会计师事务所审计并出具审计报告。

### 2、半年度报告

基金管理人在本基金每个会计年度的前六个月结束后六十日内编制完成半年度报告，并将半年度报告正文登载于基金管理人的国际互联网站上，将半年度报告摘要刊登在至少一种由中国证监会指定的全国性报刊上，半年度报告正文一式二份报送中国证监会备案。

### 3、季度报告

基金管理人应当在每个季度结束后十五个工作日内编制完成季度报告，并刊登在基金管理人的国际互联网站及至少一种由中国证监会指定的全国性报刊上，同时一式二份报送中国证监会备案。

### 4、基金净值公告

基金管理人应于本基金每个开放日的第二天计算基金单位资产净值，并登载于基金管理人国际互联网站、中国证监会指定的全国性报刊及其他披露媒介上。

## （六）临时公告

基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当于第一时间报告中国证监会，并编制临时报告，经中国证监会核准后公告。

重大事件是指可能对基金持有人权益及基金单位的交易价格产生重大影响的事件，包括但不限于下列情况：

- 1、基金持有人大会决议；
- 2、基金管理人或基金托管人变更；
- 3、基金管理人的董事长、总经理、基金经理、基金托管人的总经理变动；
- 4、基金管理人的董事一年内变更超过 50%；
- 5、基金管理人或基金托管部主要业务人员一年内变更超过 30%；
- 6、基金管理人或基金托管人受到重大处罚；
- 7、重大关联事项；
- 8、重大诉讼、仲裁事项；
- 9、基金单位估值差错超过基金单位资产净值的 0.5%；
- 10、基金发生巨额赎回并延期支付；
- 11、基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- 12、基金暂停接受申购、赎回申请或基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 13、基金费用的调整；
- 14、基金转换等业务的推出；
- 15、基金投资限额的调整；
- 16、增减销售代理机构；
- 17、变更基金的注册登记机构；
- 18、为基金提供相关服务的机构出现有关事项，有可能影响投资人对基金风险或业绩的评估或判断；
- 19、基金所重点投资的上市公司或企业、金融债发行人经营状况或财务状况出现严重恶化，从而对基金的投资业绩产生较大影响；
- 20、基金所重点投资的股票或债券的价格出现连续跌停或非正常原因持续停牌，从而对基金的投资业绩产生较大影响；
- 21、基金提前终止；
- 22、其他重要事项。

☆ (七) 澄清公告与说明

- 1、在任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动时，相关的信息披露义务人知悉后应当立即对该

消息进行公开澄清，并将有关情况立即报送中国证监会。

2、有关基金信息公布后，基金信息披露义务人可根据中国证监会要求对公告内容作进一步公开说明。

#### （八）申购、赎回等业务公告书

本基金管理人将按照《暂行办法》及其实施准则、《试点办法》编制公告书，同时报中国证监会备案。

在日常申购开始日的三个工作日前，在指定媒体公告申购公告书；

在日常赎回开始日的三个工作日前，在指定媒体公告赎回公告书；

在日常基金间转换开始日的三个工作日前，在指定媒体公告转换公告书；

#### （九）信息披露管理

1、基金管理人、基金托管人应当指定专人负责信息披露事务。

2、基金托管人须对基金管理人编制的定期报告中有关内容进行复核，并就此向基金管理人出具书面文件。

3、基金管理人应建设、维护信息披露的国际互联网站，并及时更新国际互联网站披露的信息。

4、基金管理人可选择中国证监会指定的全国性报刊披露信息，所选择的报刊在一个基金会计年度内不得更换。

5、基金管理人除在其国际互联网站及中国证监会指定的全国性报刊上披露信息外，还可以根据需要在其他报刊或销售资料中披露信息，但应当保证：

1) 国际互联网站及指定报刊上披露的同一信息应在同一天披露；

2) 国际互联网站及指定报刊不晚于非指定报刊或销售资料披露信息；

3) 在不同宣传媒介上披露同一信息的内容一致；

4) 在不同宣传媒介上披露信息不应影响投资人作出决策。

6、基金管理人、托管人及其委托的机构通过新闻媒体披露与本基金有关的信息后，应当将相关的披露宣传材料报告中国证监会备案。

#### （十）信息披露文件的存放与查阅

本基金的信息披露文件文本存放在基金管理人、基金托管人和基金销售代理人的办公场所和营业场所，投资者可在办公时间免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复印件。

基金管理人和基金托管人应保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 二十三、基金终止

有下列情形之一的，本基金经中国证监会批准后终止：

- (一) 存续期间内，基金持有人数量连续 60 个工作日达不到 100 人，或连续 60 个工作日基金资产净值低于人民币 5,000 万元；
- (二) 基金经基金持有人大会表决终止；
- (三) 因重大违法、违规行为，基金被中国证监会责令终止；
- (四) 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任本基金的管理人，而无其他适当的基金管理机构承接其权利及义务；
- (五) 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任本基金的托管人，而无其他适当的基金托管机构承接其权利及义务；
- (六) 由于投资方向变更引起的基金合并、撤销；
- (七) 法律、法规规定或中国证监会允许的其他情况。

自基金终止之日起，与基金有关的所有交易应立即停止。在基金清算小组组成并接管基金资产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金契约和托管协议的规定继续履行保护基金资产安全的职责。

## 二十四、基金清算

### (一) 基金清算小组

1、自基金终止之日起 30 个工作日内成立基金清算小组，基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算，在基金清算小组接管基金资产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金契约和托管协议的规定继续履行保护基金资产安全的职责。

2、基金清算小组成员由基金发起人、基金管理人、基金托管人、具有相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金清算小组负责基金资产的保管、清理、估价、变现和分配，编制基金清算报告，并将清算结果上报中国证监会。基金清算小组可以依法进行必要的民事活动。

## （二）清算程序

- 1、基金终止后，由基金清算小组统一接管基金资产；
- 2、基金清算小组对基金资产进行清理和确认；
- 3、对基金资产进行评估和变现；
- 4、将基金清算结果报告中国证监会；
- 5、公布基金清算公告；
- 6、对基金资产进行分配。

## （三）基金清算小组的工作内容

- 1、基金终止后，发布基金清算公告；
- 2、基金清算小组统一接管基金资产；
- 3、对基金资产进行清理和确认；
- 4、对基金资产进行估价；
- 5、对基金资产进行变现；
- 6、将基金清算结果报告中国证监会；
- 7、以自身名义参加与基金有关的民事诉讼；
- 8、公布基金清算结果公告；
- 9、进行基金剩余资产的分配。

## （四）清算费用

清算费用是指清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由清算小组优先从基金资产中支付。

## （五）基金资产按下列顺序清偿

- 1、支付清算费用；
- 2、交纳所欠税款；
- 3、清偿基金债务；
- 4、按基金持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金资产未按前款（1）至（3）项规定清偿前，不分配给基金持有人。

## （六）基金清算的公告

基金清算公告于基金终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内公告；清算过程中的有关重大事项将及时公告；基金清算结果公告由基金清算小组经中国证监

会批准后在 3 个工作日内公告。

#### （七）基金清算账册及文件的保存

基金清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

### 二十五、基金专用交易席位的选择

#### （一）选择使用基金专用交易席位的证券经营机构的选择标准和程序

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其专用交易席位供本基金证券买卖专用，选择标准为：

- 1、实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- 2、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- 3、经营行为规范，最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚；
- 4、内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- 5、具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- 6、研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订委托协议，报中国证监会备案并公告并通知基金托管人。

#### （二）席位租用期限及更换方式

席位的使用期限暂定为半年。使用期满后，基金管理人将根据各证券经营机构所提供的各类研究报告和信息资讯进行综合评价，包括：

- 1、提供的研究报告质量和数量；
- 2、研究报告被基金采纳的情况；
- 3、因采纳其报告而为基金运作带来的直接效益和间接效益；
- 4、因采纳其报告而为基金运作避免或减少的损失；
- 5、由基金管理人提出课题，证券经营机构提供的研究论文质量；

- 6、开放证券经营机构资料库的情况；
- 7、其他可评价的量化标准。

根据上述综合评价的结果进行排名。在这一过程中，基金管理人不但对已使用席位的证券经营机构进行排名，同时亦关注并接受其他证券经营机构的研究报告和信息资讯，为半年后的席位更换作准备。

若证券经营机构所提供的研究报告及其他信息服务不符合要求，基金管理人有权提前终止租用其交易席位。

### （三）席位运作方式

根据中国证监会《关于加强证券投资基金管理有关问题的通知》中关于“每只基金通过任何一家证券经营机构买卖证券的年成交量，不超过该基金买卖证券年总成交量的 30%”的规定，基金管理人将结合各证券经营机构提供研究报告及信息服务的质量，分配基金在各席位买卖证券的交易量。

### （四）其他事宜

基金管理人将根据有关规定，在基金半年度报告和年度报告中将所选择的证券经营机构的有关情况、基金通过该证券经营机构买卖证券的成交量、支付的佣金等予以披露，并向中国证监会报告。

## 二十六、招募说明书存放及查阅方式

本基金招募说明书存放在基金管理人、基金托管人、销售代理人和注册登记机构的办公场所或营业场所，投资者可在办公时间免费查阅。也可按工本费购买本基金招募说明书复印件，但应以基金招募说明书正本为准。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

**附录：代销机构名录**

名 称：交通银行

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：方城国

电 话：(021) 58781234

传 真：(021) 58408836

联系人：王玮

名 称：海通证券股份有限公司

住 所：上海市淮海中路 98 号

法定代表人：王开国

电 话：(021) 53594566—4125

传 真：(021) 53858549

联系人：金芸

客户服务热线：(021) 962503

名 称：国泰君安证券股份有限公司

住 所：上海市浦东新区商城路 618 号

法定代表人：祝幼一

电 话：(021) 82580818—177

传 真：(021) 62583439

联系人：顾文松

客户服务热线：400—8888—666、(021) 962588

名 称：华夏证券有限公司

住 所：北京市东城区新中街 68 号

法定代表人：周济普

电 话：(010) 65186758

传 真: (010) 65182261

联系人: 权唐

客户服务热线: 400—8888—108 (免长途费)、(010) 65186758

名称: 广发证券股份有限公司

住所: 广州市天河北路 183 号大都会广场 36、38、41 楼

电话: (020) 87555888 转 875

传真: (020) 87667985

联系人: 肖中梅

名称: 国信证券有限责任公司

住所: 深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信大厦 16—26 层

法定代表人: 胡关金

电话: (0755) 82130510

传真: (0755) 82133302

联系人: 王红彦

客户服务热线: 800—810—8868

名称: 湘财有限责任公司

住所: 长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 层

法定代表人: 陈学荣

电话: (021) 68634518

传真: (021) 68865938

联系人: 杜颖灏

名称: 招商证券股份有限公司

住所: 深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人: 官少林

电话: (0755) 82943167

传 真: (0755) 82943237  
联系人: 钟俊杰  
客户服务热线: 4008888111、(0755) 26951111

名 称: 兴业证券股份有限公司  
住 所: 福建省福州市湖东路 99 号标力大厦  
法定代表人: 蓝荣  
电 话: (021) 68419125  
传 真: (021) 68419867  
联系人: 缪白  
客户服务热线: (021) 68419125

名 称: 闽发证券有限责任公司  
住 所: 福州市五四路 158 号环球广场 28—29 层  
电 话: (0591) 7801006  
传 真: (0591) 7801003  
联系人: 林瑜

名 称: 东吴证券有限责任公司  
住 所: 苏州市十梓街 298 号  
法定代表人: 吴永敏  
电 话: (0512) 65158018  
传 真: (0512) 65158028  
联系人: 方晓丹

名 称: 广东证券股份有限公司  
住 所: 广州市解放南路 123 号金汇大厦  
法定代表人: 钟伟华  
电 话: (020) 83270846 转 72899

传 真: (020) 83270505

联系人: 陈新

客户服务热线: (020) 96210

名称: 广州证券有限责任公司

住所: 广州市先烈中路 69 号东山广场主楼五楼

法定代表人: 吴张

电话: (020) 87320991

传真: (020) 87325036

联系人: 黄繁豫

名称: 天和证券经纪有限公司

住所: 浙江省杭州市孝女路 2—2 号

法定代表人: 赵万兴

电话: (0571) 87925134、(0571) 9336

传真: (0571) 87922522

联系人: 张帆

如在发行期内增加代销机构, 本基金发起人将另行公告。

如中国证监会或其授权机构批准本基金通过交易所系统发行, 则相关的证券交易所或机构将作为本基金的代理销售机构。

## 金鹰中小盘精选证券投资基金招募说明书

### 备查文件目录

- 一、 中国证监会批准金鹰中小盘精选证券投资基金设立的文件
- 二、 金鹰中小盘精选证券投资基金基金契约
- 三、 金鹰中小盘精选证券投资基金销售代理协议
- 四、 金鹰中小样精选证券投资基金托管协议
- 五、 法律意见书
- 六、 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 七、 基金托管人业务资格批件和营业执照
- 八、 金鹰基金管理有限公司开放式基金业务规则
- 九、 中国证监会要求的其他文件

# 金鹰中小盘精选证券投资基金招募说明书摘要

本招募说明书摘要的目的仅为尽可能广泛、迅速地向公众提供有关本次发行地简要情况。招募说明书方为本次发行的法律文件。投资人在做出认购或申购本基金的决定之前，应仔细阅读招募说明书，并以招募说明书全文和其他法律文件作为投资决定的依据。

## 一、基金概览

基金名称：金鹰中小盘精选证券投资基金

基金类型：契约型开放式

基金单位面值：1,00 元

发行对象：中国人民共和国境内的个人投资者和机构投资者（法律、法规及其他有关规定禁止投资证券投资基金的除外）

发行方式：通过基金管理人的直销网点和销售代理人的代销网点向公众公开发行。

发行时间：2004 年 4 月 12 日至 2004 年 5 月 20 日

基金发起人：金鹰基金管理有限公司

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：交通银行

销售渠道：采取直销和代销相结合的方式，通过直销机构和代销机构的代理销售网点公开发售。经中国证监会及授权机构批准，本基金可在证券交易所系统发行和交易，相关的证券交易所或机构将作为本基金的代理销售机构。

直销机构：金鹰基金管理有限公司

代销机构：交通银行  
海通证券股份有限公司  
国泰君安证券股份有限公司  
华夏证券有限公司

广发证券股份有限公司  
 国信证券股份有限责任公司  
 湘财证券有限责任公司  
 招商证券股份有限公司  
 兴业证券股份有限公司  
 闽发证券有限责任公司  
 东吴证券有限责任公司  
 天和证券经纪有限公司  
 广东证券股份有限公司

注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司  
 预期募集规模：本基金不设预期募集规模上限  
 募集期限：自招募说明书公告之日起不超过3个月  
 基金单位资产净值：T日的基金单位资产净值在当天收市后计算，精确到0.0001元，小数点后第五位四舍五入，于T+1日公告基金份额精确度保留到小数点后两位，剩余部分舍去，舍去部分所代表的资产归基金所有  
 会计期间：公历1月1日至12月31日  
 会计师事务所：广东智洋律师事务所  
 律师事务所：安永华明会计师事务所

## 二、投资目标和投资范围

### 投资目标

本基金投资具有较高成长性和良好基本面的中小盘股票，通过积极的投资组合管理，在控制风险的前提下谋求基金资产的长期稳定增值。

### 投资范围

本基金的投资对象为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市股票、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金的股票投资占基金资产总值的比例为50%到80%，债券投资占基金

资产总值的比例为 20% 到 40%，现金占基金资产总值的比例不超过 10%。

### 三、投资决策

本基金的投资决策依据包括：宏观经济形势及前景、行业发展现状及前景、上市公司基本面及发展前景、证券市场走势及预期、股票、债券等类别资产的预期收益率及风险水平。

本基金的投资组合符合以下比例规定：

- 1、本基金投资于股票、债券的比例，不得低于基金资产总值的 80%。
- 2、本基金投资于国家债券的不利，不得低于基金资产净值的 20%。
- 3、本基金投资于中小盘股的比例不得低于本基金股票投资总额的 80%。

有关法律法规、中国证监会及本基金契约所规定的其他比例限制。

本基金投资策略

本基金采取主动地股票投资策略，在专业化研究的基础上，将系统的选股方法与基金的投资操作相结合，选择具有较高成长性、基金面良好的股票构建股票投资组合、把握投资机会，实现收益。

本基金的债券投资采取稳健的混合管理投资策略，根据对利率，收益率走势的预测，考虑债券信用等级、期限、品种、流动性等因素、依据修正久期、凸性等指标、构建债券组合、

### 四、选股标准

本基金主要选择具有较高成长性和良好基本面的、流通市值在市场平均水平之下的中小盘股票进行投资。基金选股采用 PEG（其中 PE 是股票的静态市盈率，G 是预期净利润增产率）作为定量指标，采用公司素质和财务状况作为定性指标。

### 五、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为 75% 的股票投资比较基准加上 25% 的债券投资比较基准。

股票投资比较基准采用 50% 的中信中盘指数收益率加 50% 的中信小盘指数收

益率。债券投资比较基准采用中信国债指数。

## 六、风险收益特征及目标客户

本基金属于适中、收益较高的基金品种。

根据本基金风险和收益水平特征,我们将目标客户定位为风险容忍程度适中追求资本长期稳定增值的基金投资者。

## 七. 认购安排

本基金的认购费率按照认购金额递减,即认购金额越大,所适用的认购费率越低,认购费用等于认购金额乘以所适用的认购费率。

认购金额在 100 万元人民币以下的,认购费率为 1.2%。

认购金额在 100 万元以上(含 100 万元人民币)、1000 万元人民币以下的,认购费率为 1.0%。

认购资金利息在本基金成立后归入基金资产。

投资者通过代销机构的单笔最低认购金额均不得低于 500 元,详情请见当地销售机构公告。

首次通过直销机构的认购最低限额为 10 万元,后续每笔认购金额不低于 500 元。

认购期间单个投资者的累积认购规模没有限制。

## 八、基金费用概览

- 1、 基金费用包括
  - 1) 基金管理人的报酬
  - 2) 基金托管人的托管费
  - 3) 证券交易费用
  - 4) 基金信息披露费用(基金认购期所发生的此类费用从基金发行费用中列支,不另从基金资产支付)
  - 5) 基金持有人大会费用
  - 6) 与基金相关的会计师、律师等中介机构费用(基金认购期所发生的此类费用从基金发行费用中列支,不另从基金资产支付)

7) 基金分红手续费

8) 法律、法规、中国证监会规定可以列入的其他费用、

2、基金管理人报酬和基金托管人的托管费的计提标准和方法

基金管理人报酬按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。计算方法为：

$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$ 、

$H$  为每日应支付的基金管理人报酬，基金管理人报酬每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

基金托管人的托管费按前一日的基金资产净值的 2.5% 的年费率计提。计算方法为：

$H = E \times 2.5\% \div \text{当年天数}$

$H$  为每日应支付的基金托管费， $E$  为前一日的基金资产净值。基金托管人的托管费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

### 3 申购费用

1) 申购费用

本基金申购费率按照申购金额递减，即申购金额越大，所适用的申购费率越低，申购费用等于申购金额乘以所适用的申购费率。

申购金额在 100 万元人民币以下的，申购费率为 1.5%。

申购金额在 100 万元人民币以上（含 100 万元人民币）、1000 万元人民币以下的，申购费率为 1.2%。

申购金额在 1000 万元人民币以上（含 1000 万元人民币）、申购费率不超过 1.0%。

本基金的申购费用由申购人承担，用于市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金资产。

2) 赎回费用

赎回费率按照持有时间递减，即持有时间越长，所适用的赎回费率越低，赎回费用等于赎回金额乘以所适用的赎回费率。

持有时间在一年以内的，赎回费率为 0.5%。

持有时间在一年以上（含一年）两年以内的，赎回费率为 0.4%。

持有时间在两年以上（含两年）三年以内的，赎回费率为 0.3%。

持有时间在三年以上（含三年）的，赎回费率为 0.2%。

本基金的赎回费用由基金持有人承担，赎回费用的 80%用于注册登记费及相关手续费，20%归基金资产。

## 九、 基金管理人概况

名 称：金鹰基金管理有限公司

注册地址：广东省珠海市吉大九州大道东段商业银行大厦 7 楼 16 单元

办公地址：广州市沿江中路 298 号江湾商业大厦 22 楼

法定代表人：吴张

成立时间：2002 年 12 月 25 日

批准设立机关及文号：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：人民币一亿元

存续期限：持续经营

## 十、 基金托管人概括

名 称：交通银行

住 所：上海市银城中路 188 号

法定代表人：方诚国、

组织 形 式：股份制商业银行

注册 资本：170 亿元

存续期限：持续经营

## 十一、风险揭示

投资于本基金的主要风险有：

- 1、 市场风险
- 2、 信用风险
- 3、 管理风险

- 4、流动性风险
- 5、基金所投资的特定投资对象可以引起的特定风险
  - 1) 中小盘股票的投资风险

本基金主要投资具有较高成长性的良好基本面的、流通市值在市场平均水平之下的中小盘股票进行投资，虽然可以通过分散投资策略和组合管理降低风险，但单个中小盘股票和大盘股票比较，具有相对较高的价格波动性。

- 2) 流动性风险和价格冲击风险

中小盘股票的平均流通市值相对较小，本基金投资这些股票时存在一定的流动性风险，即对买卖成交的及时性带来不利影响。此外，本基金投资这些股票会对其价格产生一定的冲击，从而有可能增加买入成本或减少投资盈利。

- 3) 股票选择风险

随着股票平均市值的增大，本基金可以选择投资的样本股票数量增加，样本股票数量的偏多，对基金选股可能带来一定困难。

依据 PEG 指标的定量选股，需要对上市公司的未来成长性进行预期，预期的错误会影响股票选择的合理性、准确性，从而影响本基金的收益水平。

此外，本基金的定性选股也需要对上市公司的素质和财务状况进行预期或判断，预期或判断的错误会影响股票选择的合理性、准确性，从而影响本基金的收益水平。

- 6、操作或技术风险
- 7、法律风险

## 十二、基金的申购和赎回

- 1、申购与赎回办理场所

投资者应在销售机构办理开放式基金业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购与赎回。

- 2、申购与赎回办理的时间

本基金为投资者办理申购与赎回等业务的工作日，即开放日，为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易日。具体业务办理时间由基金管理人与销售代理人约定。

本基金自成立日后不超过 30 个工作日的时间起开始办理申购。

本基金自成立日后不超过 30 个工作日的时间起开始办理赎回。

### 3、申购与赎回的原则

“未知价”原则，即本基金的申购、赎回价格以受理申请当日收市后计算的基金单位净值为基准进行计算。

本基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请。

经中国证监会批准，本基金可在证券交易所系统发行。在交易所发行的本基金需要赎回时，须将基金的托管转到本基金任一销售机构后，才能申请赎回。

### 4、申购与赎回的程序

#### 1) 申购与赎回的申请方式

基金投资者须按销售机构规定的手续，在规定的申购赎回日的业务办理时间提出申购或赎回的申请。

投资人申购本基金，须按销售机构规定的方式备足申购资金。

投资人提交赎回申请时，其在销售机构（网点）必须有足够的基金单位余额。

#### 2) 申购与赎回申请的确认

基金管理人应以收到申购或赎回申请的当天（T 日）作为申购或赎回申请日，并在收到申请后的 1 个工作日内对该交易的有效性进行确认。投资者可在 2 个工作日之后（包括改日）向基金代销网点查询申购与赎回的成交情况。

#### 3) 申购与赎回申请的款项支付

申购采用全额交付方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，申购不成功或无效款项将退回投资者账户。投资者赎回申请成交后，基金管理人应只是基金托管人按有关规定将赎回款项在自受理基金投资人有效赎回申请之日起不超过 7 个工作日内划往管理人汇总清算账户，再由管理人划往赎回人银行账户。在发生巨额赎回时，款项的支付办法按本基金的基金契约有关规定处理。

### 5、申购与赎回的数额限制

代销网点每个账户每次申购的最低金额为 500 元人民币，具体数额请留意当地代销网点；

直销中心每个账户首次申购的最低金额为 10 万元人民币，追加申购的最低

金额为 500 元人民币,已在直销中心有认购本基金记录的投资不受首次申购最低金额的限制;

基金持有人可将其全部或部分基金单位赎回。

#### 6、申购份额与赎回金额的计算方式

##### 申购份额的计算

申购份额= (申购金额—申购费用) ÷T 日基金单位净值

基金单位份额保留小数点后两位。

##### 赎回费和赎回金额的计算

赎回费=赎回份额×赎回日基金单位资产净值×赎回费率

赎回金额=赎回份额×赎回日基金单位资产净值—赎回费

#### 7、申购与赎回的注册登记

投资者申购基金成功后,注册登记机构在 T+1 日为投资者办理增加权益的登记手续,投资者自 T+2 日起起有权赎回该部分基金单位。

投资者赎回基金成功后,注册登记机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益的登记手续。

#### 8、巨额赎回的认定及处理方式

##### 1) 巨额赎回的认定

单个开放日基金赎回申请(有效赎回申请总份额扣除有效申购申请总份额后的余额)超过上一日基金总份额的 10%时,为巨额赎回。

##### 2) 巨额赎回的处理方式

出现巨额赎回时,基金挂你人可以根据本基金当时的资产组合状况结婚搜全额赎回或部分赎回。

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

**部分赎回:**当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难,或认为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金单位资产净值发生较大波动时,基金管理人在当日接受赎回比较不低于上一日基金总份额的 10%的前提下,对其余赎回申请延期办理。赎回份额;未受理部分可延迟至下一个开放日办理。转入第二个开放日的赎回申请不享有优先权并以该开放日的基金单位资产净值为依据计

算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。投资者在申请赎回时可选择将当日为获受理部分予以撤销。

#### 9、拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形处理

在如下情况下，基金挂你人可以拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1) 不可抗力
- 2) 证券交易场所交易时间非正常停市
- 3) 法律、法规规定或经中国证监会批准的其他情形。

在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资人的赎回申请：

- 1) 不可抗力；
- 2) 证券交易所交易时间非正常停市；
- 3) 因市场剧烈波动或其他原因而出现连续巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难时，基金管理人可以暂停接受基金的赎回申请；
- 4) 法律、法规规定或经中国证监会批准的其他情形。

### 十三、基金转换

在同一注册登记机构的前提下，本基金可以转换为本基金管理人管理的其他基金，由于本基金和转入基金的认购、申购、赎回费率结构不一致，需支付的转换费率也由区别，具体转换机转换费率本基金管理人另行公告。

基金管理人在不损害基金持有人利益的情况下可更改上述转换程序及转换费率，并按照有关规定在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上公告。

### 十四、基金交易

经中国证监会批准，本基金可在证券交易所系统发行。通过证券交易所系统认购本基金的基金持有人可按照证券交易所的有关规定，进行本基金的交易。通过直销和代销系统认/申购得本基金，须将基金转托管至国内任意一家证券公司的营业部后，才可在交易所交易。通过证券交易所系统买入的本基金亦可以转托管到本基金的销售代理机构，然后申请赎回。关于本基金在证券交易所系统的交易、分红处理及跨市场转托管等业务将遵循证券交易所和中国证监会登记结算有限责任公司的相关业务规则。

### 十五、基金收益及分配

1、 收益的构成

- 1) 基金投资所得红利、股息、债券利息；
- 2) 买卖证券价差；
- 3) 存款利息；
- 4) 法律、法规、中国证监会及本基金契约规定的其他收入。

2、 收益分配

在符合法定分红条件的前提下，本基金每年至少分红一次；投资者可以选择现金分红或红利再投资方式。

## 十六、基金持有人服务

基金管理人承诺为基金持有人提供一些列的服务，目前主要服务内容如下：

- 1、 持有人注册于过户登记服务
- 2、 定期、定额投资计划
- 3、 资料寄送服务
- 4、 红利再投资服务
- 5、 咨询、查询服务
- 6、 投诉受理

上述内容仅为基金招募说明书摘要，详细资料须以本招募说明书正文所载的内容为准。