



金鹰保本混合型证券投资基金 更新的招募说明书摘要 2013 年第 2 号

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司



【重要提示】

金鹰保本混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据2011年3月23日中国证券监督管理委员会《关于核准金鹰保本混合型证券投资基金募集的批复》（证监许可【2011】436号）和2011年3月31日《关于金鹰保本混合型证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函【2011】196号）进行募集。本基金的基金合同经中国证监会基金监管部于2011年5月17日备案确认（基金部函【2011】315号）后正式生效。

投资有风险, 投资人申购基金时应认真阅读招募说明书及其摘要。

基金的过往业绩并不预示其未来表现, 基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

基金管理人保证本招募说明书及其摘要的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准, 但中国证监会对本基金募集的核准, 并不表明其对本基金的价值和收益做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。

本基金投资于证券市场, 基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动, 投资者在投资本基金前, 应全面了解本基金的产品特性, 充分考虑自身的风险承受能力, 理性判断市场, 并承担基金投资中出现的各类风险, 包括: 因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等等。

本基金为保本混合型基金, 保本周期为三年, 投资者认购并持有到期的基金份额存在着仅能收回本金（即实际净认购金额）的可能性; 未持有到期的基金份额, 投资者赎回或转换出时不能获得保本担保, 将承担市场波动的风险。此外, 投资者投资于保本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构, 如果发生《基金合同》约定的不适用保本条款的情形, 投资者认购并持有到期的基金份额亦存在着无法收回本金的可能性。保本周期到期后, 本基金可能到期终止或转入下一保本周期或根据《基金合同》的约定转为其他类型基金, 到期具体操作以届时公告为准。

投资人购买本基金时应认真阅读本基金的基金合同、担保合同、招募说明书。基金管理人建议投资人根据自身的风险收益偏好, 选择适合自己的基金产品, 并且中长期持有。投资



者购买本基金份额的行为视为同意保证合同的约定。

本招募说明书摘要已经本基金托管人复核。除非另有说明，本招募说明书摘要所载内容截止日为2013年11月17日，有关财务数据截止日为2013年9月30日，净值表现截止日为2013年9月30日，本报告中财务数据未经审计。



一、基金管理人

（一）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：广东省广州市天河区体育西路189号22-23层

设立日期：2002年12月25日

法定代表人：刘东

联系电话：020-83282855

联系人：祝红

注册资本：人民币2.5亿元

股权结构：

股东名称	出资额(万元)	出资比例
广州证券有限责任公司	12250	49%
广州白云山医药集团股份有限公司	5000	20%
广东美的电器股份有限公司	5000	20%
东亚联丰投资管理有限公司	2750	11%
总计	25000	100%

（二）主要人员情况

1、公司董事和监事

刘东先生，董事长，经济学硕士，高级经济师。曾在中国现代国际关系研究所、中国信达信托投资公司驻武汉证券交易中心任职，历任中国信达信托投资公司北京营业部总经理、证券业务总部副总经理，新疆宏源信托投资股份有限公司总经理助理兼证券业务总部总经理，宏源证券股份有限公司党委委员、副总经理，宏源期货有限公司董事长，现任广州证券有限责任公司总经理。经公司第三届董事会第十六次会议选举通过，并报经中国证监会核准，2010年4月起担任公司董事长。



郑德理先生，董事，留美经济学博士，教授，高级经济师。历任广州中山大学管理学院讲师、副教授，美国乔治华盛顿大学助教，美国华盛顿投资咨询公司副研究员，美国世界银行政策研究局转型经济处经济顾问。现任广州证券有限责任公司副总经理、首席经济学家，兼任广州风险投资促进会会长，广州市政协委员，上市公司独立董事等。

王静女士，董事，企业管理硕士。历任广东美的电器股份有限公司资本运营项目助理，资产重组经理，现任广东美的电器股份有限公司资产重组高级专员。

温婉容女士，董事，商科毕业。历任德盛安联资产管理香港有限公司市场及传媒经理、景顺投资管理亚洲有限公司副总裁、德意志资产管理(香港)有限公司区域销售总监、Societe Generale Asset Management Asia Ltd. 高级副总裁、德盛安联资产管理香港有限公司行政总裁、香港财务策划师学会行政总裁等职。2011年7月加入东亚联丰投资管理有限公司，现任东亚联丰投资管理有限公司行政总裁。

陈炳华先生，董事，硕士，会计师。曾任广州药业股份有限公司财务部部长，现任广州药业股份有限公司财务总监。

吴晓球先生，独立董事，国民经济管理学博士。历任江西省余江县商业局秘书、中国人民大学经济研究所主任、中国人民大学财政金融学院副院长、中国人民大学研究生院副院长，现任中国人民大学校长助理、财政金融学院常务副院长、金融与证券研究所所长、教授、博导。

杜金岷先生，独立董事，博士、教授、博士生导师。历任高校讲师、副教授，现任暨南大学教授、暨南大学社会科学研究处处长、副院长，广东中青年经济工作者学会副秘书长，广东经济学会常务理事，中华外国经济学说研究会理事、广东金融学会理事、广州留学归国人员协会理事等。

黄元生先生，独立董事，经济学硕士、副教授、高级会计师。历任中山大学会计教研室主任及会计系副主任，广州市康乐会计师事务所副所长及所长，现任广州万隆康正会计师事务所主任会计师。

颜俊先生，独立董事，法学硕士、法学博士生，资深合伙人、律师。曾为广东华邦世纪律师事务所的创始合伙人、北京市金杜律师事务所资深合伙人。现任安徽国祯环保节能科技股份有限公司独立董事，北京市君泽君律师事务所资深合伙人。

刘晓东先生，监事，工商管理硕士。曾任深圳市审计局主任科员，招商银行总行稽核部高级审计师，鹏华基金管理有限公司监察稽核部副总监，现任金鹰基金管理有限公司监察稽核部总监。

曾巧女士，监事，管理学学士。历任佛山会计师事务所审计助理、美的集团审计部审计



经理、美的集团审计监察部副部长，现任美的集团审计监察部总监。

姚万义先生，监事，大学本科。历任中共北京市纪律检查委员会北京市监察局办公厅主任、副局长、常委等职，中国证监会北京证管办副主任、巡视员等职，现任北京证券业协会顾问。

2、公司高级管理人员

殷克胜先生，总经理，经济学博士。曾在综合开发研究院（中国深圳）、深圳市体改办任职，历任深圳证监局法规处副处长、上市公司处处长，鹏华基金管理有限公司董事、常务副总经理，方正证券有限责任公司基金公司筹备组组长等职。经公司第三届董事会第十六次会议选举通过，并报经中国证监会核准，2010年4月起担任公司总经理。

刘葆先生，副总经理，经济学博士，副教授。历任深圳国资经营公司（商贸控股）资产经营部总经理助理，上海复旦大学博士后流动站（金融研究方向）博士后研究员，深圳华强集团资本经营部副部长，广州越秀集团资本经营部副经理，广州证券有限责任公司总经理助理兼资产管理总部总经理，金鹰基金管理有限公司总经理助理等职。经公司第二届董事会第二十一次会议审议通过，并报经中国证监会核准，2008年12月起担任公司副总经理。

郭容辰女士，副总经理，法律硕士。历任交通银行深圳分行公司业务部科长、交通银行深圳华富支行行长助理、交通银行深圳福田支行行长、交通银行深圳分行个人金融部总经理、零售信贷管理部总经理、华夏银行深圳分行个人业务部总经理等职。经公司第三届董事会第十九次会议审议通过，并报经中国证监会核准，2010年10月起担任公司副总经理。

苏文锋先生，督察长，经济学硕士。历任广州市经济管理干部学院外贸经济系党支部书记，南方证券广州分公司研究发展部总经理，南方证券广州分公司大德路营业部总经理，南方证券广州分公司办公室主任，南方证券广州分公司投资银行部总经理，华鼎担保投资有限公司副总经理等职，金鹰基金管理有限公司市场拓展部副总监等职。经公司第二届董事会第二十一次会议审议通过，并报经中国证监会核准，2008年9月起担任公司督察长。

3、本基金基金经理

邱新红（XINHONG QIU），卡内基梅隆大学计算金融专业硕士，南京大学物理系应用物理专业学士，证券从业经历10年。曾任职于美国太平洋投资管理公司（PIMCO），担任投资组合经理助理。2008年3月到2010年6月担任Bayview资产管理公司的投资经理，负责债券投资组合管理。2010年8月加入金鹰基金管理有限公司，现任固定收益部总监，兼任本基金、金鹰持久回报分级债券型证券投资基金、金鹰元丰保本混合型证券投资基金、金鹰元盛分级债券型发起式证券投资基金以及金鹰元安保本混合型证券投资基金基金经理。

洪利平女士，西南财经大学金融学硕士毕业，证券从业经历4年。洪利平女士曾任职于



生命人寿保险股份有限公司，任债券交易员。2010 年 7 月加入金鹰基金管理公司任债券研究员，现任本基金、金鹰元丰保本混合型证券投资基金以及金鹰货币市场证券投资基金基金经理。

4、固定收益投资决策委员会成员

本基金采取集体投资决策制度，固定收益投资决策委员会成员有：

殷克胜先生，固定收益投资决策委员会主席，总经理；

邱新红先生，固定收益投资决策委员会委员，固定收益部总监，基金经理；

杨绍基先生，固定收益投资决策委员会委员，首席投资官，基金经理；

杨刚先生，固定收益投资决策委员会委员，研究发展部总监；

林昆先生，固定收益投资决策委员会委员，集中交易部部副总监。

5、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

本基金之基金托管人为中国工商银行股份有限公司，基本情况如下：

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号，邮编：100140

成立时间：1984年1月1日

法定代表人：姜建清

注册资本：人民币349,018,545,827元

联系电话：010-66105799

联系人：赵会军

三、基金担保人

名称：广州国际集团有限公司

住所：广州市越秀区东风中路509号建银大厦25楼，邮政编码：510045

注册地址：广州市越秀区东风中路509号建银大厦25楼

法定代表人：关易波

成立日期：2001年12月6日



注册资本： 20亿元人民币

联系人：常文彦

联系电话：(020) 83606813/15/52/52—2015

组织形式：有限责任公司（国有独资）

经营范围：对授权范围内的国有资产的经营管理

四、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

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：广东省广州市天河区体育西路 189 号城建大厦 22-23 层

法定代表人：刘东

总经理：殷克胜

成立时间：2002 年 12 月 25 日

批准设立机关及批准设立文号：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：2.5 亿元人民币

存续期间：持续经营

联系人：潘晓毅

联系电话：020-83282950

传真电话：020-83283445

客户服务及投诉电话：4006-135-888

电子邮箱：csmail@gefund.com.cn

网址：www.gefund.com.cn

2、代销机构（排名不分先后）

（1）名称：中国工商银行股份有限公司

注册（办公）地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清



联系人：王俭

电话：010-66107900

客服电话：95588（全国）

网址：www.icbc.com.cn

（2）名称：中国银行股份有限公司

注册（办公）地址：北京市复兴门内大街 1 号

法定代表人：田国立

联系人：宁敏

电话：010-66594977

客服电话：95566（全国）

网址：www.bankofchina.com

（3）名称：交通银行股份有限公司

注册（办公）地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

电话：（021）58781234

联系人：曹榕

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

（4）名称：中信银行股份有限公司

注册（办公）地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：常振明

联系人：郭伟

电话：010-65557048

客服电话：95558（全国）

网址：bank.ecitic.com

（5）名称：中国民生银行股份有限公司

注册（办公）地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：董文标

联系人：董云巍

电话：010-58351666

客服电话：95568（全国）



网址: www.cmbc.com.cn

(6) 名称: 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址: 上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址: 上海市中山东一路 12 号

法定代表人: 吉晓辉

联系人: 虞谷云

电话: 021-61618888

客服电话: 95528 (全国)

网址: www.spdb.com.cn

(7) 名称: 广东顺德农村商业银行股份有限公司

注册(办公)地址: 佛山市顺德区大良德和居委会拥翠路 2 号

法定代表人: 吴海恒

联系人: 何浩华

联系电话: 0757-22388928

客服电话: 0757-22223388

网址: www.sdebank.com

(8) 名称: 宁波银行股份有限公司

注册(办公)地址: 宁波市江东区中山东路 294 号

法定代表人: 陆华裕

联系人: 胡技勋

电话: 021-63586210

客服电话: 96528 (上海地区 962528)

网址: www.nbcb.com.cn

(9) 名称: 平安银行股份有限公司

注册(办公)地址: 深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦

法定代表人: 孙建一

联系人: 蔡宇洲

电话: 0755-22197874

客服电话: 4006699999

网址: bank.pingan.com

(10) 名称: 东莞农村商业银行股份有限公司



注册（办公）地址：东莞市南城路2号

法定代表人：何沛良

联系人：黄飞燕

电话：0769-23394102

客服电话：0769—961122

网址：www.dgrcc.com

（11） 名称：华夏银行股份有限公司

注册（办公）地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴建

联系人： 郑鹏

联系电话：010-85238667

客服电话：95577

网址：www.hxb.com.cn

（12） 名称：浙江民泰商业银行股份有限公司

注册（办公）地址：浙江省温岭市三星大道 168 号

法定代表人：江建法

联系人： 刘兴龙

电话：0576-86109521

客服电话：96521 省外客服电话：4008896521

网址：www.mintaibank.com

（13） 名称：成都农村商业银行股份有限公司

注册（办公）地址：四川省成都市武侯区科华中路 88 号

法定代表人：陈萍

联系人：张海涛

电话：028-85190961

客服电话：4006-028-666

网址：www.cdrcb.com

（14） 名称：江苏江南农村商业银行股份有限公司

注册（办公）地址：常州市天宁区延陵中路668号

法定代表人：陆向阳

联系人：韩璐



联系电话：0519-89995066

客服电话：96005（全国）

网址：http://www.jnbank.cc/zh_CN/

（15）名称：包商银行股份有限公司

注册（办公）地址：内蒙古包头市钢铁大街 6 号

法定代表人：李镇西

联系人：刘芳

联系电话：0472-5109729

客服电话：96016(内蒙、北京)，967210(深圳、宁波)，65558555(成都)

网址：www.bsb.com.cn

（16）名称：浙江稠州商业银行股份有限公司

注册地址：浙江省义乌市江滨路义乌乐园东侧

办公地址：浙江省杭州市延安路 128 号

法定代表人：金子军

联系人：张予多

联系电话：(0571) 96527

客服电话：(0571) 96527

网址：www.czcb.com.cn

（17）名称：广州证券有限责任公司

注册（办公）地址：广东省广州市珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心19-20楼

法定代表人：刘东

联系人：林洁茹

联系电话：020-88836999

客服电话：020-961303

网址：www.gzs.com.cn

（18）名称：国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市银河中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：万建华

联系人：芮敏琪

电话：021-38676666-6161



客服电话：95521（全国）

网址：www.gtja.com

（19） 名称：中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 2-6 层

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：顾伟国

联系人：田薇

电话：010-66568430

客服电话：4008888888

网址：www.chinastock.com.cn

（20） 名称：海通证券股份有限公司

注册（办公）地址：上海市淮海中路 98 号

法定代表人：王开国

联系人：王立群

电话：021-23219286

客服电话：95533（全国）、4008888001

网址：www.htsec.com

（21） 名称：广发证券股份有限公司

注册（办公）地址：广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄兰

电话：020-87555888-333

客服电话：95575（全国）

网址：www.gf.com.cn

（22） 名称：国信证券股份有限公司

注册（办公）地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

联系人：周洋

电话：0755-82133066

客服电话：95536（全国）

网址：www.guosen.com.cn



(23) 名称: 招商证券股份有限公司

注册(办公)地址: 深圳福田区益田路江苏大厦 38-45 层

法定代表人: 宫少林

联系人: 林生迎

电话: 0755-82960223

客服电话: 95565 (全国)、4008888111

网址: www.newone.com.cn

(24) 名称: 光大证券股份有限公司

注册地址: 上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址: 上海市浦东新区浦东南路 528 号上海证券大厦南塔 16 楼

法定代表人: 袁长清

联系人: 李芳芳

电话: 021-22169089

客服电话: 95525 (全国)、4008888788

网址: www.ebscn.com

(25) 名称: 中信万通证券有限责任公司

注册地址: 青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层 (1507-1510 室)

办公地址: 青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人: 张智河

联系人: 吴忠超

电话: 0532-85022326

客服电话: 0532-96577

网址: www.zxwt.com.cn

(26) 名称: 安信证券股份有限公司

注册(办公)地址: 深圳市福田区金田路 2222 号安联大厦 34 层、28 层 A02 单元

法定代表人: 牛冠兴

联系人: 郑向溢

电话: 0755-82558038

客服电话: 4008001001

网址: www.essence.com.cn

(27) 名称: 中国中投证券有限责任公司



注册（办公）地址：深圳福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 座 18-21 层

法定代表人：龙增来

联系人：范雪玲

电话：0755-82023431

客服电话：4006008008

网址：www.cjis.cn

（28） 名称：平安证券有限责任公司

注册（办公）地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

法定代表人：杨宇翔

联系人：袁月

电话：0755-22627802

客服电话：4008816168

网址：www.stock.pingan.com

（29） 名称：湘财证券有限责任公司

注册地址：湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴 958 号华能联合大厦 5 楼

法定代表人：林俊波

联系人：鲁雁先

电话：021-68865020

客服电话：4008881551、021-38784525

网址：www.xcsc.com

（30） 名称：国元证券股份有限公司

注册（办公）地址：合肥市寿春路 179 号国元大厦

法定代表人：凤良志

联系人：李蔡

电话：0551-2272101

客服电话：95578（全国）

网址：www.gyzq.com.cn

（31） 名称：宏源证券股份有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号

办公地址：新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号宏源大厦



北京市西城区太平桥大街 19 号

法定代表人：冯戎

联系人：李巍

电话：010-88085338

客服电话：4008000562

网址：www.hysec.com

(32) 名称：国盛证券有限责任公司

注册地址：江西省南昌市永叔路 15 号

办公地址：江西省南昌市永叔路 15 号信达大厦 10-13 楼

法定代表人：管荣升

联系人：徐美云

电话：0791-6285337

客服电话：0791-6272572

网址：www.gsstock.com

(33) 名称：山西证券股份有限公司

注册（办公）地址：山西省太原市府西街 69 号国际贸易中心

法定代表人：侯巍

联系人：孟婉婷

电话：0351-8686703

客服电话：4006661618

网址：www.i618.com.cn

(34) 名称：财通证券有限责任公司

注册（办公）地址：浙江省杭州市解放路 111 号金钱大厦

法定代表人：沈继宁

联系人：乔骏

电话：0571-87925129

客服电话：0571-96336（上海地区 962336）

网址：www.ctsec.com

(35) 名称：万联证券有限责任公司

注册（办公）地址：广州市中山二路 18 号电信广场 36-37 层

法定代表人：张建军



联系人：罗创滨

电话：020-37865070

客服电话：4008888133

网址：www.wlzq.com.cn

(36) 名称：东莞证券有限责任公司

注册（办公）地址：广东省东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

法定代表人：张运勇

联系人：苏卓仁

电话：0769-22112062

客服电话：0769-961130

网址：www.dgzq.com.cn

(37) 名称：西南证券股份有限公司

注册（办公）地址：重庆市渝中区临江支路 2 号合景国际大厦 A 幢

法定代表人：余维佳

联系人：米兵

电话：023-63786922

客服电话：4008096096

网址：www.swsc.com.cn

(38) 名称：东吴证券股份有限公司

注册（办公）地址：苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦

法定代表人：吴永敏

联系人：方晓丹

电话：0512-65581136

客服电话：0512-96288

网址：www.dwzq.com.cn

(39) 名称：申银万国证券股份有限公司

注册（办公）地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：储晓明

联系人：曹晔

电话：021-54047892

客服电话：021-962505



网址: www.sywg.com

(40) 名称: 长江证券股份有限公司

注册(办公)地址: 湖北省武汉市江汉区新华路特 8 号

法定代表人: 胡运钊

联系人: 李良

电话: 021-63219781

客服电话: 4008888999

网址: www.cjsc.com.cn

(41) 名称: 齐鲁证券有限公司

注册(办公)地址: 山东省济南市经十路 20518 号

法定代表人: 李玮

联系人: 傅咏梅

电话: 0531-87107718

客服电话: 95538 (全国)

网址: www.qlzq.com.cn

(42) 名称: 国联证券股份有限公司

注册(办公)地址: 无锡市县前东街 168 号

法定代表人: 雷建辉

联系人: 徐欣

电话: 0510-82831662

客服电话: 4008885288、0510-82588168

网址: www.glsc.com.cn

(43) 名称: 爱建证券有限责任公司

注册(办公)地址: 上海市南京西路 758 号 23 楼

法定代表人: 郭林

联系人: 陈敏

电话: 021-32229888

客服电话: 021-63340678

网址: www.ajzq.com

(44) 名称: 中国国际金融有限公司

注册(办公)地址: 北京建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层



法定代表人：金立群

联系人：黄峻敏

电话：0755-83196491

客服电话：010-65051166

网址：www.cicc.com.cn

(45) 名称：财富证券有限责任公司

注册（办公）地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 层

法定代表人：孙郑勇

联系人：郭蕾

电话：0731-84403319

客服电话：0731-84403350

网址：www.cfzq.com

(46) 名称：信达证券股份有限公司

注册（办公）地址：北京市西城区三里河东路 5 号中商大厦 10 层

法定代表：张志刚

联系人：唐静

电话：010-63080985

客服电话：4008008899

网址：www.cindasc.com

(47) 名称：华福证券有限责任公司

注册（办公）地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

法定代表：黄金琳

联系人：张腾

电话：0591-87383623

客服电话：0591-96326

网址：www.gfhfzq.com.cn

(48) 名称：方正证券股份有限公司

注册（办公）地址：湖南长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

法定代表人：雷杰

联系人：邵艳霞

电话：0731-85832507



客服电话：95571（全国）

网址：www.foundersc.com

（49） 名称：中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

办公地址：北京市朝阳区新源南路 6 号京城大厦 3 层

法定代表人：王东明

联系人：陈忠

电话：010-84683893

客服电话：0755-83478806 等

网址：www.cs.ecitic.com

（50） 名称：长城证券有限责任公司

注册（办公）地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：黄耀华

联系人：匡婷

电话：0755-83516289

客服电话：4006666888

网址：www.cgws.com

（51） 名称：财达证券有限责任公司

注册（办公）地址：河北省石家庄市自强路 35 号庄家金融大厦 23 层

法定代表人：翟建强

联系人：胡士光

电话：0311-66006403

客服电话：4006128888

网址：www.s10000.com

（52） 名称：世纪证券有限责任公司

注册（办公）地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 41 楼

法定代表人：卢长才

联系人：张婷

电话：0755-83199599-8246

客服电话：0755-83199599

网址：www.csc.com.cn



(53) 名称: 华龙证券有限责任公司

注册(办公)地址: 甘肃省兰州市静宁路 308 号

法定代表人: 李晓安

联系人: 李昕田

电话: 0931-4890208

客服电话: 0931-8888088 等

网址: www.hlzqgs.com

(54) 名称: 华泰证券股份有限公司

注册(办公)地址: 江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人: 吴万善

联系人: 程高峰、万鸣

电话: 025-83290979

客服电话: 95597

网址: www.htsc.com.cn

(55) 名称: 天风证券股份有限公司

注册(办公)地址: 湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼

法定代表人: 余磊

联系人: 陈璐

电话: 027-87618882

客服电话: 027-87618882

网址: www.tfzq.com

(56) 名称: 华安证券股份有限公司

注册地址: 合肥市长江中路 357 号

办公地址: 合肥市阜南路 166 号

法定代表人: 李工

联系人: 甘霖

电话: 0551-5161821

客服电话: 96518、4008-096-518

网址: www.hazq.com

(57) 名称: 民生证券股份有限公司

注册地址: 北京市朝阳区朝阳门外大街 16 号 1901 室



办公地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16 层

法定代表人：岳献春

联系人：赵明

电话：010-85127622

客服电话：400-619-8888

网址：www.msza.com

(58) 名称：国都证券有限责任公司

注册（办公）地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人：常喆

联系人：黄静

电话：010-84183389

客服电话：400-818-8118

网址：www.guodu.com

(59) 名称：华创证券有限责任公司

注册（办公）地址：贵州省贵阳市中华北路 216 号华创大厦

法定代表人：陶永泽

联系人：陈文静

联系电话：0851-8596285

客服电话：960872

网址：www.hczq.com

(60) 名称：红塔证券股份有限公司

注册（办公）地址：云南省昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼

法定代表人：况雨林

联系人：刘晓明

电话：0871-3577942

客服电话：0871-3577888

网址：www.hongtastock.com

(61) 名称：英大证券有限责任公司

注册（办公）地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层

法定代表人：赵文安

联系人：王睿



联系电话：0755-83007069

客服电话：4008-698-698

网址：www.ydsc.com.cn

(62) 名称：天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 4 层

法定代表人：林义相

联系人：莫晓丽

电话：010-66045529

客服电话：010-66045678

网址：www.txsec.com

(63) 金元证券股份有限公司

注册地址：海口市南宝路 36 号证券大厦 4 楼

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心大厦 17 楼

法定代表人：陆涛

联系人：马贤清

联系电话：0755-83025022

客服电话：4008-888-228

网址：www.jyzq.cn

(64) 名称：五矿证券有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心办公楼 47 层 01 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心 49 层

法定代表人：张永衡

联系人：高克南

联系电话：0755-82545707

客服电话：40018-40028

网址：www.wkzq.com.cn

(65) 名称：中航证券有限公司

注册（办公）地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷大道1619号

国际金融大厦 A 座 41 楼

法定代表人：王宜四



联系人：余雅娜

电话：0791-6768763

客服电话：400-8866-567

网址：www.avicsec.com

(66) 名称：江海证券有限公司

注册（办公）地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人：孙名扬

联系人：高悦铭

联系电话：0451-82337802

客服电话：400-666-2288

网址：www.jhzq.com.cn

(67) 名称：东海证券有限责任公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18、19 号楼

办公地址：上海浦东新区东方路 989 号中达广场

法定代表人：朱科敏

联系人：霍晓飞

电话：021-50586660-8644

客服电话：400888588、0519-88166222（常州地区）、021-52574550（上海地区）、

0379-64902266（洛阳地区）

网址：www.longone.com.cn

(68) 名称：日信证券有限责任公司

注册（办公）地址：内蒙古自治区内蒙古呼和浩特市锡林南路 18 号

法定代表人：孔佑杰

联系人：陈韦杉

联系电话：010-88086830

客服电话：010-88086830

网址：www.rxzq.com.cn

(69) 名称：浙商证券股份有限公司

注册（办公）地址：浙江杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A—6 / 7 楼

法定代表人：吴承根

联系人：许嘉行



联系电话：0571-87901912

客服电话：0571-967777

网址： www.stocke.com.cn

(70) 名称：华宝证券有限责任公司

注册（办公）地址：上海市陆家嘴环路未来资产大厦 27 层

法定代表人：陈林

联系人：宋歌

联系电话：021-50122086

客服电话：021-38929908、 400-820-9898

网址：www.cnhbstock.com

(71) 名称：国海证券股份有限公司

注册（办公）地址：广西南宁市滨湖路 46 号

法定代表人：张雅锋

联系人：牛孟宇

电话：0755-83709350

客服电话：95563

网址：www.ghzq.com.cn

(72) 名称：中信证券（浙江）有限责任公司

注册（办公）地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19-20 层

法定代表人：沈强

联系人：丁思聪

电话：0571-87112510

客服电话：96598

网址：www.bigsun.com.cn

(73) 名称：新时代证券有限责任公司

注册（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：刘汝军

联系人：孙恺

电话：010-83561149

客服电话：4006-989898

网址：www.xsdzq.cn



(74) 名称: 中信建投证券股份有限公司

注册地址: 北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址: 北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人: 张佑君

联系人: 权唐

电话: 010-85130577

客服电话: 4008888108

网址: www.csc108.com

(75) 名称: 深圳众禄基金销售有限公司

办公(办公)地址: 深圳市深南东路 5047 号发展银行大厦 25 层 I、J 单元

法定代表人: 薛峰

联系人: 张玉静

电话: 0755-33227953

客服电话: 4006-788-887

网址: 众禄基金网 (www.zlfund.cn)、基金买卖网 (www.jjmmw.com)

(76) 名称: 上海好买基金销售有限公司

注册地址: 上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址: 上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

法定代表人: 杨文斌

联系人: 蒋章

电话: 021-58870011-6618

客服电话: 400-700-9665

网址: 好买基金网 (www.ehowbuy.com)

(77) 名称: 杭州数米基金销售有限公司

注册地址: 杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号

办公地址: 浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号 12 层

法定代表人: 陈柏青

联系人: 周璵旻

电话: 0751-28829790

客服电话: 4000-766-123、0571-28829123

网址: 数米基金网 (www.fund123.cn)



(78) 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: 上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人: 张跃伟

联系人: 沈雯斌

电话: 021-58788678-8201

客服电话: 400-089-1289

网址: 长量基金销售网(www.erichfund.com)

(79) 名称: 浙江同花顺基金销售有限公司

办公(办公)地址: 浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903

法定代表人: 李晓涛

联系人: 杨翼

电话: 0571-88911818

客服电话: 0571-88920897

网址: 同花顺基金销售网(www.ijijin.cn)

(80) 名称: 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司

注册地址: 上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室

办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴银城中路68号时代金融中心8楼801

法定代表人: 汪静波

联系人: 方成

电话: 021-38602377

客服电话: 400-821-5399

网址: www.noah-fund.com

(81) 名称: 北京展恒基金销售有限公司

注册地址: 北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址: 北京市朝阳区德胜门外华严北里 2 号民建大厦 6 层

法定代表人: 闫振杰

联系人: 李二钢

电话: 010-85188234

客服电话: 400-888-6661

网址: 展恒基金理财平台(www.myfund.com)



(82) 名称: 上海天天基金销售有限公司

注册地址: 浦东新区峨山路 613 号 6 幢 551 室

办公地址: 上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼

法定代表人: 其实

联系人: 潘世友

电话: 021-54509998

客服电话: 400-1818-188

网址: 天天基金网 (www.1234567.com.cn)

(83) 名称: 中期时代基金销售(北京)有限公司

办公地址: 北京市朝阳区建国门外光华路 16 号 1 幢 11 层

法定代表人: 路瑶

联系人: 徐亮

电话: 010-59539955

客服电话: 95162 或 4008888160

网址: 中期金融超市(www.cifcofund.com)

(84) 名称: 万银财富(北京)基金销售有限公司

注册地址: 北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 3201 内 3201 单元

办公地址: 北京朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 3201

法定代表人: 李招弟

联系人: 高晓芳

联系电话: 010-59393923-811

客服电话: 400-808-0069

网址: www.wy-fund.com

(85) 名称: 和讯信息科技有限公司

办公地址: 北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 1002 室

法定代表人: 王莉

联系人: 李延鹏

电话: 0755-82721122-8625

客服电话: 400-920-0022

网址: 和讯理财客 (<http://licaike.hexun.com>)

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代理销售本基金,



并及时公告。

（二）注册登记机构

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：广东省广州市天河区体育西路 189 号城建大厦 22-23 层

法定代表人：刘东

电话：020-83284983

传真：020-83282856

联系人：傅军

（三）律师事务所和经办律师

名称：广东岭南律师事务所

办公地址：广州市新港西路 135 号中山大学西门科技园 601-605 室

法定代表人：黄添顺

电话：020-84035397

传真：020-84113152

经办律师：江亚芳、陈进学、王欢

（四）会计师事务所和经办注册会计师

名称：立信会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市黄浦区南京东路 61 号四楼

法定代表人：朱建弟

电话：021-63391166

邮编：200002

经办注册会计师：张宁、刘国棣

五、基金的名称

本基金名称：金鹰保本混合型证券投资基金

本基金简称：金鹰保本混合

本基金代码：210006



六、基金的类型

本基金类型：契约型开放式

七、基金的保本

（一）保本周期

3年。

本基金的第一个保本周期自《基金合同》生效之日起至3个公历年后对应日止。如果该对应日为非工作日，保本周期到期日顺延至下一个工作日。

第一个保本周期届满时，在符合保本基金存续条件下（担保人或基金管理人认可的其他符合条件的担保人或保本义务人为本基金下一保本周期提供保本保障，与基金管理人就本基金下一保本周期签订担保合同或风险买断合同，同时本基金满足法律法规和《基金合同》规定的基金存续要求），本基金继续存续并进入下一保本周期，该保本周期的具体起讫日期以本基金管理人届时公告为准。

（二）适用保本条款的情形

1、基金份额持有人认购并持有到期的基金份额。

2、对于认购并持有到期的份额，基金份额持有人无论选择赎回、转换为基金管理人管理的其他基金、本基金转入下一保本周期或是转型为“金鹰持续收益债券型证券投资基金”，均适用保本条款。

八、基金保本的担保

为确保履行保本条款，保障基金份额持有人利益，本基金由广州国际集团有限公司作为担保人。

九、基金的投资

（一）投资范围

本基金投资于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（包括中小板、



创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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)。股票、权证占基金净资产的比例为0%~40%,其中,权证投资的比例范围占基金资产净值的0%~3%;债券、资产支持证券、货币市场工具、现金、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占基金净资产的60%~100%,其中,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。此外,在基金合同和法律法规的允许范围内,本基金将积极参与一级市场新股、新债的申购。

(二) 投资策略

1、投资策略依据

(1)“自上而下”为主,“自下而上”为辅本基金的可投资标的基本上可以划分为三大类——债券类、权益类、货币类,名义利率是影响上述三大类资产收益与风险的关键变量之一,故而,利率预测的重要性不言而喻。本基金运作过程当中的第二个关键变量是投资组合的加权平均久期,在其他条件不变的情况下,加权平均久期越长,则投资组合收益率的利率敏感性越大。

短期名义利率的预测、加权平均久期的确定,都离不开“自上而下”的分析视角。所谓“自上而下”,是指基金管理人在审慎分析宏观经济运行状况、货币政策、财政政策运行趋势的基础上,通过定量与定性相结合的方法,对利率尤其是中短期利率的变化趋势进行预测,根据预测结果,决定本基金组合在各类属资产(债券与央票,股票,现金、存款、回购)上的配置比例、期限结构与品种构成。而“自下而上”是指当某一类资产的投资收益率持续上升或下降时,本基金将审慎研判:此种上升或下降是否有基本面因素的支持,是否可持续。如果研判的结果认为该类资产投资收益率持续上升或下降具有基本面因素的支撑,可持续,本基金将“自下而上”地重新调整个券、类属资产、大类资产的配置比例与期限结构。

(2) 本金安全性与流动性优先, 兼顾收益性

就保本基金份额持有人的风险偏好而言,大致可分为两类:风险偏好程度很低的投资者与风险偏好程度较高的投资者。风险偏好程度很低的投资者购买保本基金之目的在于:在确保本金的安全性的同时,获取稳健的投资收益;风险偏好程度较高的投资者购买保本基金之目的在于:规避其他高风险资产在较长时段内的持续下跌风险。

显然,对于以上两类投资者而言,保本基金资产本金的安全性与流动性是第一位的,收益性是第二位的。为此,本基金坚持本金安全性与流动性优先、兼顾收益性的投资原则。

2、保本策略

在投资组合管理过程中,本基金采取主动投资的方法,发挥定量分析的决策辅助作用,



以期提高投资决策的科学性与及时性，在控制风险的前提下，追求基金资产的稳健增值。本基金的保本策略为改进的固定比例组合保险策略（CPPI），改进的固定比例组合保险策略是本基金在传统固定比例组合保险策略的基础上经过改进而得的投资组合保险策略，是本基金投资运作过程中的核心策略。该策略根据基金净资产、价值底线，宏观经济与资本市场运行状况、固定收益类与权益类资产风险收益特性，灵活动态地选取适当的风险乘数，以期对固定收益类与权益类资产之间的配置比例进行优化调节。

3、资产配置策略

（1）风险资产与安全资产的配置

风险乘数在很大程度上决定了风险资产与固定收益类资产的配置额，故而，本基金将风险乘数的设定作为风险资产（以权益类资产为代表）与安全资产（以固定收益类资产为代表）配置的关键变量。

本基金采用“自上而下”的投资视角，根据宏观经济与资本市场运行状况、固定收益类与权益类资产风险收益特性、基金净资产、价值底线，定性分析与定量分析并用，灵活动态地选取适当的风险乘数，以期对固定收益类与权益类资产之间的配置额进行优化调节，力争在确保本金安全的前提下，获取投资收益。

（2）大类资产的配置策略

本基金结合国内外政治经济环境，政策形势，金融市场走势（尤其是未来利率的变化趋势），分析判断市场时机，合理确定基金在债券、股票、货币等资产类别上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时动态地调整本基金投资于债券、股票、货币市场工具的比例与期限结构。

（3）债券类资产的配置策略

为实现保本期结束时的本金保障目标，本基金债券类资产中相当大一部分将会采取买入并持有的策略；对于此类配置，债券的信用风险、到期收益率、以及剩余期限是否与剩余保本期匹配等因素将着重考虑。同时为了保证基金的流动性并追求更高的收益，本基金债券类资产的一小部分将采取主动灵活的配置策略，积极布局于各类债券资产，以追求更高的收益率。

（4）存款类资产的配置策略

根据宏观经济所处投资时钟的象限、名义利率的运行趋势，债券市场、股票市场的运行情况，本基金申购赎回的情况，各期限货币的流动性、收益率的变化，确定本基金配置在现金、活期存款及1年期以下定期存款（含1年期），1年期以上的定期存款上的资金量占货币类资产总量的相对比例。



在确定各期限货币类资产配置的相对比例时，必须对基金投资组合的流动性进行严格的压力测试，根据压力测试的结果，制定审慎的配置方案，并随着前述决策变量的变化，实时动态地调整配置比例，严格控制货币资产的加权平均剩余期限。

（5）债券品种选择

由于货币类资产的品种选择相对简单，故而，此处集中分析债券类资产的品种选择。

本基金对于债券品种的选择坚持如下原则：非政策性银行所发行的金融债、企业债与公司债（无论是否含权）、资产支持证券、短期融资券在进入债券二级重点库、债券一级重点库之前都必须进行严格的内部评级。

（6）股票资产的配置策略

①股票一级市场申购策略

本基金可参与一级市场新股申购或增发。本基金将利用公司自主开发的“金鹰行业评价模型”、“金鹰企业评价模型”，对新股所属行业属性与成长空间、新股的基本面做出定量分析，采用适当的估值模型对新股的投资价值进行评估，结合二级市场的平均估值水平、并参考类似新股上市之后的平均溢价率，给出合理的询价；根据新股发行价，估算新股上市后的合理定价；根据二级市场的运行情况、新股发行的频度、近期参与一级市场新股申购的平均资金规模、拟参与申购的新股之实际发行规模，估计中签率，并据此测算该次新股申购的预期收益率，作出是否参与该次新股申购的决定。

②股票二级市场投资策略

A、进取与防御的抉择

本基金根据宏观经济与资本市场的运行状况，判断所处投资时钟的象限，作出防御或者进取的抉择。在“衰退”象限且政府已采取扩张性政策或预期将采取扩张性政策的情况下，“复苏”象限，“过热”象限但政府并未采取紧缩性政策并预期在短期内不会采取紧缩性政策的情况下，采取进取优先的策略；在“过热”象限且政府已采取紧缩性政策或预期将采取紧缩性政策的情况下，采取进取与防御并重的策略；在投资时钟的“过热”象限且政府紧缩性政策的力度不断加大，在投资时钟的“滞胀”象限并预期宏观经济将进一步滑向“衰退”象限的情况下，或股票市场的估值水平已呈现下行的趋势以修复其“高估”状态并预期估值的此种下行趋势仍将持续的情况下，采取防御优先的策略。

B、行业配置

确定了防御或者进取的投资取向之后，本基金审慎遴选重点配置的行业——根据进取优先的策略，本基金将重点配置强周期行业、高贝塔值的行业；根据防御优先的策略，本基金将重点配置弱周期行业、生活必需品行业、生物医药行业；根据防御与进取并重的策略，本



基金将在强周期与弱周期行业、高贝塔值与低贝塔值的行业之间寻求某种程度的折衷与平衡，随着宏观经济逐渐由“过热”象限滑向“滞胀”象限，投资组合渐近地偏向弱周期行业、低贝塔值行业、生活必需品行业、医药生物行业。

本公司自主开发了“金鹰行业评价模型”，该模型为本基金的行业配置提供定量化依据，避免了行业配置的盲目性与随意性。

C、风格追踪

本基金将密切追踪股票市场风格（大盘股与中小盘股、成长股与价值股、低价股与高价股、低PB与高PB）的切换与板块（地理区域板块、投资类与消费类板块）的轮动，随着市场行情风格的转换与板块的轮动，适时、适度地调整投资组合的行业配置、板块构成与风格特征。

D、个股选择

基于行业配置策略与市场行情风格，本基金在各行业内遴选相应的投资标的。

根据防御原则，本基金将审慎甄别公司的核心价值，从公司治理、公司战略、行业地位等方面审视公司核心竞争力，通过自下而上的研究，以基本面分析为核心，力求挖掘出具有核心竞争力的稳健经营、价值低估型公司。

根据进取原则，本基金将努力发掘那些可持续、可预见的成长型公司，重点在于对公司成长性的客观评价和比较上，不仅仅需要关注增长率之类的数量指标，同时还要关注成长的质量以及成长的可持续性。

为了对个股的基本面情况与投资价值进行综合评价，本公司建立了“金鹰企业评价模型”，该模型可为本基金的个股选择提供定量化依据，避免了个股选择的盲目性与随意性。

另外，对行情风格的密切追踪，可为个股选择提供新的视角，有利于提升个股选择的有效性。

4、业绩比较基准

3年期银行定期存款利率（税后）

在基金合同生效日，业绩比较基准为中国人民银行公布的、该日适用的3年期银行定期存款利率（税后）；并随着3年期银行定期存款利率的调整而动态调整。

本基金选择3年期银行定期存款利率（税后）作为业绩比较基准，主要理由是：（1）与本基金的保本期相同。本基金的保本期为3年，对于认购本基金的投资者而言，将持有到保本期结束时的收益率与另一个可替代的投资方向——3年期银行定期存款的利率（税后）相比较，可以反映出二者之间的优劣；（2）定期存款利率（税后）为投资者投资于定期存款实际可获得的收益率，将其作为本基金的业绩比较基准，有助于本基金份额的持有人理性地判



断本基金的风险收益特性，准确地理解本基金本金保证的有效性。

随着市场环境的变化，如果上述业绩比较基准不适用本基金时，本基金管理人可以从维护基金份额持有人合法权益的原则出发，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，报中国证监会备案，基金管理人应在调整前3个工作日在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。

5、风险收益特征

本基金为积极配置的保本混合型基金，属于证券投资基金当中的低风险品种，其长期平均风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的债券型基金，但高于货币市场基金。

（三）投资禁止行为与限制

1、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- （1）承销证券；
- （2）向他人贷款或提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）买卖其他基金份额，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；
- （5）向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或债券；
- （6）买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- （7）从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- （8）当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

2、基金投资组合比例限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

- （1）本基金保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；
- （2）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的10%；
- （3）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%；
- （4）本基金持有的债券其信用级别不低于BBB级；
- （5）本基金进入全国银行间同业市场进行债券正回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%；



(6) 本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

(7) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的0.5%；本基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定；

(8) 本基金应投资于信用级别评级为BBB以上（含BBB）的资产支持证券。本基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起20个工作日内全部卖出；

(9) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

(10) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；

(11) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；

(12) 本基金财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，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(13) 本基金持有一家公司发行的流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的2%；本基金持有的所有流通受限证券，其市值不得超过基金资产净值的10%；经基金管理人和基金托管人协商，可对以上比例进行调整；

(14) 本基金不得违反《基金合同》关于投资范围和投资比例的约定；

(15) 法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定，履行适当程序后，本基金不受上述规定的限制。

（四）投资组合比例调整

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合《基金合同》的有关约定。由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在10个交易日内进行调整，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

（五）基金管理人代表基金行使股东权利处理原则和方法

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金财产的安全与增值；
- 3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的



利益；

4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

十、基金投资组合报告（未经审计）

本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金的托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于2013年12月13日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2013年9月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

（一）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	22,824,348.56	4.16
	其中：股票	22,824,348.56	4.16
2	固定收益投资	392,468,011.10	71.52
	其中：债券	392,468,011.10	71.52
	资产支持证券	—	—
3	金融衍生品投资	—	—
4	买入返售金融资产	104,644,185.62	19.07
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	104,644,185.62	19.07
5	银行存款和结算备付金合计	19,796,996.66	3.61
6	其他各项资产	9,005,242.21	1.64
7	合计	548,738,784.15	100.00

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

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	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	12,935,546.88	3.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	8,879,801.68	2.12
H	住宿和餐饮业	—	—



I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	1,009,000.00	0.24
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	22,824,348.56	5.44

(三) 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	002353	杰瑞股份	150,336	10,535,546.88	2.51
2	601333	广深铁路	2,999,933	8,879,801.68	2.12
3	002521	齐峰新材	300,000	2,400,000.00	0.57
4	600000	浦发银行	100,000	1,009,000.00	0.24
5	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

(四) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	41,023,000.00	9.77
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	263,763,731.10	62.85
5	企业短期融资券	25,983,280.00	6.19
6	中期票据	61,698,000.00	14.70
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	392,468,011.10	93.51



(五) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	122086	11正泰债	400,000	40,600,000.00	9.67
2	1182254	11甘公投MTN1	300,000	30,975,000.00	7.38
3	1182298	11TCL集MTN1	300,000	30,723,000.00	7.32
4	122080	11康美债	280,250	28,333,275.00	6.75
5	122803	11滁州债	200,000	20,760,000.00	4.95

(六) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(七) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

(八) 投资组合报告附注

1、声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2、声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金报告期内基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

3、其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	117,442.51
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,886,012.80
5	应收申购款	1,786.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,005,242.21



4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金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

本基金本报告期末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。

十一、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

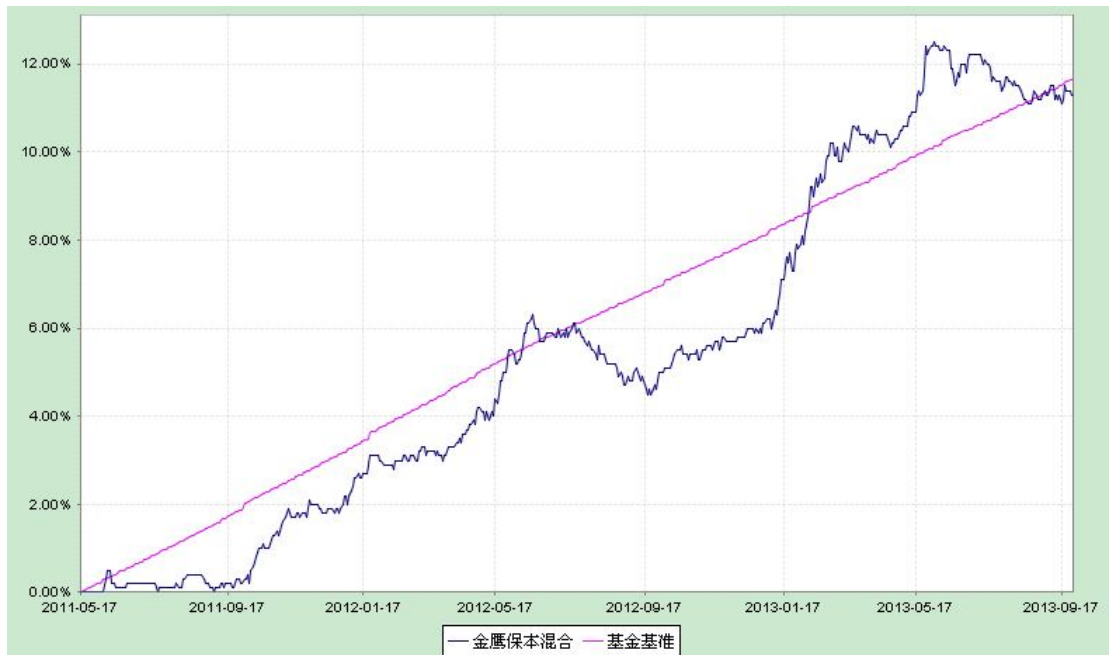
本基金合同生效日为 2011 年 5 月 17 日，基金合同生效以来（截至 2013 年 9 月 30 日）的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示：

金鹰保本混合型证券投资基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

阶段	份额净值增长率① (%)	份额净值增长率标准差② (%)	业绩比较基准收益率③ (%)	业绩比较基准收益率标准差④ (%)	①-③ (%)	②-④ (%)
2011.5.17-2011.12.31	2.20%	0.08%	3.19%	0.01%	-0.99%	0.07%
2012.1.1-2012.12.31	3.91%	0.11%	4.79%	0.01%	-0.88%	0.10%
2013.1.1-2013.9.30	4.80%	0.15%	3.27%	0.01%	1.53%	0.14%
2011.5.17-2013.9.30	11.30%	0.12%	11.68%	0.01%	-0.38%	0.10%

注：因数据四舍五入原因，上述表格可能存在尾差。

金鹰保本混合型基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2011 年 5 月 17 日至 2013 年 9 月 30 日)



注：1、截至报告日本基金各项投资比例符合基金合同规定的各项比例，即股票、权证占基金资产净值的比例为 0%~40%，其中，权证投资的比例范围占基金资产净值的 0%~3%；债券、资产支持证券、货币市场工具、现金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占基金资产净值的 60%~100%，其中，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；

2、本基金的业绩比较基准为：3 年期银行定期存款利率（税后）。

十二、基金的费用和税收

（一）与基金运作相关的费用

1、与基金运作相关的费用种类

- （1）基金管理人的管理费；
- （2）基金托管人的托管费；
- （3）因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）；
- （4）基金合同生效以后的信息披露费用；
- （5）基金份额持有人大会费用；
- （6）基金合同生效以后的会计师费和律师费；



(7) 基金资产的资金汇划费用;

(8) 按照国家有关法律法规和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

2、与基金运作相关的费用之计提方法、计提标准和支付方式

(1) 基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金财产净值的 1.2%年费率计提。

在通常情况下,基金管理费按前一日基金财产净值的 1.2%年费率计提。计算方法如下:

$$H=E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金财产净值

基金管理费每日计提,按月支付。基金管理人应于次月首日起 5 个工作日内做出划付指令;基金托管人应在次月首日起 10 个工作日内完成复核,并从该基金财产中一次性支付基金管理费给该基金管理人。

(2) 基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金财产净值的 0.2%年费率计提。

在通常情况下,基金托管费按前一日基金财产净值的 0.2%年费率计提。计算方法如下:

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金财产净值

基金托管费每日计提,按月支付。基金管理人应于次月首日起 5 个工作日内做出划付指令;基金托管人应在次月首日起 10 个工作日内完成复核,并从该基金财产中一次性支付托管费给该基金托管人。

若保本周期到期后,本基金不符合保本基金存续条件,基金份额持有人将所持有本基金份额转为变更后的“金鹰持续收益债券型证券投资基金”的基金份额,管理费按前一日基金资产净值的 0.75%的年费率计提,托管费按前一日基金资产净值的 0.2%的年费率计提。计算方法同上。

(3) 本条第(一)款第 3 至第 8 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,列入当期基金费用。

3、不列入基金费用的项目



本条第（一）款约定以外的其他费用，以及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等不列入基金费用。

4、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，无须召开基金份额持有人大会。

（二）与基金销售有关的费用

1、申购费

（1）申购费率

投资人申购本基金需缴纳申购费，投资人在同一天多次申购的，根据单次申购金额确定每次申购所适用的费率。申购费用用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。

申购费率如下：

申购金额（万元）	申购费率
$A < 100$	1.0%
$100 \leq A < 300$	0.8%
$300 \leq A < 500$	0.6%
$A \geq 500$	每笔 1000 元

注：上表中，A 为投资者申购金额。

（2）申购份额的计算方法如下：

净申购金额 = 申购金额 / [1 + 申购费率]

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日基金份额净值

以上计算结果（包括申购份额）以四舍五入的方式保留到小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

2、赎回费

（1）赎回费率



赎回费率随基金份额持有人持有本基金的时间的增加而递减，具体赎回费率如下表所示：

持有期（计为 T）	赎回费率
$T < 1$ 年	1.5%
$1 \text{ 年} \leq T < 2 \text{ 年}$	1.2%
$2 \text{ 年} \leq T < 3 \text{ 年}$	1.0%
$T \geq 3 \text{ 年}$	0%

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，不低于赎回费总额 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。

基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率和赎回费率。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施 2 日前在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登公告。

基金管理人可以在不违背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，在基金促销活动期间，基金管理人可以对促销活动范围内的基金投资者调低基金申购费率、赎回费率。

(2) 赎回金额的计算

投资人赎回本基金的金额为赎回总额扣减赎回费用。其中：

赎回总额 = 赎回份数 $\times$ T 日基金份额净值

赎回费用 = 赎回总额 $\times$ 赎回费率

赎回金额 = 赎回总额 - 赎回费用

上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位。由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

3、转换费率

本基金与基金管理人所管理的其他基金之间的转换费率由基金管理人根据有关法律法规和基金合同的原则另行制定并公告。

4、基金管理人可以在基金合同规定的范围内调整上述费率。上述费率如发生变更，基金管理人应按照《信息披露办法》或其他相关规定于新的费率实施前在至少一种指定媒体公告。调整后的上述费率还应在最新的招募说明书中列示。

基金管理人可以在不违背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, 针对以特定交易方式(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, 基金管理人在与托管人协商一致后可以, 对促销活动范围内的投资者调低基金申购、赎回费率, 并报中国证监会备案。

(三) 税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体, 依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

十三、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》、《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》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 2013 年 6 月 8 日刊登的《金鹰保本混合型证券投资基金招募说明书》进行了更新, 主要更新的内容如下:

(一) 在“三、基金管理人”部分, 更新了公司高级管理人员部分信息及基金经理任职情况;

(二) 在“四、基金托管人”部分, 更新了有关基金托管人的资料信息;

(三) 在“六、相关服务机构”部分, 对机构与人员的信息按照最新变动情况进行了更新:

1、更新了代销机构等相关服务机构的基本信息和联络方式;

2、新增了江苏江南农村商业银行股份有限公司为代销机构, 该变动事项于 2013 年 8 月 1 日公告;

3、新增了包商银行股份有限公司为代销机构, 该变动事项于 2013 年 8 月 16 日公告;

4、新增了浙江稠州商业银行股份有限公司为代销机构, 该变动事项于 2013 年 9 月 2 日公告;

5、新增了万银财富(北京)基金销售有限公司为代销机构, 该变动事项于 2013 年 10 月 8 日公告。

(四) 在“十六、基金的投资”部分, 更新了本基金最近一期投资组合报告的内容;

(五) 在“十七、基金的业绩”, 更新了本基金基金合同生效以来投资业绩;

(六) 在“三十、其他应披露事项”部分, 更新了本基金在本报告期内公开披露的信息



内容。

金鹰基金管理有限公司

2013年12月14日