



# 金鹰保本混合型证券投资基金

## 更新的招募说明书全文

2016 年第 1 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。本基金的第一个保本期起始于 2011 年 5 月 17 日，并于 2014 年 5 月 19 日到期。本基金第一个保本周期到期后，在符合基金合同规定的保本基金存续的条件下，本基金转入第二个保本期并与第二保本周期保本责任的担保人广州越秀金融控股集团有限公司签订了保证合同。

针对本基金转入第二个保本周期以及第二个保本期担保人的变更，在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，依据《金鹰保本混合证券投资基金基金合同》约定的基金合同变更程序，经与基金托管人协商一致，基金管理人就《金鹰保本混合证券投资基金基金合同》进行了修改，并于 2014 年 5 月 6 日刊登了修改基金合同的公告，对基金合同修改部分进行了说明，本次修订后的基金合同于 2014 年 5 月 20 日起生效。前述修改变更事项已报中国证监会备案。

基金管理人保证本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，第二个保本周期为三年，投资者在第二个保本周期开始前的过渡期申购或从第一个保本周期转入到第二个保本周期，并持有到期的基金份额存在着仅能收回本金的可能性；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，投资者在第二个保本周期开始前的过渡期申购或从第一个保本周期转入到第二个保本周期，并持有到期的基金份额亦存在着无法收回本金的可能性。第二个保本周期到期后，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。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本招募说明书已经本基金托管人复核。除非另有说明，本招募说明书所载内容截止日为 2016 年 5 月 17 日，有关财务数据截止日为 2016 年 3 月 31 日，净值表现截止日为 2016 年 3 月 31 日，本报告中财务数据未经审计。



## 目 录

|                             |     |
|-----------------------------|-----|
| 一、绪言.....                   | 5   |
| 二、释义.....                   | 5   |
| 三、基金管理人.....                | 11  |
| 四、基金托管人.....                | 21  |
| 五、基金担保人.....                | 24  |
| 六、相关服务机构 .....              | 25  |
| 七、基金的募集.....                | 53  |
| 八、基金合同的生效.....              | 53  |
| 九、基金份额的申购与赎回.....           | 54  |
| 十、基金的转换.....                | 61  |
| 十一、基金的非交易过户与转托管.....        | 61  |
| 十二、基金份额的冻结、解冻及质押 .....      | 62  |
| 十三、定期定额投资计划 .....           | 62  |
| 十四、基金的保本 .....              | 62  |
| 十五、基金保本的保证.....             | 64  |
| 十六、基金的投资 .....              | 67  |
| 十七、基金的业绩 .....              | 89  |
| 十八、基金的财产 .....              | 90  |
| 十九、基金财产的估值.....             | 92  |
| 二十、基金的收益与分配 .....           | 96  |
| 二十一、基金的费用和税收.....           | 97  |
| 二十二、基金的会计与审计.....           | 99  |
| 二十三、基金的信息披露 .....           | 100 |
| 二十四、风险揭示 .....              | 105 |
| 二十五、保本周期到期.....             | 110 |
| 二十六、基金合同的变更、终止与基金财产的清算..... | 116 |
| 二十七、基金合同的内容摘要.....          | 118 |
| 二十八、基金托管协议的内容摘要.....        | 141 |
| 二十九、对基金份额持有人的服务.....        | 150 |
| 三十、其它应披露事项.....             | 152 |
| 三十一、招募说明书的存放及查阅方式 .....     | 156 |



---

|                 |     |
|-----------------|-----|
| 三十二、备查文件 .....  | 157 |
| 附件：《保证合同》 ..... | 158 |



## 一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）及其他有关规定以及《金鹰保本混合型证券投资基金基金合同》编写。

本招募说明书阐述了金鹰保本混合型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。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的基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同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份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 二、释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

|            |                                    |
|------------|------------------------------------|
| 基金或本基金     | 指金鹰保本混合型证券投资基金；                    |
| 基金合同或本基金合同 | 指《金鹰保本混合型证券投资基金基金合同》及对其的任何有效修订和补充； |
| 招募说明书      | 指《金鹰保本混合型证券投资基金招募说明书》及其定期更新；       |
| 发售公告       | 指《金鹰保本混合型证券投资基金基金份额发售公告》；          |
| 托管协议       | 指《金鹰保本混合型证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充；   |
| 中国证监会      | 指中国证券监督管理委员会；                      |
| 中国银监会      | 指中国银行业监督管理委员会；                     |
| 《基金法》      |                                    |

指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务



|          |                                                                                                                                                       |
|----------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|          | 委员会第五次会议通过的自 2004 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及不时做出的修订；（包括但不限于经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议于 2012 年 12 月 28 日修订通过并自 2013 年 6 月 1 日起施行最新版《中华人民共和国证券投资基金法》） |
| 《反洗钱法》   | 指 2006 年 10 月 31 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第二十四次会议通过，自 2007 年 1 月 1 日起实施的《中华人民共和国反洗钱法》及颁布机关对其不时作出的修订；                                                         |
| 《销售办法》   | 指 2011 年 6 月 21 日由中国证监会公布并于 2011 年 10 月 1 日起实施的《证券投资基金销售管理办法》及不时做出的修订；                                                                                |
| 《运作办法》   | 指 2004 年 6 月 29 日由中国证监会公布，同年 2004 年 7 月 1 日起实施并于 2014 年 7 月 7 日修订的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及不时做出的修订及不时做出的修订；                                                 |
| 《信息披露办法》 | 指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布并于 2004 年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及不时作出的修订；                                                                                  |
| 元        | 指人民币元；                                                                                                                                                |
| 基金管理人    | 指金鹰基金管理有限公司；                                                                                                                                          |
| 基金托管人    | 指中国工商银行股份有限公司；                                                                                                                                        |
| 担保人      | 广州越秀金融控股集团有限公司或《基金合同》约定的其他机构；                                                                                                                         |
| 注册登记业务   | 指本基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等；                                                                            |
| 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金鹰基金管理有限公司或接受金鹰基金管理有限公司委托代为办理本基金注册登记业务的机构；                                                                                 |
| 投资者      | 指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者；                                                                                                    |
| 个人投资者    | 指依据中华人民共和国有关法律法规可以投资于证券投资基金的自然人；                                                                                                                      |
| 机构投资者    | 指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有                                                                                                                            |



|                      |                                                                                                   |
|----------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                      | 效存续并依法可以投资于证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；                                                            |
| 合格境外机构投资者            | 指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者；                              |
| 基金份额持有人大会            | 指按照本基金合同第九部分之规定召集、召开并由基金份额持有人或其合法的代理人进行表决的会议；                                                     |
| 募集期                  | 指基金合同和招募说明书中载明，并经中国证监会核准的基金份额募集期限，自基金份额发售之日起最长不超过 3 个月；                                           |
| 基金合同生效日              | 指募集结束，基金募集的基金份额总额、募集金额和基金份额持有人人数符合相关法律法规和基金合同规定的，基金管理人依据《基金法》向中国证监会办理备案手续后，中国证监会的书面确认之日；          |
| 存续期                  | 指本基金合同生效至终止之间的不定期期限；                                                                              |
| 保本周期、当期保本周期          | 基金管理人提供保本的期限，在本基金合同中如无特别指明即为第二个保本周期，即自本基金第二个保本周期起始日起至 3 个公历年后对应日止，如该对应日为非工作日，第二个保本周期到期日顺延至下一个工作日； |
| 保本周期到期日              | 保本周期届满的最后一日，如该对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日；                                                                |
| 持有到期                 | 基金份额持有人在当期保本周期内持续、不间断地持有其在当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期的基金份额的行为；                               |
| 到期操作                 | 基金份额持有人在保本周期到期后，赎回本基金基金份额，将本基金基金份额转换为基金管理人管理的其他开放式基金基金份额，转入下一保本周期，或继续持有变更后基金的基金份额的行为；             |
| 到期操作期间               | 基金份额持有人可以进行到期操作的期间。本基金的到期操作期间为保本周期到期日及之后 3 个工作日（含第 3 个工作日）；                                       |
| 当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保 | 基金份额持有人在当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期并持有到期的基金份额与当                                              |





本周期转入到当期保本周期并持有到期的基金份额的可赎回金额

保本 本基金向基金份额持有人就其当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期并持有到期的基金份额提供保本的金额，即基金份额持有人持有的该类基金份额与 1.00 元人民币的乘积

保本赔付差额 在保本周期到期日，基金份额持有人当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期并持有到期的基金份额的可赎回金额与相应基金份额的在当期保本周期内累计分红金额之和低于其保本额的金额；

保本 在保本周期到期日，如果基金份额持有人当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期并持有到期的基金份额的可赎回金额加上相应基金份额在当期保本周期内累计分红金额之和低于保本额（低出的部分即为“保本赔付差额”），基金管理人应向基金份额持有人补足该差额；

担保 担保人为本基金保本提供的不可撤销的连带责任担保，担保期限为基金保本周期到期日起六个月止；

过渡期 到期操作期间截止日起（不含该日）至下一保本周期开始日前一工作日的期间为过渡期；过渡期最长不超过 20 个工作日；

过渡期申购 投资者在过渡期内申请购买本基金基金份额的行为。在过渡期内，投资者转换入本基金基金份额，视同为过渡期申购；

折算日 下一保本周期开始日的前一工作日，即过渡期最后一个工作日；

基金份额折算 在折算日，得到基金管理人确认的基金份额（包括保本周期



|                |                                                                                                                                  |
|----------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                | <p>结束后选择或默认选择转入下一个保本周期并得到确认的基金份额、投资者进行过渡期申购并得到确认的基金份额）在其持有的基金份额所代表的资产净值总额保持不变的前提下，变更登记为基金份额净值为 1.00 元的基金份额，基金份额数额按折算比例相应调整；</p>  |
| 基金转换           | <p>投资者向基金管理人提出申请将其所持有的基金管理人管理的任一开放式基金（转出基金）的全部或部分基金份额转换为基金管理人管理的任何其他开放式基金（转入基金）的基金份额的行为；</p>                                     |
| 转换入            | <p>投资者向基金管理人提出申请将其所持有的基金管理人管理的其他开放式基金的全部或部分基金份额转换为本基金的基金份额的行为；</p>                                                               |
| 转换出            | <p>投资者向基金管理人提出申请将其所持有的本基金的全部或部分基金份额转换为基金管理人管理的其他开放式基金的行为；</p>                                                                    |
| 保证合同           | <p>基金管理人与担保人签署的《金鹰保本混合型证券投资基金第二个保本周期保证合同》；</p>                                                                                   |
| 保本基金存续条件       | <p>本基金保本周期届满时，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保证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；</p>        |
| 转入下一保本周期       | <p>在符合保本基金存续条件下，持有到期的基金份额持有人继续持有本基金基金份额的行为；</p>                                                                                  |
| 保本周期到期后基金的存续形式 | <p>保本周期届满时，若符合保本基金存续条件，本基金继续存续；否则，本基金变更为非保本的债券型基金，基金名称相应变更为“金鹰持续收益债券型证券投资基金”。如果本基金不符合法律法规和《基金合同》对基金的存续要求，则本基金将按照《基金合同》的规定终止；</p> |
| 工作日            | <p>指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日；</p>                                                                                                   |
| 认购             | <p>指在基金募集期内，投资者按照本基金合同的规定申请购买</p>                                                                                                |



|        |                                                                                              |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | 本基金基金份额的行为；                                                                                  |
| 申购     | 指在本基金合同生效后的存续期间，投资者申请购买本基金基金份额的行为；                                                           |
| 赎回     | 指在本基金合同生效后的存续期间，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求基金管理人购回本基金基金份额的行为；                                        |
| 巨额赎回   | 在单个开放日，本基金的基金份额净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日本基金总份额的 10% 时的情形； |
| 转托管    | 指基金份额持有人将其基金账户内的某一基金的基金份额从一个销售机构托管到另一销售机构的行为；                                                |
| 指令     | 指基金管理人在运用基金财产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令；                                                   |
| 代销机构   | 指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并接受基金管理人委托，代为办理基金认购、申购、赎回和其他基金业务的机构；                        |
| 销售机构   | 指基金管理人及本基金代销机构；                                                                              |
| 基金销售网点 | 指基金管理人的直销中心及基金代销机构的代销网点；                                                                     |
| 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基金份额余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办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务而引起的基金份额的变动及结余情况的账户；                             |
| 开放日    | 指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日；                                                                       |
| 封闭期    | 指基金成立后不办理申购、赎回的工作日，最长不超过自基金成立之日起三个月；                                                         |
| T 日    | 指销售机构受理投资者申购、赎回或其他业务申请的日期；                                                                   |
| T+n 日  | 指 T 日后（不包括 T 日）第 n 个工作日，n 指自然数；                                                              |
| 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、银行存款利息以及其他合法收入；                                                     |



|        |                                                                                                                      |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金财产总值 | 指基金持有的各类有价证券、银行存款本息、应收申购款以及以其他资产等形式存在的基金财产的价值总和；                                                                     |
| 基金财产净值 | 指基金财产总值减去基金负债后的价值；                                                                                                   |
| 基金份额净值 | 指以计算日基金财产净值除以计算日基金份额余额所得的单位基金份额的价值；                                                                                  |
| 基金财产估值 | 指计算、评估基金财产和负债的价值，以确定基金财产净值和基金份额净值的过程；                                                                                |
| 法律法规   | 指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、地方法规、地方规章、部门规章及其他规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充；                                                  |
| 指定媒体   | 指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站或其它媒体；                                                                                     |
| 不可抗力   | 指任何无法预见、无法克服、无法避免的事件和因素，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、疫情、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律变化、突发停电、电脑系统或数据传输系统非正常停止以及其他突发事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等。 |

### 三、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珠江新城珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

设立日期：2002 年 12 月 25 日

法定代表人：凌富华

联系人：潘晓毅

联系电话：020-83282855

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 |
|------------|---------|------|
| 广州证券股份有限公司 | 12250   | 49%  |



|                 |       |      |
|-----------------|-------|------|
| 广州白云山医药集团股份有限公司 | 5000  | 20%  |
| 美的集团股份有限公司      | 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

凌富华先生，董事，经济学学士、会计师，历任苏州航空工业部长风机械总厂财务处会计、广州大同精密机械有限公司会计部经理，广西北海国际信托投资公司所属城市信用社、营业部、信贷部经理助理，香港大同机械企业有限公司驻国内企业会计主任，广东省联谊信诚贸易有限公司财务部经理，长城证券有限责任公司广州营业部财务经理、总部财务中心综合部经理、广州营业部拟任总经理，广州恒运企业集团股份有限公司财务部副经理、财务部经理兼任财务负责人、财务总监兼任财务负责人，广州证券有限责任公司财务总监兼任财务负责人。现任广州证券股份有限公司副总裁兼任财务总监、财务负责人。经公司第五届董事会第五次会议决议通过，并经中国证券监督管理委员会证监许可[2014]1401号核准，自2015年1月起，担任金鹰基金管理有限公司董事长。

刘岩先生，董事，金融学博士，历任中国光大银行总行投行业务部业务主管，中国光大银行总行财富管理中心业务副经理，广州证券有限责任公司资产管理总部总经理等职。经公司第四届董事会第三十九次会议审议通过，并报经中国证监会核准，自2014年8月7日至今，担任金鹰基金管理有限公司总经理。

王毅先生，董事，工商管理硕士、经济师，历任广州证券有限责任公司营业部经理、营业部总经理助理、营业部副总经理，办公室副主任（主持全面工作）、合规总监、董事会秘书。现任广州证券股份有限公司副总裁兼任董事会秘书、首席风险官、合规总监。

程宁女士，董事，注册会计师、注册税务师，历任广州白云山制药总厂财务科科长、广州白云山宝得药厂财务科副科长，兼任广州白云山兽药厂财务科科长、广州白云山制药股份有限公司经营部结算科科长、结算中心会计出纳科科长、财务部副部长、监事会成员兼监事会秘书、广州白云山企业集团有限公司资财处代理处长、处长、广州医药集团财务部副部长、财务部部长。现任广州医药集团副总经理、财务总监、财务部部长，广州白云山医药集团股份有限公司董事，广州白云山香港有限公司董事会召集人。

江鹏，董事，会计学硕士。江鹏先生自2000年9月参加工作后，先后在广东肇庆星湖生物科技股份有限公司、广东美的电器股份有限公司等担任董事会秘书职务，现任美的集团股份有限公司董事会秘书。

温婉容女士，董事，商科毕业。曾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。

谭跃先生，独立董事。财务（金融）学 博士。曾任株洲基础大学担任助教、长沙理工大学担任讲师、暨南大学担任副教授，现任暨南大学教授、博士生导师等职务。刘国常先生，独立董事，管理学（会计学）博士、教授、博士生导师，曾在郑州航空工业管理学院、暨南大学管理学院任教。现任广东财经大学会计学院教授，兼任暨南大学管理学院博士生导师、广东省审计学会副会长、广州市审计学会副会长等。

谢石松先生，独立董事，法学博士、教授，历任广州中山大学法学院讲师、副教授，现任中山大学法学院教授，国际法研究所所长。兼任武汉大学法学院、西北政法大学兼职教授，中国国际私法学会副会长；中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员及专家咨询委员会委员，华南国际经济贸易仲裁委员会、上海国际经济贸易仲裁委员会仲裁员，上海、广州、长沙、深圳、厦门、珠海、佛山、肇庆、惠州等仲裁委员会仲裁员等。

曾巧女士，监事，管理学学士。曾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。

陈家雄先生，监事，硕士研究生，历任东莞证券资产管理部投资经理、广州证券资产管理部产品总监，现任金鹰基金管理有限公司产品研发部总监。

姜慧斌先生，监事，管理学硕士。曾任宇龙计算机通信科技（深圳）有限公司人力资源部组织发展经理，现任金鹰基金管理有限公司综合管理部总监。

## 2、 公司高级管理人员

刘岩先生，总经理，金融学博士，历任中国光大银行总行投行业务部业务主管，中国光大银行总行财富管理中心业务副经理，广州证券有限责任公司资产管理总部总经理等职。经公司第四届董事会第三十九次会议审议通过，并报经中国证监会核准，2014 年 8 月 7 日起担任公司总经理。

李云亮先生，副总经理，金融学博士，先后于重庆理工大学、中国证监会重庆监管局任职，历任西南证券股份有限公司证券资管部总经理等职。根据公司第五届董事会第四次会议决议，经中国证券投资基金业协会备案，于 2014 年 12 月 25 日起任公司副总经理。现兼任深圳前海金鹰资产管理有限公司董事长。

曾长兴先生，副总经理，金融学博士，2004 年 9 月至 2006 年 10 月在广东证券公司（原）任研究员，2006 年 10 月至 2010 年 5 月担任安信证券股份有限公司分析师，2010 年 5 月至 2011 年 10 月担任国联安基金管理有限公司产品开发部总监，2011 年 11 月加入金鹰基金管理有限公司，历任产品研发部总监、总经理助理等职务。根据公司第五届董事会第二十五次会议决议，经中国证券投资基金业协会备案，自 2016 年 5 月 12 日起担任公司副总经理职务。

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

李涛先生，北京大学金融学硕士。历任光大银行总行资金部货币市场自营投资业务主管、中银国际证券研究部宏观研究员、广州证券资产管理总部投研总监。2014 年 11 月加入金鹰基金管理有限公司，现任固定收益部副总监职务。现任金鹰保本混合型证券投资基金、金鹰持久增利债券型(LOF)证券投资基金、金鹰元安保本混合型证券投资基金、金鹰元丰保本混合型证券投资基金、金鹰灵活配置混合型证券投资基金、金鹰元祺保本混合型证券投资基金基金经理。

倪超先生，厦门大学硕士研究生。2009 年 6 月加盟金鹰基金管理有限公司，先后任行业研究员，消费品研究小组组长、基金经理助理。现任金鹰行业优势混合型证券投资基金、金鹰保本混合型证券投资基金、金鹰元祺保本混合型证券投资基金基金经理。

### 4、投资决策委员会成员

本公司采取集体投资决策制度，相关投资决策委员会成员有：

#### (1) 公司投资决策委员会

刘岩先生，投资决策委员会主席，总经理；

曾长兴先生，投资决策委员会委员，副总经理；

王喆先生，投资决策委员会委员，权益投资部总监，基金经理；

于利强先生，投资决策委员会委员，研究部总监，基金经理；

李涛先生，投资决策委员会委员，固定收益部副总监，基金经理。

#### (2) 权益投资决策委员会

刘岩先生，投资决策委员会主席，总经理；

曾长兴先生，投资决策委员会委员，副总经理；

王喆先生，投资决策委员会委员，权益投资部副总监，基金经理；

于利强先生，投资决策委员会委员，研究部副总监，基金经理；

陈立先生，投资决策委员会委员，基金经理。

#### (3) 固定收益投资决策委员会

刘岩先生，投资决策委员会主席，总经理；

曾长兴先生，投资决策委员会委员，副总经理；

李涛先生，投资决策委员会委员，固定收益部副总监，基金经理；

刘丽娟女士，投资决策委员会委员，固定收益部副总监，基金经理；

张俊杰先生，投资决策委员会委员，基金经理。



## 5、上述人员之间均不存在近亲属关系。

### （三）基金管理人的职责

#### 1、权利

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括、但不限于：

- （1）依法募集资金；
- （2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- （3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- （4）销售基金份额；
- （5）按照规定召集基金份额持有人大会；
- （6）依据《基金合同》及有关法律、法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律、法规规定，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；
- （7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- （8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- （9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- （10）依据《基金合同》及有关法律、法规规定决定基金收益的分配方案；
- （11）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- （12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东与债权人权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- （13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；
- （14）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- （15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商、期货经纪机构或其他为基金提供服务的外部机构；
- （16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户等业务规则；
- （17）在法律法规和基金合同规定的范围内决定除调高基金托管费、基金管理费之外的基金费率结构和收费方式；
- （18）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。





## 2、义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

- (1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- (2) 办理基金备案手续；
- (3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；
- (4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- (5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
- (6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
- (7) 依法接受基金托管人的监督；
- (8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；
- (9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- (10) 编制季度、半年度和年度基金报告；
- (11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- (12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；
- (13) 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
- (14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- (15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；
- (17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下列得到有关资料的复印件；
- (18) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
- (20) 因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；



(21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

(23) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

#### (四) 基金管理人的承诺

### 1、建立健全内部控制制度，防止违法行为发行

基金管理人承诺不从事违反《证券法》、《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、《指导意见》等法律法规的行为，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反行为的发生。

### 2、建立健全内部风险控制制度，有效防范风险

基金管理人承诺不从事以下禁止性行为，并承诺建立健全的内部风险控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生。

(1) 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

(2) 不公平地对待其管理的不同基金财产；

(3) 利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

(4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

(5) 侵占、挪用基金财产；

(6) 泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

(7) 玩忽职守，不按照规定履行职责；

(8) 依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为及基金合同禁止的行为。



### 3、诚实信用，勤勉尽责

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) 违反基金合同或托管协议；
- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
- (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) 泄露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) 除按本公司制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他股票投资；
- (9) 协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；
- (10) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲倒、对仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (11) 贬损同行，以提高自己；
- (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (13) 以不正当手段谋求业务发展；
- (14) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (15) 其他法律、行政法规禁止的行为。

### 4、基金管理人关于禁止性行为的承诺

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) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是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；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利



害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，符合中国证监会的规定，并履行信息披露义务。

## 5、基金经理承诺

(1) 依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

(2) 不能利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；

(3) 不违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，不泄露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) 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

(五) 基金管理人的内部控制制度

### 1、内部控制的目标

(1) 保证公司经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念。

(2) 防范和化解经营风险，提高经营管理效益，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，实现公司的持续、稳定、健康发展。

(3) 确保基金、公司财务和其他信息真实、准确、完整、及时。

### 2、内部控制的原则

(1) 健全性原则。内部控制应当包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

(2) 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。

(3) 独立性原则。公司各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

(4) 相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

(5) 成本效益原则。公司运用科学化的经营管理方法降低运营成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。



### 3、内部控制制度

公司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，是各项基本管理制度的纲要和总揽，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。

基本管理制度包括风险控制制度、投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、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紧急应变制度。

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、岗位职责、操作守则等的具体说明。

公司制定内部控制制度遵循了以下原则：

- (1) 合法合规性原则。公司内控制度应当符合国家法律、法规、规章和各项规定。
- (2) 全面性原则。内部控制制度应当涵盖公司经营管理的各个环节，不得留有制度上的空白或漏洞。
- (3) 审慎性原则。制定内部控制制度应当以审慎经营、防范和化解风险为出发点。
- (4) 适时性原则。内部控制制度的制定应当随着有关法律法规的调整和公司经营战略、经营方针、经营理念等内外部环境的变化进行及时的修改或完善。

### 4、内部控制系统

公司的内部控制系统是一个分工明确、相互牵制、完备严密的系统。公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任，各个业务部门负责本部门的内部控制，督察长和监察稽核部负责检查公司的内部控制措施的执行情况。具体而言，包括如下组成部分：

#### (1) 董事会

负责制定公司的内部控制大纲，对公司内部控制负完全的和最终的责任。

#### (2) 督察长

负责公司及其业务运作的监察稽核工作，对公司内部控制的执行情况进行监督检查。督察长对董事会负责，将定期和不定期向董事会报告公司内部控制的执行情况，并定期向中国证监会呈送督察长评估报告。

#### (3) 监察稽核部

监察稽核部负责对公司各部门内部控制的执行情况进行监督。监察稽核部对总经理负责，将定期和不定期对各业务部门内部控制制度的执行情况和遵守国家法律法规及其他规定的执行情况进行检查，适时提出修改建议，并定期向中国证监会呈送监察稽核报告。

#### (4) 业务部门

内部控制是每一个业务部门的责任。各部门总监对本部门的内部控制负直接责任，负责履行公司的内部控制制度，并负责建立、执行和维护本部门的内部控制措施。



## 5、基金管理人关于内部控制的声明

基金管理人确知建立内部控制系统、维持其有效性以及有效执行内部控制制度是董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任；基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确，并承诺根据市场的变化和基金管理人的发展不断完善内部控制制度。

## 四、基金托管人

### （一）基金托管人基本情况

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

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：易会满

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

联系电话：010-66105799

联系人：洪渊（二）主要人员情况

截至 2016 年 3 月末，中国工商银行资产托管部共有员工 198 人，平均年龄 30 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

### （二）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2016 年 3 月，中国工商银行共托管证券投资基金 555 只。自 2003 年以来，本行连续十一年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 49 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。





### （三）基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。继2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013、2014年八次顺利通过评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的SAS70（审计标准第70号）审阅后，2015年中国工商银行资产托管部第九次通过ISAE3402（原SAS70）审阅获得无保留意见的控制及有效性报告，表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可。也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

#### 1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

#### 2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

#### 3、内部风险控制原则

（1）合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

（2）完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督





制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

(3) 及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

(4) 审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

(5) 有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

(6) 独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

#### 4、内部风险控制措施实施

(1) 严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

(2) 高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为中国工商银行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

(3) 人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

(4) 经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

(5) 内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

(6) 数据安全控制。通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

(7) 应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托



管理部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

## 5、资产托管部内部风险控制情况

(1) 资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

(2) 完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

(3) 建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

(4) 内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

## 五、基金担保人

名称：广州越秀金融控股集团有限公司

住所：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔写字楼第 63 层 01-B 单元

邮政编码：510620

注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔写字楼第 63 层 01-B 单元

法定代表人：张招兴

成立日期：1992 年 11 月 24 日

注册资本：40.537 亿元人民币

联系人：周建余



联系电话： 020-88836888

组织形式：有限责任公司（法人独资）

经营范围：利用自有资金进行对外投资（法律法规禁止投资的项目除外）；企业管理。

担保人简介

广州越秀金融控股集团有限公司成立于一九九二年十一月二十四日，是经国家工商行政管理机关批准、广州市工商行政管理局注册成立的国有资产完全控股的综合性金融控股公司，公司注册资本 40.537 亿元人民币，公司总部设在广州。

财务状况

截至 2015 年 12 月 31 日，广州越秀金融控股集团有限公司总资产 621.20 亿元人民币，净资产 142.34 亿元人民币；最近四年连续盈利——2015 年、2014 年、2013 年、2012 年度合并报表中归属母公司所有者的净利润分别为 791,448,946.84 元、594,140,850.20 元、155,215,000.52 元、103,500,683.21 元人民币。

对外承担保证或偿付责任的情况的说明

广州越秀金融控股集团有限公司对外承担保证或偿付责任的情况如下：

截至 2015 年 12 月 31 日，广州越秀金融控股集团有限公司对外提供担保金额为 152,334.97 万元。

## 六、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珠江新城珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

法定代表人：凌富华

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：020-83936180、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）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：易会满

联系人：查樱

电话：010-66105662

客服电话：95588（全国）

网址：www.icbc.com.cn

### （2）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）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

联系人：张宏革

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

### （4）中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

办公地址：北京东城区朝阳门北大街 9 号东方文化大厦



法定代表人：常振明  
联系人：赵树林  
电话：010-65556960  
客服电话：95558（全国）  
网址：[www.bank.ecitic.com](http://www.bank.ecitic.com)

（5） 上海浦东发展银行股份有限公司  
注册地址：上海市中山东一路 12 号  
办公地址：上海市北京东路 689 号东银大厦 17 楼  
法定代表人：吉晓辉  
联系人：吴斌  
客服电话：95528  
网址：<http://www.spdb.com.cn>

（6） 兴业银行股份有限公司  
注册（办公）地址：福建省福州市湖东路 154 号中山大厦  
法定代表人：高建平  
联系人：张磊  
客服电话：95561  
网址：[www.cib.com.cn](http://www.cib.com.cn)

（7） 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：洪崎  
联系人：董云巍  
电话：010-58351666  
客服电话：95568（全国）  
网址：[www.cmbc.com.cn](http://www.cmbc.com.cn)

（8） 中国邮政储蓄银行股份有限公司  
注册（办公）地址：北京市西城区金融大街 3 号  
法定代表人：李国华  
联系人：文彦娜  
电话：010-66421200  
客服电话：95580（全国）  
网址：[www.psbc.com](http://www.psbc.com)

（9） 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](http://www.hxb.com.cn)

(10) 平安银行股份有限公司

注册（办公）地址：广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人：孙建一

联系人：周晓霞

电话：0755-22166212

客服电话：95511

网址：[www.bank.pingan.com](http://www.bank.pingan.com)

(11) 宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号

办公地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人：陆华裕

联系人：陈晖

客服电话：95574

网址：[www.nbcb.com.cn](http://www.nbcb.com.cn)

(12) 浙江民泰商业银行股份有限公司

注册（办公）地址：中国浙江省温岭市三星大道 168 号

法定代表人：江建法

联系人：戚玉林

客服电话：0571-81915305

网址：[www.mintaibank.com](http://www.mintaibank.com)

(13) 浙江稠州商业银行股份有限公司

注册地址：浙江省义乌市义乌乐园东侧

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：邵利兵

电话：0571-87117604

客服电话：(0571) 96527 / 4008096527

网址：[www.czcb.com.cn](http://www.czcb.com.cn)

(14) 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](http://www.dgrcc.com)

（15） 广东顺德农村商业银行股份有限公司

注册（办公）地址：广东省佛山市顺德区大良新城区拥翠路 2 号

法定代表人：姚真勇

联系人：杨洁莹

电话：0757-22387567

客服电话：0757-22223388

网址：[www.sdebank.com](http://www.sdebank.com)

（16） 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

网址：[http://www.jnbank.cc/zh\\_CN/](http://www.jnbank.cc/zh_CN/)

（17） 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](http://www.bsb.com.cn)

（18） 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](http://www.cdrcb.com)





(19) 南充市商业银行股份有限公司

注册地址：四川省南充市顺庆区涪江路 1 号

办公地址：四川省南充市滨江中路一段 97 号 26 栋泰和尚渡南充市商业银行

法定代表人：黄光伟

联系人：李俊辉

联系电话：0817-7118079

客服电话：400-169-6869

网址：www.cgnb.cn

(20) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：杨德红

联系人：朱雅崴

电话：021-38676767

客服电话：95521

网址：http://www.gtja.com

(21) 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：王常青

联系人：许梦圆

电话：010-85156398

客服电话：4008888108

网址：www.csc108.com

(22) 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国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

联系人：容榕

电话：0755-82130504

客服电话：95536

网址：http://www.guosen.com.cn

(23) 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：黄婵君



电话：0755-82960167

客服电话：95565（全国）、4008888111

网址：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

（24） 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](http://www.gf.com.cn)

（25） 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

联系人：侯艳红

电话：010-60838995

客服电话：0755-23835888

网址：<http://www.cs.ecitic.com>

（26） 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：陈有安

联系人：邓颜

电话：010-66568292

客服电话：4008888888

网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

（27） 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：汪小蕾

电话：021-23219689

客服电话：95553 4008888001

网址：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

（28） 申万宏源证券有限公司



注册（办公）地址：上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层

法定代表人：李梅

联系人：李玉婷

电话：021-33388229

客服电话：021-96250500

网址：<http://www.swhysc.com>

（29）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：崔少华

联系人：李良

电话：021-63219781

客服电话：4008888999

网址：[www.cjsc.com.cn](http://www.cjsc.com.cn)

（30）安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层

法定代表人：王连志

联系人：郑向溢

电话：0755-82558038

客服电话：4008-001-001

网址：[www.essence.com.cn](http://www.essence.com.cn)

（31）西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法定代表人：余维佳

联系人：张煜

电话：023-63786141

客服电话：4008096096

网址：[www.swsc.com.cn](http://www.swsc.com.cn)

（32）湘财证券股份有限公司

注册（办公）地址：长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

法定代表人：林俊波

联系人：李鑫

电话：021-68634510

客服电话：4008881551



网址: <http://www.xcsc.com>

(33) 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](http://www.wlzq.com.cn)

(34) 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: 余政

联系人: 赵明

电话: 010-85127622

客服电话: 400-619-8888

网址: [www.msyzq.com](http://www.msyzq.com)

(35) 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: 蔡咏

联系人: 李蔡

电话: 0551-2272101

客服电话: 95578 (全国)

网址: [www.gyzq.com.cn](http://www.gyzq.com.cn)

(36) 渤海证券股份有限公司

注册地址: 天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址: 天津市南开区滨水西道 8 号

法定代表人: 王春峰

联系电话: 022-28451991

客服电话: 400-651-5988

网址: [www.ewww.com.cn](http://www.ewww.com.cn)

(37) 华泰证券股份有限公司

注册(办公)地址: 江苏省南京市江东中路 228 号

法定代表人: 周易

联系人: 庞晓芸



电话：0755-82492193

客服电话：95597

网址：[www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

（38） 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](http://www.i618.com.cn)

（39） 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

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：杨宝林

联系人：赵艳青

电话：0532 - 85023924

客服电话：95548

网址：[www.zxwt.com.cn](http://www.zxwt.com.cn)

（40） 东兴证券股份有限公司

注册（办公）地址：北京市西城区金融大街 5 号（新盛大厦）12、15 层

法定代表人：魏庆华

联系人：汤漫川

联系电话：010-66555316

客服电话：010-66555835

网址：[www.dxzq.net](http://www.dxzq.net)

（41） 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：范力

联系人：陆晓

电话：0512-62938521

客服电话：0512-96288

网址：[www.dwzq.com.cn](http://www.dwzq.com.cn)

（42） 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：尹旭航

联系电话：010-63081493

客服电话：4008008899

网址：www.cindasc.com

（43） 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

（44） 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：刘阳

联系电话：0755-83516289

客服电话：400-6666-888

网址：www.cgws.com

（45） 光大证券股份有限公司

注册（办公）地址：上海市静安区新闸路 1508 号

法定代表人：薛峰

联系人：李晓哲

电话：021-22169111

客服电话：95525（全国）、4008888788

网址：www.ebscn.com

（46） 广州证券股份有限公司

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：邱三发

联系人：林洁茹

联系电话：020-88836999

客服电话：020-961303

网址：www.gzs.com.cn

（47） 东北证券股份有限公司



注册（办公）地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：杨树财

联系人：安岩岩

联系电话：0431-85096517

客服电话：95360/4006-000686

网址：www.nesc.cn

（48） 上海证券有限责任公司

注册（办公）地址：上海市黄浦区西藏中路 336 号

法定代表人：李俊杰

联系人：许曼华

联系电话：021-53519888

客服电话：400-891-8918

网址：www.962518.com

（49） 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

（50） 大同证券有限责任公司

注册地址：大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 12 层

办公地址：山西省太原市长治路 111 号山西世贸中心 A 座 12、13 层

法定代表人：董祥

联系人：薛津

联系电话：0351-4130322

客服电话：400-7121-212

网址：www.dtsbc.com.cn

（51） 国联证券股份有限公司

注册地址：无锡市金融一街 8 号

办公地址：无锡市太湖新城金融一街 8 号 国联金融大厦 7-9 楼

法定代表人：姚志勇

联系人：沈刚

电话：0510-82831662

客服电话：0510-82588168





网址: <http://www.glsc.com.cn>

(52) 浙商证券股份有限公司

注册地址: 浙江省杭州市西湖区杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座

办公地址: 浙江省杭州市西湖区杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6、7 楼

法定代表人: 吴承根

联系人: 陈韵

电话: 021-64718888-2024

客服电话: 95345

网址: <http://www.stocke.com.cn>

(53) 平安证券有限责任公司

注册(办公)地址: 深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人: 谢永林

联系人: 石静武

电话: 021-20667181

客服电话: 95511 转 8

网址: [www.stock.pingan.com](http://www.stock.pingan.com)

(54) 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: 范超

电话: 0551-65161821

客服电话: 96518、4008-096-518

网址: [www.hazq.com](http://www.hazq.com)

(55) 国海证券股份有限公司

注册地址: 广西桂林市辅星路 13 号

办公地址: 广西壮族自治区南宁市滨湖路 46 号

法定代表人: 何春梅

联系人: 王宁基

电话: 0755-82047857

客服电话: 0771-5539032

网址: [www.ghzq.com.cn](http://www.ghzq.com.cn)

(56) 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：蔡一兵

联系人：郭蕾

电话：0731-84403319

客服电话：0731—84403350

网址：[www.cfzq.com](http://www.cfzq.com)

（57） 东莞证券股份有限公司

注册（办公）地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号

法定代表人：张运勇

联系人：孙旭

电话：0769-22119348

客服电话：0769-95328

网址：<http://www.dgzq.com.cn>

（58） 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：李弢

电话：010-84183331

客服电话：400-818-8118

网址：[www.guodu.com](http://www.guodu.com)

（59） 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：刘化军

联系人：霍晓飞

电话：021-50586660-8644

客服电话：4008888588、0519-88166222（常州地区）、021-52574550（上海地区）、0379-64902266（洛阳地区）

网址：[www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

（60） 国盛证券有限责任公司

注册（办公）地址：江西省南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦

法定代表人：曾小普

联系人：俞驰

电话：0791-86283080

客服电话：400-822-2111

网址：[www.gsstock.com](http://www.gsstock.com)



(61) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

办公地址：北京西城区太桥大街 19 号

法定代表人：李季

联系人：王君

联系电话：0991-2310927

客服电话：4008000562

网址：[www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

(62) 中泰证券股份有限公司

注册（办公）地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李玮

联系人：王霖

电话：0531-68889157

客服电话：95538（全国）

网址：[www.qlzq.com.cn](http://www.qlzq.com.cn)

(63) 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：姜昧军

联系人：张婷

电话：0755-83199599-8246

客服电话：0755-83199599

网址：[www.csc.com.cn](http://www.csc.com.cn)

(64) 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](http://www.jyzq.cn)

(65) 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） 德邦证券股份有限公司  
注册地址：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼  
办公地址：上海市福山路 500 号城建国际中心 26 楼  
法定代表人：姚文平  
联系人：刘 熠  
联系电话： 021-68761616-8076  
客服电话： 95353  
网址： www.tebon.com.cn

（67） 西部证券股份有限公司  
注册（办公）地址： 西安市东新街 232 号信托大厦 16-17 层  
法定代表人：刘建武  
联系人：梁承华  
电话：029-87406168  
客服电话：95582  
网址：http: //www.westsecu.com

（68） 华福证券有限责任公司  
注册（办公）地址：福州市鼓楼区温泉街道五四路 157 号 7-8 层  
法定代表人：黄金琳  
联系人：郭相兴  
电话：021-20655175  
客服电话：96326  
网址：http://www.hfzq.com.cn

（69） 华龙证券股份有限公司  
注册（办公）地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心 21 楼  
法定代表人：李晓安  
联系人：邓鹏怡  
电话：0931-4890208  
客服电话：0931-4890619  
网址：www.hlzqgs.com

（70） 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：丁学东

联系人：黄峻敏

电话：0755-83196491

客服电话：010-65051166

0755-8319 5000

网址：www.cicc.com.cn

（71） 财通证券股份有限公司

注册（办公）地址：杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心

法定代表人：沈继宁

联系人：章力彬

电话：0571-87825100

客服电话：0571-95336

网址：http://www.ctsec.com

（72） 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 号荣超经贸中心大厦 47、48、49 层

法定代表人：赵立功

联系人：王鹏宇

电话：0755-83219194

客服电话：40018-40028

网址：www.wkzq.com.cn

（73） 华鑫证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、 B01（b）单元

办公地址：上海市肇嘉浜路 750 号

法定代表人：俞洋

联系人：杨莉娟

电话：021-64376936

客服电话：4008-888-999

网址：www.cfsc.com.cn

（74） 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：高涛

联系人：刘毅

客服电话：4006008008



网址: [www.cjis.cn](http://www.cjis.cn)

(75) 中山证券有限责任公司

注册及办公地址: 深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层

法定代表人: 黄扬录

业务联系人: 罗艺琳

联系电话: 0755-82570586

客服电话: 4001-022-011

网址: [www.zszq.com](http://www.zszq.com)

(76) 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](http://www.hongtastock.com)

(77) 日信证券有限责任公司

注册(办公)地址: 内蒙古自治区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](http://www.rxzq.com.cn)

(78) 联讯证券股份有限公司

注册(办公)地址: 广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼

法定代表人: 徐刚

联系人: 彭莲

电话: 0752-2119700

客服电话: 95564

网址: [www.lxzq.com.cn](http://www.lxzq.com.cn)

(79) 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](http://www.jhzq.com.cn)

（80）九州证券股份有限公司

注册地址：青海省西宁市城西区西大街 11 号

北京运营总部：北京市朝阳区安立路 30 号仰山公园东一门 2 号楼

办公地址：深圳市福田区民田路新华保险大厦 18 楼

法定代表人：吴强

联系人：张靓雅

电话：

010-57672000

0755-33331188-8807

客服电话：4006-5432-18

网址：[www.tyzq.com.cn](http://www.tyzq.com.cn)

（81）国金证券股份有限公司

注册（办公）地址：四川省成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

联系人：刘婧漪、贾鹏

联系电话：028-86690057、028-86690058

客服电话：95310

网址：[www.gjqz.com.cn](http://www.gjqz.com.cn)

（82）中国民族证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼

办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 A 座 40F-43F

法定代表人：何亚刚

联系点人：李小雅

联系电话：010-59355930

客服电话：4008895618

网址：[www.e5618.com](http://www.e5618.com)

（83）爱建证券有限责任公司

注册(办公)地址：上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 楼

法定代表人：钱华

联系人：王薇

电话：021-32229888-25125

客服电话：4001962502

网址：<http://www.ajzq.com>





(84) 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: 吴俊

联系人: 吴尔辉

联系电话: 0755-83007159

客服电话: 4008-188-688

网址: [www.ydsc.com.cn](http://www.ydsc.com.cn)

(85) 华融证券股份有限公司

注册(办公)地址: 北京市西城区金融大街 8 号

法定代表人: 祝献忠

联系电话: 010-85556100

客服电话: 95390;400-898-9999

网址: [www.hrsec.com.cn](http://www.hrsec.com.cn)

(86) 财达证券有限责任公司

注册地址: 河北省石家庄市桥西区自强路 35 号

办公地址: 河北省石家庄市桥西区自强路 35 号庄家金融大厦 24 层

法定代表人: 翟建强

联系人: 李卓颖

联系电话: 0311-66008561

客服电话: 4006128888

网址: [www.s10000.com](http://www.s10000.com)

(87) 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](http://www.tfzq.com)

(88) 首创证券有限责任公司

注册(办公)地址: 北京市西城区德胜门外大街 115 号德胜尚城 E 座

法定代表人: 吴涛

联系人: 刘宇

电话: 010-59366070

客服电话: 4006200620



网址: <http://www.sczq.com.cn/>

(89) 宏信证券有限责任公司

注册(办公)地址: 四川省成都市人民南路二段十八号川信大厦 10 楼

法定代表人: 吴玉明

联系人: 杨磊

电话: 028-86199041

客服电话: 4008-366-366

网址: <http://www.hxzq.cn>

(90) 太平洋证券股份有限公司

注册(办公)地址: 云南省昆明市青年路 389 号志远大厦 18 层

法定代表人: 李长伟

联系人: 唐昌田

电话: 010-88321717

客服电话: 0871-68898130

网址: <http://www.tpyzq.com>

(91) 开源证券股份有限公司

注册(办公)地址: 西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

法定代表人: 李刚

联系电话: 029-63387289

客服电话: 400-860-8866

网址: [www.kysec.cn](http://www.kysec.cn)

(92) 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: 尹伶

电话: 010-66045529

客服电话: 010-66045678

网址: [www.txsec.com](http://www.txsec.com)

(93) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址: 深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006 室

办公地址: 北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 16 层

法定代表人: 杨懿

联系人: 文雯



电话：010-83363101

客服电话：400-166-1188

网址：www.new-rand.cn

(94) 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：陈虹

电话：021-20835809

客服电话：400-920-0022

网址：和讯理财客 (<http://licaike.hexun.com>)

(95) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

办公地址：上海市杨浦区昆明路 508 号北美广场 B 座 12 楼

法定代表人：汪静波

联系人：张裕

电话：021-38509735

客服电话：400-821-5399

网址：www.noah-fund.com

(96) 深圳众禄金融控股股份有限公司

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

电话：0755-33227950

客服电话：4006-788-887

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

(97) 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](http://www.1234567.com.cn))

(98) 上海好买基金销售有限公司

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：张茹

电话：021-20613600

客服电话：400-700-9665

网址：好买基金网（[www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)）

（99） 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：韩爱彬

客服电话：4000-766-123

网址：数米基金网（[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)）

（100） 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](http://www.erichfund.com))

（101） 浙江同花顺基金销售有限公司

注册（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：凌顺平

联系人：吴强

电话：0571 - 88911818

客服电话：4008-773-772

网址：同花顺基金销售网（[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)）

（102） 北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层

法定代表人：闫振杰

联系人：马林

电话：010-59601366-7024

客服电话：400-888-6661

网址：[www.myfund.com](http://www.myfund.com)



(103) 上海利得基金销售有限公司

办公地址: 上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号陆家嘴软件园 10 号楼 12 楼

法定代表人: 沈继伟

联系人: 徐鹏

电话: 021-50583533

客服电话: 400-067-6266

网址: <http://admin.leadfund.com.cn/>

(104) 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: 姜新

联系人: 侯英建

电话: 010-59539955

客服电话: 95162 或 4008888160

网址: 中期金融超市([www.cifcofund.com](http://www.cifcofund.com))

(105) 嘉实财富管理有限公司

注册地址: 上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 46 层 4609-10 单元

办公地址: 北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层

法定代表人: 赵学军

联系人: 余永健

电话: 010-85097570

客服电话: 400-021-8850

网址: [www.harvestwm.cn](http://www.harvestwm.cn)

(106) 北京增财基金销售有限公司

注册(办公)地址: 北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208-1209 室

法定代表人: 王昌庆

联系人: 李皓

联系电话: 010-67000988-6097

客服电话: 400-001-8811

网址: [www.zcvc.com.cn](http://www.zcvc.com.cn)

(107) 北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址: 北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址: 北京市朝阳区东三环中路 20 号乐成中心 A 座 23 层

法定代表人: 梁越

联系人: 马鹏程



电话： 010-57756074

客服电话： 4008980618

网址： [www.chtfund.com](http://www.chtfund.com)

（108）北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲 6 号万通中心 D 座 21&28 层

法定代表人：蒋煜

联系电话：010-58170911

客服电话：400-818-8866

网址： [www.shengshiview.com.cn](http://www.shengshiview.com.cn)

（109）一路财富(北京)信息科技有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街 9 号院 5 号楼 702 室

办公地址：北京市西城区阜城门内大街 2 号万通大厦 22 层 2208 室

法定代表人：吴雪秀

联系人：徐越

电话：010-88312887

客服电话：400-001-1566

网址： [www.yilucaifu.com](http://www.yilucaifu.com)

（110）北京钱景财富投资管理有限公司

注册（办公）地址：北京市海淀区中关村西区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

法定代表人：赵荣春

联系人：盛海娟

联系电话： 010-57418813

客服电话： 400-893-6885

网址： [www.qianjing.com](http://www.qianjing.com)

（111）中经北证（北京）资产管理有限公司

注册（办公）地址：北京市西城区车公庄大街 4 号 5 号楼 1 层

法定代表人：徐福星

联系人：徐娜

联系电话：010-68292940

客服电话：400 600 0030

网址： [www.bzfunds.com/](http://www.bzfunds.com/)

（112）北京君德汇富投资咨询有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 18 号 15 层办公楼一座 1502 室



办公地址：北京市东城区建国门内大街 18 号恒基中心办公楼一座 2202 室

法定代表人：李振

联系人：李梦秋

电话：010-53361051

客服电话：400-066-9355

网址：[www.ksfortune.com](http://www.ksfortune.com)

（113）上海联泰资产管理有限公司

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

法定代表人：燕斌

联系人：陈东

联系电话：021-52822063

客服电话：4000-466-788

网址：<http://www.66zichan.com>

（114）上海汇付金融服务有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山南路 100 号 19 楼

办公地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

法定代表人：冯修敏

联系人：陈云卉

电话：021-33323999\*8318

手机客户端：天天盈基金

网站：<https://tty.chinapnr.com/>

（115）上海凯石财富基金销售有限公司

办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼

法定代表人：陈继武

联系人：李晓明

电话：021-63333319

客服电话：4000-178-000

网址：[www.lingxianfund.com](http://www.lingxianfund.com)

（116）上海中正达广投资管理有限公司

注册（办公）地址：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 3 楼

法定代表人：黄欣

联系人：戴珉微

电话：021-33768132

客服电话：400-6767-523

网址：<http://www.zzwealth.cn>



(117) 北京乐融多源投资咨询有限公司

办公地址: 北京市朝阳区西大望路 1 号温特莱中心 A 座 16 层

法定代表人: 董浩

联系人: 于婷婷

电话: 010-56409010

客服电话: 400-068-1176

网址: [www.jimufund.com](http://www.jimufund.com)

(118) 深圳富济财富管理有限公司

办公地址: 深圳市南山区高新南七道 12 号惠恒集团二期 418 室

法定代表人: 齐小贺

联系人: 陈勇军

电话: 0755-83999907-806

客服电话: 0755—83999907

网址: [www.jinqianwo.cn](http://www.jinqianwo.cn)

(119) 上海陆金所资产管理有限公司

办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人: 郭坚

联系人: 宁博宇

联系电话: 021-20665952

客服电话: 400-8219-031

网址: [www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

(120) 大泰金石投资管理有限公司

办公地址: 上海市长宁区虹桥路 1386 号文广大厦 15 楼

法定代表人: 袁顾明

联系人: 朱真卿

联系电话: 021-22267943

客服电话: 021-22267982

网址: <http://www.dtfortune.com/>

(121) 珠海盈米财富管理有限公司

办公地址: 广州市海珠区琶洲大道 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203

法定代表人: 肖雯

联系人: 钟琛

电话: 020-89629012

客服电话: 020-89629066





网址: [www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

(122) 中国国际期货有限公司

注册地址: 北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 1 层、2 层、9 层、11 层、12 层

办公地址: 北京市朝阳区麦子店西路 3 号新恒基国际大厦 15 层

法定代表人: 王兵

业务联系人: 赵森

联系电话: 010-59539864

客服电话: 95162 / 400-8888-160

网址: [www.cifco.net](http://www.cifco.net)

(123) 中信期货有限公司

注册(办公)地址: 深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座 13 层 1301-1305 室、14 层

法定代表人: 张皓

联系人: 韩钰

联系电话: 0755-23953913

客服电话: 400-9908-826

网址: [www.citicsf.com](http://www.citicsf.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: 广东省广州市天河区珠江新城珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

电话: 020-38283037

传真: 020-83282856

联系人: 张盛

(三) 律师事务所和经办律师

名称: 广东岭南律师事务所

住所: 广州市新港西路 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：欧阳兵、何官益

#### （四）会计师事务所和经办注册会计师

名称：中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：武汉市武昌区东湖路 169 号众环海华大厦 2-9 层

法定代表人：石文先

电话：027 86770549

传真：027 85424329

邮编：430077

经办注册会计师：王兵、龚静伟

### 七、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同的相关规定、并经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）核准募集。

本基金为契约型开放式股票型基金，基金存续期为不定期。

本基金自 2011 年 4 月 13 日起公开募集，并于 2011 年 5 月 13 日募集结束。募集对象为符合法律法规规定的个人投资者、机构投资者及合格境外机构投资者。

本基金的初始面值为每份基金份额人民币 1.00 元。

### 八、基金合同的生效

本基金基金合同于 2011 年 5 月 17 日正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

基金合同生效后，基金份额持有人数量不满两百人或者基金资产净值低于五千万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续二十个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因和报送解决方案。

中国证监会另有规定的，按其规定办理。



## 九、基金份额的申购与赎回

### （一）申购与赎回办理的场所

本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。

投资人可以在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购与赎回。本基金管理人可根据情况增减基金代销机构，并予以公告。

条件成熟时，投资人可以通过基金管理人或其指定的代销机构以电话、传真或网上交易等形式进行基金的申购和赎回，具体办法另行公告。

### （二）申购与赎回办理的开放日及时间

#### 1. 开放日及开放时间

本基金的开放日是指为投资人办理基金申购、赎回等业务的上海、深圳证券交易所交易日。具体业务办理时间以销售机构公布时间为准。

若出现新的证券交易市场或其他特殊情况，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提前公告，同时报中国证监会备案。

#### 2. 申购赎回的开始时间

本基金已于 2011 年 6 月 17 日起开始办理日常申购业务。

（1）基金管理人开始办理申购、赎回业务时应当按照基金合同的规定进行公告并办理备案手续。

（2）基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，其基金份额申购、赎回或转换价格为下次办理基金份额申购、赎回或转换时间所在开放日的价格。

### （三）申购与赎回的原则

（1）“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

（2）“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

（3）当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

（4）赎回遵循“后进先出”原则，即按照投资者认购、申购的先后次序逆序赎回；



(5) 基金管理人可根据基金运作的实际情况并在不影响基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体及基金管理人网站公告并报中国证监会备案。

#### (四) 申购与赎回的程序

##### 1、申购和赎回的申请方式

基金投资者必须根据基金销售机构规定的程序, 在开放日的业务办理时间向基金销售机构提出申购或赎回的申请。

投资者在申购本基金时须按销售机构规定的方式备足申购资金, 投资者在提交赎回申请时, 必须有足够的基金份额余额, 否则所提交的申购、赎回的申请无效而不予成交。

##### 2、申购和赎回申请的确认

T 日规定时间受理的申请, 正常情况下, 基金注册登记机构在 T+1 日内为投资者对该交易的有效性进行确认, 在 T+2 日后 (包括该日) 投资者可向销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申购与赎回的确认情况。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内, 依法对上述申购和赎回申请的确认时间进行调整, 并必须在调整实施日前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案。

基金发售机构申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功, 而仅代表发售机构确实接收到申购、赎回申请。申购、赎回的确认以基金注册登记机构的确认结果为准。

##### 3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式, 若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功, 若申购不成功或无效, 申购款项将退回投资者账户。

投资者 T 日赎回申请成功后, 基金管理人将通过基金注册登记机构及其相关基金销售机构在 T+7 日 (包括该日) 内将赎回款项划往基金份额持有人账户。在发生巨额赎回以及保本周期到期赎回的情形时, 款项的支付办法参照《基金合同》的有关条款处理。

#### (五) 申购和赎回的数额和价格

##### 1、申购金额、赎回份额及余额的处理方式



(1) 投资者通过各代销机构申购本基金份额的, 申购最低金额为 10 元, 超过部分不设最低级差限制; 投资者通过本公司网上交易平台申购的, 申购最低金额为 100 元, 超过部分不设最低级差限制; 通过基金管理人直销中心柜台申购本基金份额时, 首次申购最低金额为人民币 10000 元, 追加申购最低金额为人民币 10 元。投资者可多次申购, 对单个投资者累计持有基金份额不设上限限制。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

(2) 投资者通过各代销机构赎回本基金基金份额的, 赎回最低份额为 1 份, 基金份额余额不得低于 1 份, 赎回后导致基金份额不足 1 份的需全部赎回; 投资者通过本公司网上交易平台赎回的, 赎回最低份额为 100 份, 持有基金份额不足 100 份时发起赎回需全部赎回。

(3) 基金管理人可在法律法规允许的情况下, 调整上述规定申购金额、赎回份额、单个投资者累计持有基金份额上限及单个交易账户的最低基金份额余额的数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

(4) 各代销机构可根据业务情况在不低于上述交易下限的前提下自行调整最低申购金额、最低追加申购金额、最低赎回份额和最低留存份额的限制, 投资者办理相关业务时, 应遵循各代销机构的具体业务规定。

## 2、申购赎回费率

(1) 申购费率:

本基金在申购时收取前端申购费用, 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。

本基金申购费用由投资者承担, 不列入基金财产, 主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

本基金的申购费用应在投资者申购基金份额时收取。投资者在一天之内如果有多笔申购, 适用



费率按单笔分别计算。

## （2）赎回费率

本基金赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。本基金的赎回费率如下：

| 持有期（计为 T）     | 赎回费率 |
|---------------|------|
| T < 1 年       | 1.5% |
| 1 年 ≤ T < 2 年 | 1.2% |
| 2 年 ≤ T < 3 年 | 1.0% |
| T ≥ 3 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。

（3）本基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

（4）基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

（5）基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定情形下根据市场情况制定基金促销计划，包括但不限于针对以特定交易方式（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，基金管理人可以对基金销售费用实行一定的优惠并依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

## 3、申购份额的计算方法

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / [1 + \text{申购费率}]$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日基金份额净值}$$

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。

例二，假定某投资人申购本基金 10,000 元，T 日本基金的基金份额净值为 1.1 元。该笔申购的申购费用及获得的申购份额计算如下：

$$\text{净申购金额} = 10,000 / [1 + 1.0\%] = 9,900.99 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 10,000 - 9,900.99 = 99.01 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 9,900.99 / 1.10 = 9000.90 \text{ 份}$$

#### 4、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：

$$\text{赎回总额} = \text{赎回份数} \times \text{T 日基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{赎回金额} = \text{赎回总额} - \text{赎回费用}$$

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。

例三，假定某投资人在 T 日赎回其持有的基金份额 10,000 份，T 日的基金份额净值为 1.1 元，则投资人获得的赎回金额计算如下：

$$\text{赎回总额} = 10,000 \times 1.1 = 11,000 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 11,000 \times 1\% = 110 \text{ 元}$$

$$\text{赎回金额} = 11,000 - 110 = 10890 \text{ 元}$$

#### 5、基金份额净值的计算公式

T 日的基金份额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。计算公式为：

$$\text{T 日基金份额净值} = \text{T 日基金资产净值} / \text{T 日基金份额的余额数量}$$

##### （六）申购与赎回的注册登记

（1）经基金销售机构同意，基金投资人提出的申购和赎回申请，在基金管理人规定的时间之前可以撤销。

（2）投资人申购基金成功后，基金注册登记人在 T+1 日为投资人增加权益并办理注册登记手续，投资人自 T+2 日起有权赎回该部分基金份额。

（3）投资人赎回基金成功后，基金注册登记人在 T+1 日为投资人扣除权益并办理相应的注册





登记手续。

(4) 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 日予以公告。

#### (七) 巨额赎回的认定及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

单个开放日中, 本基金的基金份额净赎回申请(赎回申请总份额扣除申购总份额后的余额)与净转出申请(转出申请总份额扣除转入申请总份额后的余额)之和超过上一日基金总份额的 10%, 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决定接受全额赎回或部分延期赎回。

(1) 接受全额赎回: 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) 部分延期赎回: 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财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 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, 应当按单个基金份额持有人申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例, 确定该基金份额持有人当日受理的赎回份额; 未受理部分除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外, 延迟至下一开放日办理, 赎回价格为下一个开放日的价格。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权, 以此类推, 直到全部赎回为止。

(3) 当发生巨额赎回并顺延赎回时, 基金管理人应在 2 日内通过指定媒体及基金管理人的公司网站或代销机构的网点刊登公告, 并在公开披露日向中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。同时以邮寄、传真或《招募说明书》规定的其他方式通知基金份额持有人, 并说明有关处理方法。

(4) 暂停接受和延缓支付: 本基金连续 2 个或 2 个开放日以上发生巨额赎回, 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 20 个工作日, 并应当在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。





#### （八）拒绝或暂停接受申购、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者的申购申请：

- 1）不可抗力的原因导致基金无法正常运作；
- 2）证券交易场所在交易时间非正常停市，导致当日基金资产净值无法计算；
- 3）基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益；
- 4）法律法规规定或中国证监会认定的其他可暂停申购的情形；
- 5）基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购。

发生上述情形之一的，申购款项将全额退还投资者。发生上述（1）到（4）项暂停申购情形时，基金管理人应当在至少一家指定媒体及基金管理人网站刊登暂停申购公告。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并依法公告。

（2）在以下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请：

- 1）不可抗力的原因导致基金管理人不能支付赎回款项；
- 2）证券交易场所依法决定临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- 3）因市场剧烈波动或其他原因而出现连续 2 个或 2 个以上开放日巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；
- 4）发生《基金合同》规定的暂停基金资产估值情况；
- 5）发生《基金合同》第二十二条“保本周期到期”约定的情况，即基金管理人可在保本周期到期前 30 个工作日内视情况暂停本基金的日常赎回业务（含转换出业务）；
- 6）法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应在当日立即向中国证监会备案。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，可延期支付部分赎回款项，按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以支付。

同时，在出现上述第 3）款的情形时，对已接受的赎回申请可延期支付赎回款项，最长不超过 20 个工作日，并在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。投资者在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。

暂停基金的赎回，基金管理人应及时在至少一家指定媒体及基金管理人网站上刊登暂停赎回公告。

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，并依照有关规定在至少一



家指定媒体及基金管理人网站上公告。

(3) 暂停基金的申购、赎回，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

(4) 暂停申购或赎回期间结束，基金重新开放时，基金管理人应依法公告并报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

1) 如果发生暂停的时间为一天，基金管理人将于重新开放日，在至少一种指定媒体，刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公告最近一个开放日的基金份额净值。

2) 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，基金管理人将提前两个工作日，在至少一种指定媒体，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近一个开放日的基金份额净值。

3) 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，基金管理人应提前三个工作日，在至少一种指定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近一个开放日的基金份额净值。

## 十、基金的转换

基金转换是指基金份额持有人在本基金存续期间按照基金管理人的规定申请将其持有的本基金基金份额全部或部分转换为基金管理人管理的其它开放式基金份额的行为。

本基金已在部分代销机构、网上直销平台开通本基金与本基金管理人管理的其他部分基金之间的转换业务，具体业务办理时间、业务规则及转换费率已在相关基金转换公告中列明，具体实施办法参见相关公告。其他最新转换业务信息本基金管理人将另行公告。

## 十一、基金的非交易过户与转托管

(1) 非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资人基金账户转移到另一投资人基金账户的行为，包括继承、捐赠、强制执行，及基金注册与过户登记人认可的其它行为。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是合格的个人投资者或机构投资者。其中：

1) “继承”是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承。

2) “捐赠”仅指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或其他具有社会公益性质的社会团体。

3) “强制执行”是指国家有权机关依据生效的法律文书将基金份额持有人持有的基金份额强制执行划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。



基金注册登记人可以办理的非交易过户情形，以其公告的业务规则为准。

(2) 办理非交易过户业务必须提供基金注册登记人要求提供的相关资料，直接向基金注册登记人或其指定的机构申请办理。

(3) 基金份额持有人在变更办理基金申购与赎回等业务的销售机构（网点）时，投资人可根据各销售机构的实际情况办理已持有基金份额的转托管。基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

## 十二、基金份额的冻结、解冻及质押

基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻以及注册登记机构认可的其他情况下的冻结与解冻。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益按照我国法律法规、监管规章以及国家有权机关的要求决定是否冻结。在国家有权机关作出决定之前，被冻结部分产生的权益先行一并冻结。被冻结部分份额仍然参与收益分配与支付。

## 十三、定期定额投资计划

本基金管理人可为基金投资人提供定期定额投资计划服务，具体实施方法以基金管理人届时公布的业务规则和公告为准。

## 十四、基金的保本

### （一）保本

本基金为基金份额持有人在当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期并持有到期的基金份额提供的保本额为：在当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期并持有到期的基金份额 $\times$ 1.00 元人民币。

在保本周期到期日，如按基金份额持有人在当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上相应基金份额在当期保本周期内的累计分红款金额之和计算的总金额高于或等于保本额，基金管理人将按可赎回金额支付给基金份额持有人；如基金份额持有人在当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上相应基金份额在当期保本周期内的累计分红金额之和低于保本额，差额部分即为保本赔付差额。详细赔付程序请参见《招募说明书》“第十五、基金保本的保证”之第（五）条。但基金份额持有人未持有到期而赎



回或转换出的，赎回或转换出的部分不适用本条款；在保本周期内申购的基金份额，除担保人书面对其承诺保本并提供担保外，不适用本条款。

## （二）保本周期

3 年，亦称为当期保本周期，特指本基金第二个保本周期。

本基金的第二个保本周期自第二个保本周期起始日起至 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。

第二个保本周期届满时，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。

## （三）保本案例

若某投资者在本基金第二个保本周期起始日持有 10,000 份本基金份额并持有到第二个保本周期到期，在第二个保本周期内持有基金份额累积分红 0.05 元/基金份额，则：

（一）、若保本周期到期日，本基金基金份额净值为 0.85 元

可赎回金额 $=0.85 \times 10,000 = 8,500$  元

持有期间累计分红金额 $=0.05 \times 10,000 = 500$  元

可赎回金额+持有期间累计分红金额 $=9000$  元

即：可赎回金额+持有期间累计分红金额 $<$ 实际净认购金额

若第二个保本周期到期日该投资者赎回基金份额，则基金管理人将按照适合保本的基金份额在第二个保本周期起始日的初始投资金额（10000 元）扣除其持有期间的累计分红金额，向该投资者支付 9500 元。

（2）若保本周期到期日，本基金基金份额资产净值为 1.500 元

可赎回金额 $=1.500 \times 10,000 = 15,000$  元

持有期间累计分红金额 $=0.05 \times 10,000 = 500$  元

可赎回金额+持有期间累计分红金额 $=15,500$  元

即：可赎回金额+持有期间累计分红金额 $>$ 实际净认购金额

若保本周期到期日该投资者赎回基金份额，则基金管理人将按照可赎回金额向该投资者支付 15,000 元。



#### （四）适用保本条款的情形

（1）基金份额持有人在当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期并持有到期的基金份额。

（2）对于持有到期的份额，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。

#### （五）不适用保本条款的情形

（1）在保本周期到期日，本基金的基金份额净值与每份基金份额在保本周期内的累计分红金额之和等于或高于 1.00 元人民币；

（2）基金份额持有人在当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期，但在基金保本周期到期日前（不包括该日）赎回或转换出的基金份额；

（3）基金份额持有人在保本周期内申购的基金份额；

（4）在保本周期内发生《基金合同》规定的《基金合同》终止的情形；

（5）在保本周期内发生本基金与其他基金合并或更换基金管理人的情形，且担保人不同意继续承担担保责任；

（6）在保本周期到期日之后（不包括该日）基金份额发生的任何形式的净值减少；

（7）因不可抗力原因导致基金投资亏损；或因不可抗力事件直接导致基金管理人无法按约定履行全部或部分义务或延迟履行义务的，或《基金合同》规定的其它情形基金管理人免于履行保本义务的；

（8）因不可抗力事件导致基金担保人无法按约定履行全部或部分义务或延迟履行义务的。

### 十五、基金保本的保证

（1）为确保履行保本条款，保障基金份额持有人利益，本基金由广州越秀金融控股集团有限公司作为担保人。

（2）担保人与基金管理人签订《金鹰保本混合型证券投资基金第二个保本周期保证合同》。（全文详见《招募说明书》附件）。基金份额持有人购买基金份额的行为视为同意该担保函的约定。本基金保本由担保人提供不可撤销的连带责任担保；担保的范围为基金份额持有人在第二个保本周期开始前的过渡期申购或从第一个保本周期转入到第二个保本周期并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上相应基金份额在第二个保本周期内的累计分红金额之和低于基金份额持有人保本额的差额。担保期间为基金保本周期到期日之日起六个月止。担保人承担担保责任的金额最高不超过本基金第二个保本周期的募集规模上限。



(3) 保本周期内，担保人出现足以影响其履行担保函项下担保责任能力情形的，应在该情形发生之日起三日内通知基金管理人以及基金托管人。基金管理人在接到通知之日起三个工作日内应将上述情况报告中国证监会并提出处理办法，并在接到通知之日起五个工作日内在指定媒体上公告上述情形。当确定担保人己丧失履行担保函项下担保责任能力或宣告破产的情况下，基金管理人应召集基金份额持有人大会。

(4) 保本周期内、下一保本周期内更换担保人必须经基金份额持有人大会决议通过，并且担保人的更换必须符合基金份额持有人的利益。

保本周期内更换担保人的程序：

1) 提名

新任担保人由基金管理人提名。

基金管理人提名的新任担保人必须符合如下条件：(1) 具有法律法规和中国证监会规定的担任基金担保人的资质和条件；(2) 符合基金份额持有人的利益。

2) 决议

基金份额持有人大会对被提名的新任担保人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的 1/2 以上（含 1/2）表决通过。

3) 备案

基金份额持有人大会选任新任担保人的决议须经中国证监会备案后方可执行。

4) 签订《保证合同》

更换担保人经中国证监会备案后，基金管理人与新任担保人签订《保证合同》。

5) 公告

基金管理人在中国证监会备案后 2 日内在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告更换担保人的有关事项以及基金管理人与新任担保人签订的《保证合同》。

6) 交接

原担保人职责终止的，原担保人应妥善保管保本周期内担保业务资料，及时向基金管理人和新任担保人办理担保业务资料的交接手续，基金管理人和新任担保人应及时接收。

保本周期内更换担保人的，原担保人承担的所有与本基金担保责任相关的权利义务由继任的担保人承担。在新任担保人接任之前，原担保人应继续承担担保责任。

(5) 基金份额持有人于此同意授权基金管理人作为其代理人代为行使向担保人索偿的权利并办理相关的手续(包括但不限于向担保人发送《履行担保责任通知书》及代收相关款项等)。如果符合条件的基金份额持有人在第二个保本周开始前的过渡期申购或从第一个保本周转入到第二个保本周并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上相应基金份额在第二个保本周内的累计分红金额之和低于基金份额持有人的保本额，且基金管理人无法全额履行保本义务的，





基金管理人在保本周期到期日后三个工作日内，向担保人发出书面《履行担保责任通知书》（应当载明需担保人代偿的金额），担保人将在收到基金管理人发出的《履行担保责任通知书》后的三个工作日内完成应代偿金额的核实，并于核实完成后的四个工作日内将基金管理人尚未补足的款项一次性足额支付至本基金在基金托管人处开立的资金结算账户，基金管理人应在保本周期到期日后二十个工作日内将保本赔付差额（含基金管理人自有资金和担保人的代偿款）支付给基金份额持有人。若担保人未履行全部或部分担保责任的，基金份额持有人有权直接就差额部分向担保人追偿。担保人将代偿金额全额划入本基金在基金托管人处开立的账户中后即全部履行了担保责任，担保人无须对基金份额持有人逐一进行清偿。代偿款的分配与支付由基金管理人负责，担保人对此不承担责任。

（6）基金管理人有权代表基金份额持有人要求担保人按照本基金合同及担保函的约定履行担保责任。除本部分第四款之第 6 项所指的“保本周期内更换担保人的，原担保人承担的所有与本基金担保责任相关的权利义务由继任的担保人承担”以及下列除外责任情形外，担保人不得免除担保责任：

1）在第二个保本周期到期日，基金份额净值与每份基金份额在第二个保本周期内的累计分红金额之和等于或高于 1.00 元人民币；

2）基金份额持有人在第二个保本周期开始前的过渡期申购或从第一个保本周期转入到第二个保本周期，但在基金第二个保本周期到期日前（不包括该日）赎回或转换出的基金份额；

3）基金份额持有人在第二个保本周期内申购的基金份额；

4）在第二个保本周期内发生本基金合同规定的基金合同终止的情形；

5）在第二个保本周期内发生本基金与其他基金合并或更换基金管理人的情形，且担保人不同意继续承担担保责任；

6）在第二个保本周期到期日之后（不包括该日）基金份额发生的任何形式的净值减少；

7）未经担保人书面同意修改《基金合同》条款，可能加重担保人担保责任的，根据法律法规要求进行修改的除外；

8）因不可抗力的原因导致基金投资亏损；或因不可抗力事件直接导致基金管理人无法按约定履行全部或部分义务或延迟履行义务的，或《基金合同》规定的其他情形基金管理人免于履行保本义务的；

9）因不可抗力事件导致基金担保人无法按约定履行全部或部分义务或延迟履行义务的。

（7）保本周期届满时，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，并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的，本基金将转入下一保本周期；否则，本基金变更为非保本的债券型基金，基金名称相应变更为“金鹰持续收益债券型证券投资



资基金”，担保人不再为该债券型基金承担担保责任。

(8) 担保费用由基金管理人从基金管理费收入中按照前一日基金净资产的 0.12% 年费率计提担保费，担保费每日计算，逐日累计至每年年末，按年度支付。

## 十六、基金的投资

### (一)、保本周期内的投资

#### 1、投资目标

采用改进的固定比例组合保险策略（CPPI），引入收益锁定机制，在严格控制投资风险、保证本金安全的基础上，力争在保本期结束时，实现基金资产的稳健增值。

#### 2、投资理念

坚持“深入研究、稳健投资、严控风险、保护本金”的投资理念，在注重投资组合安全性与流动性的前提下，努力把握投资机会，追求基金资产的稳健增值。

#### 3、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。

#### 4、投资策略

首先，通过一个举例的例子来说明本基金的投资策略。假设基金初始募集规模为 15 亿元，计算基金价值底线的贴现率取三年期国债的到期收益率 2.8772%；保守起见，假设风险乘数 M 等于 1，则初始投资于债券的金额为 13.7763 亿元，投资于股票的金额为 1.2237 亿元；即便是投资于股票





的 1.2237 亿元全部损失,那么,所投资的 13.7763 亿元国债在 3 年之后本息总额就变成了 15 亿元,从而,实现了保本的目标。

#### (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。

##### 1) 传统的 CPPI 策略

本基金权益类资产与固定收益类资产配置的核心策略是改进的固定比例组合保险策略(CPPI),



该策略的基本原理如下：

假设本基金保本期结束时的保本额度为： $V_{tur}$ ，当前时点距离保本周期到期日的时间长度为  $T$  期，期间固定收益类资产的连续时间收益率为  $r$ ，则本基金组合的价值底线（Cushion）为： $V = V_{tur} \times e^{-rT}$

再假设本基金的风险乘数为  $m$ ，则  $t$  期本基金可投资于权益类资产的额度为：

$$S_t = m_t \times (V_t - V)$$

投资于固定收益类资产的额度为： $B_t = V_t - S_t$

$m_t$  为  $t$  时刻的风险乘数，反映了本基金的风险特征。

## 2) 改进的 CPPI 策略——引入收益锁定机制

传统的 CPPI 策略存在一个重要的缺陷：缺乏收益锁定机制。为了弥补经典 CPPI 策略的上述缺陷，本基金作出如下的改进：

### a. 价值底线的计算

假设截止  $t$  时刻单位基金份额的累计分红为  $dt$ ， $t$  时刻基金资产净值为  $V_t$ 、基金份额为  $E_t$ ，单位基金份额的保本额为 1 元，则：

$$V = \max[(1-p) \times E_t \times (1-dt) \times e^{-rT} + p \times V_t, E_t \times (1-dt) \times e^{-rT}]$$

在上式当中， $p$  为收益锁定比率， $p$  大于 0 且小于 1，一般情况下  $p$  不低于 0.8。

再假设本基金的风险乘数为  $m_t$ ，则  $t$  期本基金可投资于权益类资产的额度为：

$$S_t = m_t \times (V_t - V)$$

投资于固定收益类资产的额度为： $B_t = V_t - S_t$

### b. 通过定性与定量分析，确定风险乘数的具体数值

首先，本基金通过对宏观经济所处投资时钟的象限、股票市场的估值水平以及上市公司盈利的未来增长，再结合国债、央票、金融债、企业债这四个子类债券的存量规模/（本基金的净资产规模×本基金债券投资比例的中值）、日均成交量/（本基金的净资产规模×本基金债券投资比例的中值）、日均换手率等参数进行定性分析，决定风险乘数是增加、不变还是降低；其次，本基金对上述考量因素进行审慎的定量分析，以进一步明确风险乘数的具体数值。

### c. 收益锁定比率的确定

$p$  大于 0 且小于 1，一般情况下  $p$  不低于 0.8。在具体数值的设定上，本基金根据宏观经济所处的投资时钟的象限、政府财政政策与货币政策态势、债券市场定价与股票市场估值状况、运行趋势及其收益率的波动性、单位基金份额的累计净值、距离保本周期到期日的时间长度，以确定收益锁定比率的数值。

一般而言，在宏观经济所处的投资时钟的“衰退”象限、并预期“衰退”即将结束，“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，



以及股票市场的估值状态并未处于历史上估值水平的较高区间并预期估值下行空间较小的情况下，将收益锁定比率  $p$  维持在较低水平；在投资时钟的“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，以及股票市场的估值水平处于历史上估值水平的较高区间并预期较高的估值水平难以持续的情况下，将逐渐提高收益锁定比率  $p$ ；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，将收益锁定比率  $p$  比例保持在较高水平。

另外，如果单位基金份额的累计净值较大，可将收益锁定比率  $p$  维持在较低水平；如果距离保本周期到期日较近，应将收益锁定比率  $p$  维持在较高水平，以锁定收益。

### （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。

##### ① 大类资产的比例配置

借鉴投资时钟的分析框架，结合未来利率的变化趋势、上市公司未来整体盈利增长状况、股票市场估值状况与未来可能运行区间的审慎研判，确定债券类、权益类、货币类资产配置的大致比例。

在投资时钟的“衰退”象限、并预期“衰退”即将结束，在投资时钟的“复苏”象限，在投资时钟的“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，以及股票市场的估值状态并未处于历史上估值水平的较高区间并预期估值下行空间较小的情况下，将本基金权益类资产的配置比例维持在较高水平，债券类、货币类资产的配置比例随之而定；在投资时钟的“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，以及股票市场的估值水平处于历史上估值水平的较高区间并预期较高的估值水平难以持续的情况下，将逐渐降低



权益类资产的配置比例，并根据本基金对于未来利率变化趋势的预判，合理确定债券类、货币类资产的配置比例；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，根据财政政策与货币政策的取向、股票市场的估值水平与运行状况，严格控制权益类资产的配置比例，同时，将债券类资产的配置比例维持在较高水平，货币类资产的配置比例随之而定；

#### ② 大类资产的期限配置

根据宏观经济所处投资时钟的象限、加权平均久期的目标值，确定本基金债券类资产的加权平均久期之目标区间、货币资产的加权平均期限之目标范围（股票资产不存在期限的问题）。

在确定债券类资产的配置比例与期限结构的过程中，必须针对债券市值相对于利率变化的敏感性进行严格的压力测试与情景模拟，根据压力测试与情景模拟的结果，制定审慎的配置方案。

#### 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。

#### ① 债券组合的加权平均久期之目标范围

本基金根据宏观经济走势及其所处投资时钟的象限、CPI 与利率变化趋势以及预测值、未来 1～3 年央行可能的加减息幅度，通过审慎分析与测算，确定投资组合的加权平均久期。一般而言，当预期利率下降时，适当提升久期，以分享债券的上涨收益；当预期利率上升时，适当降低久期，以规避债券的下跌风险。

当宏观经济处于投资时钟“过热”象限且政府已采取紧缩性政策或预期政府将采取紧缩性政策的情况下、在投资时钟的“滞胀”象限且预期短期内还会进入“衰退”的象限的情况下，将投资组合的加权平均久期维持在较低的水平；在宏观经济的“滞胀”象限、“衰退”象限且政府已采取宽松性政策或预期将采取宽松政策的情况下，加权平均久期可适当增大；在“复苏”象限，视申购赎回的情况、相关券种的流动性等因素选择适当的加权平均久期，原则上，维持加权平均久期基本不变。

#### ② 债券类资产的期限配置

在确定了债券类、货币类资产的配置比例与大致的期限结构之后，根据债券类资产的加权平均久期之目标区间，在投资时钟的分析框架下确定久期为 1 年以下、1～3 年、3～5 年、5 年以上的债券品种之市值占本基金债券总市值的相对比例。



### ③债券类资产的类属配置

本基金通过对未来利率的变动趋势、宏观经济所处投资时钟的象限、基金申购与赎回的情况、股票市场的运行状况等定性与定量因素的分析，确定国债、央票、金融债、企业债与公司债这四个子类债券市值占基金债券类资产总市值的相对比例。

当宏观经济处于投资时钟“衰退”象限且政府已采取宽松性政策或预期将采取宽松政策的情况下、“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，以及股票市场的上行阶段，将可转债的配置比例保持在一个较高的水平，以获取较高的投资收益，同时，将国债、央票、金融债配置的配置比例维持在一个较高的水平，以应对可能发生的净赎回与基金转换；当宏观经济处于“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、“滞胀”象限，以及股票市场的下行阶段，降低企业债、公司债（尤其是可转债）的配置比例，提高国债、央票、金融债配置的配置比例。

如果基金连续处于净赎回状态，则应提高国债、央票、金融债配置的配置比例，以提升资产组合的流动性。

本基金将根据各类属债券的流动性、换手率、配置比例的目标区间、投资组合加权平均久期的目标区间以及基金净申购与净赎回的情况，确定各类属债券的期限构成。

#### 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。

#### ①国债与央票

对于国债与央行票据，本基金原则上采取买入并持有的投资策略，但在持有过程中会结合利率





走势、到期收益率、换手率、投资组合的加权平均久期之目标范围、申购赎回的情况，在不同剩余期限的国债与央票之间选取适当的品种。另外，本基金将审慎评估回购收益率与国债、央票的到期收益率之间的利差，选择到期收益率高于回购收益率或者预期收益率有下降空间的国债、央票品种。

#### ② 金融债

在内部评级的基础上，本基金将根据未来宏观经济所处投资时钟的象限、未来利率的变化趋势、金融债各品种的到期收益率、换手率、外部评级、本基金投资组合的加权平均久期之目标范围等因素，审慎遴选具有比较优势的金融债品种。

#### ③ 普通企业债与公司债

本基金根据债券市场收益率数据，运用债券定价模型对单个债券进行估值，并结合债券的信用评级（外部评级与本基金内部评级）、流动性、息票率、税赋、提前偿付与赎回等因素，选择具有比较优势的债券品种进行投资。

如果债券获得主管机构的豁免评级，本基金根据对该债券内部评级的结果，决定是否将其纳入基金的投资范围。

#### ④ 含权债券的选择

含权债券主要有两类：含赎回或回售选择权的债券；含可转换为股本选择权的债券。

本基金利用债券市场收益率数据，运用相关定价模型，计算含赎回或回售选择权的债券之期权调整利差（OAS），作为此类债券估值的主要依据。

可转换公司债券包含了股票买入期权，投资者既可以获得债券投资的固定收益，又可在一定期限之后转换为股票以分享公司股票价格上涨所带来的投资回报。本基金在对债转股条款、发债公司基本面进行深入分析的基础上，利用到期收益率来判别可转债的纯债价值，选择纯债价值被低估的可转债以提升本金投资的安全性；通过对发债公司未来经营业绩的预测、股票估值模型、未来宏观经济所处投资时钟的象限以及股票市场运行趋势的判断，来鉴别可转债的期权价值。在宏观经济与股票市场下行周期的后半段与上升周期的前半段，优先选择期权价值被低估的可转债，以获取投资收益。

#### ⑤ 资产支持证券

通过分析资产支持证券之基础性资产池的风险收益特征，本基金将审慎测算其基础性资产的违约风险、提前偿付风险，根据资产证券化的收益结构安排，模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流支付，并利用合理的到期收益率对资产支持证券进行估值。同时，本基金还将充分考虑资产支持证券之到期收益率的风险溢价与流动性溢价，严格控制资产支持证券的投资风险。

#### ⑥ 回购



结合利率走势、回购收益率、交易对手的信用状况，综合评估其收益性与违约风险，审慎分析品种间收益率的期限结构，以短期品种为主，选择收益率相对高的回购品种进行投资。

#### ⑦金鹰债券综合评价模型

为了综合评价债券品种的比较优势，本基金根据债券品种的流动性、区间收益率、信用评级、历史上的违约记录、到期收益率，以及本基金的资产规模等因素，开发了“金鹰债券综合评价模型”，为债券品种的遴选提供数量化依据。

根据“金鹰债券综合评价模型”的得分值，将久期为1年以下、1~3年、3~5年、5年以上的国债、央票、金融债、企业债、公司债、短期融资券、资产支持证券分类排序，分别选取7个子类债券、4种期限范围内得分值居于前1/2的品种作为本基金的备选投资品种。

#### 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。

#### 7) 其他金融工具的投资

若有中国证监会允许基金投资的其他金融工具推出（比如指数期权、个股期权等），本基金可在符合相关法律法规的规定下，进行投资，无需就投资该投资品种召开基金持有人大会。本基金将至少在开展新品种投资三个工作日前进行相应公告。

## 5、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。

## 6、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。

（二）变更后的“金鹰持续收益债券型证券投资基金”的投资

### 1、投资目标

通过对宏观经济、资本市场运行趋势的前瞻性研判，预测未来利率水平及其变化趋势，力求准确把握固定收益类、权益类资产的投资机会，在严格控制投资风险的前提下，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。

### 2、投资理念

坚持“深入研究、稳健投资、主动管理、严控风险”的投资理念，在注重投资组合安全性与流动性的前提下，努力把握投资机会，追求基金资产的稳健增值。

### 3、投资范围

本基金主要投资于固定收益类证券，包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债（含分离交易可转债）、资产支持证券、短期融资券、回购等固定收益类证券品种，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）。本基金对固定收



益类证券品种的投资比例不低于基金资产的 80%；对股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、货币等其他金融工具的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，权证投资的比例范围占基金资产净值的 0~3%。为维持投资组合的流动性，本基金持有现金和到期日不超过一年的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金可在二级市场买卖股票、权证等权益类资产，也可参与一级市场新股申购或增发。

#### 4、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) 安全性与流动性优先，兼顾收益性

就债券型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债券型基金之目的在于：获取稳健的投资收益，而不必承担过高的投资风险；风险偏好程度较高的投资者购买债券型基金之目的在于：暂时规避其他高风险资产的下跌风险。

显然，对于以上两类投资者而言，债券型基金资产的安全性与流动性都是第一位的，收益性是第二位的。为此，本基金坚持安全性与流动性优先、兼顾收益性的投资原则。

##### （2）投资策略方法



在投资组合管理过程中，本基金采取主动投资的方法，充分发挥金融工程与数量化方法的决策辅助作用，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，追求收益最大化。本基金的核心投资策略方法由两部分组成：基础性分析工具（市场利率预测、投资时钟所处象限的判断）与交易性策略。

本基金分别采用定性与定量的方法来预测利率的变化趋势与变化量。另外，本基金借鉴投资时钟的分析框架，通过对投资时钟各象限内股票、债券、货币资产平均收益率的审慎考察，为本基金大类资产配置提供新的分析视角。

本基金的交易型策略包括：收益率曲线分析、期限结构滚动配置与现金流管理、无风险套利、流动性管理、加权平均久期管理、利率波动策略、正回购放大、利率免疫、一级市场参与、信用策略。本基金将根据宏观经济运行状况、债券市场与股票市场走势、CPI 与未来利率的变化趋势，灵活选择恰当的交易策略，在严格控制风险、保持投资组合流动性的前提下，获取投资收益。

### （3）资产配置策略

本基金的资产配置策略分成：投资组合加权平均久期的确定、大类资产配置、债券类属配置、债券品种的选择这四个层面。在每一个层面上，需要解决的问题各不相同。

#### 1）确定投资组合的加权平均久期之目标范围

本基金根据宏观经济走势及其所处投资时钟的象限、CPI 与利率变化趋势以及预测值、未来 1～12 个月央行可能的加減息幅度，通过审慎分析与测算，确定投资组合的加权平均久期。一般而言，当预期利率下降时，适当提升久期，以分享债券的上涨收益；当预期利率上升时，适当降低久期，以规避债券的下跌风险。

当宏观经济处于投资时钟“过热”象限且政府已采取或预期将采取紧缩性政策、“滞胀”象限且预期政府短期内不会采取扩张性政策的情况下，将投资组合的加权平均久期维持在较低的水平；而在“滞胀”象限或“衰退”象限且政府已采取或预期将采取扩张性政策的情况下，将投资组合的加权平均久期维持在较高的水平；在“复苏”象限，视申购赎回的情况、相关券种的流动性等因素选择适当的加权平均久期，原则上，维持加权平均久期基本不变。

#### 2）大类资产的配置策略

本基金采用“自上而下”的投资视角，定性分析与定量分析并用，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。



### ① 大类资产的比例配置

借鉴投资时钟的分析框架，结合未来利率的变化趋势、股票市场估值状况与未来可能的运行区间，大致确定债券类、权益类、货币类资产配置的大致比例。

当宏观经济处于投资时钟“衰退”象限并预期“衰退”即将结束、“复苏”象限、“过热”象限但政府并未采取紧缩性政策，以及股票市场的上行阶段，将本基金权益类资产的配置比例维持在较高水平，债券类、货币类资产的配置比例随之而定；在“过热”象限且政府已采取或预期将采取紧缩性政策、“滞胀”象限并预期滞胀状态仍将持续的情况下，将债券类、权益类资产的配置比例均维持在较低水平，货币类资产的配置比例随之而定；在“滞胀”象限并预期将滑入“衰退”象限、“衰退”象限，根据财政政策与货币政策的取向、股票市场的估值水平与运行状况，确定权益类资产的配置比例，同时，将债券类资产的配置比例维持在较高水平，货币类资产的配置比例随之而定。

### ② 大类资产的期限配置

根据宏观经济所处投资时钟的象限、加权平均久期的目标范围，确定本基金债券类资产的加权平均久期之目标区间、货币资产的加权平均期限之目标范围（股票资产不存在期限的问题）。

在确定大类资产的配置比例与期限结构的过程中，必须针对债券市值相对于利率变化的敏感性进行严格的压力测试与情景模拟，根据压力测试与情景模拟的结果，制定审慎的配置方案。

## 3) 债券类资产的配置策略

### ① 债券类资产的期限配置

在确定了债券类、货币类资产的配置比例与大致的期限结构之后，根据债券类资产的加权平均久期之目标区间，在投资时钟的分析框架下确定久期为 1 年以下、1~3 年、3~5 年、5 年以上的债券品种之市值占本基金债券总市值的相对比例。

### ② 债券类资产的类属配置

本基金通过对未来利率的变动趋势、宏观经济所处投资时钟的象限、基金申购与赎回的情况、股票市场的运行状况等定性与定量因素的分析，确定国债、央票、金融债、企业债与公司债这四个子类债券市值占基金债券类资产总市值的相对比例。

当宏观经济处于投资时钟“衰退”象限并预期“衰退”即将结束、“复苏”象限、“过热”象限但政府并未采取紧缩性政策，以及股票市场的上行阶段，将可转债的相对比例保持在一个较高的水平，以获取较高的投资收益，同时，将国债、央票、金融债配置的相对比例维持在一个较高的水平，以应对可能发生的净赎回与基金转换；当宏观经济处于“过热”象限且政府已采取或预期将采取紧缩性政策、“滞胀”象限，以及股票市场的下行阶段，降低企业债、公司债（尤其是可转债）的配置比例，提高国债、央票、金融债配置的相对比例。



如果基金连续处于净赎回状态，则应提高国债、央票、金融债配置的相对比例，以提升资产组合的流动性。

本基金将根据各类属债券的流动性、换手率、相对配置比例的目标区间、投资组合加权平均久期的目标区间以及基金净申购与净赎回的情况，确定各类属债券的期限构成。

#### 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、中期票据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。

##### ① 国债与央票

对于国债与央行票据，本基金原则上采取买入并持有的投资策略，但在持有过程中会结合利率走势、到期收益率、换手率、投资组合的加权平均久期之目标范围、申购赎回的情况，在不同剩余期限的国债与央票之间选取适当的品种。另外，本基金将审慎评估回购收益率与国债、央票的到期收益率之间的利差，选择到期收益率高于回购收益率或者预期收益率有下降空间的国债、央票品种。

##### ② 金融债

在内部评级的基础上，本基金将根据未来宏观经济所处投资时钟的象限、未来利率的变化趋势、金融债各品种的到期收益率、换手率、外部评级、本基金投资组合的加权平均久期之目标范围等因素，审慎遴选具有比较优势的金融债品种。

##### ③ 普通企业债与公司债

本基金根据债券市场收益率数据，运用债券定价模型对单个债券进行估值，并结合债券的信用评级(外部评级与本基金内部评级)、流动性、息票率、税赋、提前偿付与赎回等因素，选择具有比较优势的债券品种进行投资。

如果债券获得主管机构的豁免评级，本基金根据对该债券内部评级的结果，决定是否将其纳入





基金的投资范围。

#### ④ 含权债券的选择

含权债券主要有两类：含赎回或回售选择权的债券；含可转换为股本选择权的债券。

本基金利用债券市场收益率数据，运用相关定价模型，计算含赎回或回售选择权的债券之期权调整利差（OAS），作为此类债券估值的主要依据。

可转换公司债券包含了股票买入期权，投资者既可以获得债券投资的固定收益，又可在一定期限之后转换为股票以分享公司股票价格上涨所带来的投资回报。本基金在对债转股条款、发债公司基本面进行深入分析的基础上，利用到期收益率来判别可转债的纯债价值，选择纯债价值被低估的可转债以提升本金投资的安全性；通过对发债公司未来经营业绩的预测、股票估值模型、未来宏观经济所处投资时钟的象限以及股票市场运行趋势的判断，来鉴别可转债的期权价值。在宏观经济与股票市场下行周期的后半段与上升周期的前半段，优先选择期权价值被低估的可转债，以获取投资收益。

#### ⑤ 资产支持证券

通过分析资产支持证券之基础性资产池的风险收益特征，本基金将审慎测算其基础性资产的违约风险、提前偿付风险，根据资产证券化的收益结构安排，模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流支付，并利用合理的到期收益率对资产支持证券进行估值。同时，本基金还将充分考虑资产支持证券之到期收益率的风险溢价与流动性溢价，严格控制资产支持证券的投资风险。

#### ⑥ 回购

结合利率走势、回购收益率、交易对手的信用状况，综合评估其收益性与违约风险，审慎分析品种间收益率的期限结构，以短期品种为主，选择收益率相对高的回购品种进行投资。

#### ⑦ 金鹰债券综合评价模型

为了综合评价债券品种的比较优势，本基金根据债券品种的流动性、区间收益率、信用评级、历史上的违约记录、到期收益率，以及本基金的资产规模等因素，开发了“金鹰债券综合评价模型”，为债券品种的遴选提供数量化依据。

根据“金鹰债券综合评价模型”的得分值，将久期为1年以下、1~3年、3~5年、5年以上的国债、央票、金融债、企业债、公司债、短期融资券、资产支持证券分类排序，分别选取7个子类债券、4种期限范围内得分值居于前1/2的品种作为本基金的备选投资品种。

#### 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”象限且政府已经采取或预期将采取扩展性政策的情况下，“复苏”象限，“过热”象限但政府并未采取紧缩性政策的情况下，采取进取优先的策略；在“过热”象限且政府已经采取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“滞胀”象限或“衰退”象限且预期政府短期内不会采取扩展性政策的情况下，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。

### （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；
- （6）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；
- （7）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。

运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，符合国务院证券监督管理机构的规定，并履行信息披露义务。

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。

## (六) 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2016年3月31日，本报告中所列财务数据未经审计。

## 1、报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额(元)         | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|---------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 2,860,865.40  | 5.10         |
|    | 其中：股票             | 2,860,865.40  | 5.10         |
| 2  | 固定收益投资            | 47,253,259.40 | 84.17        |
|    | 其中：债券             | 47,253,259.40 | 84.17        |
|    | 资产支持证券            | —             | —            |
| 3  | 贵金属投资             | —             | —            |
| 4  | 金融衍生品投资           | —             | —            |
| 5  | 买入返售金融资产          | —             | —            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | —             | —            |
| 6  | 银行存款和结算备付金合计      | 5,055,222.07  | 9.00         |
| 7  | 其他各项资产            | 972,489.97    | 1.73         |
| 8  | 合计                | 56,141,836.84 | 100.00       |

## 2、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              | 2,860,865.40 | 5.20         |
| 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      | -            | -            |
| 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              | -            | -            |
| 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               | 2,860,865.40 | 5.20         |

## 3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)   | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 300224 | 正海磁材 | 79,938  | 1,462,865.40 | 2.66         |
| 2  | 600667 | 太极实业 | 200,000 | 1,398,000.00 | 2.54         |

注：本基金本报告期仅持有2只股票。

## 4、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      | 30,016,000.00 | 54.51        |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | -             | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -             | -            |
| 4  | 企业债券      | 17,237,259.40 | 31.30        |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |
| 6  | 中期票据      | -             | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | -             | -            |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 47,253,259.40 | 85.81        |

## 5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 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  | 019506 | 15 国债 06       | 200,000.00 | 20,006,000.00 | 36.33        |
| 2  | 124588 | 14 济宁债         | 101,000.00 | 10,904,970.00 | 19.80        |
| 3  | 150020 | 15 付息国<br>债 20 | 100,000.00 | 10,010,000.00 | 18.18        |
| 4  | 124251 | 13 鲁信投         | 50,000.00  | 5,110,500.00  | 9.28         |
| 5  | 122724 | 12 攀国投         | 10,570.00  | 1,169,570.50  | 2.12         |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金报告期末未持有贵金属投资。

## 8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。



## 9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

## (1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金报告期末未持有股指期货投资。

## (2) 本基金投资股指期货的投资政策

无

## 10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

## (1) 本期国债期货投资政策

无

## (2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金报告期末未持有国债期货投资。

## (3) 本期国债期货投资评价

无

## 11、投资组合报告附注

(1) 本基金投资的前十名证券的发行主体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) 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   | 26,146.82  |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 946,343.15 |
| 5  | 应收申购款   | -          |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 972,489.97 |



## (4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无

## (5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的<br>公允价值(元) | 占基金资产净<br>值比例(%) | 流通受限情<br>况说明 |
|----|--------|------|--------------------|------------------|--------------|
| 1  | 300224 | 正海磁材 | 1,462,865.40       | 2.66             | 重大事项         |

## 5.11.6 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。

## 十七、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 2016 年 3 月 31 日）的投资业绩及与同期基准，本基金托管人复核了本基金的业绩。

## (一) 收益率比较

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<br>值增长<br>率①<br>(%) | 份额净<br>值增长<br>率标准<br>差②<br>(%) | 业绩比<br>较基准<br>收益率<br>③<br>(%) | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④<br>(%) | ①—③<br>(%) | ②—④<br>(%) |
|----------------------|-------------------------|--------------------------------|-------------------------------|----------------------------------|------------|------------|
| 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%      |
| 2013.1.1-2013.12.31  | 3.67%                   | 0.15%                          | 4.40%                         | 0.01%                            | -0.73%     | 0.14%      |
| 2014.1.1-2014.12.31  | 4.99%                   | 0.14%                          | 4.37%                         | 0.01%                            | 0.62%      | 0.13%      |
| 2015.1.1-2015.12.31  | 12.32%                  | 0.32%                          | 3.47%                         | 0.01%                            | 8.85%      | 0.31%      |

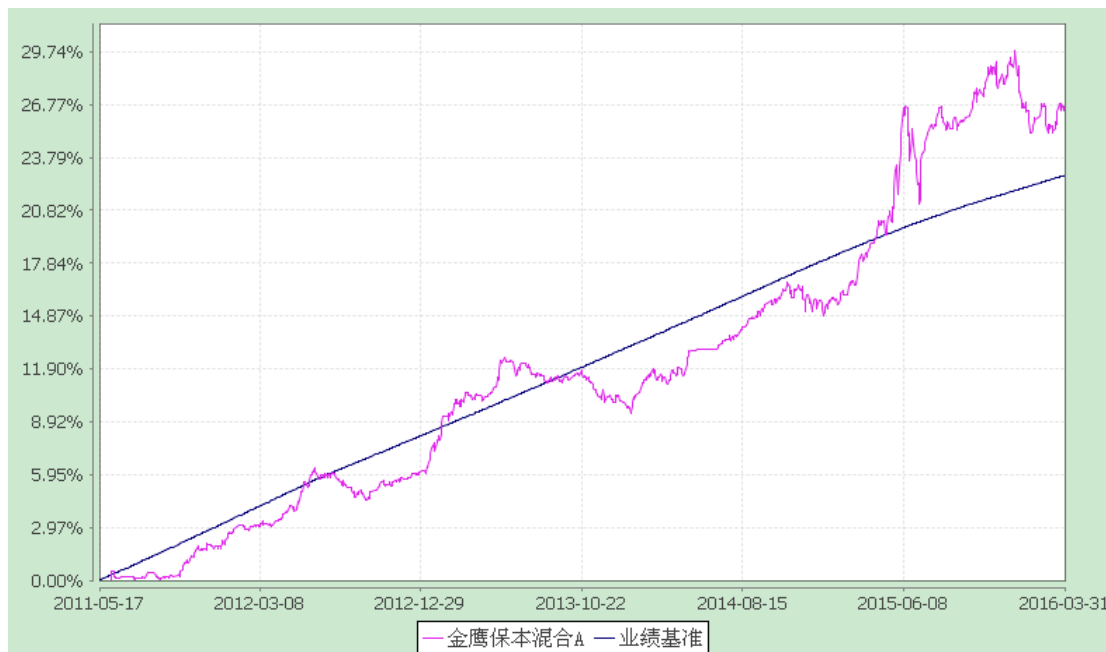




|                         |        |       |        |       |        |       |
|-------------------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 2016. 1. 1-2016. 3. 31  | -2.44% | 0.31% | 0.70%  | 0.01% | -3.14% | 0.30% |
| 2011. 5. 17-2016. 3. 31 | 26.67% | 0.19% | 22.78% | 0.01% | 3.89%  | 0.18% |

## （二）收益充走势图

金鹰保本混合型基金份额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 2016 年 3 月 31 日)



注：（1）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）基金的业绩比较基准为：3年期银行定期存款利率（税后）。

## 十八、基金的财产

### （一）基金资产总值

基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

其构成主要有：



- (1) 银行存款及其应计利息；
- (2) 结算备付金及其应计利息；
- (3) 根据有关规定缴纳的保证金及其应收利息；
- (4) 应收证券交易清算款；
- (5) 应收申购款；
- (6) 股票投资及其估值调整；
- (7) 债券投资及其估值调整和应计利息；
- (8) 权证投资及其估值调整；
- (9) 其他投资及其估值调整；
- (10) 其他资产等。

## (二) 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

## (三) 基金财产的账户

本基金以基金托管人的名义开立资金结算账户和托管专户用于基金的资金结算业务，并以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户、以本基金的名义开立银行间债券托管账户并报中国人民银行备案。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金代销机构和基金注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

## (四) 基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金代销机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产；基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或其他情形而取得的财产和收益，归入基金财产。基金管理人、基金托管人、基金注册登记机构和基金代销机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。

基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵消；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵消。



## 十九、基金财产的估值

### （一）估值目的

基金资产估值的目的是客观、准确地反映基金资产是否保值、增值，依据经基金资产估值后确定的基金资产净值而计算出的基金份额净值，是计算基金申购与赎回价格的基础。

### （二）估值日

本基金的估值日为相关的证券交易所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

### （三）估值对象

基金所拥有的股票、债券、权证和银行存款本息等资产和负债。

### （四）估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金管理人完成估值后，将估值结果加盖业务公章以书面形式加密传真或以电子方式传送至基金托管人，基金托管人按法律法规、《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后在基金管理人传真的书面估值结果上加盖业务公章或以电子方式传送返回给基金管理人；月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

### （五）估值方法

本基金按以下方式进行估值：

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（3）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利



息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（4）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

## 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理

（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

（2）首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

（3）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

## 3、其它情况处理

（1）因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

（2）全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

（3）同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

（4）如有确凿证据表明按上述方法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与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

（5）相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意見，按照基金管理人對基金资产净值的计算结果对外予以公布。



## （六）基金份额净值的确认和估值错误的处理

基金份额净值的计算保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入。当估值或份额净值计价错误实际发生时，基金管理人应当立即纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。当错误达到或超过基金资产净值的 0.25% 时，基金管理人应报中国证监会备案；当估值错误偏差达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。因基金估值错误给投资者造成损失的，应先由基金管理人承担，基金管理人对其不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。

关于差错处理，本基金合同的当事人按照以下约定处理：

### 1、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或代理销售机构、或投资者自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资者的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

### 2、差错处理原则

（1）差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的由差错责任方承担；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正；

（2）差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责；

（3）因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责，如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返



还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方；

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式；

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金资产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金资产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和其他基金托管人之外的第三方造成基金资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；

(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律、行政法规、《基金合同》或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失；

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构的交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认；

(5) 基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当报告中国证监会；基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告并报中国证监会备案。

#### (七) 暂停估值的情形

(1) 与本基金投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

(2) 因不可抗力或其他情形致使基金管理人无法准确评估基金资产价值时；

(3) 中国证监会认定的其他情形。

#### (八) 特殊情形的处理

(1) 基金管理人按估值方法的第 6 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；



(2) 由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误, 或由于其他不可抗力原因, 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, 基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。”

## 二十、基金的收益与分配

### (一) 基金利润的构成

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

### (二) 基金可供分配利润

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

### (三) 基金收益分配原则

#### 1、分配次数

在符合有关基金分红条件的前提下, 本基金每年收益分配次数最多为 6 次, 每次收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的 20%, 若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;

#### 2、本基金收益分配方式

(1) 保本周期内: 仅采取现金分红一种收益分配方式, 不进行红利再投资;

(2) 转型后: 基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资, 投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资; 若投资者不选择, 本基金默认的收益分配方式是现金分红; 如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同, 基金注册登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准;

#### 3、其它说明

(1) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值; 即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;





- (2) 每一基金份额享有同等分配权；
- (3) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### (四) 收益分配方案

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

#### (五) 收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 日内在指定媒体公告并报中国证监会备案。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。

#### (六) 基金收益分配中发生的费用

当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额：

(1) 在保本周期内（包括但不限于第一个保本周期），现金红利转基金份额视同保本周期内的申购，红利再投资的金额不保本，也不收取申购费。

(2) 保本周期届满后，若本基金转型为非保本的金鹰持续收益债券型证券投资基金，现金红利转基金份额视同申购，但不收取申购费。

在（1）、（2）两种情形下，红利再投资的计算方法，均依照《业务规则》执行。

### 二十一、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。(4)、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）本基金申购费、赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“九、基金份额的申购与赎回”中的“（五）申购和赎回的数额和价格”中的相关规定。

##### （2）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。

（3）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纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

## 二十二、基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

（1）基金管理人为本基金的基金会计责任方；

（2）基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于 2 个月，可以并入下一个会计年度；

（3）基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；



(4) 会计制度执行国家有关会计制度；

(5) 本基金独立建账、独立核算；

(6) 基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、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；

(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) 基金年度审计

(1) 基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。

(2) 会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人和基金托管人同意。

(3) 基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在 2 日内在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告并报中国证监会备案。

## 二十三、基金的信息披露

### (一) 披露依据

本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。

### (二) 信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。

本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的媒体和基金管理人、基金托管人的互联网网站（以下简称“网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

### (三) 信息披露承诺

本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：



- (1) 虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- (2) 对证券投资业绩进行预测；
- (3) 违规承诺收益或者承担损失；
- (4) 诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；
- (5) 登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- (6) 中国证监会禁止的其他行为。

#### (四) 披露文本

基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

#### (五) 公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

### 1、《招募说明书》、《基金合同》、《托管协议》

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人在基金份额发售的 3 日前，将《招募说明书》、《基金合同》摘要登载在指定媒体和基金管理人网站上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、《托管协议》登载在网站上。

(1) 《招募说明书》应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金管理人在每 6 个月结束之日起 45 日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定媒体上；基金管理人在公告的 15 日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

(2) 《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

(3) 《托管协议》是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

### 2、《发售公告》

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制《发售公告》，并在披露《招募说明书》的当



日登载于指定媒体和基金管理人网站上。

### 3、《基金合同》生效公告

基金管理人应当在《基金合同》生效的次日在指定媒体和基金管理人网站上登载《基金合同》生效公告。

### 4、基金资产净值、基金份额净值

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒体和基金管理人网站上。

### 5、基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在《基金合同》、《招募说明书》等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

### 6、基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒体上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定媒体上。

基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定媒体和基金管理人网站上。

《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在



地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本和书面报告两种方式。

## 7、临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：

- (1) 基金份额持有人大会的召开；
- (2) 终止《基金合同》；
- (3) 转换基金运作方式；
- (4) 更换基金管理人、基金托管人；
- (5) 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- (6) 基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- (7) 基金募集期延长；
- (8) 基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- (9) 基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十；
- (10) 基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过百分之三十；
- (11) 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
- (12) 基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- (13) 基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
- (14) 重大关联交易事项；
- (15) 基金收益分配事项；
- (16) 管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- (17) 基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；
- (18) 基金改聘会计师事务所；
- (19) 变更基金销售机构；
- (20) 更换基金注册登记机构；
- (21) 本基金开始办理申购、赎回；
- (22) 本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；





(23) 本基金发生巨额赎回并延期支付;

(24) 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请;

(25) 本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回;

(26) 与保本周期到期相关事项的公告:

1) 在保本周期到期前, 基金管理人将进行提示性公告;

2) 保本周期届满时, 若发生保本赔付, 赔付的具体操作细则由基金管理人提前公告;

3) 过渡期的起讫日期, 以及过渡期申购的日期、时间、场所、方式和程序等事宜由基金管理人确定并提前公告;

4) 保本周期届满时, 若符合保本基金存续条件, 本基金将继续存续并进入下一保本周期。基金管理人应依照法律法规的规定就该保本周期的具体起讫日期、保本及担保安排等相关事宜进行公告;

5) 保本周期届满时, 若不符合保本基金存续条件, 本基金将变更为“金鹰持续收益债券型证券投资基金”, 基金管理人将在临时公告或《金鹰持续收益债券型证券投资基金招募说明书》中公告相关规则;

(27) 中国证监会规定的其他事项。

## 8、澄清公告

在《基金合同》存续期限内, 任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的, 相关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告中国证监会。

## 9、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项, 应当依法报国务院证券监督管理机构核准或者备案, 并予以公告。召开基金份额持有人大会的, 召集人应当至少提前 40 日公告基金份额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。

基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会, 基金管理人、基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的, 召集人应当履行相关信息披露义务。

## 10、中国证监会规定的其他信息。



## （六）信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专人负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定媒体中选择披露信息的报刊。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒体和基金管理人网站上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒体披露信息，但是其他公共媒体不得早于指定媒体和基金管理人网站披露信息，并且不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后 10 年。

## （七）信息披露文件的存放与查阅

《招募说明书》公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，供公众查阅、复制。

基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，以供公众查阅、复制。

## 二十四、风险揭示

### （一）风险提示

基金主要投资于证券市场，而证券市场价格因受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而产生波动，从而导致基金收益水平发生变化，产生风险。另外，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。



## （二）证券市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生风险，主要包括：

### 1、政策风险

因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、产业政策、地区发展政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

### 2、经济周期风险

随着经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资的收益水平也会随之变化，从而产生风险。

### 3、利率风险

金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资的收益水平会受到利率变化的影响，从而产生风险。例如在利率上升时，基金持有的债券类资产价格将会下降，若基金组合加权平均久期过长，则将给基金资产带来较大的损失。

### 4、通货膨胀风险

通货膨胀风险也称购买力风险。基金持有人的收益将主要通过现金形式来分配，如果发生通货膨胀，现金的购买力会下降，从而影响基金的实际收益。

### 5、上市公司经营风险

上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但也不能完全规避。

### 6、债券收益率曲线变动的风险



债券收益率曲线变动风险是指与收益率曲线非平行移动相关的风险。由于不同期限债券的收益率变动程度不同，各期限债券的价格变动也会不同；基金组合单一的加权平均久期指标将不能充分反映这一债券收益率曲线非平行移动带来的风险。

## 7、再投资风险

再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响，这与利率上升所带来的价格风险（即利率风险）互为消长。具体为当利率下降时，基金从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时，将获得比以前较少的收益率。

## 8、信用风险

主要指债券、资产支持证券、票据等发行主体信用状况恶化，到期不能履行合约进行兑付；以及债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用资质降低导致债券价格下降的风险；信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险，以及上市公司信息披露不真实、不完整，而导致基金资产损失和收益变化的风险。

## 9、资产支持证券的提前偿付风险

基金投资资产支持证券品种时，证券化的信托财产中债务人提前还款会造成信托财产的现金流量失衡，从而与设计的现金流量规划不同，影响基金投资的资产支持证券的收益。除受债务人自身的财务状况影响外，市场利率的变化，其他融资成本的变化等因素都将影响债务人提前还款。由于影响因素多且不确定，因此债务人提前还款的时间和数量都很难准确预计。

## 10、股价波动风险

由于本基金可投资于权益类资产（含新股申购），本基金所投资的权益类资产在持有期内价格的波动将会对基金收益率产生影响；本基金进行新股申购时，由于资金的占用、中签率和首日开盘价的不确定性，以及某些申购成功的新股因锁定期而在一段时间内丧失流动性而带来的风险，也将对基金资产的收益造成影响；另外基金投资的衍生品资产（包括含权债券），其内在价值也会因标的资产价格的波动以及距离到期的时间而变化，进而给基金组合的收益带来影响。

## 11、债券回购风险

债券回购为提升整体基金组合收益提供了可能，但也存在一定的风险。债券回购的主要风险包



括信用风险、投资风险及波动性加大的风险，其中，信用风险指回购交易中交易对手在回购到期时，不能偿还全部或部分证券或价款，造成基金净值损失的风险；投资风险是指在进行正回购操作时，回购利率大于融入资金的投资收益率，或者逆回购操作时，回购利率小于融出资金潜在的投资收益率而导致的风险，以及由于正回购操作导致投资总量放大，致使整个组合风险放大的风险；而波动性加大的风险是指在进行正回购操作时，在对基金组合收益进行放大的同时，也对基金组合的波动性（标准差）进行了放大，即基金组合的风险将会加大。正回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对基金净值造成损失的可能性也就越大。

### （三）管理风险

基金运作过程中由于基金投资策略、人为因素、管理系统设置不当造成操作失误或公司内部失控而可能产生的损失。管理风险包括：

#### 1、决策风险

决策风险指基金投资的投资策略制定、投资决策执行和投资绩效监督检查过程中，由于决策失误而给基金资产造成的可能的损失；

#### 2、操作风险

操作风险指基金投资决策执行中，由于投资指令不明晰、交易操作失误等人为因素而可能导致的损失；

#### 3、技术风险

技术风险是指公司管理信息系统设置不当等因素而可能造成的损失。

### （四）职业道德风险

职业道德风险是指公司员工不遵守职业操守，发生违法、违规行为而可能导致的损失。

### （五）流动性风险

因市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地转变为现金的风险。同时在基金运作过程中，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，甚至影响基金份额净值。



## （六）合规性风险

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合同有关规定的风险。

## （七）投资管理风险

本基金根据宏观经济运行状况、金融市场环境及利率走势的综合判断，在控制利率风险、信用风险以及流动性风险等基础上，采取主动的自上而下的投资策略和自下而上的品种选择相互结合，力争为投资者在保障本金安全的情况下实现更多的资产增值，但同时也不可避免地带来了组合风险的增加。在基金投资管理运作过程中，可能因基金管理人经济形势和证券市场态势的判断有误、获取的信息不全等因素而影响基金的收益水平。同时，基金管理人的投资管理水平、手段和技术等对基金收益也存在影响。

## （八）本基金特有的风险

本基金投资策略主要采用改进的固定比例组合保险策略（CPPI），特有的风险包括：

（1）基金的业绩表现可能因为风险资产投资不当带来基金净值损失的风险，影响基金资产的增值；或风险乘数波动过大而使基金业绩波动较大；

（2）本基金的本金保障条款存在前提条件——持有到保本期结束，在此期间基金净值可能低于基金合同承诺的保底金额，若在此期间赎回将不享受保底金额的保障。

（3）为保证基金的本金安全，基金运作中可能会对部分无风险资产采用买入并持有的策略；若遇大规模赎回，基金可能因资产流动性不足等原因带来损失。

（4）虽然担保人为本基金的保本责任提供担保，但是，担保人也会因下列情形的发生而导致其不能在保本周期到期后履行担保责任，从而产生担保风险，这些情形包括但不限于：担保人发生经营风险而影响其履行担保责任；发生不可抗力事件，导致担保人无法履行担保责任。

## （九）其他风险

（1）随着符合本基金投资理念的新投资工具的出现和发展，如果投资于这些工具，基金可能会面临一些特殊的风险；

（2）因技术因素而产生的风险，如计算机系统不可靠产生的风险；

（3）因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；

（4）因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；





(5) 对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；

(6) 战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；

(7) 其他意外导致的风险。

## 二十五、保本周期到期

### (一) 保本周期到期后基金的存续形式

保本周期届满时，在符合保本基金存续条件下，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、保本及担保安排以本基金管理人届时公告为准。

如保本到期后，本基金未能符合上述保本基金存续条件，则本基金将按《基金合同》的约定，变更为“金鹰持续收益债券型证券投资基金”；同时，基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等相关内容也将根据《基金合同》约定相应变更。上述变更由基金管理人和基金托管人同意后，可不经基金份额持有人大会决议，在报中国证监会备案后，提前在临时公告或更新的基金招募说明书中说明。

如果本基金不符合法律法规和《基金合同》对基金的存续要求，则本基金将根据《基金合同》规定终止。

### (二) 保本周期到期操作规则

(1) 本基金保本周期到期后，基金份额持有人可以做出如下选择，其保本权利均适用保本条款：

1) 保本周期到期后赎回基金份额；

2) 保本周期到期后将基金份额转换为基金管理人管理的、已公告开放转换转入的其他基金；

3) 保本周期到期后，本基金符合保本基金存续条件，基金份额持有人持有的基金份额根据届时基金管理人的公告转入下一保本周期，单位基金份额净值按届时公告的折算方法调整至 1.00 元；

4) 保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，基金份额持有人继续持有变更后的“金鹰持续收益债券型证券投资基金”的基金份额。

(2) 基金份额持有人可将其持有的所有基金份额选择上述四种操作方式之一，也可以部分选择赎回、转入下一保本周期或继续持有变更后基金的基金份额、转换为基金管理人管理的其他基金。

(3) 基金份额持有人将本基金的基金份额转入下一保本周期或转换为基金管理人管理的其他基金或转为变更后的“金鹰持续收益债券型证券投资基金”后的费用，适用其所转入基金的费用、费率体系。





(4) 本基金保本周期到期后，如基金份额持有人未进行到期操作，本基金符合保本基金存续条件，则基金管理人将默认基金份额持有人继续持有本基金基金份额；如基金份额持有人未进行到期操作，本基金不符合保本基金存续条件，则基金管理人将默认基金份额持有人选择了继续持有变更后的“金鹰持续收益债券型证券投资基金”基金份额。

(5) 到期操作采取“未知价”原则，即：在到期操作期间，基金份额持有人赎回本基金基金份额或将本基金基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的，赎回金额或转出金额以基金份额持有人实际操作日的本基金基金份额净值为基准进行计算。

#### (6) 比例确认

在到期操作期间截止日，按照该日单位基金份额净值（若该日为非交易日，则采用最近一个交易日的单位基金份额净值）计算，如果基金份额持有人选择或默认选择转入下一个保本周期的基金份额之净值大于或等于法律法规允许的本基金下一保本周期的募集规模上限，则基金管理人将对选择或默认选择转入下一个保本周期的基金份额进行比例确认，并及时公告确认比例的计算结果；同时，本基金将不开放过渡期申购。

### (三) 到期操作期间

(1) 本基金的到期操作期间为保本周期到期日及之后 3 个工作日（含第 3 个工作日）。

(2) 在到期操作期间，本基金将暂停日常申购和转换入业务。

(3) 在到期操作期间，基金管理人应使基金财产保持为现金形式，利息收入计入基金资产；基金管理人和基金托管人免收该期间的基金管理费和基金托管费。

本基金保本周期到期前，基金管理人将提前公告并提示基金份额持有人进行到期操作，基金份额持有人可在届时公告规定的时间内按照公告规定的方式到期操作。

### (四) 保本周期到期的保本条款

本基金为基金份额持有人在当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期并持有到期的基金份额提供的保本额为：在当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期并持有到期的基金份额 $\times$ 1.00元人民币。

(1) 在当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期并持有到期的基金份额持有人，无论选择赎回、转换为基金管理人管理的其他基金、或者转入下一保本周期或继续持有变更后的“金鹰持续收益债券型证券投资基金”基金份额，其持有到期的基金份额均适用保本条款。

(2) 若基金份额持有人选择在持有到期后赎回基金份额，而基金份额的可赎回金额加上相应基金份额的累计分红金额之和低于保本额，差额部分即为保本赔付差额，基金管理人应补足该差额，



以保本额（扣除相应基金份额在持有期间的累计分红金额）支付给投资者，担保人对此提供不可撤销的连带责任担保。

（3）若基金份额持有人选择在持有到期后进行基金转换，而基金份额的可赎回金额加上相应基金份额的累计分红金额之和低于保本额，差额部分即为保本赔付差额，基金管理人应补足该差额，以保本额（扣除相应基金份额在持有期间的累计分红金额）作为转出金额，担保人对此提供不可撤销的连带责任担保。

（4）若基金份额持有人选择继续持有进入下一保本周期的基金份额或变更后的“金鹰持续收益债券型证券投资基金”的基金份额，而基金份额的可赎回金额加上相应基金份额的累计分红金额之和低于保本额，差额部分即为保本赔付差额，基金管理人应补足该差额，以保本额（扣除相应基金份额的累计分红金额）作为转入下一保本周期或转入变更后的“金鹰持续收益债券型证券投资基金”的转入金额，担保人对此提供不可撤销的连带责任担保。

（5）在到期操作期间，在当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期并持有到期的基金份额的持有人进行到期操作或默认继续持有的，可按相应基金份额在保本周期到期日的可赎回金额加上基金份额在持有期间的累计分红金额之和低于保本额的差额（即保本赔付差额）享有保本利益，但对于保本周期到期日之后（不含保本周期到期日）至其实际操作日（含该日）的净值波动风险由基金份额持有人自行承担。

#### （五）本基金转入下一保本周期的方案

保本周期届满时，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担保，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的，本基金继续存续并进入下一保本周期。

### 1、过渡期和过渡期申购的前提条件

#### （1）过渡期

到期操作期间截止日起（不含该日）至下一保本周期开始日前一个工作日的期间为过渡期；过渡期最长不超过 20 个工作日。

#### （2）过渡期申购的前提条件

投资者在过渡期内申请购买本基金基金份额的行为称为“过渡期申购”。在过渡期内，投资者转换入本基金基金份额，视同为过渡期申购。

在到期操作期间截止日，按照该日单位基金份额净值（若该日为非交易日，则采用最近一个交



易日的单位基金份额净值) 计算, 如果基金份额持有人选择或默认选择转入下一个保本周期的基金份额之净值小于法律法规允许的本基金下一保本周期的募集规模上限, 则基金管理人将开放过渡期申购。

## 2、过渡期申购

(1) 基金管理人将根据担保人或者保本义务人提供的下一保本周期担保额度或保本偿付额度确定并公告本基金过渡期申购规模上限以及规模控制的方法。

(2) 过渡期申购采取“未知价”原则, 即过渡期申购价格以申请当日收市后计算的本基金基金份额净值为基准进行计算。

(3) 投资者进行过渡期申购的, 其持有相应基金份额至过渡期最后一日(含该日)期间的净值波动风险由基金份额持有人自行承担。

(4) 过渡期申购费率

过渡期申购费率最高不超过 5%, 具体费率见《招募说明书》第九章第(五)条中列示。

过渡期申购费用由过渡期申购的投资者承担, 不列入基金财产, 主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

(5) 过渡期申购的日期、时间、场所、方式、程序、比例确认等事宜由基金管理人确定并提前公告。

(6) 过渡期内, 本基金将暂停办理日常赎回、转换出业务。

(7) 过渡期内, 基金管理人应使基金财产保持为现金形式, 利息收入计入基金资产; 基金管理人和基金托管人免收该期间的基金管理费和基金托管费。

## 3、下一保本周期基金资产的形成

(1) 持有到期的基金份额

如果保本周期到期日基金份额持有人当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期并持有到期的基金份额可赎回金额加上相应基金份额在当期保本周期内的累计分红金额之和低于保本额, 差额部分即为保本赔付差额, 基金管理人应补足该差额并以现金形式支付给基金份额持有人。

对于投资者在当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期, 或者在当期保本周期内申购、转换入的基金份额, 选择或默认选择转入下一保本周期的, 转入下一保本周期的转入金额等于选择或默认选择转入下一保本周期并得到基金管理人确认的基金份额在下一保本周期开始前一工作日(即折算日)所对应的基金资产净值。



## （2）过渡期申购的基金份额

对于投资者过渡期申购的基金份额，转入下一保本周期的转入金额等于得到本基金管理人确认的基金份额在下一保本周期开始前一工作日（即折算日）所对应的基金资产净值（申购金额在申购期间的利息收入计入基金资产净值）。

## 4、基金份额折算

过渡期最后一个工作日（即下一保本周期开始日前一工作日）为基金份额折算日。

在基金份额折算日，得到基金管理人确认的基金份额（包括投资者过渡期申购并得到确认的基金份额、保本周期结束后选择或默认选择转入下一个保本周期并得到确认的基金份额）在其持有的基金份额所代表的资产净值总额保持不变的前提下，变更登记为基金份额净值为 1.00 元的基金份额，基金份额数额按折算比例相应调整。

在基金份额持有人赎回基金份额时，持有期的计算仍以投资者认购、申购、转换入或者过渡期申购基金份额的实际操作日期计算，不受基金份额折算的影响。

## 5、开始下一保本周期运作

折算日的下一个工作日为下一保本周期开始日，本基金进入下一保本周期运作。

基金份额持有人在当期保本周期的到期操作期间选择或默认选择转入下一保本周期并得到确认的份额以及过渡期申购并得到确认的基金份额，经基金份额折算后，适用下一保本周期的保本条款。

基金份额持有人持有经折算的基金份额至下一保本周期到期的，如果下一保本周期到期日的可赎回金额加上相应基金份额在该保本周期的累计分红金额之和低于保本额，低出的部分即为保本赔付差额，则基金管理人应向基金份额持有人补足该差额，并由担保人或者保本义务人提供保本保证。下一保本周期保本额为：经基金份额折算后，基金份额持有人持有至下一保本周期到期的基金份额  $\times 1.00$  元人民币。

本基金进入下一保本周期后，仍使用原名称和基金代码办理日常申购、赎回等业务。

自本基金下一保本周期开始后，本基金管理人将暂停本基金的日常申购、赎回、定期定额投资、基金转换等业务。暂停期限最长不超过 3 个月。

投资者在下一保本周期开始后的开放日申购或转换入本基金基金份额的，相应基金份额不适用下一保本周期的保本条款。



#### （六）转为变更后的“金鹰持续收益债券型证券投资基金”资产的形成

（1）保本周期届满时，若不符合保本基金存续条件，本基金变更为“金鹰持续收益债券型证券投资基金”。如果保本到期日基金份额持有人在当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期并持有到期的基金份额的可赎回金额加上相应基金份额在当期保本周期内的累计分红金额之和低于保本额，差额部分即为保本赔付差额，基金管理人应补足该差额并以现金形式支付给基金份额持有人。

（2）对于投资者在本基金在当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期的基金份额、当期保本周期内申购或转换入的基金份额，选择或默认选择转为变更后的“金鹰持续收益债券型证券投资基金”的，转入金额等于选择或默认选择转为“金鹰持续收益债券型证券投资基金”的基金份额在“金鹰持续收益债券型证券投资基金”基金合同生效日前一个工作日所对应的基金资产净值。

#### （七）保本周期到期的公告

（1）保本周期届满时，若符合保本基金存续条件，本基金将继续存续。基金管理人应依照法律法规规定就本基金继续存续及为下一保本周期开放申购的相关事宜进行公告。

（2）保本周期届满时，若不符合保本基金存续条件，本基金将变更为“金鹰持续收益债券型证券投资基金”，基金管理人将在临时公告或《金鹰持续收益债券型证券投资基金招募说明书》中公告相关规则。

（3）在保本周期到期前，基金管理人将进行提示性公告。

#### （八）保本周期到期的赔付

（1）保本赔付责任的承担，请参见《招募说明书》“第十五、基金保本的保证”之第（五）条。

（2）保本赔付资金到账后，基金管理人应按照《基金合同》的约定进行分配和支付。

（3）发生赔付的具体操作细则由基金管理人提前公告。



## 二十六、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### （一）《基金合同》的变更

#### 1、以下变更《基金合同》的事项应经基金份额持有人大会决议通过

（1）更换基金管理人；

（2）更换基金托管人；

（3）保本周期内更换担保人；

（4）转换基金运作方式；

（5）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；

（6）变更基金类别，但在保本到期后在《基金合同》规定范围内变更为“金鹰持续收益债券型证券投资基金”除外；

（7）变更基金投资目标、范围或策略，但在保本到期后在《基金合同》规定范围内变更为“金鹰持续收益债券型证券投资基金”并按《基金合同》约定的“金鹰持续收益债券型证券投资基金”的投资目标、范围和策略执行的以及法律法规和中国证监会另有规定的除外；

（8）本基金与其他基金的合并；

（9）变更基金份额持有人大会召开程序；

（10）其他可能对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案：

（1）保本到期后，在《基金合同》规定范围内变更为“金鹰持续收益债券型证券投资基金”，并按《基金合同》约定的“金鹰持续收益债券型证券投资基金”的投资目标、范围和策略执行；

（2）调低基金管理费、基金托管费；

（3）法律法规要求增加的基金费用的收取；

（4）在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率；

（5）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

（6）对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；

（7）除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。





## 2、《基金合同》变更生效

关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，自《基金合同》生效之日起在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。

### （二）基金合同的终止

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- （1）基金份额持有人大会决定终止的；
- （2）基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- （3）《基金合同》约定的其他情形；
- （4）相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### （三）基金财产的清算

（1）基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

（2）基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券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。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

（3）基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

（4）基金财产清算程序：

- 1）《基金合同》终止后，由基金财产清算小组统一接管基金；
- 2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- 3）对基金财产进行估值和变现；
- 4）制作清算报告；
- 5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- 6）将清算报告报中国证监会备案并公告；
- 7）对基金财产进行分配。

（5）基金财产清算的期限为 6 个月。





#### （四）清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

#### （五）基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### （六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于《基金合同》终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

#### （七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

### 二十七、基金合同的内容摘要

#### （一）基金合同当事人及权利义务

##### 1、基金管理人的权利与义务

（1）根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- 1) 依法募集基金；
- 2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- 3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- 4) 销售基金份额；
- 5) 召集基金份额持有人大会；
- 6) 依据《基金合同》及有关法律、法规监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，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；
- 7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- 8) 选择、委托、更换基金代销机构，对基金代销机构的相关行为进行监督和处理；



9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金注册登记机构办理基金注册登记业务并获得《基金合同》规定的费用;

10) 依据《基金合同》及有关法律决定基金收益的分配方案;

11) 在《基金合同》约定的范围内, 拒绝或暂停受理申购与赎回申请;

12) 在符合有关法律法规和《基金合同》的前提下, 制订和调整《业务规则》, 决定和调整除调高管理费率 and 托管费率之外的基金相关费率结构和收费方式;

13) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利, 为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利;

14) 在法律法规允许的前提下, 为基金的利益依法为基金进行融资;

15) 以基金管理人的名义, 代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;

16) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;

17) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

(2) 根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定, 基金管理人的义务包括但不限于:

1) 依法募集基金, 办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜; 如认为基金代销机构违反《基金合同》、基金销售与服务代理协议及国家有关法律规定, 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;

2) 办理基金备案手续;

3) 自《基金合同》生效之日起, 以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;

4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策, 以专业化的经营方式管理和运作基金财产;

5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度, 保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立, 对所管理的不同基金分别管理, 分别记账, 进行证券投资;

6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外, 不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益, 不得委托第三人运作基金财产;

7) 依法接受基金托管人的监督;

8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定, 按有关规定计算并公告基金资产净值, 确定基金份额申购、赎回的价格;

9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

10) 编制半年度和年度基金报告;

11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定, 履行信息披露及报告义务;

12) 保守基金商业秘密, 不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外, 在基金信息公开披露前应予保密, 不向他人泄露;



- 13) 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
- 14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- 15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- 16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；
- 17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；
- 18) 保本周期到期日若发生需要保本赔付的情形，则基金管理人应补足保本赔付差额，并根据《基金合同》约定将该差额支付至指定账户。如基金管理人未能全额补足保本赔付差额，则应根据《基金合同》约定向担保人发出书面《履行保证责任通知书》，并要求担保人在收到通知书后的约定期限内将需清偿的金额支付至指定账户。基金管理人最迟应在保本周期到期日后 20 个工作日内将保本赔付差额支付给基金份额持有人；
- 19) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- 20) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
- 21) 因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- 22) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
- 23) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失，而基金管理人首先承担了责任的情况下，基金管理人有权向第三方追偿；
- 24) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；
- 25) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；
- 26) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；
- 27) 建立并保存基金份额持有人名册，定期或不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册；
- 28) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。



## 2、基金托管人的权利与义务

(1)、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

1) 自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

2) 依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

4) 以基金托管人和基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司和深圳分公司开设证券账户；

5) 以基金托管人名义开立证券交易资金账户，用于证券交易资金清算；

6) 以基金的名义在中央国债登记结算有限公司开设银行间债券托管账户，负责基金投资债券的后台匹配及资金的清算；

7) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

8) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

9) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

(2)、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

2) 设立专门的基金托管部门，具有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，负责基金财产托管事宜；

3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的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、账册记录等方面相互独立；

4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

5) 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；

6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；



9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;

10) 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见,说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行;如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为,还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施;

11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上;

12) 建立并保存基金份额持有人名册;

13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对;

14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项;

15) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会;

16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作;

17) 参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会和银行监管机构,并通知基金管理人;

19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时,应承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时,应为基金利益向基金管理人追偿;

21) 执行生效的基金份额持有人大会的决定;

22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### 3、基金份额持有人的权利与义务

(1)、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的权利包括但不限于:

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) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会,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) 监督基金管理人的投资运作;



- 8) 对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼;
- 9) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

(2)、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的义务包括但不限于:

- 1) 遵守《基金合同》;
- 2) 缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用;
- 3) 在其持有的基金份额范围内,承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任;
- 4) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动;
- 5) 返还在基金交易过程中因各种原因,自基金管理人、基金托管人及代销机构处获得的不当得利;
- 6) 执行生效的基金份额持有人大会的决定;
- 7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## (二) 基金份额持有人大会

基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

### 1、召开事由

- (1)、当出现或需要决定下列事由之一的,应当召开基金份额持有人大会:
- 1) 终止《基金合同》;
  - 2) 更换基金管理人;
  - 3) 更换基金托管人;
  - 4) 保本周期内更换担保人;
  - 5) 转换基金运作方式;
  - 6) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准;
  - 7) 变更基金类别,但在保本到期后在《基金合同》规定范围内变更为“金鹰持续收益债券型证券投资基金”除外;
  - 8) 本基金与其他基金的合并;
  - 9) 变更基金投资目标、范围或策略,但在保本到期后在《基金合同》规定范围内变更为“金鹰持续收益债券型证券投资基金”并按照《基金合同》约定的“金鹰持续收益债券型证券投资基金”的投资目标、范围或策略执行的以及法律法规和中国证监会另有规定的除外;





- 10) 变更基金份额持有人大会程序;
  - 11) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会;
  - 12) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上(含 10%)基金份额的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算,下同)就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会;
  - 13) 担保人己丧失履行担保函项下担保责任能力或宣告破产;
  - 14) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项;
  - 15) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。
- (2)、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改,不需召开基金份额持有人大会:
- 1) 保本到期后,在《基金合同》规定范围内变更为“金鹰持续收益债券型证券投资基金”,并按照《基金合同》约定的“金鹰持续收益债券型证券投资基金”的投资目标、范围或策略执行;
  - 2) 调低基金管理费、基金托管费;
  - 3) 法律法规要求增加的基金费用的收取;
  - 4) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率;
  - 5) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改;
  - 6) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化;
  - 7) 除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

## 2、会议召集人及召集方式

- (1)、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外,基金份额持有人大会由基金管理人召集;
- (2)、基金管理人未按规定召集或不能召集时,由基金托管人召集;
- (3)、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集,并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起 60 日内召开;基金管理人决定不召集,基金托管人仍认为有必要召开的,应当由基金托管人自行召集。
- (4)、代表基金份额 10%以上(含 10%)的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起 60 日内召开;基金管理人决定不召集,代表基金份额 10%以上(含 10%)的基金份额持有人仍认为有必要召开的,应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到





书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

(5)、代表基金份额 10%以上（含 10%）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，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

(6)、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

### 3、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

(1)、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 40 天，在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- 1) 会议召开的时间、地点、方式和会议形式；
- 2) 会议拟审议的事项、议事程序和表决形式；
- 3) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- 4) 授权委托书的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- 5) 会务常设联系人姓名及联系电话；
- 6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- 7) 召集人需要通知的其他事项。

(2)、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议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份额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、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

(3)、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。



#### 4、基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开。

会议的召开方式由会议召集人确定，但更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方式召开。

（1）、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托书委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

2）经核对，汇总到会者出示的在权利登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）。

（2）、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

1）会议召集人按《基金合同》规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

2）召集人按基金合同规定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）；

4）上述第（3）项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记注册机构记录相符，并且委托人出具的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定；

5）会议通知公布前报中国证监会备案。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者；表面符合法律法规和会议通知规定的书面



表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

## 5、议事内容与程序

### （1）、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%（含 10%）以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日至少 35 天前提交召集人并由召集人公告。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开日 30 天前公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

召集人对于基金管理人、基金托管人和基金份额持有人提交的临时提案进行审核，符合条件的应当在大会召开日 30 天前公告。大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

1）关联性。大会召集人对于提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和《基金合同》规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

2）程序性。大会召集人可以对提案涉及的程序性问题做出决定。如将提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%（含 10%）以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定除外。

基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当最迟在基金份额持有人大会召开前 30 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日



期有 30 日的间隔期。

## （2）、议事程序

### 1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证号码、住所地址、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）等事项。

### 2) 通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

## 6、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

（1）、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过方为有效；除下列第（2）项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

（2）、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。



基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

## 7、计票

### （1）、现场开会

1) 如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额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；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

2) 监票人应当在基金份额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。

3) 如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

4) 计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

### （2）、通讯开会

在通讯开会的情况下，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（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

## 8、生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。

基金份额持有人大会的决议自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作日内在至少一家指定媒体及基金管理人网站上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。





生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

### （三）基金的保本

#### 1、保本

本基金为基金份额持有人在当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期并持有到期的基金份额提供的保本额为：在当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期并持有到期的基金份额 $\times 1.00$  元人民币。

在保本周期到期日，如果基金份额持有人在当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期并持有到期的基金份额的可赎回金额加上相应基金份额在当期保本周期内的累计分红金额之和高于或等于保本额，基金管理人将按可赎回金额支付给基金份额持有人。

在保本周期到期日，如果基金份额持有人在当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期并持有到期的基金份额的可赎回金额加上相应基金份额在当期保本周期内的累计分红金额之和低于保本额，差额部分即为保本赔付差额。详细赔付程序请参见《招募说明书》“第十五、基金保本的保证”之第（五）条。

基金份额持有人未持有到期而赎回或转换出的基金份额或者发生《基金合同》约定的其他不适用保本条款情形的，相应基金份额不适用保本条款。

#### 2、保本周期

3 年，亦称为当期保本周期，特指本基金第二个保本周期。

本基金的第二个保本周期自第二个保本周期起始日起至 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。

第二个保本周期届满时，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。

#### 3、适用保本条款的情形

（1）基金份额持有人在当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期并持有到期的基金份额；

（2）对于持有到期的份额，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。

#### 4、不适用保本条款的情形

(1) 在保本周期到期日，本基金的基金份额净值与每份基金份额在保本周期内的累计分红金额之和等于或高于 1.00 元人民币；

(2) 基金份额持有人在当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期，但在基金当期保本周期到期日前（不包括该日）赎回或转换出的基金份额；

(3) 基金份额持有人在保本周期内申购的基金份额；

(4) 在保本周期内发生《基金合同》规定的《基金合同》终止的情形；

(5) 在保本周期内发生本基金与其他基金合并或更换基金管理人的情形，且担保人不同意继续承担担保责任；

(6) 在保本周期到期日之后（不包括该日）基金份额发生的任何形式的净值减少；

(7) 因不可抗力原因导致基金投资亏损；或因不可抗力事件直接导致基金管理人无法按约定履行全部或部分义务或延迟履行义务的，或《基金合同》规定的其他情形基金管理人免于履行保本义务的；

(8) 因不可抗力事件导致基金担保人无法按约定履行全部或部分义务或延迟履行义务的。

#### (四) 基金保本的担保

(1) 为确保履行保本条款，保障基金份额持有人利益，本基金的保本由担保人提供不可撤销的连带责任担保。本基金的担保人为广州越秀金融控股集团有限公司或《基金合同》规定的其他机构。担保人的基本情况见《招募说明书》。

(2) 担保人与基金管理人签订《金鹰保本混合型证券投资基金第二个保本周期保证合同》。（见《基金合同》附件）。基金份额持有人购买基金份额的行为视为同意该保证合同的约定。本基金保本由担保人提供不可撤销的连带责任担保；对基金份额持有人在第二个保本周期开始前的过渡期申购或从第一个保本周期转入到第二个保本周期并持有到期的基金份额的担保范围为保本赔付差额，即在保本周期到期日基金份额持有人在第二个保本周期开始前的过渡期申购或从第一个保本周期转入到第二个保本周期并持有到期的基金份额的可赎回金额与相应基金份额在第二个保本周期内的累计分红金额之和低于保本额的金额。

担保期限为：基金保本周期到期日起 6 个月止。

担保人承担担保责任的总金额最高不超过本基金第一个保本周期的募集规模上限。

(3) 保本周期内，担保人出现足以影响其履行担保函项下担保责任能力情形的，应在该情形





发生之日起 3 个工作日内通知基金管理人以及基金托管人。基金管理人在接到通知之日起 3 个工作日内应将上述情况报告中国证监会并提出处理办法，并在接到通知之日起 5 个工作日内在指定媒体上公告上述情形。当确定担保人已丧失履行担保函项下担保责任能力或宣告破产的情况下，基金管理人应召集基金份额持有人大会。

(4) 保本周期内更换担保人必须经基金份额持有人大会决议通过，并且担保人的更换必须符合基金份额持有人的利益。保本周期内更换担保人的，原担保人承担的所有与本基金担保责任相关的权利义务由继任的担保人承担。在新的担保人接任之前，原担保人应继续承担担保责任。

(5) 基金份额持有人兹同意授权基金管理人作为其代理人代为行使向担保人通知履行担保责任的权利并办理相关的手续(包括但不限于：向担保人发送《履行担保责任通知书》以及代收相关款项等)。如果保本周期到期日基金份额持有人在当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期并持有到期的基金份额的可赎回金额与相应基金份额在当期保本周期内的累计分红金额之和低于保本额（低出的部分即为“保本赔付差额”），基金管理人应按《基金合同》的约定在保本周期到期日后 4 个工作日内将保本赔付差额补足至本基金在基金托管人处开立的资金结算账户；基金管理人无法全额履行保本义务的，基金管理人应在保本周期到期日后 3 个工作日内，向担保人发出书面《履行担保责任通知书》（应当载明需担保人代偿的金额），担保人将在收到基金管理人发出的《履行担保责任通知书》后的 3 个工作日内完成应代偿金额的核实，并于核实完成后的 4 个工作日内将尚未补足的款项一次性足额划入本基金在基金托管人处开立的账户中，基金管理人应在保本周期到期日后 20 个工作日内将保本赔付差额（含基金管理人自有资金和担保人的代偿款）支付给基金份额持有人。若担保人未履行全部或部分担保责任的，基金份额持有人有权直接就差额部分向担保人追偿。无论何时，担保人承担担保责任的最高限额不超过本基金第一个保本周期的募集规模上限。

(6)、基金管理人有权代表基金份额持有人要求担保人按照本基金合同及担保函的约定履行担保责任。除本条第（四）款所指的“保本周期内更换担保人的，原担保人承担的所有与本基金担保责任相关的权利义务由继任的担保人承担”以及下列除外责任情形外，担保人不得免除担保责任：

1) 在保本周期到期日，基金份额净值与每份基金份额在保本周期内的累计分红金额之和等于或高于 1.00 元人民币；

2) 基金份额持有人在第二个保本周期开始前的过渡期申购或从第一个保本周期转入到第二个保本周期、但在基金第二个保本周期到期日前（不包括该日）赎回或转换出的基金份额；

3) 基金份额持有人在第二个保本周期内申购的基金份额；

4) 在第二个保本周期内发生本《基金合同》规定的《基金合同》终止的情形；

5) 在第二个保本周期内发生本基金与其他基金合并或更换基金管理人的情形，且担保人不同意继续承担担保责任；



6) 在第二个保本周期到期日之后（不包括该日）基金份额发生的任何形式的净值减少；

7) 未经担保人书面同意修改《基金合同》条款，可能加重担保人担保责任的，根据法律法规要求进行修改的除外；

8) 因不可抗力的原因导致基金投资亏损；或因不可抗力事件直接导致基金管理人无法按约定履行全部或部分义务或延迟履行义务的，或《基金合同》规定的其他情形基金管理人免于履行保本义务的；

9) 因不可抗力事件导致基金担保人无法按约定履行全部或部分义务或延迟履行义务的。

(7) 保本周期届满时，基金管理人认可的其他机构继续为本基金的保本提供不可撤销的连带责任担保或者承诺提供保本，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的，本基金将转入下一保本周期，本基金保本期间内的担保人承诺继续对下一保本周期提供担保的，由担保人与基金管理人另行签订保证合同；否则，本基金变更为非保本的债券型基金，基金名称相应变更为“金鹰持续收益债券型证券投资基金”，担保人不为该债券型基金承担担保责任。

(8) 担保费用由基金管理人从基金管理费收入中按照前一日基金净资产的 0.12% 年费率计提担保费，担保费每日计算，逐日累计至每年年末，按年度支付。

(9) 担保人授权基金管理人在指定媒体上公告其出具的《金鹰保本混合型证券投资基金担保函》。

#### (五) 保本周期到期

### 1、保本周期到期后基金的存续形式

保本周期届满时，在符合保本基金存续条件下，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、保本及担保安排以本基金管理人届时公告为准。

如保本到期后，本基金未能符合上述保本基金存续条件，则本基金将按《基金合同》的约定，变更为“金鹰持续收益债券型证券投资基金”；同时，基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等相关内容也将根据《基金合同》约定相应变更。上述变更由基金管理人和基金托管人同意后，可不经基金份额持有人大会决议，在报中国证监会备案后，提前在临时公告或更新的基金招募说明书中说明。

如果本基金不符合法律法规和《基金合同》对基金的存续要求，则本基金将根据《基金合同》规定终止。



## 2、保本周期到期操作规则

(1) 本基金保本周期到期后，基金份额持有人可以做出如下选择，其保本权利均适用保本条款：

- 1) 保本周期到期后赎回基金份额；
- 2) 保本周期到期后将基金份额转换为基金管理人管理的、已公告开放转换转入的其他基金；
- 3) 保本周期到期后，本基金符合保本基金存续条件，基金份额持有人持有的基金份额根据届时基金管理人的公告转入下一保本周期，单位基金份额净值按届时公告的折算方法调整至 1.00 元；
- 4) 保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，基金份额持有人继续持有变更后的“金鹰持续收益债券型证券投资基金”的基金份额。

(2) 基金份额持有人可将其持有的所有基金份额选择上述四种操作方式之一，也可以部分选择赎回、转入下一保本周期或继续持有变更后基金的基金份额、转换为基金管理人管理的其他基金。

(3) 基金份额持有人将本基金的基金份额转入下一保本周期或转换为基金管理人管理的其他基金或转为变更后的“金鹰持续收益债券型证券投资基金”后的费用，适用其所转入基金的费用、费率体系。

(4) 本基金保本周期到期后，如基金份额持有人未进行到期操作，本基金符合保本基金存续条件，则基金管理人将默认基金份额持有人继续持有本基金基金份额；如基金份额持有人未进行到期操作，本基金不符合保本基金存续条件，则基金管理人将默认基金份额持有人选择了继续持有变更后的“金鹰持续收益债券型证券投资基金”基金份额。

(5) 到期操作采取“未知价”原则，即：在到期操作期间，基金份额持有人赎回本基金基金份额或将本基金基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的，赎回金额或转出金额以基金份额持有人实际操作日的本基金基金份额净值为基准进行计算。

### (6) 比例确认

在到期操作期间截止日，按照该日单位基金份额净值（若该日为非交易日，则采用最近一个交易日的单位基金份额净值）计算，如果基金份额持有人选择或默认选择转入下一个保本周期的基金份额之净值大于或等于法律法规允许的本基金下一保本周期的募集规模上限，则基金管理人将对选择或默认选择转入下一个保本周期的基金份额进行比例确认，并及时公告确认比例的计算结果；同时，本基金将不开放过渡期申购。

## 3、到期操作期间

(1) 本基金的到期操作期间为保本周期到期日及之后 3 个工作日（含第 3 个工作日）。

(2) 在到期操作期间，本基金将暂停日常申购和转换入业务。



(3) 在到期操作期间，基金管理人应使基金财产保持为现金形式，利息收入计入基金资产；基金管理人和基金托管人免收该期间的基金管理费和基金托管费。

本基金保本周期到期前，基金管理人将提前公告并提示基金份额持有人进行到期操作，基金份额持有人可在届时公告规定的时间内按照公告规定的方式到期操作。

#### 4、保本周期到期的保本条款

本基金为基金份额持有人在当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期并持有到期的基金份额提供的保本额为：在当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期并持有到期的基金份额 $\times 1.00$  元人民币

(1) 在当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期并持有到期的基金份额持有人，无论选择赎回、转换为基金管理人管理的其他基金、或者转入下一保本周期或继续持有变更后的“金鹰持续收益债券型证券投资基金”基金份额，其持有到期的基金份额均适用保本条款。

(2) 若基金份额持有人选择在持有到期后赎回基金份额，而基金份额的可赎回金额加上基金份额持有期间的累计分红金额之和低于保本额，差额部分即为保本赔付差额，基金管理人应补足该差额，以保本额（扣除相应基金份额在持有期间的累计分红金额）支付给投资者，担保人对此提供不可撤销的连带责任担保。

(3) 若基金份额持有人选择在持有到期后进行基金转换，而基金份额的可赎回金额加上基金份额持有期间的累计分红金额之和低于保本额，差额部分即为保本赔付差额，基金管理人应补足该差额，以保本额（扣除相应基金份额在持有期间的累计分红金额）作为转出金额，担保人对此提供不可撤销的连带责任担保。

(4) 若基金份额持有人选择继续持有进入下一保本周期的基金份额或变更后的“金鹰持续收益债券型证券投资基金”的基金份额，而基金份额的可赎回金额加上基金份额在持有期间的累计分红金额之和低于保本额，差额部分即为保本赔付差额，基金管理人应补足该差额，以保本额（扣除相应基金份额在持有期间的累计分红金额）作为转入下一保本周期或转入变更后的“金鹰持续收益债券型证券投资基金”的转入金额，担保人对此提供不可撤销的连带责任担保。

(5) 在到期操作期间，在当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期的基金份额的持有人进行到期操作或默认继续持有的，可按相应基金份额在保本周期到期日的可赎回金额加上基金份额在持有期间的累计分红金额之和低于保本额的差额（即保本赔付差额）享有保本利益，但对于保本周期到期日之后（不含保本周期到期日）至其实际操作日（含该日）的净值波动风险由基金份额持有人自行承担。



## 5、本基金转入下一保本周期的方案

保本周期届满时，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担保，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的，本基金继续存续并进入下一保本周期。

### （1）过渡期和过渡期申购的前提条件

#### 1）过渡期

到期操作期间截止日起（不含该日）至下一保本周期开始日前一个工作日的期间为过渡期；过渡期最长不超过 20 个工作日。

#### 2）过渡期申购的前提条件

投资者在过渡期内申请购买本基金基金份额的行为称为“过渡期申购”。在过渡期内，投资者转换入本基金基金份额，视同为过渡期申购。

在到期操作期间截止日，按照该日单位基金份额净值（若该日为非交易日，则采用最近一个交易日的单位基金份额净值）计算，如果基金份额持有人选择或默认选择转入下一个保本周期的基金份额之净值小于法律法规允许的本基金下一保本周期的募集规模上限，则基金管理人将开放过渡期申购。

### （2）过渡期申购

1）基金管理人将根据担保人或者保本义务人提供的下一保本周期担保额度或保本偿付额度确定并公告本基金过渡期申购规模上限以及规模控制的方法。

2）过渡期申购采取“未知价”原则，即过渡期申购价格以申请当日收市后计算的本基金份额净值为准进行计算。

3）投资者进行过渡期申购的，其持有相应基金份额至过渡期最后一日（含该日）期间的净值波动风险由基金份额持有人自行承担。

#### 4）过渡期申购费率

过渡期申购费率最高不超过 5%，具体费率见《招募说明书》第九章第（五）条中列示。

过渡期申购费用由过渡期申购的投资者承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

5）过渡期申购的日期、时间、场所、方式、程序、比例确认等事宜由基金管理人确定并提前公告。

6）过渡期内，本基金将暂停办理日常赎回、转换出业务。

7）过渡期内，基金管理人应使基金财产保持为现金形式，利息收入计入基金资产；基金管理人和基金托管人免收该期间的基金管理费和基金托管费。





### （3）下一保本周期基金资产的形成

#### 1) 持有到期的基金份额

如果保本周期到期日基金份额持有人在当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期并持有到期的基金份额可赎回金额加上相应基金份额在当期保本周期内的累计分红金额之和低于保本额，差额部分即为保本赔付差额，基金管理人应补足该差额并以现金形式支付给基金份额持有人。

对于投资者在当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期或者在当期保本周期内申购、转换入的基金份额，选择或默认选择转入下一保本周期的，转入下一保本周期的转入金额等于选择或默认选择转入下一保本周期并得到基金管理人确认的基金份额在下一保本周期开始前一工作日（即折算日）所对应的基金资产净值。

#### 2) 过渡期申购的基金份额

对于投资者过渡期申购的基金份额，转入下一保本周期的转入金额等于得到本基金管理人确认的基金份额在下一保本周期开始前一工作日（即折算日）所对应的基金资产净值（申购金额在申购期间的利息收入计入基金资产净值）。

### （4）基金份额折算

过渡期最后一个工作日（即下一保本周期开始日前一工作日）为基金份额折算日。

在基金份额折算日，得到基金管理人确认的基金份额（包括投资者过渡期申购并得到确认的基金份额、保本周期结束后选择或默认选择转入下一个保本周期并得到确认的基金份额）在其持有的基金份额所代表的资产净值总额保持不变的前提下，变更登记为基金份额净值为 1.00 元的基金份额，基金份额数额按折算比例相应调整。

在基金份额持有人赎回基金份额时，持有期的计算仍以投资者认购、申购、转换入或者过渡期申购基金份额的实际操作日期计算，不受基金份额折算的影响。

### （5）开始下一保本周期运作

折算日的下一个工作日为下一保本周期开始日，本基金进入下一保本周期运作。

基金份额持有人在当期保本周期的到期操作期间选择或默认选择转入下一保本周期并得到确认的份额以及过渡期申购并得到确认的基金份额，经基金份额折算后，适用下一保本周期的保本条款。

基金份额持有人持有经折算的基金份额至下一保本周期到期的，如果下一保本周期到期日的可赎回金额加上相应基金份额在该保本周期的累计分红金额之和低于保本额，低出的部分即为保本赔付差额，则基金管理人应向基金份额持有人补足该差额，并由担保人或者保本义务人提供保本保证。下一保本周期保本额为：经基金份额折算后，基金份额持有人持有至下一保本周期到期的基金份额  $\times 1.00$  元人民币。



本基金进入下一保本周期后，仍使用原名称和基金代码办理日常申购、赎回等业务。

自本基金下一保本周期开始后，本基金管理人将暂停本基金的日常申购、赎回、定期定额投资、基金转换等业务。暂停期限最长不超过 3 个月。

投资者在下一保本周期开始后的开放日申购或转换入本基金基金份额的，相应基金份额不适用下一保本周期的保本条款。

#### （六）转为变更后的“金鹰持续收益债券型证券投资基金”资产的形成

（1）保本周期届满时，若不符合保本基金存续条件，本基金变更为“金鹰持续收益债券型证券投资基金”。如果保本到期日基金份额持有人在当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期并持有到期的基金份额的可赎回金额加上相应基金份额在当期保本周期内的累计分红金额之和低于保本额，差额部分即为保本赔付差额，基金管理人应补足该差额并以现金形式支付给基金份额持有人。

（2）对于投资者在本基金在当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期的基金份额、当期保本周期内申购或转换入的基金份额，选择或默认选择转为变更后的“金鹰持续收益债券型证券投资基金”的，转入金额等于选择或默认选择转为“金鹰持续收益债券型证券投资基金”的基金份额在“金鹰持续收益债券型证券投资基金”基金合同生效日前一个工作日所对应的基金资产净值。

#### （七）保本周期到期的公告

（1）保本周期届满时，若符合保本基金存续条件，本基金将继续存续。基金管理人应依照法律法规规定就本基金继续存续及为下一保本周期开放申购的相关事宜进行公告。

（2）保本周期届满时，若不符合保本基金存续条件，本基金将变更为“金鹰持续收益债券型证券投资基金”，基金管理人将在临时公告或《金鹰持续收益债券型证券投资基金招募说明书》中公告相关规则。

（3）在保本周期到期前，基金管理人将进行提示性公告。

#### （八）保本周期到期的赔付

（1）保本赔付责任的承担，请参见《招募说明书》“第十五、基金保本的保证”之第（五）条。

（2）保本赔付资金到账后，基金管理人应按照《基金合同》的约定进行分配和支付。

（3）发生赔付的具体操作细则由基金管理人提前公告。





## (九) 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### 1、《基金合同》的变更

(1)、以下变更《基金合同》的事项应经基金份额持有人大会决议通过：

- 1) 更换基金管理人；
- 2) 更换基金托管人；
- 3) 转换基金运作方式；
- 4) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- 5) 变更基金类别；
- 6) 变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- 7) 本基金与其他基金的合并；
- 8) 变更基金份额持有人大会召开程序；
- 9) 终止《基金合同》；
- 10) 其他可能对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案：

- 1) 调低基金管理费、基金托管费；
- 2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- 3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率；
- 4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- 5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》

当事人权利义务关系发生变化；

- 6) 除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

(2)、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，自《基金合同》生效之日起在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。

### 2、《基金合同》的终止

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- (1) 基金份额持有人大会决定终止的；
- (2) 基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接



的；

- (3) 《基金合同》约定的其他情形；
- (4) 相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### 3、基金财产的清算

(1) 基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2) 基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券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。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

(3) 基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

(4) 基金财产清算程序：

- 1) 《基金合同》终止后，由基金财产清算小组统一接管基金；
- 2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- 3) 对基金财产进行估值和变现；
- 4) 制作清算报告；
- 5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- 6) 将清算报告报中国证监会备案并公告。
- 7) 对基金财产进行分配；

(5)、基金财产清算的期限为 6 个月。

### 4、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

### 5、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交



纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

## 6、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于《基金合同》终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

## 7、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

### （十）、争议的处理

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

《基金合同》受中国法律管辖。

### （十一）、基金合同存放地及投资者取得基金合同的方式

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构的办公场所和营业场所查阅；投资者也可按工本费购买《基金合同》复制件或复印件，但内容应以《基金合同》正本为准。

## 二十八、基金托管协议的内容摘要

### （一）基金托管协议当事人

#### 1、基金管理人

名称：金鹰基金管理有限公司

住所：广东省广州市天河区珠江新城珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

设立日期：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

法定代表人：刘东

注册资本：2.5 亿元人民币

组织形式：有限责任公司

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、特定客户资产管理和中国证监会许可的其他业务。

存续期间：持续经营

## 2、基金托管人

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：易会满

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

联系电话：010-66105799

联系人：洪渊

组织形式：股份有限公司

批准设立机关和设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146 号）

存续期间：持续经营

经营范围：办理人民币存款、贷款、同业拆借业务；国内外结算；办理票据承兑、贴现、转贴现、各类汇兑业务；代理资金清算；提供信用证服务及担保；代理销售业务；代理发行、代理承销、代理兑付政府债券；代收代付业务；代理证券投资基金清算业务（银证转账）；保险代理业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；保管箱服务；发行金融债券；买卖政府债券、金融债券；证券投资基金、企业年金托管业务；企业年金受托管理服务；年金账户管理服务；开放式基金的注册登记、认购、申购和赎回业务；资信调查、咨询、见证业务；贷款承诺；企业、个人财务顾问服务；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外币兑换；出口托收及进口代收；外汇票据承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；自营、代客外汇买卖；外汇金融衍生业务；银行卡业务；电话银行、网上银行、手机银行业务；办理结汇、售汇业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

### （二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（1）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人的投资行为



进行监督。主要包括以下方面：

1) 对基金的投资范围、投资对象进行监督；

2) 对基金投融资比例进行监督；

3) 对基金投资禁止行为进行监督；

4) 基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金关联投资限制进行监督。为对基金禁止从事的关联交易进行监督，基金管理人和基金托管人应相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单及其更新；

5) 基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

6) 基金托管人对基金管理人选择存款银行进行监督。

7) 基金托管人对基金投资流通受限证券的监督。

(2) 基金托管人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

(3) 基金托管人发现基金管理人的投资运作及其他运作违反《基金法》、《基金合同》、基金托管协议及其他有关规定时，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在下一个工作日及时核对，并以书面形式向基金托管人发出回函，进行解释或举证。

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。基金管理人对于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。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因其违反《基金合同》而致使投资者遭受的损失。

基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规规定或者违反《基金合同》约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。

基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，必须在规定时间内答复基金托管人并改正，就基金托管人的疑义进行解释或举证，对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

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

基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠基金托管人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金托管人进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。



### （三）基金管理人对于基金托管人的业务核查

（1）基金管理人对于基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

（2）基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本托管协议及其他有关规定时，基金管理人应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向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，督促基金托管人改正，并予协助配合。基金托管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。基金管理人有权要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

（3）基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

### （四）基金财产的保管

#### 1、基金财产保管的原则

（1）基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

（2）基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。

（3）基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。

（4）基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理，确保基金财产的完整与独立。

（5）对于因基金认（申）购、基金投资过程中产生的应收财产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人对此不承担责任。

#### 2、募集资金的验证

（1）基金募集期满，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，由基金管理人聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所进行



验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字有效。

（2）验资完成，基金管理人应将募集的属于本基金财产的全部资金划入基金托管人为基金开立的资产托管专户中，基金托管人在收到资金当日出具确认文件。

### 3、基金的银行账户的开立和管理

（1）基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

（2）基金托管人以基金托管人的名义在其营业机构开设资产托管专户，保管基金的银行存款。本基金的一切货币收支活动，均需通过基金托管人的资产托管专户进行。

（3）本基金资产托管专户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用基金的任何银行账户进行本基金业务以外的活动。

（4）资产托管专户的管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理暂行条例》、《人民币利率管理规定》、《利率管理暂行规定》、《支付结算办法》以及银行业监督管理机构的其他规定。

### 4、基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开立基金证券交易资金账户，用于证券清算。

基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

### 5、债券托管账户的开立和管理

（1）《基金合同》生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管自营账户，并由基金托管人负责基金的债券的后台匹配及资金的清算。

（2）基金管理人和基金托管人应一起负责为基金对外签订全国银行间国债市场回购主协议，





正本由基金托管人保管，基金管理人保存副本。

## 6、其他账户的开设和管理

在本托管协议订立日之后，本基金被允许从事符合法律法规规定和《基金合同》约定的其他投资品种的投资业务时，如果涉及相关账户的开设和使用，由基金管理人协助托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

## 7、基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证的保管

基金财产投资的有关实物证券由基金托管人存放于基金托管人的保管库；其中实物证券也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

## 8、与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别应由基金托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应当保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人在合同签署后 5 个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达基金托管人处。合同原件应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门 15 年以上。

### （五）基金资产净值计算和会计核算

#### 1、基金资产净值的计算

（1）基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日该基金份额总数后的价值。

（2）基金管理人应每工作日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算办法》及其他法律法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金份额资产净值并以加密传真方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后，签名、盖章并以加密传真方式传送给基金管理人，由基金管理人对外公布。



(3) 根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。

(4) 基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。

## 2、基金会计核算

### (1) 基金账册的建立

基金管理人和基金托管人在《基金合同》生效后，应按照相关各方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本基金的全套账册，对相关各方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金资产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。

### (2) 基金定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成；招募说明书在《基金合同》生效后每六个月更新并公告一次，于该等期间届满后 45 日内公告。季度报告应在每个季度结束之日起 15 个工作日内编制完毕并公告；半年度报告在会计年度半年终了后 60 日内编制完毕并公告；年度报告在会计年度结束后 90 日内编制完毕并公告。

基金管理人在月度报表完成当日，对报表加盖公章后，以加密传真方式将有关报表提供基金托管人复核；基金托管人在 3 个工作日内进行复核，并将复核结果及时书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 7 个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在半年报完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 30 日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 45 日内复核，并将复核结果书面通知基金管理人。

基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖业务印鉴或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书，相关各方各自留存一份。如果基金管理人于基金托管人不能于应当发布公告日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

### (六) 基金份额持有人名册的保管

基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册，包括《基金合同》生效日、



《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权利登记日、每年 6 月 30 日、12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由基金的基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人、基金托管人应按照目前相关规则分别保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。保管期限为 15 年。

基金管理人应当及时向基金托管人提交下列日期的基金份额持有人名册：《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权利登记日、每年 6 月 30 日、每年 12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。其中每年 12 月 31 日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交；《基金合同》生效日、《基金合同》终止日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生后十个工作日内提交。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保存期限为 15 年。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

#### （七）争议解决方式

相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，除经友好协商可以解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在北京，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，相关各方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

#### （八）基金托管协议的变更、终止与基金财产的清算

### 1、托管协议的变更与终止

#### （1）托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议的内容进行变更。变更后的托管协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准后生效。

#### （2）基金托管协议终止的情形



发生以下情况，本托管协议终止：

- 1) 《基金合同》终止；
- 2) 基金托管人解散、依法被撤销、破产或有其他基金托管人接管基金资产；
- 3) 基金管理人解散、依法被撤销、破产或有其他基金管理人接管基金管理权；
- 4) 发生法律法规或《基金合同》规定的终止事项。

## 2、基金财产的清算

(1) 基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2) 在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》和本托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

(3) 基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券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。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

(4) 基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

(5) 基金财产清算程序：

- 1) 《基金合同》终止后，由基金财产清算小组统一接管基金；
- 2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- 3) 对基金财产进行估值和变现；
- 4) 基金清算组作出清算报告；
- 5) 会计师事务所对清算报告进行审计；
- 6) 律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- 7) 将基金清算结果报告中国证监会；
- 8) 公布基金清算公告；
- 9) 对基金财产进行分配。

(6) 清算费用

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

(7) 基金财产按下列顺序清偿：

- 1) 支付清算费用；



- 2) 交纳所欠税款;
- 3) 清偿基金债务;
- 4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款 1) —3) 项规定清偿前, 不分配给基金份额持有人。

## 二十九、对基金份额持有人的服务

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

### (一) 资料寄送服务

#### 1、账户确认书

根据客户的需要, 为客户寄送开放式基金账户确认书。

#### 2、对账单

基金投资人对账单包括季度对账单和年度对账单。其中, 季度对账单在每季结束后的 20 个工作日内向有交易的持有人以书面或电子文件形式寄送; 年度对账单在每年度结束后 25 个工作日内对所有持有人以书面或电子文件形式寄送。

如投资人需要更改寄送方式或寄送频率, 请致电本公司客服中心或登陆公司网站。

#### 3、其他相关的信息资料

介绍公司最新动态、投资运作、新产品、国内外金融市场动态和投资机会等。

### (二) 基金间转换服务

基金管理人在本基金合同生效后的适当时候将为投资人办理基金间的转换业务, 具体业务办理时间、业务规则及转换费率在基金转换公告中列明。

### (三) 定期投资计划

在技术条件成熟时, 基金管理人将利用直销网点或代销网点为投资人提供定期投资的服务。通过定期投资计划, 投资人可以通过固定的渠道, 定期申购基金份额。该定期投资计划的有关规则另



行公告。

#### （四）网络在线服务

通过本基金管理人网站的留言板和客户服务信箱，投资人可以实现在线咨询、投诉、建议和寻求各种帮助。

基金管理人网站提供了基金公告、投资资讯、理财刊物、基金常识等各种信息，投资人可以根据各自的使用习惯非常方便的自行查询或信息定制。

基金管理人网站将为投资人提供基金账户查询、交易明细查询、对账单寄送方式或频率设置、修改查询密码等服务。

公司网址：<http://www.gefund.com.cn>

电子信箱：[csmail@gefund.com.cn](mailto:csmail@gefund.com.cn)

#### （五）信息定制服务

在技术条件成熟时，基金管理人还可为基金投资人提供通过基金管理人网站、客户服务中心提交信息定制申请，基金管理人通过手机短讯、E-MAIL 定期为客户发送所定制的信息，内容包括：每笔交易确认查询、每月账户余额与损益查询、最近季度的基金投资组合、分红提示、公司最新公告、新产品信息披露、基金净值查询等。

#### （六）客户服务中心（CALL-CENTER）电话服务

呼叫中心自动语音系统提供 7×24 小时交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息查询。

呼叫中心人工座席每个交易日 9:00-11:30, 13:00-17:00 为投资人提供服务，投资人可以通过该热线获得业务咨询，信息查询，服务投诉，信息定制，资料修改等专项服务。

客服及投诉电话：4006-135-888、020-83936180

传真：020-83282856

#### （七）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或以书信、电子邮件等方式，对基金管理人和销售网点所提供的服务进行投诉。

对于工作日期间受理的投诉，以“及时回复”为处理原则，对于不能及时回复的投诉，基金管理人承诺在 2 个工作日之内对投资人的投诉做出回复。对于非工作日提出的投诉，基金管理人将在顺延的工作日当日进行回复。



## (八) 网上开户与交易服务

在技术条件成熟时，金鹰基金及其合作机构将为投资人提供方便快捷的网上在线开户交易服务。

## 三十、其它应披露事项

## 1、本基金在本报告期内公开披露的信息内容

|    | 披露内容                                            | 披露媒体  | 披露日期       |
|----|-------------------------------------------------|-------|------------|
| 1  | 金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与海通证券股份有限公司费率优惠并开通定投、转换业务的公告 | 证券时报等 | 2015-12-22 |
| 2  | 金鹰基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新已过期身份证件的公告                 | 证券时报等 | 2015-12-29 |
| 3  | 金鹰基金管理有限公司关于增加北京乐融多源投资咨询有限公司为旗下部分基金代销机构的公告      | 证券时报等 | 2015-12-29 |
| 4  | 金鹰保本混合型证券投资基金更新的招募说明书摘要 2015 年第 2 号             | 证券时报等 | 2015-12-29 |
| 5  | 金鹰基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新已过期身份证件的公告                 | 证券时报等 | 2015-12-31 |
| 6  | 金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国光大银行股份有限公司费率优惠活动的公告       | 证券时报等 | 2015-12-31 |
| 7  | 金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国邮政储蓄银行股份有限公司费率优惠活动的公告     | 证券时报等 | 2015-12-31 |
| 8  | 金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加平安银行股份有限公司费率优惠活动的公告         | 证券时报等 | 2015-12-31 |
| 9  | 金鹰基金管理有限公司关于旗下开放式基金资产净值等的公告                     | 证券时报等 | 2016-1-4   |
| 10 | 金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与深圳市新兰德证券投资咨询有限公司费率优惠活动的公告   | 证券时报等 | 2016-1-6   |





|    |                                                  |       |           |
|----|--------------------------------------------------|-------|-----------|
| 11 | 金鹰基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新已过期身份证件的公告                  | 证券时报等 | 2016-1-8  |
| 12 | 金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京钱景财富投资管理有限公司费率优惠并开通定投业务的公告 | 证券时报等 | 2016-1-13 |
| 13 | 金鹰基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新已过期身份证件的公告                  | 证券时报等 | 2016-1-18 |
| 14 | 关于金鹰基金新增东兴证券为代销机构并开通转换的公告                        | 证券时报等 | 2016-1-19 |
| 15 | 金鹰基金管理有限公司关于旗下基金参加包商银行股份有限公司费率优惠活动的公告            | 证券时报等 | 2016-1-19 |
| 16 | 金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与申万宏源费率优惠活动的公告                | 证券时报等 | 2016-1-19 |
| 17 | 金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠的公告     | 证券时报等 | 2016-1-20 |
| 18 | 金鹰保本混合型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告                     | 证券时报等 | 2016-1-21 |
| 19 | 关于安信证券新增为我司旗下部分基金的代销机构并开通基金定投、转换及参与费率优惠活动的公告     | 证券时报等 | 2016-1-26 |
| 20 | 金鹰基金管理有限公司关于增加上海凯石财富基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构的公告       | 证券时报等 | 2016-1-28 |
| 21 | 金鹰基金管理有限公司关于增加华金证券股份有限公司为代销机构的公告                 | 证券时报等 | 2016-1-28 |
| 22 | 金鹰基金管理有限公司关于直销渠道转换费率优惠活动的公告                      | 证券时报等 | 2016-1-28 |
| 23 | 关于金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增钱景财富为代销机构并开通基金定投及参与费率优惠活动的公告 | 证券时报等 | 2016-1-29 |
| 24 | 关于金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增金元证券为代销机构并开通基金转换业务的公告        | 证券时报等 | 2016-2-2  |



|    |                                                        |       |           |
|----|--------------------------------------------------------|-------|-----------|
| 25 | 金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与平安证券定投及费率优惠活动的公告                   | 证券时报等 | 2016-2-17 |
| 26 | 金鹰基金管理有限公司关于新增上海证券为旗下部分基金代销机构的公告                       | 证券时报等 | 2016-2-23 |
| 27 | 金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京恒宇天泽投资管理有限公司为代销机构并开通定投、转换业务的公告   | 证券时报等 | 2016-3-1  |
| 28 | 关于金鹰保本混合型证券投资基金增加基金份额类别并修改基金合同及托管协议的公告                 | 证券时报等 | 2016-3-2  |
| 29 | 金鹰基金管理有限公司关于直销渠道转换费率优惠活动的公告                            | 证券时报等 | 2016-3-3  |
| 30 | 关于金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增广发证券股份有限公司为代销机构并开通费率优惠、定投及转换业务的公告  | 证券时报等 | 2016-3-4  |
| 31 | 金鹰基金管理有限公司关于暂停旗下部分基金参与北京君德汇富投资咨询有限公司费率优惠活动的公告          | 证券时报等 | 2016-3-8  |
| 32 | 金鹰基金管理有限公司关于新增渤海证券为代销机构并开通转换业务的公告                      | 证券时报等 | 2016-3-8  |
| 33 | 金鹰基金管理有限公司关于在顺德农商行开通旗下部分基金转换业务的公告                      | 证券时报等 | 2016-3-11 |
| 34 | 金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中航证券为代销机构并开通转换业务的公告                | 证券时报等 | 2016-3-15 |
| 35 | 金鹰基金管理有限公司关于增加上海中正达广投资管理有限公司为旗下部分基金代销机构的公告             | 证券时报等 | 2016-3-15 |
| 36 | 金鹰基金管理有限公司关于增加中国邮政储蓄银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构及开通基金定投和转换业务的公告 | 证券时报等 | 2016-3-17 |



|    |                                                                 |       |           |
|----|-----------------------------------------------------------------|-------|-----------|
| 37 | 金鹰基金管理有限公司关于增加中国邮政储蓄银行股份有限公司为金鹰保本混合型证券投资基金代销机构及开通基金定投业务、转换业务的公告 | 证券时报等 | 2016-3-21 |
| 38 | 金鹰基金管理有限公司关于中国邮政储蓄银行股份有限公司代销旗下部分基金定投费率优惠的公告                     | 证券时报等 | 2016-3-23 |
| 39 | 金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中信建投证券股份有限公司费率优惠活动并开通定投、转换业务的公告             | 证券时报等 | 2016-3-25 |
| 40 | 金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京钱景财富投资管理有限公司为代销机构并参与费率优惠的公告               | 证券时报等 | 2016-3-25 |
| 41 | 金鹰基金管理有限公司关于新增华融证券股份有限公司为代销机构并开通费率优惠、定投及转换业务的公告                 | 证券时报等 | 2016-3-30 |
| 42 | 金鹰基金管理有限公司关于大同证券有限责任公司代理销售旗下部分基金并开通定投及转换业务的公告                   | 证券时报等 | 2016-3-30 |
| 43 | 金鹰基金管理有限公司关于旗下基金参加中国工商银行股份有限公司费率优惠活动的公告                         | 证券时报等 | 2016-4-1  |
| 44 | 金鹰基金管理有限公司关于网上交易系统升级暂停服务的公告                                     | 证券时报等 | 2016-4-11 |
| 45 | 金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京晟视天下投资管理有限公司为代销机构并开通转换业务的公告               | 证券时报等 | 2016-4-25 |
| 46 | 金鹰基金管理有限公司 关于旗下基金参与深圳市新兰德证券投资咨询有限公司费率优惠活动的公告                    | 证券时报等 | 2016-4-25 |
| 47 | 金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增珠海盈米财富管理有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告              | 证券时报等 | 2016-4-28 |



|    |                                                  |       |           |
|----|--------------------------------------------------|-------|-----------|
| 48 | 关于金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增开源证券股份有限公司为代销机构并开通定投、转换业务的公告 | 证券时报等 | 2016-4-29 |
| 49 | 金鹰基金管理有限公司关于直销渠道转换费率优惠活动的公告                      | 证券时报等 | 2016-5-3  |
| 50 | 金鹰基金管理有限公司关于增加上海攀赢金融信息服务有限公司为旗下部分基金代销机构的公告       | 证券时报等 | 2016-5-5  |
| 51 | 金鹰基金管理有限公司关于网上交易关闭支付宝服务的公告                       | 证券时报等 | 2016-5-5  |
| 52 | 金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增首创证券有限责任公司为代销机构并开通定投及转换业务的公告 | 证券时报等 | 2016-5-6  |

## 2、其它重要信息

(1) 由于原为公司旗下基金提供审计服务的会计师事务所中审亚太会计师事务所（特殊普通合伙）并购的原因，从 2015 年 12 月 31 日起旗下基金事务所由原来的中审亚太会计师事务所（特殊普通合伙）变更为中审众环会计师事务所（特殊普通合伙），该事项已获得董事会同意，于 2015 年 12 月 31 日在证监会指定媒体公告，并按规定向证监会备案。

(2) 本公司于 2016 年 3 月 28 日搬迁到新地址办公，变更后办公地址为：广州市天河区珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层，相关变更手续已按证监会规定程序办理，并在证监会指定媒体披露。

(3) 2016 年 3 月 2 日，本基金管理人完成相关报备手续后公告金鹰保本混合基金增设 A 类和 C 类份额。

## 三十一、招募说明书的存放及查阅方式

基金招募说明书、定期报告、临时报告与公告等文本存放在基金管理人、基金托管人和销售机构的办公场所和营业场所，在办公时间内可供免费查阅。投资人也可以直接登录基金管理人的网站进行查阅。投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。对投资人按此种方式所获得的文件及其复印件，基金管理人和基金托管人应保证与所公告的内容完全一致。



## 三十二、备查文件

备查文件等文本存放在基金管理人、基金托管人和销售机构的办公场所和营业场所，在办公时间内可供免费查阅。

- (1) 中国证监会核准金鹰保本混合型证券投资基金募集的文件（证监许可【2011】436 号）；
- (2) 《金鹰保本混合型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《金鹰保本混合型证券投资基金托管协议》；
- (4) 法律意见书；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 基金托管人业务资格批件、营业执照；
- (7) 《金鹰基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- (8) 中国证监会要求的其他文件。



附件：《保证合同》

## 金鹰保本混合型证券投资基金

### 第二个保本周期保证合同

**基金管理人：金鹰基金管理有限公司**

**基金担保人：广州越秀金融控股集团有限公司**

**基金管理人：金鹰基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）**

**住所地：广州市天河区体育西路 189 号城建大厦 22、23 层**

**公司地址：广州市天河区体育西路 189 号城建大厦 22、23 层**

**法定代表人：凌富华**

**电话：020-83282403      传真：020-83282856      邮编：510620**

**基金担保人：广州越秀金融控股集团有限公司（以下简称“担保人”）**

**住所地：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔写字楼第 63 层 01-B 单元**

**公司地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔写字楼第 63 层 01-B 单元**

**法定代表人：张招兴**

**电话：（020）88836888      邮编：510620**

#### 鉴于

《金鹰保本混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）约定了基金管理人的保本义务（见《基金合同》）。为保护基金投资者合法权益，依照《中华人民共和国担保法》、《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《关于保本基金的指导意见》等法律法规的规定，基金管理人和担保人在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上，特订立《金鹰保本混合型证券投资基金第二个保本周期保证合同》（以下简称“本合同”或“《保证合同》”）。担保人就金鹰保本混合型证券投资基金（以下简称“本



基金”)的第二个保本周期内基金管理人对基金份额持有人在第二个保本周期开始前的过渡期申购或从第一个保本周期转入到第二个保本周期,并持有到期的基金份额所承担保本义务的履行提供不可撤销的连带责任保证。担保人保证责任的承担以本《保证合同》为准。

《保证合同》的当事人包括基金管理人、担保人和基金份额持有人。基金投资者依《基金合同》取得基金份额,即成为基金份额持有人和《保证合同》的当事人,其购买基金份额的行为本身即表明其对《保证合同》的承认、接受和同意。

除非本《保证合同》另有约定,本《保证合同》所使用的词语或简称与其在《基金合同》中的释义部分具有相同含义。

### 一、担保范围和担保限额

担保范围为:基金份额持有人在第二个保本周期开始前的过渡期申购或从第一个保本周期转入到第二个保本周期并持有到期的基金份额的可赎回金额加上相应基金份额在第二个保本周期内的累计分红金额之和低于其保本额(在第二个保本周期开始前的过渡期申购并持有到期或从第一个保本周期转入到第二个保本周期并持有到期的基金份额之保本额为该基金份额在第二个保本周期开始前的份额折算日所对应的资产净值)的差额(以下简称保本赔付差额)。“持有到期”是指基金份额持有人在保本周期内持续、不间断地持有所认购的基金份额的行为;基金份额的“可赎回金额”指在保本周期到期日,基金份额持有人持有的基金份额与到期日基金份额净值的乘积。基金份额持有人在第二个保本周期内申购或转换转入的或第二个保本周期到期日前赎回或转换转出的部分不在担保范围之内。

担保限额为 40 亿元人民币。金鹰保本混合型证券投资基金第二个保本周期起始日的资产规模上限不得超过担保限额,担保人履行担保责任以持有到期的基金份额持有人之总额不超过第二个保本周期起始日的资产规模上限的基金份额所对应的保本赔付差额为限。担保人对可担保份额上限和担保责任金额上限不得调减。

第二个保本周期到期日是指本基金第二个保本周期届满的最后一日。本基金的第二个保本周期为三年,自第二个保本周期起始日起至三年后对应日止,如该对应日为非工作日,第二个保本周期到期日顺延至下一个工作日。

### 二、担保期间

担保期间为第二个基金保本周期到期日起六个月止。





### 三、担保的方式与担保费用

在担保范围、担保限额、担保期间内，本担保人承担不可撤销的连带清偿责任。担保人因承担连带清偿责任而收取担保费用，担保费用由基金管理人从基金管理费收入中按照前一日基金净资产的 0.12% 年费率计提担保费，担保费每日计算，逐日累计至每年年末，于次年前 15 个工作日内（保本周期到期的，应在保本周期到期日后 15 个工作日内）一次性付清。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。担保费计算公式：每日担保费计算公式=担保费计提日前一日基金资产净值×0.12%×1/当年天数。担保费的计算期间为第二个保本周期起始日起，至担保人解除保证责任之日或第二个保本周期到期日较早者止，起始日及终止日均应计入期间。

### 四、担保责任的履行及清偿程序

1、在第二个保本周期到期日，如基金份额持有人在第二个保本周期开始前的过渡期申购或从第一个保本周期转入到第二个保本周期，并持有到期的基金份额的可赎回金额加上相应基金份额在第二个保本周期的累计分红金额之和低于其保本额，基金管理人应按《基金合同》的约定在第二个保本周期到期日后 5 个工作日内将保本赔付差额补足至本基金在基金托管人处开立的资金结算账户；基金管理人无法全额履行保本义务的，基金管理人在第二个保本周期到期日后 5 个工作日内，向担保人发出书面《履行担保责任通知书》（应当载明基金管理人应向基金份额持有人支付的本基金保本赔付差额、基金管理人已自行偿付的金额、需担保人支付的代偿款项以及基金管理人指定的本基金在基金托管人处开立的账户信息）。

2、本担保人将在收到基金管理人发出的《履行担保责任通知书》后的 3 个工作日内完成应代偿金额的核实，并于核实完成后的 4 个工作日内将尚未补足的款项一次性足额划入本基金在基金托管人处开立的账户中。担保人将差额款项足额划入本基金在基金托管人处开立的账户中并得到基金托管人的书面确认后即为全部履行了担保责任，无须对基金份额持有人逐一进行清偿，代偿款的分配与支付由基金管理人负责，担保人对此不承担责任。

3、基金管理人应在第二个保本周期到期日后 20 个工作日内将保本赔付差额（含基金管理人自有资金和担保人的代偿款）支付给基金份额持有人。

4、若基金管理人和担保人未履行全部或部分保本义务和保证责任的，自第二个保本周期到期后第 21 个工作日起，基金份额持有人有权根据《基金合同》第二十五部分“争议的处理和适用的法律”的约定，有权直接就差额部分向基金管理人和担保人追偿，但基金份额持有人直接向担保人追偿的，仅得在担保期间内提出。

对于在第二个保本周期开始前的过渡期申购或从第一个保本周期转入到第二个保本周期并持有到期的基金份额，基金份额持有人无论选择赎回、转换出、转入下一保本周期还是转型为管理人



不再承担保本义务的证券投资基金，都不影响担保人担保责任的履行。

## 五、除外责任

当发生下列情形时，担保人不承担担保责任：

（一）在保本周期到期日，基金份额持有人在第二个保本周期开始前的过渡期申购或从第一个保本周期转入到第二个保本周期并持有到期的基金份额的可赎回金额与相应基金份额于第二个保本周期内的累计分红金额之和不低于其保本额；

（二）基金份额持有人在基金第二个保本周期到期日前（不包括该日）赎回或转换转出的基金份额；

（三）基金份额持有人在第二个保本周期内申购或转换转入的基金份额；

（四）在保本周期内发生《基金合同》规定的《基金合同》终止的情形；

（五）在第二个保本周期内发生本基金与其他基金合并或更换基金管理人的情形，且担保人不同意继续承担担保责任；

（六）在第二个保本周期到期日之后（不包括该日）基金份额发生的任何形式的净值减少；

（七）未经担保人书面同意修改《基金合同》条款，可能加重担保人保证责任的部分，担保人对加重部分不承担担保责任，根据法律法规要求进行修改的除外；

（八）因不可抗力原因导致基金投资亏损；或因不可抗力事件直接导致基金管理人无法按约定履行全部或部分义务或延迟履行义务的，或《基金合同》规定的其他情形基金管理人免于履行保本义务；或因不可抗力事件导致基金担保人无法履行担保责任的。不可抗力是指不能预见、不能避免且不能克服的客观事件。

## 六、追偿权、追偿程序和还款方式

担保人根据本合同履行担保责任后，有权向基金管理人追偿。担保人履行了保证责任后，即有权要求基金管理人归还担保人为履行保证责任支付的全部款项（包括但不限于担保人按《履行保证责任通知书》所载明代偿款项支付的实际金额、基金份额持有人直接向担保人要求代偿的金额、基金份额持有人通过召开基金份额持有人大会向担保人要求代偿的金额及其他担保人为履行保证责任支付的金额，前述款项重叠部分不重复计算）和自支付之日起的利息（利率为每日万分之三）。

具体追偿程序和还款方式如下：

1、在担保人履行担保责任后的 10 个工作日内，担保人将向基金管理人发出《确认函》，基金管理人应在收到担保人发出的《确认函》后 3 个工作日内确认担保人代基金管理人清偿的金额并向担保人发出《〈确认函〉回执》；

2、基金管理人在发出《〈确认函〉回执》后 5 个工作日内，应根据担保人代偿的金额和自身实



际情况制作《还款计划书》并发担保人确认；

3、在担保人确认基金管理人的还款计划后，基金管理人应按《还款计划书》列明的期限和金额向担保人还款。如基金管理人不能按期还款，逾期超过五日，担保人将向基金管理人发出《催款函》催交欠款；逾期超过十五日，担保人将委托律师事务所向基金管理人发出《律师函》催交欠款；逾期超过三十日，担保人将依法向担保人所在地人民法院提起诉讼，行使法定追偿权；

#### 七、适用法律及争议解决方式

在本合同履行期间，凡因履行本合同所发生的或与本合同有关的一切争议、纠纷，双方应尽量友好协商解决。若引起诉讼由担保人所在地人民法院管辖。

#### 八、其他条款

1、基金管理人应向本基金的基金份额持有人公告本《保证合同》。

2、本《保证合同》自基金管理人、担保人双方加盖公司公章或由基金管理人、担保人双方法定代表人（或其授权代理人）签字（或加盖人名章）并加盖公司公章后成立，自本基金第二个保本周期起始日起生效。

3、本基金第二个保本周期到期日后，基金管理人、担保人双方全面履行了本合同规定的义务，本合同终止。

4、担保人若承诺继续对本基金下一个保本周期提供保本保障的，基金管理人、担保人另行签署合同。

5、本保证合同一式六份，每份具有同等法律效力。

金鹰基金管理有限公司

2016 年 6 月 22 日