

金鹰基金管理有限公司

金鹰成份股优选证券投资基金

基金合同

(2023年8月)

基金发起人：金鹰基金管理有限公司

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

## 目 录

一、释 义	2
二、前 言	5
三、基金合同当事人及权利和义务	6
四、基金份额持有人大会	13
五、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序	20
六、基金的基本情况	22
七、基金单位的发行	23
八、基金的成立	25
九、基金的申购与赎回	26
十、基金的托管	33
十一、基金认购、申购、赎回业务	34
十二、基金的注册登记	35
十三、基金的投资	36
十四、基金资产	1
十五、基金资产的估值	2
十六、基金的费用与税收	6
十七、基金收益与分配	8
十八、基金的会计与审计	10
十九、基金的信息披露	11
二十、基金合同的终止与清算	17
二十一、违约责任	20
二十二、争议的处理	21
二十三、基金合同的效力	22
二十四、基金合同的修改和终止	23
二十五、基金专用交易席位的选择	24
二十六、其他事项	26

---

---

## 一、释 义

- 基金或本基金：指金鹰成份股优选证券投资基金
- 《基金合同》或本基金合同：指《金鹰成份股优选证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充
- 招募说明书：指《金鹰成份股优选证券投资基金招募说明书》及其更新
- 发行公告：指《金鹰成份股优选证券投资基金发行公告》
- 《信息披露办法》：指中国证监会2019年7月26日颁布、同年9月1日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 《暂行办法》：指《证券投资基金管理暂行办法》
- 《试点办法》：指《开放式证券投资基金试点办法》
- 中国证监会：指中国证券监督管理委员会
- 基金发起人：指金鹰基金管理有限公司
- 基金托管人：指中国银行股份有限公司
- 基金管理人：指金鹰基金管理有限公司
- 销售机构：指直销机构及销售代理机构
- 直销机构：指金鹰基金管理有限公司
- 销售代理机构：指依据有关销售代理协议办理本基金认购、申购、赎回和其他基金业务的代理机构
- 注册登记业务：指本基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资人基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等
- 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：指个人投资者和/或机构投资者
- 个人投资者：指持有有效的中华人民共和国居民身份证等合法证件的自然人或其代理人

---

---

机构投资者：	指在中华人民共和国境内合法注册登记或经有关政府部门批准设立的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织
基金成立日：	指基金达到成立条件后，基金发起人宣告基金成立的日期
设立募集期：	指自招募说明书公告之日起到基金成立日的时间段，最长不超过3个月
认购：	指在本基金募集期内，投资者申请购买本基金基金单位的行为
申购：	指在本基金存续期间内，投资者申请购买本基金基金单位的行为
赎回：	指基金份额持有人按《基金合同》规定的条件，要求基金管理人购回本基金基金单位的行为
基金账户：	指注册登记机构为基金投资者开立的记录其持有的由该注册登记机构办理注册登记的本基金或基金管理人管理的其他开放式基金份额及其变动情况的账户
交易帐户：	指销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构买卖本基金或基金管理人管理的其他开放式基金份额变动及结余情况的帐户
存续期：	指基金成立并存续的不定期之期限
开放日：	指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日
工作日：	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日
T日：	指申购、赎回或其他交易的申请日
基金收益：	指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入
基金资产总值：	指基金购买的各类证券、银行存款本息、基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和
基金资产净值：	指基金资产总值减去负债后的价值
基金资产估值：	指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程
重大事件：	指可能对基金份额持有人合法权益及基金单位的交易价格产生重大影响的事件

---

---

指定媒介：	指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介
《流动性风险管理规定》：	指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订
流动性受限资产：	是指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等
基金产品资料概要	《金鹰成份股优选证券投资基金基金产品资料概要》及其更新
侧袋机制	指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户
特定资产	包括：（1）无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性的资产；（2）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（3）其他资产价值存在重大不确定性的资产

---

---

## 二、前 言

### （一）订立本基金合同的目的、依据和原则

1、订立本基金合同的目的是保护基金投资者合法权益、明确基金合同当事人的权利与义务、规范基金运作；

2、订立本基金合同的依据是《暂行办法》、《试点办法》、《流动性风险管理规定》、《信息披露办法》、《销售办法》及其他有关法律、法规和中国证监会的有关规定；

3、基金发起人、基金管理人和基金托管人根据平等自愿、诚实信用、充分保护投资者权益的原则，协商一致共同订立本基金合同。

（二）本基金由发起人依照《暂行办法》、《试点办法》、基金合同及其有关法律、法规和中国证监会的有关规定发起，须经中国证监会批准方可募集设立。该批准并不表明中国证监会对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。基金管理人依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

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

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

投资者应当认真阅读基金招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

（五）本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临投资存托凭证的特殊风险。

### 三、基金合同当事人及权利和义务

#### （一）基金发起人

##### 1、基金发起人简况

名称：金鹰基金管理有限公司

住所：广州市南沙区横沥镇汇通二街 2 号 3212 房（仅限办公）

法定代表人：姚文强

成立时间：2002 年 12 月 25 日

批准设立机关及文号：中国证监会，证监基金字[2002]97 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币 5.102 亿元

存续期限：持续经营

##### 2、基金发起人的权利和义务

###### 1) 基金发起人的权利

根据《暂行办法》、本《基金合同》及其他有关法规，基金发起人享有如下权利：

- （1）申请发起设立基金；
- （2）法律、法规、中国证监会及《基金合同》规定的其他权利。

###### 2) 基金发起人的义务

根据《暂行办法》、本《基金合同》及其他有关法规，基金发起人负有如下义务：

- （1）遵守《基金合同》；
- （2）编制并公告招募说明书，并保证其陈述内容真实、准确、完整；
- （3）自开放式基金设立申请获得批准之日起 6 个月内进行设立募集；超过 6 个月尚未开始设立募集的，原申请内容如有实质性改变，应当向中国证监会报告；原申请内容没有实质性改变的，应当向中国证监会备案；
- （4）不得从事任何有损基金及其他基金当事人合法利益的活动；
- （5）在基金不能成立时承担基金全部募集费用，并在发行期结束后 30 天内把已募集到的资金加计同期银行活期存款利息退还基金投资者；

(6) 法律、法规、中国证监会及《基金合同》规定的其他义务。

(二) 基金管理人：金鹰基金管理有限公司

### 1、基金管理人简况

住所：广州市南沙区横沥镇汇通二街2号3212房（仅限办公）

法定代表人：姚文强

成立时间：2002年12月25日

批准设立机关及文号：中国证监会，证监基金字[2002]97号

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币5.102亿元

存续期限：持续经营

### 2、基金管理人的权利义务

#### 1) 基金管理人的权利

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

(1) 自本基金成立之日起，根据法律、法规和本《基金合同》的规定管理和运作基金资产；

(2) 按照《基金合同》规定，获得基金管理人报酬；

(3) 销售基金单位，办理其他基金交易业务；

(4) 选择、更换基金销售代理人，对基金销售代理人的相关行为进行监督。如认为基金销售代理人违反本《基金合同》、《基金销售代理协议》或国家法律、法规的有关规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(5) 依照《暂行办法》、《试点办法》及其他有关规定，代表基金行使因基金投资而获得的相应权利；

(6) 根据法律法规、《基金合同》及《托管协议》的有关规定，监督基金托管人的托管行为，如认为基金托管人违反了法律法规、《基金合同》及《托管协议》的有关规定，应呈报中国证监会和中国人民银行，并采取必要措施保护基金投资人的利益；

(7) 法律、法规、中国证监会及《基金合同》规定的其他权利。

#### 2) 基金管理人的义务



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

- (1) 遵守《基金合同》；
- (2) 自基金成立日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产；
- (3) 配备足够的具有专业知识的人员进行基金投资分析、决策，以专业化经营方式管理和运作基金资产；
- (4) 配备足够的专业人员办理基金单位的认购、申购和赎回业务或委托其他机构代理该项业务；
- (5) 配备足够的专业人员进行基金的注册登记或委托其他机构代理该项业务；
- (6) 建立健全内部风险控制、监察稽核、财务管理及人事管理等制度，保证基金资产与基金管理人的资产相互独立，保证不同基金在资产运作、财务管理等方面相互独立；
- (7) 除依据《暂行办法》、《试点办法》、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金资产为自己及除基金份额持有人以外的任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金资产；
- (8) 依法接受基金托管人的监督；
- (9) 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净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；
- (10) 严格按照《暂行办法》、《试点办法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务，编制季度报告、中期报告和年度报告；
- (11) 保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等。除《暂行办法》、《试点办法》、基金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，不得向他人泄露；
- (12) 开放式基金成立后的存续期间内，其有效持有人数量连续 20 个工作日达不到 100 人，或者连续 20 个工作日最低基金资产净额低于 5000 万元的，基金管理人应当及时向中国证监会报告，说明出现上述情况的原因以及解决方案；
- (13) 按照规定向基金份额持有人分配基金收益；
- (14) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回、分红款项；

(15) 不谋求对上市公司的控股和直接管理；

(16) 依据《暂行办法》、《试点办法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会；

(17) 负责编制基金财务会计报告，保存基金的会计帐册、报表、记录 15 年以上；

(18) 确保需要向基金投资人提供的各项文件或资料在规定时间发出；并且保证基金投资人能够按照《基金合同》规定的时间和方式，查阅到与基金有关的公开信息，并得到有关资料的复印件；

(19) 参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

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

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

(23) 采取适当、合理的方式向基金投资人进行赔偿；

(24) 基金托管人因过错造成基金资产损失时，应为基金向基金托管人追偿；

(25) 法律、法规、中国证监会及《基金合同》规定的其他义务。

(三) 基金托管人：中国银行

#### 1、基金托管人概况

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：葛海蛟

成立时间：1983 年 10 月 31 日

批准设立机关：中国人民银行

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

存续期限：持续经营

#### 2、基金托管人的权利和义务

##### 1) 基金托管人的权利

根据《暂行办法》、《试点办法》、本《基金合同》及其他有关法规，基金托

管人享有如下权利：

- (1) 依法持有并保管本基金资产；
- (2) 依据本《基金合同》约定获得基金托管费；
- (3) 根据法律法规、本《基金合同》及《托管协议》的有关规定，监督基金管理人本基金的运作，如认为基金管理人违反了法律法规、本《基金合同》及《托管协议》的有关规定，应呈报中国证监会和中国人民银行，并采取必要措施保护基金投资人的利益；
- (4) 在更换基金管理人时，提名新任基金管理人；
- (5) 在更换基金管理人、审议与基金管理人可能构成利益冲突的事项或基金管理人未能行使召集权的情况下，负责召集基金份额持有人大会；
- (6) 法律、法规、中国证监会及《基金合同》规定的其他权利。

## 2) 基金托管人的义务

根据《暂行办法》、本《基金合同》及其他有关法规，基金托管人负有如下义务：

- (1) 遵守《基金合同》；
- (2) 依法持有基金资产；
- (3) 以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金资产；
- (4) 设置专业的基金托管部门和符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金资产托管事宜；
- (5) 建立健全内部风险控制、监察稽核、财务管理及人事管理等制度，保证基金资产与基金托管人自有资产相互独立；保证不同的基金资产相互独立，对不同的基金分别设置帐户，独立核算、分帐管理；保证不同基金之间在名册登记、帐户设置、资金划拨、帐册记录等方面相互独立；
- (6) 除依据《暂行办法》、《试点办法》、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金资产为自己及除基金份额持有人以外的任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金资产；
- (7) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- (8) 基金托管人应当代表基金，以托管人和基金联名的方式开设证券帐户，以托管人的名义开立资金结算帐户，代理基金的资金结算业务，执行基金管理人的投资指令；

(9) 保守基金商业秘密。除《暂行办法》、《试点办法》、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，不得向他人泄露；

(10) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、赎回价格；

(11) 采取适当、合理的措施，使开放式基金单位的认购、申购、赎回等事项符合基金合同等有关法律文件的规定；

(12) 采取适当、合理的措施，使基金投资和融资的条件符合基金合同等法律文件的规定；

(13) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(14) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具基金托管人意见，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；

(15) 建立并保存基金份额持有人名册；

(16) 按有关规定，保存基金的会计帐册、报表和记录等 15 年以上；

(17) 按规定制作相关帐册并与基金管理人核对；

(18) 依据基金管理人的指令或有关规定将基金份额持有人基金收益和赎回款项划拨至专用帐户；

(19) 参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；

(20) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，应及时报告中国证监会和中国人民银行，并通知基金管理人；

(21) 因过错导致基金资产的损失，应承担赔偿责任，其过错责任不因其退任而免除；

(22) 基金管理人因过错造成基金资产损失时，应为基金向基金管理人追偿；

(28) 法律、法规、中国证监会及《基金合同》规定的其他义务。

#### (四) 基金份额持有人

##### 1、基金份额持有人的权利

根据《暂行办法》、《试点办法》、《基金合同》及其他有关法律法规的规定，基金份额持有人享有如下权利：

##### 1) 取得基金收益；

- 
- 
- 2) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，并行使表决权；
  - 3) 获取本基金业务及财务状况的资料；
  - 4) 申购、赎回基金单位；
  - 5) 监督基金经营情况；
  - 6) 取得基金清算后的剩余资产；
  - 7) 因基金管理人、托管人、销售机构、注册登记机构的过错导致基金份额持有人损失的求偿权；
  - 8) 法律、法规、中国证监会及《基金合同》规定的其他权利；
  - 9) 每份基金单位具有同等的合法权益。

## 2、基金份额持有人的义务

根据《暂行办法》、《试点办法》、《基金合同》及其他有关法律法规的规定，基金份额持有人负有如下义务：

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

## 四、基金份额持有人大会

本基金基金份额持有人大会不设日常机构。

### （一）召开事由

有下列情形之一的，应召开基金份额持有人大会：

- 1、提前终止基金合同；
- 2、基金扩募或者延长基金合同期限；
- 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、更换基金管理人、基金托管人；
- 6、法律、法规、《基金合同》和中国证监会规定的其他事项。

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、调低基金管理费、基金托管费；
- 2、在法律法规和基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
- 3、因相应的法律、法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- 4、对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- 5、按照法律法规或《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

### （二）召集方式

1、除法律法规或基金合同另有规定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集，基金份额持有人大会的开会时间、地点及权利登记日由基金管理人选择确定；在更换基金管理人或基金管理人未行使召集权的情况下，由基金托管人召集。

2、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十日内决定是否召集，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六十日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

3、代表基金份额百分之十以上的基金份额持有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十日内决定是否召集，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六十日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额百分之十以上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十日内决定是否召集，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六十日内召开。

4、代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前三十日报中国证监会备案。

5、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。

### （三）通知

召开基金份额持有人大会，召集人应当至少在会议召开前 30 天，在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知至少应载明以下内容：

- 1、会议召开的时间、地点和形式；
- 2、会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；
- 3、有权出席基金份额持有人大会的权利登记日；
- 4、代理投票授权委托书的内容要求、送达时间和地点；
- 5、会务常设联系人姓名、电话；
- 6、召集人需要通知的其他事项。

采取通讯方式开会并进行表决的情况下，由基金管理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、书面表决意见的寄交、收取方式和截止时间。

#### （四）会议的召开方式

##### 1、召开方式

（1）基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会；

（2）现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席；

（3）通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决；

（4）会议的召开方式由召集人确定。但决定基金管理人更换或基金托管人的更换事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

##### 2、基金份额持有人大会召开条件

###### （1）现场开会

必须同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

1) 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，有效的基金份额应当大于在代表权益登记日基金总份额的 50%；

2) 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，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。

未能满足上述条件的情况下，则对同一议题可履行再次开会的程序。召集人可另行确定并公告重新开会的时间和地点，再次开会日期的提前通知期限至少为 10 天，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权利登记日不变。

###### （2）通讯方式开会

通讯方式开会应以书面方式进行表决。

必须同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

1) 召集人按基金合同规定公布会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；

2) 召集人在公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见；

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代表的基金份额占在权益登记日基金总份额的 50%以上；

4) 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其



它代表,同时提交持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定。

5) 会议通知公布前已报中国证监会备案。

如表决截止日前(含当日)未达到上述要求,则对同一议题可履行再次开会的程序。召集人可另行确定并公告重新表决的时间,再次表决日期的提前通知期限至少为10天,但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权利登记日不变。

#### (五) 议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

议事内容为本公告第一项“一、召开事由”中所指的关系基金份额持有人利益的重大事项;

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。

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权利登记日基金总份额10%或以上的基金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(临时提案只适用于现场方式开会),临时提案应当在大会召开日前至少15天提交召集人。召集人对于临时提案应当在大会召开日前至少10天公告。

临时提案不得包括更换基金管理人、更换基金托管人、决定终止基金和与其他基金合并事项。

对于基金份额持有人提交的提案,大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核:

(1) 关联性。大会召集人对于基金份额持有人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。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题作出决定。如将其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作出决定,并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

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前至少 10 天公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少有 10 天的间隔期。

## 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规定程序宣布会议议事程序及注意事项，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，在公证机构的监督下形成大会决议。

基金管理人召集大会时，由基金管理人授权代表主持；基金托管人召集大会时，由基金托管人授权代表主持；代表基金份额 10% 以上的基金份额持有人召集大会时，由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额 50% 以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

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、持有或者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) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，由召集人提前至少 30 天公布提案，在所通知的表决截止日期第二天统计全部有效表决，在公证机构监督下形成决议。

## (六) 表决

1、基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

2、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及代理人所持表决权的百分之五十以上通过方为有效；除下列（2）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，特别决议须经参加大会的基金份额持有人及代理人所持表决权的三分之二以上通过。转换基金运作方式、更换基金管理人、更换基金托管人、提前终止基金合同等重大事项必须以特别决议的方式通过方为有效。

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。

3、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

5、基金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。

#### （七）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，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三名代表担任监票人。

（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，并由公证机关对其计票过程予以公证。

（3）如果会议主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果会议主持人对于提交的表决结果没有怀疑，而出席会议的其他人员对会议主持人宣布的表决结果有异议，有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，会议主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

##### 2、通讯方式开会

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

#### （八）生效与公告

基金份额持有人大会表决通过的事项，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，自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人均有法律约束力。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定。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在指定媒介公告。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。

(九) 实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

若本基金实施侧袋机制,则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例,但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的,则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例:

1、基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额 10%以上(含 10%);

2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一(含二分之一);

3、通讯开会的直接出具表决意见或授权他人代表出具表决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相关基金份额的二分之一(含二分之一);

4、在参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一、召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内就原定审议事项重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上(含三分之一)相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票;

5、现场开会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;

6、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二分之一以上(含二分之一)通过;

7、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。

同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。

(十) 法律法规或中国证监会对基金份额持有人大会有关事项另有规定的,从其规定。

## 五、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序

### （一）基金管理人、基金托管人的更换条件

#### 1、基金管理人的更换条件

有下列情形之一的，经中国证监会批准，基金管理人必须退任：

- 1) 基金管理人解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产；
- 2) 基金托管人有充分理由认为更换基金管理人符合基金份额持有人利益，并提请基金份额持有人大会表决通过；
- 3) 代表 50%以上基金单位的基金份额持有人要求基金管理人退任；
- 4) 中国证监会有充分理由认为基金管理人不能继续履行基金管理职责。

#### 2、基金托管人的更换条件

有下列情形之一的，经中国证监会和中国人民银行批准，基金托管人必须退任：

- 1) 基金托管人解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产；
- 2) 基金管理人充分理由认为更换基金托管人符合基金份额持有人利益，并提请基金份额持有人大会表决通过；
- 3) 代表 50%以上基金单位的基金份额持有人要求基金托管人退任；
- 4) 中国人民银行有充分理由认为基金托管人不能继续履行基金托管职责。

### （二）基金托管人和基金管理人的更换程序

更换基金托管人和基金管理人应按照如下程序进行：

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

2、决议：基金份额持有人大会对被提名的新任基金管理人或新任基金托管人形成决议。

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

---

4、公告：更换基金管理人时，由基金托管人在中国证监会批准后 2 日内在指定媒介上公告。更换基金托管人时，由基金管理人在中国证监会和中国人民银行批准后 2 日内在指定媒介上公告。前后两任基金管理人或基金托管人应办理资产管理的交接手续，并核对资产总值。如果基金管理人和基金托管人同时更换，由新任的基金管理人和基金托管人在批准后的 2 日内在指定媒介上联合刊登公告。

---

---

## 六、基金的基本情况

- (一) 基金名称：金鹰成份股优选证券投资基金
- (二) 基金类型：契约型开放式
- (三) 基金投资目标：通过资产配置和对投资组合的动态调整，在控制投资组合风险的前提下，实现基金资产的中长期增值和获取适当、稳定的现金收益
- (四) 基金单位发行规模：不低于 2 亿元人民币
- (五) 基金份额初始面值：人民币 1.00 元
- (六) 存续期限：不定期

---

---

## 七、基金单位的发行

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

### （一）发行方式

通过基金管理人的直销网点以及商业银行、证券公司等代销机构的代理销售网点公开发售。

### （二）发行时间

自招募说明书公告之日起不超过 3 个月。

### （三）发行对象

中华人民共和国境内自然人及法人（法律、法规及其他有关规定禁止购买者除外）。

### （四）设立募集规模

本基金不设固定的募集规模。

### （五）投资者认购原则

- 1、投资者认购前，需按销售机构规定的方式备足认购的资金；
- 2、设立募集期内，投资者可多次认购基金单位；
- 3、认购申请受理完成后，投资者不得撤销。

### （六）认购费用

认购费率采取按认购规模和持有期限递减的后端收费模式，即投资人在认购本基金时不支付认购费，而在赎回时支付，认购费率根据规模和持有期限递减计算，详细的认购费率可参见本基金的招募说明书的有关内容。

在认购期间，对于单一基金帐户，认购规模可累计计算；后端收认购费的计算基数按基金认购时的面值金额计算。

### （七）认购资金利息的处理

认购资金利息在本基金成立后折成投资者认购的基金份额，归投资者所有。

### （八）认购份额的计算

本基金采用金额认购方法，计算公式如下：

认购份额=（认购金额+认购资金利息）/认购价格



---

认购价格=基金单位面值

认购份额计算结果保留到小数点后两位，小数点两位以后的部分舍去，舍去部分归基金所有。

（九）基金的认购限制

1、代销网点每个基金帐户每次最低认购金额为 1,000 元人民币；直销中心每个基金帐户首次最低认购金额为 100 万元人民币，追加认购的最低金额为 1,000 元人民币；

2、认购期间单个投资者的累计认购规模没有限制。

---

---

## 八、基金的成立

### （一）基金成立的条件

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

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

### （二）基金设立失败

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

2、本基金不成立时，基金管理人、基金托管人不得请求报酬。基金管理人、基金托管人为本基金支付之一切费用应由各方各自承担。

### （三）基金不能成立时已募集资金的处理方式

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

### （四）基金存续期内基金份额持有人数量和资产净值的限制

本基金成立后的存续期间内，有效基金份额持有人数量连续 20 个工作日达不到 100 人，或连续 20 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元人民币，基金管理人应及时向中国证监会报告，说明出现上述情况的原因及解决方案。若有效基金份额持有人数量连续 60 个工作日达不到 100 人，或连续 60 个工作日基金资产净值低于人民币 5000 万元，基金管理人可宣布本基金终止。

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

（六）本基金若依法不能成立，基金管理人应根据有关规定进行公告。

---

---

## 九、基金的申购与赎回

### （一）申购与赎回办理的场所

投资者应当在销售机构办理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。

本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的销售代理人。

金鹰基金管理有限公司可以根据情况变化增加或者减少代销机构，并在基金管理人网站公示。

销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市（网点），并另行公告。

### （二）申购与赎回办理的时间

#### 1、开放日及开放时间

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

若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及具体业务办理时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### 2、申购的开始时间

本基金自成立之日起不超过 30 个工作日内开始办理申购。

#### 3、赎回的开始时间

本基金自成立之日起不超过 30 个工作日内开始办理赎回。

4、在确定申购开始时间与赎回开始时间后，由基金管理人最迟于开放日前 3 个工作日依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告申购与赎回的开始时间。

### （三）申购与赎回的原则

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

2、本基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以前撤销；

4、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则。基金管理人最迟于新规则开始实施日前 3 个工作日依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

5、赎回基金份额时，将首先赎回其持有时间最长的基金份额；

#### （四）申购与赎回的程序

##### 1、申购与赎回的申请方式

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

投资人申购本基金，须按销售机构规定的方式备足申购资金。

投资人提交赎回申请时，其在销售机构（网点）必须有足够的基金单位余额。

##### 2、申购与赎回申请的确认

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

##### 3、申购与赎回申请的款项支付

申购采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，申购不成功或无效款项将退回投资者账户。投资者赎回申请成功后，基金管理人应指示基金托管人按有关规定将赎回款项在自受理基金投资人有效赎回申请之日起不超过 7 个工作日内划往赎回人银行账户。在发生巨额赎回时，款项和份额的支付办法按《基金合同》有关规定处理。

#### （五）申购与赎回的数额限制

1、代销网点每个账户每次申购的最低金额为 1,000 元人民币，具体数额请留意当地代销网点；

2、直销中心每个账户首次申购的最低金额为 100 万元人民币，追加申购的最低金额为 1,000 元人民币；已在直销中心有认购本基金记录的投资者不受首次申购最低金额的限制；

3、赎回的最低份额为 500 份基金单位，基金份额持有人可将其全部或部分基金单位赎回，但某笔赎回导致单个交易账户的基金单位余额少于 500 份时，余额部分基金单位必须一同赎回；

4、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。具体请参见相关公告。

5、基金管理人可根据市场情况，调整申购的金额和赎回的份额的数量限制，基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告并在更新过的招募说明书中列示；

6、申购份额、余额的处理方式：申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日基金单位资产净值为基准计算，保留到小数点后两位，剩余部分舍去，舍去部分所代表的资产归基金所有；

7、赎回金额的处理方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金单位资产净值为基准并扣除相应的费用，保留到小数点后两位，剩余部分舍去，舍去部分所代表的资产归基金所有。

#### （六）本基金的申购费与赎回费

本基金申购费用采取按照申购规模和持有期限递减的后端收费模式，即投资者在申购时不支付手续费，而在赎回时收取，并随着持有期间的长短而变动。基金份额持有年限越长，规模越大，后收申购费率越低，直至为零，详细的申购费率可参见本基金的招募说明书的有关内容。

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

对于持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产。对于持续持有期不少于 7 日的投资者，赎回费按照赎回金额的 0.5% 收取，其中归入基金资产部分的比例为赎回费总额的 25%，其余部分作为注册登记费和其他手续费支出。

基金管理人可以调整申购费率和赎回费率，基金管理人必须在调整前报中国证监会备案，并在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上刊登公告并在更新过的招募说明书中列示。

#### （七）申购份额与赎回金额的计算方式

##### 1、申购份额的计算

申购份额=申购金额÷T 日基金份额净值

基金单位份额保留小数点后两位。

## 2、后端收申购费、赎回费和赎回金额的计算

后端收申购费的计算基数按申购时的基金单位净值计算。

赎回费的计算基数为赎回日基金份额资产净值。

赎回时后端收申购费、赎回费和赎回金额计算公式为：

后端收申购费=赎回份额×申购时基金份额资产净值×申购费率

赎回费=赎回份额×赎回日基金份额资产净值×赎回费率

赎回金额=赎回份额×赎回日基金份额资产净值－后端收申购费－赎回费

投资者赎回按照“先申购部分先赎回”的原则，根据每笔赎回所对应的申购，分笔计算应收的后端收申购费并在赎回金额中扣除。

3、T日的基金单位净值在当天收市后计算，并在T+1日公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

4、本基金的申购费率和/或赎回费率如发生调整，则调整后的申购费率和/或赎回费率在报中国证监会备案生效之日后第一个工作日起实施，并最迟应于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

### （八）申购与赎回的注册登记

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

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

基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

### （九）巨额赎回的认定及处理方式

#### 1、巨额赎回的认定

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

#### 2、巨额赎回的处理方式

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

（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资者的全部赎回申请时，

按正常赎回程序执行。

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

(3) 当基金发生巨额赎回，在单个持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额 25% 的情形下，基金管理人可以延期办理该单个持有人超过上一开放日基金总份额 25% 的赎回申请。对于该单个持有人未超过上一开放日基金总份额 25% 的赎回申请，与当日其他赎回申请一起，按照上述 (1)、(2) 方式处理。当日未获受理的赎回申请将于下一开放日的赎回申请一并处理，直到全部赎回为止。如该持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

当发生巨额赎回并部分延期赎回时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在 2 日内在指定媒介上刊登公告。

本基金连续两个开放日发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，并应当在指定媒介公告。

#### (十) 拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资人的申购申请

- 1) 不可抗力；
- 2) 证券交易场所在交易时间非正常停市；
- 3) 基金管理人认为市场缺乏合适的投资机会，继续接受申购可能对已有的基金份额持有人利益产生损害；
- 4) 基金管理人认为会有损于已有基金份额持有人利益的其他申购；
- 5) 基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金

份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形时。

6) 当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请。

7) 申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限的。

8) 法律法规规定或经中国证监会批准的其他情形。

被拒绝的申购款项将全额退还给投资者。

2、在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资人的赎回申请

1) 不可抗力；

2) 证券交易场所交易时间非正常停市；

3) 因市场剧烈波动或其他原因而出现连续巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难时，基金管理人可以暂停接受基金的赎回申请；

4) 当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金赎回申请或延缓支付赎回款项。

5) 法律、法规规定或经中国证监会批准的其他情形。

发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。已接受的赎回申请，基金管理人应当足额兑付；如暂时不能足额兑付，应当按单个账户已被接受的赎回申请量占已接受的赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分在后续开放日予以兑付，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。投资者在申请赎回时可选择将当日未获受理部分予以撤销。

同时，在出现上述第三款的情形时，对已经接受赎回申请可延期支付赎回款项，最长不超过正常支付时间 20 个工作日，并在指定媒介上公告。

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。

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

4、暂停基金的申购、赎回，基金管理人应在规定期限内指定媒介刊登暂停公告。

5、暂停期间结束基金重新开放时，基金管理人应予以公告。



---

如果发生暂停的时间为 1 天，基金管理人应于重新开放日在指定媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过 1 天但少于两周，暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 1 个工作日在指定媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最新的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复在指定媒介上刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 3 个工作日在指定媒介连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最新的基金单位净值。

（十一）实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见招募说明书或相关公告。

---

---

## 十、基金的托管

本基金管理人与本基金托管人必须按照《暂行办法》、《试点办法》和法律、法规及中国证监会的有关规定，订立《金鹰成份股优选证券投资基金托管协议》，以明确基金托管人与基金管理人之间在基金份额持有人名册保管、基金资产的保管和运作及相互监督等相关事宜中的权利、义务及职责，确保基金资产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

---

---

## 十一、基金认购、申购、赎回业务

本基金的销售业务指接受投资者申请为其办理的本基金的认购、申购、赎回、转换及定期定额投资等业务。

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

基金管理人有权选择和更换销售代理人，并对其销售代理行为进行必要的监督和处理；如发现基金销售代理人违反有关法律、法规和《基金合同》、委托销售代理协议的有关规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益。

---

---

## 十二、基金的注册登记

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

本基金的注册登记业务目前由基金管理人负责办理，基金管理人根据业务需  
要也可以委托的其他符合条件的机构办理注册登记业务。基金管理人委托其他机  
构办理本基金注册登记业务的，应与代理人签订委托代理协议，以明确基金管理  
人和代理机构在投资人基金账户管理、基金单位注册登记、清算及基金交易确认、  
代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等事宜中的权利和义务，保护基  
金投资者和基金份额持有人的合法权益。

---

---

## 十三、基金的投资

### （一）投资目标

通过资产配置和对投资组合的动态调整，在控制投资组合风险的前提下，实现基金资产的中长期增值和获取适当、稳定的现金收益。

### （二）投资范围

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

本基金的股票投资主要投资于上证 180 指数成份股和深证 100 指数成份股，本基金的其他股票投资还包括新股申购、股票增发申购和有可能入选成份股的股票等。

本基金的债券投资包括国内依法公开发行、上市的国债、金融债、企业（公司）债（包括可转债）等债券，本基金的债券投资以国债投资为主。

### （三）投资策略

#### 1、决策依据

本基金的投资决策依据包括：

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

#### 2、决策程序

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

2) 投资决策委员会根据本基金的投资目标，结合对本基金投资相关因素的全局考虑，确定本基金的投资策略，制定总体资产配置计划；

3) 本基金基金经理根据投资决策委员会制定的基金的总体资产配置计划，

考虑研究部门的相关建议，拟定投资计划，报投资决策委员会批准；

4) 本基金基金经理根据投资决策委员会批准的投资计划，考虑研究部门的相关建议，制定具体投资方案。

### 3、组合原则

#### 1) 有关法规的规定

根据《暂行办法》等有关法规的规定，本基金的投资组合必须符合以下比例规定

(1) 本基金投资于股票、债券的比例，不得低于基金资产总值的 80%；

(2) 本基金投资于国家债券的比例，不得低于基金资产净值的 20%；

(3) 本基金持有一家上市公司的股票，不得超过基金资产净值的 10%；

(4) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券总和，不得超过该证券的 10%；

(5) 运用基金资产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司该次的股票发售总量；

(6) 有关法律法规、中国证监会及《基金合同》所规定的其他比例限制。

法律法规或监管部门对上述比例另有规定时从其规定。

#### 2) 本基金的投资组合比例目标

(1) 本基金的股票投资占基金投资组合的比例不超过 80%，其中投资于上证 180 指数和深证 100 指数的成份股的比例不低于本基金股票投资的 70%；

(2) 本基金的债券投资占基金投资组合的比例不低于 20%。

(3) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 15%；

(4) 本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30%；

(5) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15%；

因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。

(6) 基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手

开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;

(7) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行,与境内上市交易的股票合并计算;

本基金将于成立日后三个月内达到符合规定的比例限制。

#### (四) 选股标准

本基金主要在成份股中选择公司价值被市场低估的股票及收益稳定、分红派息率高的股票构造股票投资组合。

选择公司价值被市场低估的股票采用包含下列 4 个指标:即 P/E(市盈率:市价比每股收益)、P/B(市净率:市价比每股净资产)、P/S(市价比每股销售收入)、P/C(市价比每股现金流)的定量准则和包含公司素质、财务状况的定性评价指标体系。

选择收益稳定、分红派息率高的股票采用包含下列 2 个指标: D/P(派现价格比), D/E(股息支付率)的定量准则和包含公司素质、财务状况的定性评价指标体系。

#### (五) 存托凭证投资策略

本基金投资存托凭证的策略依照股票投资策略执行,选择投资价值高的存托凭证进行投资。

#### (六) 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为

$(\text{上证 180 指数收益率} \times 80\% + \text{深证 100 指数收益率} \times 20\%) \times 75\% + \text{中证全债指数收益率} \times 25\%$ 。

#### (七) 投资限制

本基金投资遵守《暂行办法》、《试点办法》等有关法律法规和中国证监会的有关规定,以及《基金合同》规定的投资限制,基金资产禁止从事下列行为:

- 1、投资于其他基金;
- 2、将基金资产用于抵押、担保、资金拆借或者贷款;
- 3、以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券;
- 4、从事证券信用交易;
- 5、以基金资产进行房地产投资;

- 
- 
- 6、从事可能使基金资产承担无限责任的投资；
  - 7、将基金资产投资于与基金托管人或者基金管理人有关联关系的公司发行的证券；
  - 8、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。
- 法律法规或监管部门对上述限制另有规定时从其规定。

#### （八）侧袋机制的实施和投资运作安排

当基金持有特定资产且存在或潜在重大赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，无需召开基金份额持有人大会审议。

侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。

侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见招募说明书的规定。



## 十四、基金资产

### （一）基金资产总值

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

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去按照国家有关规定可以在基金资产中扣除的费用后的价值。

### （三）基金资产的帐户

基金托管人以托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司和中央国债登记结算有限责任公司开设证券账户，以其名义在中国证券登记结算有限责任公司开立本基金资金结算帐户，用于证券资金清算；在中央国债登记结算有限责任公司开立国债托管账户，用于国债的交易和清算。基金资产的帐户与基金发起人、基金管理人和基金托管人的自有资产帐户以及其他基金资产帐户相独立。

### （四）基金资产的处分

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

---

---

## 十五、基金资产的估值

### （一）估值目的

基金估值的目的是为了准确、真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值。开放式基金份额申购、赎回价格应按基金估值后确定的基金份额净值计算。

### （二）估值日

本基金合同生效后，每个交易日对基金财产进行估值。

### （三）估值对象

基金所持有的金融资产和金融负债。

### （四）估值方法

#### 1、股票估值方法

##### （1）上市流通股票的估值

上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；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）未上市股票的估值

送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；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。

首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。

##### （3）有明确锁定期股票的估值

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收盘价估值；非公开发行且处于明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

## 2、固定收益证券的估值办法

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘净价估值，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净价估值；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) 证券交易所市场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（自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息）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所含的最近交易日债券应收利息后的净价估值；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) 未上市债券采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。

(4) 在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。

(5) 交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，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，按成本进行后续计量。

(6) 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。

## 3、权证估值：

### (1) 配股权证的估值：

因持有股票而享有的配股权，类同权证处理方式的，采用估值技术进行估值。

### (2) 认沽/认购权证的估值：

从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的认沽/认购权证按估值日的收盘价估值，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。未上市交易的认沽/认购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的情况下，按成本估值；停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

4、 本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。

5、其他资产的估值方法

其他资产按照国家有关规定或行业约定进行估值。

6、在任何情况下，基金管理人采用上述 1-5 项规定的方法对基金财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人有着充足的理由认为按上述方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素的基础上与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

6、国家有最新规定的，按其规定进行估值。

#### （五）估值程序

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金资产净值、基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式报给基金托管人，基金托管人按《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。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。

#### （六）暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停交易时；
- 2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值；
- 4、中国证监会认定的其他情形。

#### （七）基金单位净值的确认

基金资产净值、基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金净值信息并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金份额净值予以公布。

基金份额净值的计算精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

#### （八）估值差错的处理

---

1、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后四位（含第四位）内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。

2、基金管理人和基金托管人将采取必要、适当合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。

3、前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。

#### （九）实施侧袋机制期间的基金资产估值

本基金实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金资产净值和份额净值，暂停披露侧袋账户份额净值。

#### （十）特殊情况的处理

1、基金管理人按本条第（四）款有关估值方法规定的第 6 项条款进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

---

---

## 十六、基金的费用与税收

### （一）基金费用的种类

基金费用从基金资产中支付，包括：

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

### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### （1）基金管理人的报酬

基金管理人的报酬按基金资产净值的 1.20% 年费率计提。

基金管理人的报酬费率将根据有关法律、法规的规定及时调整。

在通常情况下，基金管理人报酬按前一日基金资产净值的 1.20% 年费率计提。计算方法为：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理人报酬

E 为前一日基金资产净值

本基金成立三个月后，若持有现金的比例超过本基金资产净值的 20%，超出部分不计提基金管理人报酬。

基金管理人报酬每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理人报酬划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### （2）基金托管人的托管费

基金托管人的托管费按基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。

基金托管人的托管费率将根据有关法律、法规的规定及时调整。

在通常情况下，基金托管人的托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法为：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管人的托管费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起两个工作日内从基金资产中一次性支付，若遇节假日、休息日等，支付日期顺延。

3、本基金合同第十六节第（一）款中第 3—8 项费用由基金托管人根据有关规定进行核算，发生的费用如果影响基金单位净值小数点后第五位的，即发生的其他费用大于基金净值十万分之一，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。发生的其他费用如果不影响基金单位净值小数点后第五位的，即发生的其他费用小于基金净值十万分之一，应于发生时直接计入基金损益。

#### （三）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

#### （四）基金管理费和基金托管费的调整

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

#### （五）实施侧袋机制期间的基金费用

本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，详见招募说明书的规定。

#### （六）税收

本基金及基金份额持有人依照法律、法规的有关规定履行纳税义务。

---

---

## 十七、基金收益与分配

### （一）基金收益的构成

- 1、基金投资所得红利、股息、债券利息；
- 2、买卖证券差价；
- 3、存款利息；
- 4、法律、法规、中国证监会及《基金合同》规定的其他收入。

因运用基金资产带来的成本或费用的节约计入收益。

### （二）基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按照有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

### （三）收益分配原则

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

### （四）收益分配方案

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



---

---

#### （五）收益分配方案的确定与公告

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，由基金托管人核实后确定，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### （六）收益分配中发生的费用

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

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

#### （七）实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书的规定。

---

---

## 十八、基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

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

### （二）基金审计

（1）本基金管理人聘请与基金发起人、基金管理人和基金托管人独立的、具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对基金财务会计报告进行年度审计并出具审计报告。

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

（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按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

---

---

## 十九、基金的信息披露

### 一、总则

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

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、行政法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点，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、完整性、及时性、简明性和易得性。

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全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”）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。

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

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

本基金公开披露的信息应采用中文文本。同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的，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。

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、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

## 二、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

### （一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

1、《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。

2、基金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，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

3、基金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。

4、基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

### （二）《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介上登载《基金合同》

生效公告。

### （三）基金净值信息

《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在指定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。

### （四）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销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

### （五）定期公告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，并将年度报告登载在指定网站上，将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，并将中期报告登载在指定网站上，将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

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网站上，将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

《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、中期报告或者年度报告。

基金管理人应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析。

报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在基金定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告

期内持有份额变化情况及本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

若中国证监会或其他相关监管机构出台新规定，则按新规执行。

#### （六）临时公告

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，并登载在指定报刊和指定网站上。

前款所称重大事件是指可能对基金份额持有人权益及基金份额的价格产生重大影响的事件，包括但不限于下列情况：

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、《基金合同》终止、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- 8、基金募集期延长或提前结束募集；
- 9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- 11、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 12、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- 13、基金管理人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重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的情形除外；

- 
- 
- 14、基金收益分配事项；
  - 15、管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
  - 16、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；
  - 17、本基金开始办理申购、赎回；
  - 18、本基金发生巨额赎回并延期办理；
  - 19、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；
  - 20、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
  - 21、基金信息披露义务人认为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其他事项或中国证监会规定的其他事项。

#### （七）澄清公告

在《基金合同》存续期限内，任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的，以及可能损害基金份额持有人利益的，相关的信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报送中国证监会。

#### （八）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，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

#### （九）清算报告

《基金合同》终止的，基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### （十）投资存托凭证的信息披露

本基金投资存托凭证的信息披露依照境内上市交易的股票执行。

#### （十一）实施侧袋机制期间的信息披露

本基金实施侧袋机制的，相关信息披露义务人应当根据法律法规、基金合同和招募说明书的规定进行信息披露，详见招募说明书的规定。

### 三、信息披露管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专门部门及高级管理人员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等法律法规的规定。

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、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息，并且在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。

基金管理人、基金托管人除按法律法规要求披露信息外，也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度，在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响基金正常投资操作的前提下，自主提升信息披露服务的质量。具体要求应当符合《信息披露办法》等法律法规及自律规则的相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用，该费用不得从基金财产中列支。

#### 四、信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于公司住所，供社会公众查阅、复制。

#### 五、本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。



## 二十、基金合同的终止与清算

### （一）基金合同的终止

有下列情形之一的，基金应当终止：

1、存续期间内，基金份额持有人数量连续 60 个工作日达不到 100 人，或连续 60 个工作日基金资产净值低于人民币 5000 万元，基金管理人可以宣布本基金终止；

2、基金经基金份额持有人大会表决终止的；

3、因重大违法、违规行为，基金被中国证监会责令终止的；

4、基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任本基金的管理人，而无其他适当的基金管理机构承接其权利及义务；

5、基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任本基金的托管人，而无其他适当的基金托管机构承接其权利及义务；

6、由于投资方向变更引起的基金合并、撤销；

7、法律、法规规定或中国证监会允许的其他情况。

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

### （二）基金清算小组

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

2、基金财产清算小组组成：基金清算小组成员由基金发起人、基金管理人、基金托管人、具有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。基金清算小组可以聘请必要的工作人员。

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

### （三）清算程序

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

### （四）基金清算小组的工作内容

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

### （五）清算费用

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

### （六）基金资产按下列顺序清偿

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

基金资产未按前款（1）至（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

### （七）基金清算的公告

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具有证券、期货相关业务资格的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财产清算报告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，基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

（八）基金清算帐册及文件的保存

基金清算帐册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

---

---

## 二十一、违约责任

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

1、不可抗力因素；

2、基金管理人及基金托管人按照当时有效的法律、法规或中国证监会的有关规定作为或不作为而造成的损失；

3、在没有过失的情况下，基金管理人按照《基金合同》规定的原则，由于行使或不行使其投资权而造成的损失。

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

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

---

---

## 二十二、争议的处理

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

---

---

## 二十三、基金合同的效力

（一）本基金合同经基金发起人、基金管理人和基金托管人三方盖章以及法定代表人（或其授权代表人）签字并经中国证监会批准后生效。基金合同的有效期限自生效之日起至该基金清算结束报中国证监会批准并公告之日止。基金份额持有人根据本基金合同的规定合法持有本基金单位即表示对本基金合同的承认和接受。

（二）本基金合同自生效之日起对本基金合同各方当事人具有同等的法律约束力。

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

（四）本基金合同可印制成册，供基金投资者在基金管理人、基金托管人、销售代理人的办公场所和营业场所查阅；基金投资者也可按工本费购买本基金合同复制件或复印件，但内容应以本基金合同正本为准。

---

---

## 二十四、基金合同的修改和终止

### （一）基金合同的修改

1、本基金合同的修改应经基金合同当事人同意。

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

3、基金合同的修改应报中国证监会批准，自批准之日起生效。

### （二）基金合同的终止

本基金终止后，须按法律、法规和《基金合同》的有关规定对基金进行清算。中国证监会对清算结果批准并予以公告后《基金合同》方能终止。

## 二十五、基金专用交易席位的选择

(一) 选择使用基金专用交易席位的证券经营机构的选择标准和程序

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

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

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

(二) 席位租用期限及更换方式

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

- 1、提供的研究报告质量和数量;
- 2、研究报告被基金采纳的情况;
- 3、因采纳其报告而为基金运作带来的直接效益和间接效益;
- 4、因采纳其报告而为基金运作避免或减少的损失;
- 5、由基金管理人提出课题, 证券经营机构提供的研究论文质量;
- 6、开放证券经营机构资料库的情况;
- 7、其他可评价的量化标准。

根据上述综合评价的结果进行排名。在这一过程中, 基金管理人不但对已使



---

---

用席位的证券经营机构进行排名，同时亦关注并接受其他证券经营机构的研究报告和信息资讯，为半年后的席位更换作准备。

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

### （三）席位运作方式

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

### （四）其他事宜

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

---

---

## 二十六、其他事项

本基金合同如有未尽事宜，由本基金合同当事人各方共同协商解决。