

金鹰红利价值灵活配置混合型  
证券投资基金基金合同  
(2023年8月)

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

## 目 录

一、前言 .....	2
二、释义 .....	3
三、基金的基本情况 .....	9
四、基金份额的发售与认购 .....	11
五、基金备案 .....	12
六、基金份额的申购、赎回与转换 .....	13
七、基金的非交易过户与转托管 .....	21
八、基金份额的冻结、解冻及质押 .....	22
九、基金合同当事人及其权利义务 .....	22
十、基金份额持有人大会 .....	29
十一、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序 .....	38
十二、基金托管 .....	40
十三、基金的销售 .....	40
十四、基金份额的注册登记 .....	41
十五、基金的投资 .....	42
十六、基金的融资 .....	52
十七、基金的财产 .....	52
十八、基金财产估值 .....	54
十九、基金费用与税收 .....	59
二十、基金收益与分配 .....	61
二十一、基金的会计与审计 .....	63
二十二、基金的信息披露 .....	63
二十三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算 .....	69
二十四、业务规则 .....	72
二十五、违约责任 .....	72
二十六、争议的处理 .....	73
二十七、基金合同的效力 .....	73

## 一、前言

(一) 订立《金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“本基金合同”)的目的、依据和原则

### 1、订立本基金合同的目的

订立本基金合同的目的是明确本基金合同当事人的权利义务、规范金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)的运作,保护基金份额持有人的合法权益。

### 2、订立本基金合同的依据

订立本基金合同的依据是《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》)、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》(以下简称《销售办法》)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)和其他有关法律法规及相关规定。

### 3、订立本基金合同的原则

订立本基金合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护基金份额持有人的合法权益。

(二) 本基金由基金管理人依照《基金法》、本基金合同和其他有关规定募集,并经中国证监会核准。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作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但由于证券投资具有一定的风险,因此不保证投资于本基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的最低收益。

(三) 本基金合同是约定本基金合同当事人之间基本权利义务的法律文件,其他与本基金相关的涉及本基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述,均以本基金合同为准。本基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金投资人自依本基金合同取得本基金基金份额,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本基

金合同的承认和接受。基金份额持有人作为本基金合同当事人并不以在本基金合同上书面签章为必要条件。本基金合同的当事人应按照《基金法》、本基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

(四) 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。

## 二、释义

本基金合同中, 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:	指金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金;
基金合同、本基金合同或《基金合同》:	指《金鹰红利价值灵活配置混合型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《金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;
更新的招募说明书:	指金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书, 及根据相关法律、法规、规定对招募说明书进行的更新;
托管协议	指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充;
业务规则	指《金鹰基金管理有限公司开放式基金业务规则》;
发售公告:	指《金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告》;
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，2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自2013年6月1日起实施，并经2015年4月24日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订；

《证券法》指1998年12月29日颁布、1999年7月1日实施的《中华人民共和国证券法》及颁布机关对其不时做出的修订；

《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；

《运作办法》：指中国证监会2014年7月7日颁布、同年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订；

《销售办法》：指中国证监会2020年8月28日颁布、同年10月1日实施，并经2020年3月20日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决定》修正的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订；

《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；

元：指人民币元；

基金合同当事人：指受本基金合同约束，根据本基金合同享受权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和

- 基金份额持有人；
- 基金管理人：指金鹰基金管理有限公司；
- 基金托管人：指交通银行股份有限公司；
- 基金份额持有人：指依照法律法规或基金合同合法取得基金份额的投资人；
- 注册登记业务：指本基金登记、存管、过户、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、清算和结算、基金销售业务确认、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等；
- 注册登记人：指办理基金注册登记业务的机构，本基金的注册登记人为金鹰基金管理有限公司或金鹰基金管理有限公司委托代为办理基金注册登记业务的机构；
- 投资人：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及其他有关规定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证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其它组织；
- 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，经中国证监会批准可以投资于中国证券市场，并取得国家外汇管理局额度批准的中国境外的机构投资者；
- 基金份额持有人大会：指按照本基金合同之规定召集、召开并由基金份额持有人进行表决的会议；
- 基金募集期：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三个月；
- 基金合同生效日：指基金募集期满，基金募集的基金份额总额超过核准的最低募集份额总额，并且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；
- 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；
- 认购：指在基金募集期内，投资人按照本基金合同的规定申请购买本基金基金份额的行为；
- 申购：指在本基金基金合同生效后的存续期间，投资人申请购买本基金基金份额的行为；
- 赎回：指基金份额持有人按本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：指在本基金单个开放日内，基金净赎回申请份额（基金赎回申请总份额扣除申购申请总份额之余额）与净转出申请份额（基金转出申请总份额扣除转入申请总份额之余额）之和超过上一开放日本基金总份额 10% 的情形。
- 基金转换：指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效的业务规则进行的本基金份额与基金管理人管理的其他基金份额间的转换行为；
- 转托管：指基金份额持有人将其基金账户内的同一基金的基金份额从一个销售机构托管转移到另一销售机构的行为；
- 费用类别：指将基金份额持有人持有的基金份额以前端缴纳认购/申购费用所划分成的不同份额级别类型；

- 投资指令：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：指接受基金管理人委托代为办理本基金认购、申购、赎回和其他基金业务的具有基金代销业务资格的机构；
- 销售机构：指基金管理人及本基金代销机构；
- 销售服务费：指从基金财产中计提的，用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用；
- A类基金份额：指在投资者申购时收取申购费用，而不计提销售服务费的基金份额；
- C类基金份额：指在投资者申购时不收取申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额；
- 规定媒介：指符合中国证监会规定条件的全国性报刊及《信息披露办法》规定的互联网网站（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；
- 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：指注册登记人为基金投资人开立的记录其持有的由该注册登记人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：指销售机构为基金投资人开立的记录其持有的由该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务的基金份额余额及其变动情况的账户；
- 开放日：指基金管理人办理基金份额申购、赎回或其他业务的日期；
- T日：指销售机构受理投资人申购、赎回或其他业务申请的



	日期；
T+n 日：	指 T 日起（不包括 T 日）的第 n 个工作日；
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：	基金资产总值是指本基金购买的各类证券及票据价值、银行存款本息、债券的应计利息、基金应收的申购基金款、缴存的保证金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基金负债后的价值；
基金份额净值：	针对本基金各类基金份额，指计算日某一类基金份额的基金资产净值除以计算日该类基金份额总数；
基金财产估值：	指计算评估基金财产和负债的价值，以确定基金资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；
不可抗力：	指无法预见、无法克服、无法避免的任何事件和因素，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易等
《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
摆动定价机制:	指当开放式基金遭遇大额申购赎回时,通过调整基金份额净值的方式,将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者,从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响,确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。
基金产品资料概要	《金鹰红利价值灵活配置混合型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

### 三、基金的基本情况

#### (一) 基金名称

金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金。

#### (二) 基金的类别

灵活配置混合型证券投资基金。

#### (三) 基金的运作方式

契约型、开放式。

#### （四）基金投资目标

本基金通过对分红能力良好且长期投资价值突出的优质股票投资，为基金资产获取稳定的当期收益和长期增值。

#### （五）基金份额面值和认购费用

人民币 1.00 元。

本基金认购费率不高于认购金额（含认购费）的 5%，实际执行费率在招募说明书中载明。

#### （六）基金最低募集份额总额

本基金的最低募集份额总额为 2 亿份。

#### （七）基金存续期限

不定期。

#### （八）基金份额类别

本基金根据销售费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。

在投资者申购时收取申购费用，且不计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者申购时不收取申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

本基金 A 类、C 类基金份额单独设置基金代码，分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。

投资者在申购基金份额时可自行选择基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间的转换规定请见招募说明书和相关公告。

在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，根据基金实际运作情况，基金管理人经与基金托管人协商一致并履行适当程序后，可增加基金份额类别、停止某类基金份额的销售、调整基金份额分类办法及规则等，并在实施之日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告，无需召开基金份额持有人大会。

## 四、基金份额的发售与认购

### （一）发售时间

本基金募集期限自基金份额发售之日起不超过 3 个月，具体发售时间由基金管理人根据相关法律法规以及本基金合同的规定，在发售公告中确定并披露。

### （二）发售方式

本基金通过各销售机构的基金销售网点向投资人公开发售，具体情况和联系方式详见本基金发售公告。

### （三）发售对象

本基金的发售对象为中华人民共和国境内的个人投资者、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。

### （四）基金认购费用

本基金采用金额认购方法，认购费用及认购份额采用“外扣法”计算。本基金认购费率不高于认购金额（含认购费）的 5%，实际执行费率在招募说明书中载明。认购费用用于本基金的市场推广、销售、注册登记等基金募集期发生的各项费用。

投资人在认购本基金时缴纳认购费用。

认购费用及认购份额的计算方法如下：

净认购金额=认购金额/[1+认购费率]

认购费用=认购金额-净认购金额

认购份额=(净认购金额+认购金额产生的利息)/基金份额面值

上述计算结果（包括认购份额）以四舍五入的方法保留小数点后两位。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。

### （五）基金份额的认购和持有限制

投资人在募集期内可以多次认购基金份额，但认购申请一经受理，投资人就不得撤销。

本基金各销售机构的首次和追加认购的最低金额按照基金管理人和销售机

构的约定为准。本基金直销网点最低认购金额由基金管理人制定和调整。具体限制参见本基金的招募说明书和基金份额发售公告。

本基金募集期间内，投资人认购本基金，不设最高认购份额限制。

本基金存续期内，基金管理人可规定基金份额持有人在单个基金账户内持有的本基金最低份额，具体限制参见本基金招募说明书之规定。

基金管理人可根据市场情况，调整首次认购金额、追加认购金额及最低持有份额的限制。

#### （六）募集期间认购资金利息的处理方式

认购款项在本基金合同生效前产生的利息将折合成基金份额，归基金份额持有人所有。认购利息以注册登记人的记录为准。

#### （七）基金认购的具体规定

投资人认购原则、认购时间安排、投资人认购应提交的文件和办理的手续等事项，由基金管理人根据相关法律法规以及本基金合同的规定，在招募说明书和基金份额发售公告中确定并披露。

## 五、基金备案

### （一）基金备案的条件

本基金募集期限届满，具备下列条件的，基金管理人应当按照规定办理验资和基金备案手续：

- 1、基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币；
- 2、基金份额持有人的人数不少于 200 人。

### （二）基金的备案

基金管理人应当自募集期限届满之日起 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续。

### （三）基金合同的生效

- 1、自中国证监会书面确认之日起，基金备案手续办理完毕且基金合同生效；

2、基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日予以公告。

本基金募集期届满之日前，投资人的认购款项只能存入有证券投资基金托管业务资格的商业银行的基金募集专用账户，任何人不得动用。

#### （四）基金募集失败的处理方式

基金募集期届满，未达到基金合同的生效条件，或基金募集期内发生不可抗力使基金合同无法生效，则基金募集失败。基金管理人应当：

1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

2、在基金募集期限届满后 30 日内退还投资人已缴纳的认购款项，并加计银行同期存款利息。

#### （五）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同生效后，如果连续二十个工作日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。

## 六、基金份额的申购、赎回与转换

### （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，并在基金管理人网站公示。

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、赎回和转换等业务的上海，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。

## 2、申购与赎回的开始时间

本基金的申购和赎回自基金合同生效日后不超过 3 个月时间里开始办理。具体申购、赎回业务办理时间由基金管理人与销售机构约定。在确定申购开始时间与赎回开始时间后，基金管理人最迟于开放日 2 日前在中国证监会规定媒介公告。

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一开放日该类别基金份额申购、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，即基金的申购与赎回价格以受理申请当日收市后计算的对应份额类别基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”的原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、基金份额持有人赎回基金份额，对于其持有的同一费用类别下的基金份额，基金管理人按照“先进先出”的原则处理，即对基金份额持有人在销售机构托管的同一费用类别份额进行赎回处理时，申购确认日期在先的基金份额先赎回，申购确认日期在后的基金份额后赎回，以确定赎回份额所适用的申购费率；

4、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，在基金管理人规定的时间之后不得撤销；

5、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，但最迟应在新的原则实施 2 日前在规定媒介予以公告。

### （四）申购与赎回的程序

#### 1、申购与赎回申请的提出

基金投资人须按销售机构规定的程序，在开放日的业务办理时间提出申购或赎回的申请。

投资人在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效。

## 2、申购与赎回申请的确认

本基金注册登记人应以交易时间结束前收到申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日)，并在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人可在T+2日到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。

## 3、申购与赎回申请的款项支付

申购时，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无效。若申购无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将投资人已缴付的申购款项本金退还给投资人。

赎回时，当投资人赎回申请成功后，基金管理人将在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法按照本基金合同有关条款处理。

## 4、申购与赎回程序应严格遵照《反洗钱法》的有关要求执行。

### (五) 申购与赎回的数额限制

1、投资人在各销售机构首次申购和单次申购的最低金额以及单次赎回的最低份额，详见本基金招募说明书的规定。

2、基金管理人可以规定基金份额持有人每个交易账户的最低基金份额余额，具体规定请参见招募说明书。

3、基金管理人可以规定单个基金份额持有人累计持有的基金份额上限，具体规定请参见招募说明书。

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，调整申购金额、赎回份额及最低持有份额的数量限制，基金管理人必须在调整的2日前在中国证监会规定媒介上刊登公



告。

#### （六）申购与赎回的价格、费用及其用途

1、本基金A类基金份额和C类基金份额分别设置代码，分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。本基金各类基金份额净值的计算，保留到小数点后4位，小数点后第5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日内披露。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

2、申购份额的计算及余额的处理方式：投资人申购本基金A类基金份额需缴纳申购费，本基金A类基金份额的申购费率最高不超过申购金额（含申购费）的5%。本基金实际执行的申购费率在招募说明书及产品资料概要中列示。申购的有效份额为净申购金额除以当日对应份额类别的基金份额净值，有效份额单位为份，上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

3、赎回金额的计算及处理方式：投资人赎回本基金各类基金份额需缴纳一定的赎回费用，本基金的赎回费率最高不超过赎回总额（含赎回费用）的5%。本基金实际执行的赎回费率在招募说明书及产品资料概要中列示。其中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。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日对应份额类别基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

4、本基金C类基金份额不收取申购费用，A类基金份额的申购费用由申购该类基金份额的投资者承担，不列入基金财产。

5、基金管理人可以在法律法规和本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日前在规定媒介上刊登公告。

6、基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，在基金促销活动期间，基金管理人可以对促销活动范围内的基金投资人调低基金申购费率和基金赎回费率。

7、本基金A类基金份额的申购费用由申购A类基金份额的基金投资人承担，

不列入基金财产，用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

8、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% 部分归基金财产，其余部分用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

9、本基金暂不采用摆动定价机制，基金管理人可结合基金实际运作情况，根据相关法律法规在履行适当程序并提前公告后增加摆动定价机制。

#### （七）申购份额与赎回金额的计算

##### 1、申购份额的计算

方法如下：

净申购金额 = 申购金额 / [1 + 对应份额类别申购费率]

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日对应份额类别基金份额净值

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

##### 2、赎回金额的计算

投资人的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中：

赎回总额 = 赎回份数 × T 日对应份额类别基金份额净值

赎回费用 = 赎回总额 × 对应份额类别赎回费率

赎回金额 = 赎回总额 - 赎回费用

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

3、T 日的各类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，经履行适当程序后，可以适当延迟计算或公告。

T 日的各类基金份额净值均精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入，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。

#### （八）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 2 日前予以公告。

#### （九）巨额赎回的认定及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

巨额赎回是指在单个开放日内，本基金中基金净赎回申请份额（基金赎回申请总份额扣除申购申请总份额之余额）与净转出申请份额（基金转出申请总份额扣除转入申请总份额之余额）之和超过上一开放日基金总份额 10% 的情形。

##### 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人的全部赎回申请和基金间转换时，按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为该基金兑付投资者的全部赎回及转出申请有困难，或认为为实现投资者的赎回、转出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及转出的比例不低于上一日该基金总份额 10% 的前提下，对其余申请延期办理。对于当日的赎回及转出申请，应当按单个账户赎回或转出申请量占该基金赎回及转出申请总量的比例，确定当日受理的赎回或转出份额；未受理部分除投资者在提交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。转入下一开放日的申请不享有赎回和转出优先权并将以该下一个开放日的某一类别基金份额净值为基准计算，以此类推，直到全部完成赎回和转出申请为止。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

当发生巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真等方式在 3

个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在 2 日内编制临时报告书予以公告。

(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，与当日其它赎回申请一起，按照上述 (1) (2) 方式处理。当日未获受理的赎回申请将与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。

### 3、暂停接受和延缓支付

本基金连续 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；已经确认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。连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请时，基金管理人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告。

#### (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) 因不可抗力导致基金管理人无法接受投资人的申购申请；

(2) 证券交易场所在交易时间内非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

(3) 发生本基金合同规定的暂停基金财产估值情况；

(4) 基金财产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他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的情形；

(5) 基金管理人无正当理由认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害其他基金份额持有人利益时；

(6) 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。

(7) 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。

(8) 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。

(9) 法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述(1)、(2)、(3)、(4)、(7)、(9)项情形时,基金管理人应在规定期限内在规定媒介刊登公告。

如果投资人的申购申请被拒绝,被拒绝的申购款项将退还给投资人。

在暂停申购的情况消除时,基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

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) 因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项;

(2) 证券交易所在交易时间内非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值;

(3) 发生巨额赎回,根据本基金合同规定,可以暂停接受赎回申请的情况;

(4) 发生本基金合同规定的暂停基金财产估值情况;

(5) 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,基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。

(6) 法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述(1)、(2)、(3)、(4)、(5)项情形时,基金管理人应在规定期限内在规定媒介刊登暂停赎回公告。

已经确认的赎回申请,基金管理人应当足额支付;如暂时不能足额支付,应当按单个赎回申请人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支付。

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、暂停期间结束,基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应按规定公告。

(1) 如果发生暂停的时间为1天,基金管理人应于重新开放申购或赎回日在中国证监会规定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回的公告,并公告最新的基金份额净值;

(2) 如果发生暂停的时间超过 1 天但少于 2 周，基金管理人应于重新开放申购或赎回日的前 1 个工作日在中国证监会规定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并于重新开放申购或赎回日公告最新的基金份额净值；

(3) 如果发生暂停的时间超过 2 周，基金管理人应在暂停期间每两周至少重复刊登暂停公告一次。暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应最迟提前 2 日在中国证监会规定媒介上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。

#### (十一) 基金转换

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。

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。基金管理人最迟应于转换业务开始前 2 天在规定媒介上刊登公告。

#### (十二) 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。

## 七、基金的非交易过户与转托管

(一) 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。

(二) 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。

(三) 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。

## 八、基金份额的冻结、解冻及质押

(一) 基金注册登记人只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益（包括现金分红和红利再投资）一并冻结。

(二) 在不违反届时有效的法律法规的条件下，基金注册登记人将可以办理基金份额的质押业务或其他业务，公布并实施相应的业务规则。

## 九、基金合同当事人及其权利义务

### (一) 基金管理人

#### 1、基金管理人基本情况

名称：金鹰基金管理有限公司

注册地址：广州市南沙区横沥镇汇通二街2号3212房（仅限办公）

办公地址：广东省广州市天河区珠江东路28号越秀金融大厦30层

成立日期：2002年12月25日

法定代表人：姚文强

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字【2002】97号

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

组织形式：有限责任公司

注册资本：5.102 亿元人民币

存续期间：持续经营

## 2、基金管理人的权利

(1) 依法募集基金，办理基金备案手续；

(2) 自基金合同生效之日起，基金管理人依照法律法规和基金合同独立管理基金财产；

(3) 根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金募集、认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；

(4) 根据法律法规和基金合同的规定获得基金管理费；

(5) 在符合有关法律法规和基金合同的前提下，决定本基金的相关费率结构和收费方式；

(6) 根据法律法规和基金合同之规定销售基金份额，收取认购费、申购费、基金赎回手续费及其它法律法规规定的费用；

(7) 依据法律法规和基金合同的规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其它基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会和中国银监会，以及采取其它必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；

(8) 根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；

(9) 自行承担基金注册登记人或选择、更换基金注册登记代理机构，办理基金注册登记业务，并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查；

(10) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；

(11) 在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行



融资；

(12) 依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益的分配方案；

(13) 按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其它证券所产生的权利；

(14) 在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；

(15) 依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；

(16) 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者实施其他法律行为；

(17) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；

(18) 法律法规、基金合同以及依据基金合同制订的其它法律文件所规定的其它权利。

### 3、基金管理人的义务

(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；

(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、勤勉尽责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) 配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购和赎回业务；

(6) 配备足够的专业人员和相应的技术设施进行基金的注册登记或委托其他机构代理该项业务；

(7) 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资产相互独立，对所管理的不同基金分别管理、分别记账，进行证券投资；

(8) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得以基金财产为自己及任何第三人谋取非法利益，不得委托第三人运作基金财产；

(9) 接受基金托管人依法进行的监督；

(10) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，按照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；

(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，应予以保密，不得向他人泄露；

(13) 按基金合同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) 按照法律法规和本基金合同的规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回和分红款项；

(15) 不谋求对上市公司的控股和直接管理；

(16) 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；

(17) 按规定保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料不少于法律法规规定的最低年限；

(18) 进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；

(19) 编制中期报告和年度报告；

(20) 确保需要向基金份额持有人提供的各项文件或资料，在规定时间内发出；保证投资人能够按照基金合同约定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并得到有关资料的复印件；

(21) 组织并参加基金财产清算组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(22) 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；

(23) 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的合法权

益，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(24) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(25) 不从事任何有损基金财产及本基金其他当事人利益的活动；

(26) 严格履行《反洗钱法》规定的金融机构反洗钱义务；

(27) 公平对待所管理的不同基金，防止在不同基金间进行有损本基金份额持有人的利益及资源分配；

(28) 以基金管理人的名义，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；

(29) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

## (二) 基金托管人

### 1、基金托管人基本情况

名称：交通银行股份有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

法定代表人：任德奇

成立时间：1987 年 3 月 30 日

批准设立机关和批准设立文号：国务院国发(1986)字第 81 号文和中国人民银行银发 [1987] 40 号文

组织形式：股份有限公司

注册资本：742.62 亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字 [1998] 25 号

### 2、基金托管人的权利

(1) 依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；

(2) 依照基金合同的约定获得基金托管费；

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如托管人发现基金管理人的投

资指令违反基金合同或有关法律法规的规定的，不予执行并向中国证监会报告；

(4) 在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；

(5) 依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；

(6) 依据法律法规和基金合同的规定监督基金管理人，如认为基金管理人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其它基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会和中国银监会，以及采取其它必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；

(7) 法律法规、基金合同规定的其它权利。

### 3、基金托管人的义务

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产；

(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资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》、本基金合同及其他有关规定外，不以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；

(7) 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；

(8) 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应予以保密，不得向他人泄露；

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

(10) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(11) 对基金财务会计报告、中期报告和年度报告出具意见，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，还应说明基金托管人是否采取了适当的措施；

(12) 按规定保存有关基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料不少于法律法规规定的最低年限；

(13) 根据有关法律法规，建立并保存基金份额持有人名册；

(14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(15) 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、基金转换转出款项；

(16) 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；

(17) 监督基金管理人的投资运作；

(18) 财产清算组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(19) 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和银行监管机构，并通知基金管理人；

(20) 因违反基金合同造成基金财产损失时，基金托管人应为基金向基金管理人追偿；

(21) 基金合同导致基金财产的损失，应承担赔偿责任，其责任不因其退任而免除；

(22) 任何有损基金及基金合同其他当事人利益的活动；

(23) 法律法规、本基金合同和依据本基金合同制定的其他法律文件所规定的其他义务。

### (三) 基金份额持有人

1、基金投资人购买或通过其他合法方式持有本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，基金投资人自依据基金合同、招募说明书取得本基金的基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。本基金同一类别的每份基金份额具有同等的合法权益。

#### 2、基金份额持有人的权利

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- (5) 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、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- (9) 法律法规、基金合同规定的其它权利。

### 3、基金份额持有人的义务

- (1) 遵守基金合同；
- (2) 缴纳基金认购、申购款项及基金合同规定的费用；
- (3) 在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份额持有人合法利益的活动；
- (5) 不从事或协助从事任何洗钱活动；
- (6) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- (7) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利；
- (8) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

## 十、基金份额持有人大会

(一) 本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人或基金份额持有人合法的授权代表共同组成。

(二) 有以下事由情形之一时，应召开基金份额持有人大会：

- 1、修改或终止基金合同，但基金合同另有约定的除外；
- 2、转换基金运作方式，但基金合同另有约定的除外；
- 3、更换基金托管人；
- 4、更换基金管理人；
- 5、提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- 6、本基金与其它基金的合并；
- 7、变更基金类别；
- 8、变更基金投资目标、范围或策略；
- 9、变更基金份额持有人大会程序；
- 10、法律法规、基金合同或中国证监会规定的对基金合同当事人的权利、义务产生重大影响的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

(三) 以下情况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本基金的申购费率、赎回费率或销售服务费率、调整收费方式；
- 3、因相应的法律法规发生变动而应当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；
- 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；
- 6、除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其它情形。

(四) 召集人和召集方式

- 1、除法律法规或本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。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。
- 2、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，应当自行召集并确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

3、代表基金份额 10%以上（含 10%，以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）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 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。

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 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

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。

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。

#### (五) 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，召集人必须于会议召开日前 30 天在规定媒介公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- (1) 会议召开的时间、地点和方式；
- (2) 会议拟审议的主要事项；
- (3) 会议形式；
- (4) 议事程序；



- (5) 有权出席基金份额持有人大会的权益登记日；
- (6) 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；
- (7) 表决方式；
- (8) 会务常设联系人姓名、电话；
- (9) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- (10) 召集人需要通知的其他事项。

2、采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金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、书面表达意见的寄交和收取方式及截止时间。

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表决意见的计票进行监督。

#### (六) 基金份额持有人出席会议的方式

##### 1、会议方式

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。

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。

通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

会议的召开方式由召集人确定，但决定更换基金管理人或基金托管人必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

##### 2、召开基金份额持有人大会的条件

###### (1) 现场开会方式

在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，有效的基金份额应占

权益登记日基金总份额的 50%以上（含 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，则召集人可另行确定并公告重新开会的时间和地点，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

## （2）通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

① 召集人按本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 召集人在基金托管人和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应占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%）；

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他代表，同时提交的持有基金份额的凭证符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与登记注册机构记录相符。

如果开会条件达不到上述条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

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，否则表面符合法律法规和会议通知规定的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。

## （七）议事内容与程序

### 1、议事内容及提案权

（1）议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容以及召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

(2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由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前 35 天提交召集人。召集人对于临时提案应当在大会召开日前 30 天公布。

(3) 对于基金份额持有人提交的提案（包括临时提案），大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

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。

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。

(4) 单独或合并持有权利登记日基金总份额 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、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。

(5) 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或增加新的提案，应当最迟在基金份额持有人大会召开日前 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，经讨论后在公证机关监督下进行表决，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由基金管理人授权代表主持。在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人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

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前 30 天公布提案，在所通知的表决截止日期第 2 天在公证机构监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。

3、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。

## (八) 决议形成的条件、表决方式、程序

1、基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

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

一般决议须经出席会议的基金份额持有人及其代理人所持表决权的 50% 以上(含 50%) 通过方为有效，除下小项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

特别决议须经出席会议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方为有效；更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同等重大事项必须以特别决议方式通过。

3、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。

4、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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。

## （九）计票

### 1、现场开会

（1）如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则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推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推举 3 名基金份额持有人担任监票人。

（2）监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点，由大会主持人当场公布计票结果。

（3）如会议主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对投票数进行重新清点；如会议主持人未进行重新清点，而出出席会议的基金份额持有人或代理人对会议主持人宣布的表决结果有异议，其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。

（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参加基金份额持有人大会或拒不配合计票的，不影响计票的效力。

### 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（如果基金托管人为召集人，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表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

## （十）基金份额持有人大会决议的生效与公告

1、基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，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决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

2、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。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。

3、份额持有人大会决议应自核准或备案后 2 日内在规定媒介公告。

(十一) 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。

## 十一、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序

### （一）基金管理人和基金托管人的更换条件

#### 1、有下列情形之一的，基金管理人职责终止：

- （1）基金管理人被依法取消基金管理资格；
- （2）基金管理人依法解散、依法被撤销或被依法宣告破产；
- （3）基金管理人被基金份额持有人大会解任；
- （4）法律法规规定的其他情形。

基金管理人职责终止时，应当依照本基金合同的规定在六个月内召开基金份额持有人大会，选任新的基金管理人；新基金管理人产生前由中国证监会指定临时基金管理人。

#### 2、有下列情形之一的，基金托管人职责终止：

- （1）基金托管人被依法取消基金托管资格；
- （2）基金托管人依法解散、依法被撤销或被依法宣告破产；
- （3）基金托管人被基金份额持有人大会解任；
- （4）法律法规规定的其他情形。

基金托管人职责终止时，应当依照本基金合同的规定在六个月内召开基金份额持有人大会，选任新的基金托管人；新基金托管人产生前由中国证监会指定临时基金托管人。

### （二）基金管理人和基金托管人的更换程序

#### 1、基金管理人的更换程序

（1）提名：新任基金管理人由基金托管人或代表 10%以上基金份额的基金份额持有人提名。

（2）决议：基金份额持有人大会对更换基金管理人形成决议。

（3）临时基金管理人：新任基金管理人产生之前，由中国证监会指定临时基金管理人；

（4）核准并公告：上述基金份额持有人大会决议自通过之日起 5 日内，由

大会召集人报中国证监会核准，经中国证监会核准生效后方可执行。基金托管人在中国证监会核准后 2 日内在中国证监会规定媒介上公告。

(5) 交接：基金管理人职责终止的，应当妥善保管基金管理业务资料，及时办理基金管理业务的移交手续，新基金管理人或者临时基金管理人应当及时接收。新任基金管理人应与基金托管人核对基金资产总值和净值。

(6) 审计并公告：基金管理人职责终止的，应当按照规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案。

(7) 基金名称变更：基金管理人更换后，本基金应替换或删除基金名称中与原基金管理人有关的名称或商号字样。

## 2、基金托管人的更换程序

(1) 提名：新任基金托管人由基金管理人或代表 10%以上基金份额的基金份额持有人提名。

(2) 决议：基金份额持有人大会对更换基金托管人形成决议。

(3) 临时基金托管人：新任基金托管人产生之前，由中国证监会指定临时基金托管人；

(4) 核准并公告：上述更换基金托管人的基金份额持有人大会决议自通过之日起 5 日内，由大会召集人报中国证监会核准，经中国证监会核准生效后方可执行。基金管理人在中国证监会核准后 2 日内在中国证监会规定媒介上公告。

(5) 交接：基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续，新基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收。新任基金托管人与基金管理人核对基金资产总值和净值。

(6) 审计并公告：基金托管人职责终止的，应当按照规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案。

## 3、基金管理人与基金托管人同时更换

(1) 提名：如果基金管理人和基金托管人同时更换，由单独或合计持有基金总份额 10%以上的基金份额持有人提名新的基金管理人和基金托管人。

(2) 决议：基金份额持有人大会对同时更换基金管理人和基金托管人形成



决议。

(3) 临时基金管理人和临时基金托管人：新任基金管理人和新任基金托管人产生之前，由中国证监会指定临时基金管理人和临时基金托管人。

(4) 核准并公告：上述基金份额持有人大会决议自通过之日起 5 日内，由大会召集人报中国证监会核准。新任基金管理人和新任基金托管人在获得中国证监会核准后 2 日内在中国证监会规定媒介上联合公告。

(5) 交接：基金管理人职责终止的，应当妥善保管基金管理业务资料，及时办理基金管理业务的移交手续，新基金管理人或者临时基金管理人应当及时接收。基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续，新基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收。新任基金管理人与新任基金托管人核对基金资产总值和净值。

(6) 审计并公告：基金管理人和基金托管人职责终止的，应当按照规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案。

(7) 基金名称变更：基金管理人更换后，本基金应替换或删除基金名称中与原基金管理人有关的名称或商号字样。

## 十二、基金托管

本基金财产由基金托管人依法持有并保管。基金管理人应与基金托管人按照《基金法》、本基金合同及其他有关规定订立《金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金托管协议》，以明确基金管理人与基金托管人之间在基金财产的保管、基金财产的管理和运作及相互监督等相关事宜中的权利、义务及职责，确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

## 十三、基金的销售

(一) 本基金的销售业务指接受投资人申请为其办理的本基金的认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管、定期定额投资和客户服务等业务。

(二)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认购、申购、赎回业务的,应与代理机构签订委托代理协议,以明确基金管理人和代销机构之间在基金份额认购、申购、赎回等事宜中的权利和义务,确保基金财产的安全,保护基金投资人和基金份额持有人的合法权益。销售机构应严格按照法律法规和本基金合同规定的条件办理本基金的销售业务。

## 十四、基金份额的注册登记

(一)本基金基金份额的注册登记业务指本基金登记、存管、过户、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、清算和结算、基金销售业务确认、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等。

(二)本基金的注册登记业务由基金管理人或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注册登记业务的,应与代理机构签订委托代理协议,以明确基金管理人和代理机构在投资人基金账户管理、基金份额注册登记、清算和结算及基金销售业务确认、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,保护基金投资人和基金份额持有人的合法权益。

(三)注册登记人履行如下职责

- 1、保管基金份额持有人开户资料、交易资料、基金份额持有人名册等;
- 2、配备足够的专业人员办理本基金的注册登记业务;
- 3、严格按照法律法规和本基金合同规定的条件办理本基金的注册登记业务;
- 4、接受基金管理人的监督;
- 5、保持基金份额持有人名册及相关的申购与赎回等业务记录不得少于法律法规规定的最低年限;
- 6、对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务,因违反该保密义务对投资人或基金带来的损失,须承担相应的赔偿责任,但司法强制检查情形除外;
- 7、按本基金合同及招募说明书、定期更新的招募说明书的规定,为投资人办理非交易过户业务、提供其他必要的服务;

8、法律法规规定的其他职责。

(四) 注册登记人履行上述职责后, 有权取得注册登记费。

## 十五、基金的投资

### (一) 投资目标

本基金通过对分红能力良好且长期投资价值突出的优质股票投资, 兼顾投资的当期收益和长期增值, 为基金持有人获取长期稳定回报。

### (二) 投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括投资于国内依法公开发行上市的股票(含存托凭证)、债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。

本基金主要投资于分红能力良好且长期价值突出的优质企业, 股票资产占基金资产净值比例为 30%—80%; 现金、债券资产、其他资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产净值的比例为 20%—70%, 其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%, 其中, 现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等; 权证投资占基金资产净值的比例不超过 3%。

### (三) 投资理念

通过主动式投资管理, 在控制投资风险的前提下, 深入挖掘且积极投资于分红能力良好且长期价值突出的优质企业, 谋求基金资产的长期稳定增值。

### (四) 投资策略

本基金采取积极主动式投资管理, 通过积极的资产配置策略, 深入研究、调研基础上的主动性证券选择和市场时机选择, 在合理控制投资风险的前提下, 最大限度地获取投资收益。

#### 1、资产配置策略

本基金采取积极的资产配置策略, 两层次资产配置体系, 自上而下地进行配置, 以使基金在保持总体风险水平相对稳定的基础上, 优化投资组合。

第一层次资产配置为大类资产配置，是指在权益类资产、固定收益类资产和现金资产之间进行配置。本基金在资产配置中采用自上而下的策略，通过对宏观经济运行周期、财政及货币政策、资金供需情况、证券市场估值水平等的深入研究，分析股票市场、债券市场、货币市场三大类资产的预期风险和收益，适时动态地调整基金资产在股票、债券、现金三大类资产的投资比例，以规避市场系统性风险。配置的主要方法是：基于价值分析方法，定期估算股票市场整体的合理估值水平，并与市场实际的估值水平进行比较，根据两者之间的差异，结合对宏观经济、政策和证券市场走势等方面的分析，判断股票市场是否被高估或低估以及偏离程度，并据此进行资产配置。一般情况下，当估算的市场估值水平高于实际的市场估值水平，且判断市场存在明显低估时，基金将增加股票投资比例；当估算的市场估值水平低于实际的市场估值水平，且判断市场存在明显高估时，基金将减少股票投资比例。

第二层次资产配置为行业配置，是指股票资产在各行业之间的配置。本基金将通过树状集群评价体系对整体行业进行定性和定量的分析，评价体系中包括短期因素指标和长期因素指标，这些指标主要包括行业生命周期阶段、盈利模式、增长预期、盈利可持续性、政策扶持程度、整体估值水平等。通过上述分析评价，形成本基金投资的重点行业，并进行重点配置。

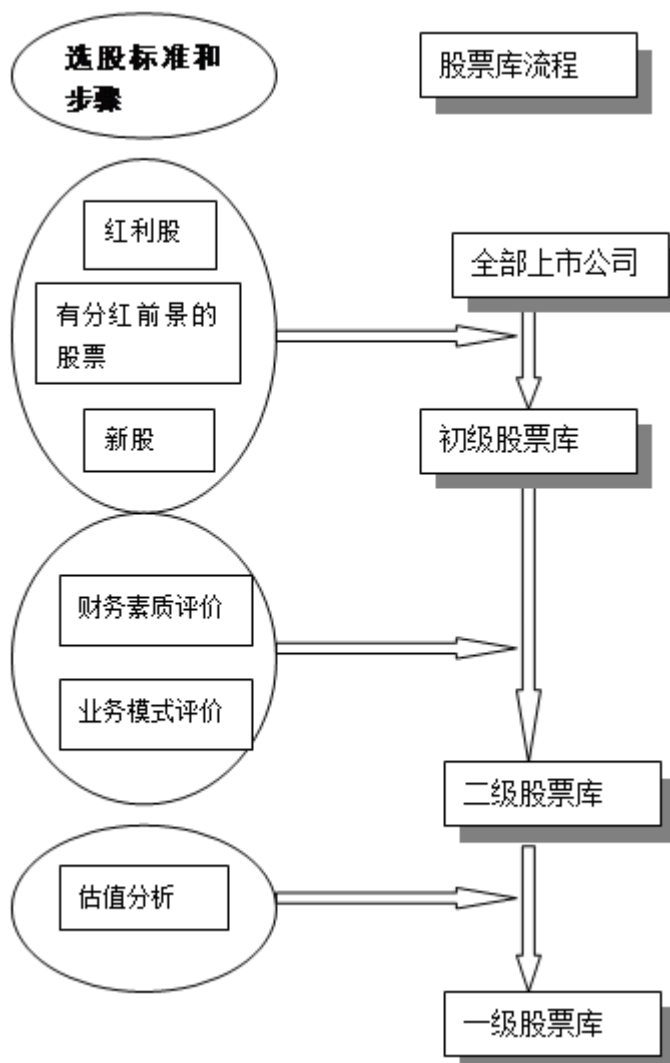
## 2、股票投资策略

本基金采用定量和定性相结合的个股精选策略，通过红利股筛选、竞争优势评价和盈利预测的选股流程，精选出兼具稳定的高分红能力、较强竞争优势和持续盈利增长的上市公司股票作为主要投资对象，以增强本基金的股息收益和资本增值能力。

### （1）建立股票备选库

#### A、股票备选库建立流程（见图1）

图 1：股票备选库筛选流程示意图



### B、初级股票库

本基金主要根据过去 3 年上市公司的历史分红状况建立初级股票库。初级股票库包括具有以下一项或多项特征的股票：

- 在过去 3 年进行过 2 次以上分红的个股；
- 年报披露只有 2 年且有 2 次分红的个股；
- 年报披露只有 1 年且有 1 次分红的个股
- 预期将会推出较优厚红利分配方案的个股；

### C、二级股票库

在初级股票库的基础上，本基金将通过财务素质和业务模式评价，对初级股

票库成份股进行筛选，确定二级股票库。

### C-1、财务素质评价

优质的企业都具备良好的财务素质，本基金设计了金鹰财务素质评价模型对上市公司的财务素质进行排序和评价，选择财务素质良好的股票进入股票库。在最终确定的模型中包括十五项基本指标，这些基本指标列表如下。而这十二项指标还可以归为五个大类，我们称之为五大财务指标序列。

表 1：四类因素及其对应的财务指标

	盈利性指标 (r=1)	成长性指标 (r=2)	现金流指标 (r=3)	偿债能力指标 (r=4)	营运能力指标 (r=5)
N=1	ROE	主营收入增长率	每股经营现金流	资产负债率	资产周转率
n=2	毛利率	净利润增长率	每股资本支出	流动比率	应收款周转率
N=3	净利率	每股收益增长率	资本支出/折旧	速动比率	存货周转率

每个行业具有不同的行业特征，因此在进行财务指标评价的时候，我们将根据各个行业的特征建立适合本行业的财务指标评价权重参数。这些参数都是我们对各个行业的上市公司的财务指标进行统计分析后得到的，是比较客观且符合市场及行业特征的，对行业财务素质的解释能力超过 85%。基本模型如下：

$$S = \sum_{r,n} A_{ir} B_{irn} C_{irn}$$

S 为某公司的财务指标评价得分。

i 代表行业的序数，r= (1, …, 5) 代表财务指标大类别的序数，n= (1, 2, 3) 代表某大类别中的财务指标的序数。

$A_{ir} = (a_{i1}, a_{i2}, a_{i3}, a_{i4}, a_{i5})$  是财务指标类别权重参数数列。 $a_{ir}$  代表第 I 行业的第 r 财务指标序列的权重参数，表示这个指标类别在整体评价中的重要性。如

$a_{i1}$  代表 I 行业中盈利性指标类别在五大类别中的权重。

$B_{im} = (b_{ir1}, b_{ir2}, b_{ir3}, b_{ir4}, b_{ir5})$  是财务指标权重参数数列。 $b_{im}$  代表 i 行业的第 r 财务指标大类序列的第 n 个财务指标的权重参数。如  $b_{i11}$  代表 I 行业的盈利性指标序列中的第一个财务指标（ROE）的权重参数。

$C_{im} = (c_{ir1}, c_{ir2}, c_{ir3}, c_{ir4}, c_{ir5})$  是公司财务指标值数列， $c_{im}$  代表 i 行业的某公司的第 r 财务指标序列的第 n 个财务指标。如  $c_{i11}$  代表 I 行业的某公司的盈利性指标序列中的第一个财务指标（ROE）的值。

经过这个基本模型的计算后，形成了各个上市公司的财务素质评分，按其投资价值高低排序，我们将选取财务素质良好且具备投资价值的公司进入我们的备选库。

结合不同的市场情况，除了上述 5 类财务指标以外，基金还将对各类因素中的其他财务指标予以关注。

#### C-2、业务模式评价

财务指标只是代表了过往经营业绩，本基金将在财务指标评价的基础上，进一步筛选出未来具有良好投资价值的红利股。这类上市公司的业务模式具有下面两个特点：

##### ①有明确的盈利增长前景

上市公司只有具备了明确的盈利增长前景，才可能使公司的价值不断获得增长，从而为股东带来投资回报。本基金将关注那些产品或服务存在巨大潜在需求，但是未来较长时间内，其总量供给能力不足，或者生产能力增长速度落后于潜在需求增长速度的产业，对该产业内增长明确的公司给予重点关注。

##### ②有难以复制的竞争优势

难以复制的竞争优势主要体现在下列几个方面：具有自然垄断或国家特许经营的特性；具有显著的品牌优势；具有产品定价能力，毛利率稳定；有较强的技术研发能力；强大的分销网络。上市公司只有具备难以复制的竞争优势，才能把盈利前景转化为真实的盈利，本基金将在盈利增长前景分析的基础上进行竞争优势分析，最终确定二级股票库。

#### D、一级股票库

在二级股票库的基础上，本基金将通过估值分析，对二级股票库的股票进行进一步分析、研究和筛选，确定一级股票库。

### 估值分析

具备长期投资价值的股票在市场某些阶段也可能存在阶段性估值过高的可能，从投资稳健性角度看，投资这类股票对基金净值增长稳定性有较大影响。因此本基金选择构成股票备选库的股票将主要选择那些估值合理或低股的长期投资价值良好的红利股票。

本基金估值分析将综合利用多种估值工具，且不同行业的股票采用的估值方法侧重点不同。根据不同行业的特征，本基金采用的估值方法主要有：自由现金流贴现模型、市盈率（P/E）、市净率（P/B）、PEG、EV/EBITDA 等。基本的估值思路是将公司的这些估值指标与行业内平均水平进行对比，选取市价低估或合理的红利股票进行长期投资。

#### （2）实地调研

研究团队将通过案头分析、公司实地调研等方式，深入了解备选股票库成份股基本面数据的真实性，确保对上市公司内在价值估计的合理性。研究员将把上市公司的盈利能力与国际、国内同行业的公司作比较，调研与公司有关的供应商、客户、竞争对手等各方的情况，从行业主管机关、税务部门、海关等进行第三方数据核实等。

实地调研过程中，研究团队还将关注上市公司的红利分配计划，了解上市公司的红利分配意愿。对于具备良好红利分配能力且具有红利分配意愿的上市公司，本基金将予以重点关注。

研究员还根据调研结果对备选股票库的成份股的投资价值进行更新判断，从而对备选股票库进行不断调整。

#### （3）构建投资组合

基金经理组将根据自己的判断、市场时机和个股流动性情况，建立投资组合。

#### 3、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。



#### 4、债券投资策略

本基金债券投资的主要目标是优化基金流动性管理，并分散股票投资风险。本基金可投资于国债、金融债和企业债（包括可转债），主要选择那些信用等级高、流动性好的债券进行投资。

##### （1）类属配置策略

在正常市场情况下，基金债券资产将主要投资于国债、金融债和央行票据。在预期股票市场收益率上升时，基金将适度增加对可转债投资；在市场流动性充足的情况下，基金将利用税收优势，适当增加对企业债投资。

##### （2）期限配置策略

基金将结合对市场利率、通货膨胀率及其他核心宏观经济变量的分析，确定期限配置策略。在预期市场利率上升或收益率曲线更加陡峭的情况下，基金将降低组合久期、减持长期债券、增持短期债券，以降低利率风险；在预期市场利率稳定或下降、收益率曲线趋于平坦的情况下，基金将提高组合久期、减持短期债券、增持长期债券，以提高基金收益。

##### （3）个券选择策略

具有以下一项或多项特征的债券，将是本基金债券投资重点关注的对象：

具有较高信用等级和较好流动性的债券；

在信用质量和剩余期限类似的条件下，到期收益率较高的债券；

风险水平合理、有较好下行保护的债券；

#### 5、权证及其他金融工具投资策略

本基金将按照相关法律法规通过利用权证、股指期货及其他金融工具进行套利、避险交易，控制基金组合风险，获取超额收益。

本基金进行权证投资时，将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上，结合股价波动率等参数，运用数量化期权定价模型，确定其合理内在价值，从而勾践套利交易或避险交易组合。

本基金投资于股票指数期货主要用于避险交易及套利交易。

##### （五）投资决策

## 1、 决策依据

以《基金法》、《运作管理办法》等有关法律法规、本基金合同等有关规定为决策依据，并以维护基金份额持有人利益作为最高准则。

## 2、 决策程序

本基金的投资决策流程如下：

(1) 投资决策委员会提出研究需求，公司研究部门提交详细研究报告，包括投资总体策略建议、资产配置和证券选择建议、投资时机建议等。

(2) 投资决策委员会认真研究公司研究部提供的投资建议，并根据有关法律法规及基金合同的有关规定制定投资的总体目标和总体设计。

(3) 在投资决策委员会制定总体投资计划的基础上，投资部将参考研究部门的研究报告，提出进一步的资产配置提案反馈投资决策委员会。投资部在制定投资方案时要接受风险控制委员会的风险控制建议和监察稽核部的监察、稽核。

(4) 基金经理在接到投资部制定的投资方案后，寻求最佳的投资机会和选择最佳的投资对象实施具体的项目投资，将投资指令下达至集中交易室的交易员执行，并将投资执行情况及时反馈。

(5) 集中交易室接到基金经理下达的交易指令执行书后将准确及时地予以执行，并及时反馈情况。同时将基金经理认可的成交回报单交基金会计进行核对和记帐。每个交易日后，基金清算室内自动根据交易所回馈信息进行基金清算。交易过程和投资运作流程均需要接受风险控制委员会和监察稽核部的风险控制建议和监察、稽核。

(6) 风险控制委员会通过监控投资决策、实施和执行的整个投资过程，并根据市场价格水平及公司风险控制政策，提出风险控制建议。

## (六) 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：

中证红利指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。

## (七) 风险收益特征

本基金是一只灵活配置混合型基金中的红利主题型基金，根据股票市场和固定收益类市场的风险收益水平灵活地配置资产，股票投资比例为基金资产净值的

30%—80%，现金、债券资产、其他资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产净值的比例为 20%—70%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；权证投资占基金资产净值的比例不超过 3%。因此，本基金风险收益特征从长期来看，其风险与预期收益高于债券型基金，低于股票型基金。

#### （八）投资禁止行为与限制

##### 1、禁止用本基金财产从事以下行为

- （1）承销证券；
- （2）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，但是国务院另有规定的除外；
- （5）向本基金的基金管理人、基金托管人出资或者买卖本基金的基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- （6）买卖与本基金的基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与本基金的基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- （7）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- （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活动。

##### 2、基金投资组合比例限制

- （1）持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- （2）本基金与基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，不超过该证券的 10%，并按有关规定履行信息披露义务；
- （3）本基金股票投资占基金资产净值比例为 30%—80%，现金、债券资产、其他资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产净值的比例为 20%—70%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证投资占基金资产净值的比例不超过 3%。
- （4）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

股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；

（5）本基金管理人管理的全部投资组合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票的 30%；

（6）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 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。

（7）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

（8）在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；

（9）在银行间市场进行债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的 40%；

（10）基金的投资组合中保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（11）权证投资比例遵照《关于股权分置改革中证券投资基金投资权证有关问题的通知》（证监基金字[2005]138 号）及相关规定执行；

（12）资产支持证券投资比例遵照《关于证券投资基金投资资产支持证券有关事项的通知》（证监基金字[2006]93 号）及相关规定执行；

（13）流通受限证券投资比例遵照《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》（证监基金字[2006]141 号）及后续相关规定执行；

（14）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；

（15）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；

（16）法律、法规、基金合同及中国证监会规定的其他比例限制。

3、法律法规或监管部门修改或取消上述限制规定时，本基金不受上述投资组合限制并相应修改限制规定。

#### （九）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约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，除上述第（6）、（10）、（12）、（14）项规定的情况外，基金管理人应当在 10 个工作日内进行调整。

#### （十）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。

## 十六、基金的融资

若将来法律法规允许基金融资，本基金可以根据届时有效的有关法律法规进行融资。

## 十七、基金的财产

#### （一）基金资产总值

基金资产总值是指本基金购买的各类证券及票据价值、银行存款本息、债券的应计利息、基金应收的申购基金款、缴存的保证金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、清算备付金及其应计利息；
- 3、根据有关规定缴存的保证金；
- 4、应收证券交易清算款；
- 5、应收申购基金款；
- 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、其他投资及其估值调整；
- 9、其他资产等。

## （二）基金资产净值

本基金基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

## （三）基金财产的账户

本基金以“金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金”的名义在基金托管人营业机构开立本基金的银行存款托管账户；以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立基金结算备付金账户，以“金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金”的名义在基金托管人托管系统中开立二级结算备付金账户；以基金托管人和“金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金”联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开立证券账户、以“金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金”的名义开立银行间债券托管账户并报中国人民银行备案。开立的上述基金财产账户与基金管理人、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。

如国家相关法律法规调整，基金管理人和基金托管人有权依据新规定执行。

## （四）基金财产的保管及处分

1、本基金财产独立于基金管理人及基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。

2、基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归基金财产。

3、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范围。

4、非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 十八、基金财产估值

### （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）估值原则

#### 1、真实性原则

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

#### 2、及时性原则

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

#### 3、完整性原则

基金资产估值的内容要完整详实，对要求揭示的所有事项不得遗漏或回避。

#### 4、公允性原则

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

#### 5、公开性原则

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

## 6、准确性原则

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

### （三）估值日

本基金合同生效后，每个交易日对基金财产进行估值。

### （四）估值对象

基金所持有的金融资产和金融负债。

### （五）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）长期停牌股票的估值

已停牌股票且潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，则相应股票采用指数收益法确定其公允价值。指数收益法是指对于需要进行估值的股票，在估值日以公开发布的相应交易市场和相应行业指数的日收益率作为该股票的收益率，然后根据此收益率计算该股票当日的公允价值。

##### （4）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方法

(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、权证估值方法

### (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、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。

5、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。

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。

7、国家有最新规定的，按其规定进行估值。

#### （六）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。各类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。

#### （七）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。

#### （八）基金份额净值的确认

各类基金份额净值、基金资产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各类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，由基金管理人对各类基金份额净值予以公布。

各类基金份额净值的计算均精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

#### （九）估值错误的处理

1、当基金资产的估值导致任一类基金份额净值小数点后四位（含第四位）内发生差错时，视为该类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某类基金份额净值的 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某类基金份额净值的 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。

#### （十）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。

#### （十一）特殊情况的处理

1、基金管理人按本条第（五）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。

## 十九、基金费用与税收

### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、C类基金份额的销售服务费；
- 4、基金的证券交易费用；
- 5、基金合同生效以后的信息披露费用；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金合同生效以后的会计师费和律师费；
- 8、按照国家有关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、基金管理人的管理费

本基金的管理费率为 1.20%。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 15 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

#### 2、基金托管人的基金托管费

本基金的托管费率为 0.20%。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，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 15 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

### 3、销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费。

本基金的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.60% 的年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 15 个工作日内从基金资产中一次性支付给登记机构，由登记机构代收后支付给销售机构。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

4、本条第（一）款第 4 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。

#### （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财产的损失，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。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支。

#### （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，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在规定媒

介上刊登公告。

#### （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）其他费用

按照国家有关规定和基金合同约定，基金管理人可以在基金财产中列支其他的费用，并按照相关的法律法规的规定进行公告或备案。

#### （七）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、基金收益与分配

### （一）收益的构成

1、基金收益包括：基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券差价、银行存款利息以及其他收入。

2、因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

3、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等项目后的余额。

### （二）收益分配原则

1、基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式（指将现金红利按分红权益再投资日经过除权后的基金份额净值为计算基准自动转为相应类别的基金份额进行再投资），基金份额持有人可选择现金方式或红利再投资方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；

2、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每

一基金份额享有同等分配权；

- 3、基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；
- 4、基金收益分配后各类基金份额的净值不能低于面值；
- 5、如果基金当期出现亏损，则不进行收益分配；
- 6、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多4次；
- 7、每次基金收益分配比例不得低于可分配收益的50%。基金合同生效不满3个月，收益可不分配；
- 8、分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红，分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红；
- 9、法律、法规或监管机构另有规定的，从其规定。

### （三）收益分配方案

基金收益分配方案中载明基金收益的范围、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式及有关手续费等内容。

### （四）收益分配方案的确定与公告

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

### （五）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，如收取该项费用，具体提取标准和方法在招募说明书或其他公告中列示。

2、收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担；如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，或者现金红利低于基金管理人规定的数额的，注册登记人自动将该基金份额持有人的现金红利按分红权益再投资日经除权后的基金份额净值为计算基准转为相应类别的基金份额。

### （六）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。

## 二十一、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，如果基金成立少于2个月，可以并入下一个会计年度。

2、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。

3、会计制度按国家有关的会计制度执行。

4、本基金独立建账、独立核算。

5、本基金会计责任人为基金管理人。

6、基金管理人应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，基金托管人定期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、基金托管人相独立的、具有从事证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师等机构对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计；

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（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，须经基金托管人（或基金管理人）同意，并报中国证监会备案后可以更换。基金管理人应在更换会计师事务所后在2日内公告。

## 二十二、基金的信息披露

### （一）披露原则

基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、基金合同及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。



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。

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符合中国证监会规定条件的全国性报刊(以下简称“规定报刊”)及《信息披露办法》规定的互联网网站(以下简称“规定网站”)等媒介披露,并保证投资人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。

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份额发售机构;
- 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。

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。

## (二) 公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括:

- 1、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

《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。

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规定的网站上;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。

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。

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,并登载在规定的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。

## 2、基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告,并在披露招募说明书的当日登载于规定媒介上。

## 3、《基金合同》生效公告

基金管理人应当在《基金合同》生效的次日在规定的媒介上登载《基金合同》生效公告。

## 4、定期报告

基金定期报告由基金管理人按照法律法规和中国证监会颁布的有关证券投资基金信息披露内容与格式的相关文件的规定单独编制,由基金托管人复核。基金定期报告,包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告。

(1) 基金年度报告: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规定的网站上,将年度报告提示性公告登载在规定的报刊上。基金年度报告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。

(2) 基金中期报告: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规定网站上，将中期报告提示性公告登载在规定报刊上。

(3)基金季度报告：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规定网站上，将季度报告提示性公告登载在规定报刊上。

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。

## 5、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规定网站披露一次各类基金份额的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，通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的各类基金份额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，在规定网站披露半年度和年度最后一日的各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

## 6、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。

## 7、临时报告

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，并登载在规定报刊和规定网站上。

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,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、销售服务费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更;

(16)任一类基金份额的基金份额净值估值错误达该类基金份额的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。

## 8、澄清公告

在基金合同期限内，任何公共媒介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，以及可能损害基金份额持有人利益的，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。

## 8、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。

## 9、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规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

## 10、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。

## 11、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。

## 12、中国证监会规定的其他信息

### (三) 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、基金托管人应当在规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规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规定媒介披露信息，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。

## 二十三、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、基金合同变更涉及本基金合同第十节第（二）项规定的对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应经基金份额持有人大会决议同意。变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

2、除上述第 1 项规定的情形外，经基金管理人和基金托管人同意可对基金合同的内容进行变更，该等变更应当在 2 日内由基金管理人进行公告并报中国证监会备案。

## （二）基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；
- 3、法律法规和基金合同规定的其他情形。

## （三）基金财产的清算

1、基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。

### 2、基金财产清算组

（1）自基金合同终止之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算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托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

（2）基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、基金注册登记人、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。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

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

### 3、清算程序

- （1）基金合同终止后，由基金财产清算组统一接管基金财产；

- (2) 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- (3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行评估和变现；
- (5) 基金清算组作出清算报告；
- (6) 会计师事务所对清算报告进行审计；
- (7) 律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (8) 将基金清算结果报告中国证监会；
- (9) 公布基金清算公告；
- (10) 对基金剩余财产进行分配。

#### 4、清算费用

清算费用是指基金财产清算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组优先从基金财产中支付。

#### 5、基金剩余财产的分配

基金财产按如下顺序进行清偿：

- (1) 支付基金财产清算费用；
- (2) 缴纳基金所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；
- (4) 清算后如有余额，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

清算小组成立后 2 日内应就清算小组的成立进行公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算组做出的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，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会批准并公告。

7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存不少于法律法规规定的最低年限。



## 二十四、业务规则

本基金合同当事人应遵守《金鹰基金管理有限公司开放式基金业务规则》(简称“业务规则”)。业务规则由基金管理人在符合法律法规及基金合同规定的前提下制定、修改和解释。

## 二十五、违约责任

(一) 基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中,违反《基金法》等法律法规的规定或者基金合同的约定,给基金财产或者基金份额持有人造成损害的,应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任;因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的,应当承担连带赔偿责任。

(二) 由于基金合同当事人违反基金合同,给其他基金合同当事人造成损失的,应当承担赔偿责任。当发生下列情况时,当事人可以免责:

1、基金管理人及基金托管人按照当时有效的法律法规、市场惯例作为或不作为而造成的损失等;

2、在没有欺诈或过失的情况下,基金管理人由于按照本基金合同规定的投资原则进行的投资所造成的损失等;

3、在没有欺诈或过失的情况下,基金托管人对基金投资形成的存放或存管在基金托管人以外机构的基金资产,由于该机构欺诈、疏忽、过失或破产所造成的损失等;

4、不可抗力。

(三) 在发生一方或者多方当事人违约的情况下,基金合同能够履行的应当继续履行。

(四) 本合同当事人一方违约后,其他当事方应当采取适当措施防止损失的扩大;没有采取适当措施致使损失扩大的,不得就扩大的损失要求赔偿。守约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

(五) 因第三方的过错而导致本基金合同当事人一方违约造成其他当事人损

失的，违约方并不免除其赔偿责任。

## 二十六、争议的处理

（一）本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

（二）本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可首先通过友好协商或调解解决。自一方书面要求协商解决争议之日起六十日内如果争议未能以协商或调解方式解决，则任何一方有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，根据提交仲裁时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为上海。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

（三）除争议所涉内容之外，本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。

## 二十七、基金合同的效力

（一）本基金合同是基金合同当事人之间的法律文件。基金合同于基金募集结束报中国证监会备案并获中国证监会书面确认后生效。

（二）本基金合同自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的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六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。

（四）基金合同可印制成册，存放在基金管理人和基金托管人住所，供投资人查阅，基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。