



金鹰元安保本混合型证券投资基金  
更新的招募说明书全文  
2016 年第 2 号

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：广发银行股份有限公司



## 【重要提示】

金鹰元安保本混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2013 年 3 月 14 日中国证券监督管理委员会《关于核准金鹰元安保本混合型证券投资基金募集的批复》（证监许可【2013】254 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 2013 年 5 月 20 日备案确认（基金部函【2013】361 号）后正式生效。本基金的第一个保本期起始于 2013 年 5 月 20 日，并于 2015 年 5 月 20 日到期。本基金第一个保本周期到期后，根据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《金鹰元安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《金鹰元安保本混合证券投资基金基金合同》进行了修改，并于 2015 年 5 月 11 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 2015 年 5 月 21 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，保本周期为二年，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，保本基金在极端情况下仍然存在本金损失的风



险，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。

此外，依照基金合同的约定，本基金若变更为“金鹰元安债券型证券投资基金”后，将可投资于中小企业私募债券，受其低流动性和较高信用风险的影响，相对于普通的债券型基金，届时本基金面临相对较高的流动性风险和信用风险。

投资人购买本基金时应认真阅读本基金的基金合同、保证合同、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 11 月 20 日，有关财务数据截止日为 2016 年 9 月 30 日，净值表现截止日为 2016 年 9 月 30 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.....                | 24  |
| 五、基金担保人.....                | 27  |
| 六、相关服务机构.....               | 28  |
| 七、基金的募集.....                | 63  |
| 八、基金合同的生效.....              | 63  |
| 九、基金份额的申购与赎回.....           | 63  |
| 十、基金的转换.....                | 72  |
| 十一、基金的非交易过户与转托管.....        | 72  |
| 十二、基金份额的冻结、解冻及质押.....       | 73  |
| 十三、定期定额投资计划.....            | 73  |
| 十四、基金的保本.....               | 73  |
| 十五、基金保本的保证.....             | 75  |
| 十六、基金的投资.....               | 80  |
| 十七、基金的业绩.....               | 99  |
| 十八、基金的财产.....               | 101 |
| 十九、基金资产的估值.....             | 102 |
| 二十、基金的费用和税收.....            | 107 |
| 二十一、基金的收益与分配.....           | 110 |
| 二十二、基金的会计与审计.....           | 112 |
| 二十三、基金的信息披露.....            | 112 |
| 二十四、风险揭示.....               | 118 |
| 二十五、保本周期到期.....             | 124 |
| 二十六、基金合同的变更、终止与基金财产的清算..... | 130 |
| 二十七、基金合同的内容摘要.....          | 133 |
| 二十八、基金托管协议的内容摘要.....        | 167 |
| 二十九、对基金份额持有人的服务.....        | 176 |



---

|                         |     |
|-------------------------|-----|
| 三十、其他应披露事项 .....        | 178 |
| 三十一、招募说明书的存放及查阅方式 ..... | 184 |
| 三十二、备查文件 .....          | 184 |
| 附件：《保证合同》 .....         | 185 |



## 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《金鹰元安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元安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：

1、基金或本基金：指金鹰元安保本混合型证券投资基金，或基金不再满足保本基金存续条件而进行变更后的“金鹰元安债券型证券投资基金”

2、基金管理人：指金鹰基金管理有限公司

3、基金托管人：指广发银行股份有限公司

4、基金担保人：亦称担保人，指根据《基金合同》的约定，为本基金份额持有人的保本提供不可撤销的连带责任保证的担保人。本基金第二个保本周期的担保人为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

5、保本义务人：指与基金管理人签订风险买断合同，为本基金的某保本周期承担保本偿付责任并放弃对基金管理人进行追偿权利的机构

6、基金合同或本基金合同：指《金鹰元安保本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



7、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《金鹰元安保本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

8、招募说明书：指《金鹰元安保本混合型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新

9、基金份额发售公告：指《金鹰元安保本混合型证券投资基金基金份额发售公告》

10、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等

11、《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

12、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

13、《信息披露办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《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

14、《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

15、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

16、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会

17、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有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

18、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

19、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

20、投资人：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及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人的合称

21、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

22、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务

23、销售机构：指金鹰基金管理有限公司以及符合《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与基金管理人签订了基金销售服务代理协议代为办理基金销售业务的机构

24、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

25、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的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登记业务的机构

26、基金账户：指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

27、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖基金的基金份额变动及结余情况的账户

28、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

29、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

30、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过 3 个月

31、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

32、保本周期：指本基金的保本期限。本基金一般每 2 年为一个保本周期，自本基金公告的保本周期起始之日起至 2 个公历年后对应日止的期间。基金管理人将在保本周期到期前公告下一保本周期的起始时间。《基金合同》中若无特别所指，保本周期即为当期保本周期

33、保本周期起始日：第一个保本周期起始日为基金合同生效日，其后保本周期起始日以基金管理人公告为准

34、保本周期到期日：指保本周期届满的最后一日，如果该对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日

35、持有到期：指基金份额持有人在保本周期内持续、不间断地持有其所认购、或过渡期申购、或从上一保本周期结束后选择或默认选择转入当期保本周期的基金份额至当期保本周期到期日的行为





36、到期操作：指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

37、到期操作期间：指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（含）及之后 3 个工作日（含第 3 个工作日）

38、实际净认购金额：指 $[\text{认购金额}/(1+\text{认购费率})]+\text{认购金额在基金募集期间的利息收入（税后）}=\text{认购份额}\times 1.00\text{ 元人民币}$

39、持有到期的基金份额的可赎回金额：根据基金保本周期到期日基金份额净值计算的可赎回金额，即基金份额持有人于当期保本周期起始日起一直持有到当期保本周期到期日基金份额与保本周期到期日基金份额净值的乘积

40、认购并持有到期的基金份额的可赎回金额：指本基金第一个保本周期内，基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与第一个保本周期到期日基金份额净值的乘积

41、过渡期申购并持有到期的基金份额持有人的保本额：基金份额持有人过渡期申购并持有到期的基金份额在基金份额折算日所代表的资产净值

42、从上一保本周期选择或默认选择转入当期保本周期并持有到期的基金份额持有人的保本额：基金份额持有人选择或默认选择转入当期保本周期并持有到期的基金份额在基金份额折算日所代表的资产净值

43、保本赔付差额：指基金份额持有人过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额的可赎回金额加上该部分基金份额在当期保本周期内的累计分红款项之和低于其保本额的差额部分

44、保本：指在保本周期到期日，如果基金份额持有人过渡期申购、或从上一保本周期选择或默认选择转入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的累计分红金额之和低于其保本额（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，并在保本周期到期日后 20 个工作日内（含该第 20 个工作日）将该差额支付给基金份额持有人；其后各保本周期到期日，如基金份额持有人过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额的可赎回金额加上该部分基金份额在当期保本周期内的累计分红款项之和低于其保本额，由当期有效的《基金合同》、《保证合同》或《风险买断合同》约定的基金管理人或保本义务人将该差额（即保本赔付差额）支付给基金份额持有人



45、担保：指担保人为本基金管理人的保本义务提供的不可撤销的连带责任担保，本基金第二个保本周期的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的差额部分（即保本赔付差额），担保期间为基金第二个保本周期到期日起六个月

46、过渡期：指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

47、过渡期申购：指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

48、折算日：指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

49、基金份额折算：指在折算日，得到基金管理人确认的基金份额（包括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、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 1.0000 元的基金份额，基金份额数额按折算比例相应调整

50、保本基金存续条件：指本基金保本周期届满时，符合法律法规有关担保人或保本义务人资质要求、并经基金管理人认可的其他机构，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

51、转入下一保本周期：指在符合保本基金存续条件下，保本周期到期日的基金份额持有人继续持有本基金基金份额的行为

52、保本周期到期后基金的存续形式：指保本周期届满时，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“金鹰元安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

53、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

54、T 日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

55、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）

56、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

57、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段



58、《业务规则》：指《金鹰基金开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守

59、认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为

60、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

61、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

62、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公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

63、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作

64、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式

65、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额的 10%

66、元：指人民币元

67、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、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

68、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

69、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

70、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

71、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

72、当期保本周期之份额折算日：针对本基金第一个保本周期后的后续各保本周期（若存在）而言，指基金份额持有人所处的保本周期开始前最后一个工作日，亦即该保本周期开



始前最近的过渡期的最后一个工作日

73、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒介

74、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

75、不可抗力：指本合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

### 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

成立日期：2002 年 12 月 25 日

法定代表人：凌富华

联系人：潘晓毅

联系电话：020-83936180

注册资本：人民币 2.5 亿元

股权结构：

| 发起人名称           | 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员、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，广药白云山香港有限公司董事会召集人。

江鹏先生，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以及上市公司东凌国际、粤传媒、博济医药、道氏技术的独立董事。

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、海南、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以及上市公司艾派克、威创股份、省广股份、阳普医疗的独立董事。

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审议，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

刘丽娟女士, 中南财经政法大学工商管理硕士, 历任恒泰证券股份有限公司交易员, 投资经理, 广州证券股份有限公司债券投资投资主办。2014 年 12 月加入金鹰基金管理有限公司, 任固定收益部总监。现任金鹰货币市场证券投资基金、金鹰灵活配置混合型证券投资基金、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、金鹰元祺保本混合型证券投资基金、金鹰元和保本混合型证券投资基金、金鹰添益纯债债券型证券投资基金及金鹰元盛债券型发起式证券投资基金 (LOF) 基金经理。

于利强先生, 复旦大学金融学学士。历任安永华明会计师事务所审计师, 华禾投资管理有限公司风险投资经理, 2009 年加入银华基金管理有限公司, 历任旅游、地产、中小盘行业研究员和银华中小盘基金经理助理。2015 年 1 月加入金鹰基金管理有限公司, 担任研究部总监。现任金鹰中小盘精选证券投资基金、金鹰元丰保本混合型证券投资基金、金鹰元安保本混合型证券投资基金、金鹰产业整合混合型证券投资基金、金鹰改革红利混合型证券投资基金及金鹰多元策略灵活配置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；

赖德昌先生， 投资决策委员会委员， 集中交易部总监。

##### （2）权益类投资决策委员会

刘岩先生， 权益投资决策委员会主任委员， 总经理；

曾长兴先生， 权益投资决策委员会委员， 副总经理；

王喆先生， 权益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， 权益投资决策委员会委员， 研究部总监， 基金经理；

陈立先生， 权益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， 固定收益投资决策委员会主任委员， 总经理；

曾长兴先生， 固定收益投资决策委员会委员， 副总经理；

刘丽娟女士， 固定收益投资决策委员会委员， 固定收益部总监， 基金经理；

##### （4）指数及量化投资决策委员会

刘岩先生， 指数及量化投资决策委员会主任委员， 总经理；

曾长兴先生， 指数及量化投资决策委员会委员， 副总经理；

黄志钢先生， 指数及量化投资决策委员会委员， 指数及量化投资部总监。

#### 5、上述人员之间均不存在近亲属关系。





### （三）基金管理人的义务

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。



#### (四) 基金管理人的承诺

(1) 基金管理人将严格遵守法律法规和基金合同，按照基金合同列明的投资目标、策略及限制全权处理本基金的投资。

(2) 基金管理人不得从事违反《基金法》及其他法律法规的行为，建立健全内部控制制度，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) 不公平地对待管理的不同基金财产；
- 3) 利用基金财产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) 用基金财产承销证券；
- 6) 用基金财产向他人贷款或提供担保；
- 7) 用基金财产从事无限责任的投资；
- 8) 用基金财产买卖其他基金份额，但国务院另有规定的除外；
- 9) 以基金财产向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- 10) 以基金财产买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- 11) 用基金财产从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- 12) 基金财产参与股票发行申购，所申报的金额超过基金的总财产，基金所申报的股票数量超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- 13) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值超过本基金资产净值的 10%；
- 14) 本基金与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，超过该证券的 10%；
- 15) 违反基金合同关于投资范围、投资策略和投资比例等约定；
- 16) 法律、法规、中国证监会及基金合同禁止的其他行为。

(3)、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) 在包括向中国证监会报送的资料中进行虚假信息披露;
- 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、倒仓等手段操纵市场价格,
- 11) 扰乱市场秩序;
- 12) 贬损同行, 以提高自己;
- 13) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分;
- 14) 以不正当手段谋求业务发展;
- 15) 有悖社会公德, 损害证券投资基金人员形象;
- 16) 参与洗钱或为洗钱活动提供协助;
- 17) 法律法规禁止的其他行为。

#### (4) 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) 不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益。

(3) 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息。

(4) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。



## （五）基金管理人的内部控制制度

### 1、内部控制制度概述

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

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

公司章程是规范公司与其他相关利益主体之间关系的基本规则以及保证这些规则得以具体执行的依据。

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

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

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

公司完善内控机制遵循以下原则：

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

**有效性原则。**通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行。

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

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

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

**成本效益原则。**公司应充分发挥各机构、各部门及广大职员的工作积极性，尽量降低经



营运作成本，保证以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

公司制定内部控制制度遵循以下原则：

合法合规原则。公司内控制度应当符合国家法律、法规、规章和各项规定。

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

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

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

#### （1）内部会计控制制度

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

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

#### （2）风险管理控制制度

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

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

#### （3）投资管理制度

投资管理制度包括研究业务管理制度、投资决策管理制度、基金交易管理制度等。

制订研究业务管理制度的目的是保持研究工作的独立、客观。研究业务管理制度包括：





建立严密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法；根据基金合同要求，在充分研究的基础上建立和维护投资对象备选库；建立研究与投资的业务交流制度，保持通畅的交流渠道；建立研究报告质量评价体系。

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

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

#### (4) 监察稽核制度

公司设立督察长，负责监察稽核工作，督察长由总经理提名，经董事会聘任，对董事会负责，报中国证监会核准。

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

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

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

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

## 2、内部控制制度的要素

内部控制制度具备控制环境、控制的性质与范围、实施、检查和报告等五个要素：

### (1) 控制环境

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



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

#### (2) 控制的性质和范围

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

#### (3) 实施

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

#### (4) 检查

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

#### (5) 报告

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

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

### 3、基金管理人内部控制制度声明书

基金管理人关于内部控制制度的声明如下：

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





## 四、基金托管人

### (一) 基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：广发银行股份有限公司

住所：广州市越秀区东风东路 713 号

办公地址：广州市越秀区东风东路 713 号

法定代表人：杨明生

成立时间：1988 年 7 月 8 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：154 亿人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会、中国银监会《关于核准广东发展银行证券投资基金托管资格的批复》，证监许可[2009]363 号

联系人：周小磊

联系电话：（010）65169562

广发银行股份有限公司成立于 1988 年，是国务院和中国人民银行批准成立的我国首批股份制商业银行之一，总部设于广东省广州市，注册资本 154 亿元。二十多年来，广发银行栉风沐雨，艰苦创业，以自己不断壮大的发展历程，见证了中国经济腾飞和金融体制改革的每一个脚印。

2016 年 3 月 1 日，中国人寿发布公告，公司与花旗集团及 IBM Credit 签订了相关收购协议，拟以 6.39 元/股的价格，收购后者合计持有的广发银行 36.48 亿股，总对价约为 233.12 亿元。目前，中国人寿持有广发银行约 67.29 亿股，持股比例 43.686%，为广发银行单一最大股东。

截至 2015 年 12 月 31 日，广发银行总资产 18365.87 亿元，较年初增幅 11.44%；总负债 17,390.47 亿元，较年初增幅 11.43%；实现营业收入 547.35 亿元，同比增长 22.61%；拨备前利润 325.55 亿元，同比增长 34.15%。据英国《银行家》杂志 2015 年全球银行排名，本行按一级资本列 92 位，首次进入百强，五年来大幅提高了 126 位。



## 2、主要人员情况

广发银行股份有限公司总行设资产托管部，是从事资产托管业务的职能部门，内设业务运行处、监控管理处、期货业务处和产品营销处，部门全体人员均具备本科以上学历和基金从业资格，部门经理以上人员均具备研究生以上学历。

部门负责人蒋柯先生，经济学硕士，高级经济师，从事托管工作十七年，托管经验丰富。曾担任大型国有商业银行资产托管部托管业务运作中心副处长、全球资产托管处副处长、全球资产托管处副处长（主持工作）等职务。曾被中国证券业协会聘任为证券投资基金估值工作小组组长。2015 年 1 月，经中国证监会核准资格，任广发银行资产托管部副总经理，现主持部门工作。

## 3、基金托管业务经营情况

广发银行股份有限公司于 2009 年 5 月 4 日获得中国证监会、银监会核准开办证券投资基金托管业务，基金托管业务批准文号：证监许可[2009]363 号。截至 2016 年 6 月末，托管资产规模超 19000 亿元。建立了一只优秀、专业的托管业务团队，保证了托管服务水准在行业的领先地位。建立了完善的产品线，产品涵盖证券投资基金、基金公司客户特定资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、保险资金托管、股权投资基金、产业基金、信托计划、银行理财产品、QDII 托管、交易资金托管、专项资金托管、中介资金托管等，能为托管产品提供全面的托管服务。

### （二）基金托管人的内部控制制度

#### 1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律、法规、规章、行政性规定、行业准则和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金资产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

#### 2、内部控制组织结构

广发银行股份有限公司总行下设资产托管部，是全行资产托管业务的管理和运营部门，专设监控管理处，配备了专职内部监察稽核人员，负责托管业务的内部控制和风险管理工作，



具有独立行使监督稽核工作的职权和能力。

### 3、内部风险控制原则

资产托管部建立了托管系统和完善的制度控制体系。制度体系包含管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

#### （三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定，基金托管人对基金的投资对象和范围、投资组合比例、投资限制、费用的计提和支付方式、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配、申购赎回以及其他有关基金投资和运作的事项，对基金管理人进行业务监督、核查。

#### 1、监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“托管业务综合系统——基金监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

#### 2、监督流程

（1）每工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

（2）收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手



等内容进行合法合规性监督。

(3) 根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价，报送中国证监会。

(4) 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

## 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。

### （一）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。

### （二）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、2013、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。



### (三) 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

客户服务中心电话：020-83936180、4006135888

电话：020-83282950

传真：020-83283445

网址：www.gefund.com.cn

#### 2、代销机构（排名不分先后）

##### (1) 交通银行股份有限公司



注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

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

电话：021-58781234

客服电话：95559

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

(2) 招商银行股份有限公司

注册（办公）地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

联系人：王琳

电话：0755-83196223

客服电话：95555（全国）

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

(3) 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)

(4) 名称：广发银行股份有限公司

注册（办）地址：广州市东风东路 713 号

法定代表人：杨明生

联系人：李春磊

电话：010-65169830



传真：010-65169555

<http://www.cgbchina.com.cn/>

(5) 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

法定代表人：孙建一

联系人：张莉

电话：021-38637673

客服电话：95511

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

(6) 宁波银行股份有限公司

注册（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：邱艇

电话：0574-87050397

客服电话：95574

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

(7) 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)

(8) 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：林培珊

电话：0769-22866254

客服电话：0769—961122

网址：www.dgrcc.com

（9） 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

电话：0519-89995066

客服电话：96005

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

（10） 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

（11） 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

电话：0817-7118079





客服电话：400-169-6869

网址：[www.cgnb.cn](http://www.cgnb.cn)

(12) 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)

(13) 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](http://www.new-rand.cn)

(14) 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：刘洋

电话：021-20835785

客服电话：400-920-0022

网址：[和讯理财客\(http://licaike.hexun.com\)](http://licaike.hexun.com)



(15) 厦门市鑫鼎盛控股有限公司

注册（办公）地址：福建省厦门市思明区鹭江道 2 号第一广场 15 楼

法定代表人：陈洪生

联系人：梁云波

联系电话：0592-3122757

客服电话：400-9180808

公司网站：www.xds.com.cn

(16) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801

法定代表人：汪静波

联系人：方成

电话：021-38602377

客服电话：400-821-5399

网址：www.noah-fund.com

(17) 深圳众禄基金销售有限公司

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）、基金买卖网（www.jjmmw.com）

(18) 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)）

（19） 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)）

（20） 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

住所：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F

法定代表人：陈柏青

联系人：韩爱彬

联系电话：0571-26888888-37494

客服电话：4000-766-123

公司网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

（21） 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))

(22) 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)）

(23) 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)

(24) 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/>

(25) 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))

(26) 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：余永键

电话：010-85097570

客服电话：400-021-8850

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

(27) 乾道金融信息服务(北京)有限公司

注册地址：北京市海淀区东北旺村南 1 号楼 7 层 7117 室

办公地址：北京市西城区德外大街合生财富广场 1302 室

法定代表人：王兴吉

联系人：高雪超

客服电话：400-088-8080

网址：<http://www.qindaojr.com>

(28) 北京格上富信投资顾问有限公司

注册地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室

法定代表人：李悦章

联系人：曹庆展

联系电话：010-65983311



客服电话：400-066-8586

公司网站：www.igesafe.com

(29) 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

电话：010-67000988-6097

客服电话：400-001-8811

网址：www.zcvc.com.cn

(30) 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：张晔

电话：010-58845312

客服电话：4008980618

网址：www.chtfund.com

(31) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 号

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 号

法定代表人：王伟刚

联系人：丁向坤

联系电话：010-56282140

客服电话：400-619-9059

公司网站：www.fundzone.cn



(32) 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

联系人：许骜

电话：010-58170911

客服电话：400-818-8866

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

(33) 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：010-883128877

客服电话：400-001-1566

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

(34) 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

电话：010-57418813

客服电话：400-893-6885

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

(35) 北京新浪仓石基金销售有限公司

注册（办公）地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室





法定代表人：李昭琛

联系人：吴翠

联系电话：18910449680

客服电话：010-62675369

公司网站：www.xincai.com

(36) 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

电话：010-68292940

客服电话：400 600 0030

网址：www.bzfunds.com/

(37) 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

(38) 上海万得投资顾问有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：上海市浦东新区福山路 33 号 8 楼

法定代表人：王廷富

联系人：徐亚丹

联系电话：021-51327185



客服电话：400-821-0203

公司网站：

(39) 凤凰金信（银川）投资管理有限公司

注册地址：宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路 142 号 14 层 1402

办公地址：北京市朝阳区紫月路 18 号院 朝来高科技产业园 18 号楼

法定代表人：程刚

联系人：张旭

联系电话：010-58160168

客服电话：400-810-5919

公司网站：[www.fengfd.com](http://www.fengfd.com)

(40) 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

电话：021-52822063

客服电话：4000-466-788

网址：<http://www.66zichan.com>

(41) 泰诚财富基金销售（大连）有限公司

注册（办公）地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号

法定代表人：林卓

联系人：张晓辉

电话：0411-88891212

客服电话：400-6411-999

公司网站：<http://www.taichengcaifu.com>

(42) 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/>

(43) 上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室(上海泰和经济发展区)

办公地址：上海市昆明路 518 号北美广场 A1002

法定代表人：王翔

联系人：吴笛

联系电话：021-6537-0077

客服电话：021-6537-0077

公司网站：[www.jiyufund.com.cn](http://www.jiyufund.com.cn)

(44) 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)

(45) 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>

(46) 北京恒宇天泽投资管理有限公司

注册地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 883 室

办公地址：北京市东城区东滨河路乙 1 号航星园 8 号楼 6 层

法定代表人：郭军爱

联系人：魏燕军

电话：010-84259208

客服电话：400-188-8848

网址：<https://1314fund.com/>

(47) 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)

(48) 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)



(49) 武汉市伯嘉基金销售有限公司

注册(办公)地址: 湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城 90(一期)  
第七幢 23 层 1 号 4 号

法定代表人: 陶捷

联系人: 陆锋

电话: 027-87006003-8026

客服电话: 400-027-9899

公司网站: <http://www.buyfunds.cn>

(50) 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

电话: 021-20665952

客服电话: 400-8219-031

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

(51) 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

电话: 021-22267943

客服电话: 021-22267982

网址: <http://www.dtfortune.com/>

(52) 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)

(53) 和耕传承基金销售有限公司

注册（办公）地址：河南省郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦 6 层

法定代表人：李淑慧

联系人：陆锋

电话：0371-85518396

客服电话：4000-555-671

公司网站：<http://www.hgccpb.com/>

(54) 奕丰金融服务（深圳）有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座 1115-1116 室及 1307 室

法定代表人：TAN YIK KUAN

联系人：叶健

联系电话：0755-89460500

客服电话：400-684-0500

公司网站：[www.ifastps.com.cn](http://www.ifastps.com.cn)

(55) 北京懒猫金融信息服务有限公司

办公地址：北京市朝阳区四惠东通惠河畔产业园区 1111 号

法定代表人：许现良

联系人：李雪

电话：010-56050820

客服电话：4001-500-882

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



(56) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址:北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401-15

办公地址:北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院 a 座 17 层

法定代表人:陈超

联系人:赵德赛

客服电话:95518

公司网址:<http://fund.jd.com>

(57) 深圳市金斧子投资咨询有限公司

注册地址:深圳市南山区粤海街道科苑路 16 号东方科技大厦 18 楼

办公地址:深圳市南山区粤海街道科苑路科兴科学园 B3 单元 7 楼

法定代表人:赖任军

联系人:张烨

电话:0755-66892301

客服电话:400-9500-888

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

(58) 深圳前海凯恩斯基金销售有限公司

注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)

办公地址:深圳市福田区深南大道 6019 号金润大厦 23A

法定代表人:高锋

联系人:廖苑兰

联系电话:0755-83655588

客服电话:400-804-8688

公司网站:[www.keynesasset.com](http://www.keynesasset.com)

(59) 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

电话：010-59539864

客服电话：95162 / 400-8888-160

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

(60) 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

电话：0755-23953913

客服电话：400-9908-826

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

(61) 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](http://www.csc108.com)

(62) 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：李颖

电话：0755-82133066

客服电话：95536

网址：<http://www.guosen.com.cn>

(63) 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)

(64) 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)

(65) 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>



(66) 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：陈共炎

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)

(67) 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)

(68) 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>

(69) 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：尤习贵



联系人：奚博宇

电话：021-68751860

客服电话：400888999

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

(70) 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)

(71) 西南证券股份有限公司

注册（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)

(72) 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：天津市南开区宾水西道 8 号

法定代表人：王春峰

联系人：张彤

电话：022-28451955

客服电话：400-651-5988



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

(73) 山西证券股份有限公司

注册地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：邓颖赟

联系电话：0351-8686796

客服电话：95573

网址：[www.i618.com.cn](http://www.i618.com.cn)

(74) 中信证券（山东）有限责任公司

注册（办公）地址：山东省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：孙秋月

电话：0532-85022026

客服电话：95548

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

(75) 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

电话：010-66555316

客服电话：010-66555835

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

(76) 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

法定代表人：张志刚

联系人：尹旭航

电话：010-63081493

客服电话：4008008899

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

（77） 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

电话：0755-83516289

客服电话：400-6666-888

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

（78） 光大证券股份有限公司

注册（办公）地址：上海市静安区新闻路 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](http://www.ebscn.com)

（79） 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：梁薇

电话：020-88836999-5408

客服电话：95396



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

(80) 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

电话：0431-85096517

客服电话：95360/4006-000686

网址：[www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

(81) 上海证券有限责任公司

注册（办公）地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

法定代表人：李俊杰

联系人：邵珍珍

电话：021-53686262

客服电话：400-891-8918

网址：[www.962518.com](http://www.962518.com)

(82) 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

电话：0351-4130322

客服电话：400-7121-212

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

(83) 国联证券股份有限公司

注册（办公）地址：江苏省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>

(84) 浙商证券股份有限公司

注册（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>

(85) 平安证券有限责任公司

注册（办公）地址：深圳市福田区金田路 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)

(86) 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)

(87) 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：广西南宁市滨湖路 46 号

法定代表人：何春梅

联系人：郑杜鹃

电话：021-20281096

客服电话：0771-5539032

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

(88) 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>

(89) 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)

(90) 东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层





办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：朱科敏

联系人：王一彦

电话：021-20333333

客服电话：95531；400-8888-588

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

(91) 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

电话：0991-2310927

客服电话：4008000562

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

(92) 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：陈曦

电话：021-20315086

客服电话：95538（全国）

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

(93) 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：姜味军

联系人：袁媛



电话：0755-83199511

客服电话：0755-83199599

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

(94) 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

电话：0755-83025022

客服电话：4008-888-228

网址：[www.jyzq.cn](http://www.jyzq.cn)

(95) 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：史江蕊

电话：010-64818301

客服电话：400-8866-567

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

(96) 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/客服：电话：400-8888-128

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



(97) 西部证券股份有限公司

注册（办公）地址：西安市东大街 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>

(98) 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](http://www.cicc.com.cn)

(99) 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](http://www.cfsc.com.cn)

(100) 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 座第 4、第 18-21 层



法定代表人：高涛

联系人：万玉琳

电话：0755-82026907

客服电话：95532；400-600-8008

网址：[www.china-invs.cn](http://www.china-invs.cn)

(101) 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

电话：0755- 82570586

客服电话：4001-022-011

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

(102) 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)

(103) 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：周俊

电话：0451-85863726

客服电话：400-666-2288

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



(104) 九州证券股份有限公司

注册地址：青海省西宁市城中区西大街 11 号

办公地址：深圳市福田区民田路新华保险大厦 18 楼

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

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)

(105) 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

电话：028-86690057、028-86690058

客服电话：95310

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

(106) 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

电话：010-59355930

客服电话：4008895618

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

(107) 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

电话：0755-83007159

客服电话：4008-188-688

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

（108）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

联系人：李慧灵

电话：010-85556100

客服电话：95390;400-898-9999

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

（109）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)

（110）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/>

(111) 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>

(112) 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>

(113) 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

联系人：袁伟涛

电话：029-63387289

客服电话：400-860-8866

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

本基金获证监会批准募集后根据实际签订的代销情况，再行补充。

基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，



并及时公告。

(二) 注册登记机构

名称：金鹰基金管理有限公司

注册地址：广东省珠海市吉大九洲大道东段商业银行大厦 7 楼 16 单元

办公地址：广东省广州市天河区珠江新城珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

法定代表人：凌富华

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《关于核准金鹰元安保本混合型证券投资基金募集的批复》（证监许可【2013】254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2013年4月15日起公开募集，并于2013年5月15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2013年5月20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，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。

## 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及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) 申购的开始时间

本基金自基金合同生效日后不超过 3 个月时间内开始办理申购，具体开始办理时间在本基金开放申购公告中规定。

#### (3) 赎回的开始时间

本基金自基金合同生效日后不超过 3 个月时间内开始办理赎回，具体开始办理赎回时间在本基金开放赎回公告中规定。

(4) 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。

(5) 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；

(%) 基金管理人可根据基金运作的实际情况并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. 份额分类

本基金将分设 A 类和 C 类两类基金份额，并分别设置基金代码，投资者申购时可以自主



选择与 A 类（基金代码：000110）或 C 类（基金代码：002513）份额相对应的基金代码进行申购。由于基金费用不同，本基金两类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。

## 2. 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。

## 3. 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。

## 4. 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时（含定期定额申购），申购最低金额为 1 元（含申购费，如有），超过部分不设最低级差限制。赎回本基金时，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。

（2）投资者通过本公司网上交易平台申购本基金时（含定期定额申购），申购最低金额为 10 元（含申购费，如有），超过部分不设最低级差限制。赎回本基金时，赎回最低份额为 10 份，持有基金份额不足 10 份时发起赎回需全部赎回。

（3）投资者通过本公司直销中心柜台申购赎回的，申购最低金额（含申购费，如有）为 5 万元（含申购费，如有）。赎回本基金时，赎回最低份额为 1 份，持有基金份额不足 1 份时发起赎回需全部赎回。

（4）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。

（5）基金管理人可与其他销售机构约定，对投资者通过其他销售机构办理基金申购与赎回的，其他销售机构可以按照委托协议的相关规定办理，不必遵守以上限制。

### 2、A 份额的申购赎回费率

#### （1）申购费率：

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

申购费率如下：

| 申购金额（万元）      | 申购费率 |
|---------------|------|
| A < 100       | 1.0% |
| 100 ≤ A < 300 | 0.8% |



|                    |           |
|--------------------|-----------|
| $300 \leq A < 500$ | 0.6%      |
| $A \geq 500$       | 每笔 1000 元 |

注：上表中，A 为投资者申购金额。

## (2) 赎回费率

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

| 持有期（计为 T）                  | 赎回费率 |
|----------------------------|------|
| $T < 1$ 年                  | 2%   |
| $1 \text{ 年} \leq T < 2$ 年 | 1.6% |
| $T \geq 2$ 年               | 0%   |

本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，不低于赎回费总额 25% 的部分归基金财产所有，其余部分用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

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

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

## 3、B 份额的申购赎回费率

### (1) 本基金 C 类基金份额的申购费率：

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

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

注：上表中，A 为投资者申购金额。

### (2) 本基金 C 类基金份额的赎回费率如下：



| 持有期（计为 T） | 赎回费率 |
|-----------|------|
| T < 30 天  | 0.5% |
| T ≥ 30 天  | 0    |

持续持有期少于 30 日的投资人收取的赎回费，将全额计入基金财产。

C 类基金份额持有人赎回时，基金管理人按“后进先出”的原则，对该持有人账户在该销售机构托管的基金份额进行处理，即注册登记确认日期在前的基金份额后赎回，注册登记确认日期在后的基金份额先赎回，以确定被赎回基金份额的持有期限和所适用的赎回费率。

(3) 本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.1%。

#### 4、申购份额的计算方法

净申购金额 = 申购金额 / [1 + 申购费率]

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日基金份额净值

以上计算结果（包括申购份额）以截尾法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 1.0800 元。该笔申购的申购费用及获得的申购份额计算如下：

净申购金额 = 10,000 / [1 + 1.0%] = 9,900.99 元

申购费用 = 10,000 - 9,900.99 = 99.01 元

申购份额 = 9,900.99 / 1.0800 = 9167.58 份

#### 5、赎回金额的计算

投资人赎回本基金的金额为赎回总额扣减赎回费用。其中：

赎回总额 = 赎回份数 × T 日基金份额净值

赎回费用 = 赎回总额 × 赎回费率

赎回金额 = 赎回总额 - 赎回费用

上述计算结果均按截尾法，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 1.0800 元，该日赎回适用的赎回费率为 1.6%，则投资人获得的赎回金额计算如下：



赎回总额=10,000×1.1=10,800 元

赎回费用=10,800×1.6%=172.8 元

赎回金额=10,800-172.8=10627.2 元

## 6、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：

T 日基金份额净值=T 日基金资产净值/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。

（3）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资产净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额 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转；
- (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、其它情况

- (1) 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。
- (2) 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他开放式基金份额的行为。

基金管理人在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 天至少在一种中国证监会指定的媒体上刊登公告并按有关规定报中国证监会备案。

本基金 A 类和 C 类基金份额之间不开通转换业务。

## 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、捐赠和司法强制执行, 及基金注册与过户登记人认可的其他行为。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) “司法强制执行”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、办理说明

(1) 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。

(2) 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

在保本周期到期日，本基金的保本额为：过渡期申购并持有到期的基金份额在当期保本周期之份额折算日的资产净值，以及上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额在当期保本周期之份额折算日的资产净值。

在保本周期到期日：

如基金份额持有人过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额的可赎回金额加上其过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额在当期保本周期内的累计分红款项之和低于其过渡期申购并持有到期的基金份额的保本额、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额的保本额，则由基金管理人或保本义务人将该差额支付给基金份额持有人。



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。

基金份额持有人未持有到期而赎回或转换转出的基金份额，或基金份额持有人在保本周期内申购或转换转入的基金份额，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。

## （二）保本周期

2 年。

本基金的第二个保本周期自本基金第二个保本周期起始日起至 2 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。

保本周期届满时，在符合保本基金存续条件下（符合法律法规有关担保人或保本义务人资质要求、并经基金管理人认可的其他机构，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），本基金继续存续并进入下一保本周期，该保本周期仍为 2 年，具体起讫日期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“金鹰元安债券型证券投资基金”。

## （三）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）对于过渡期申购并持有到期、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的份额，基金份额持有人无论选择赎回、转换为基金管理人管理的其他基金、本基金转入下一保本周期或是转型为“金鹰元安债券型证券投资基金”，均适用保本条款。

## （四）不适用保本条款的情形

（1）基金份额持有人过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的



基金份额的可赎回金额加上其过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额在当期保本周期内的累计分红款项之和不低于其过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额的保本额；

(2) 基金份额持有人过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期，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或转换转入的基金份额；

(4) 在保本周期内《基金合同》规定的不享受保本的情形。

(5) 在保本周期内发生《基金合同》规定的《基金合同》终止的情形；

(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。

#### **(五) 保本责任的担保**

为确保履行保本条款，保障基金份额持有人利益，本基金为履行保本责任提供担保人，就基金管理人对该条款的履行提供不可撤销的连带清偿责任担保。

## **十五、基金保本的保证**

### **(一) 基金保本**

本部分所述基金保本的保证责任仅适用于本基金第二个保本周期。自第二个保本周期起的后续各保本周期的保本保障机制，由基金管理人与担保人或保本义务人届时签订的《保证合同》或《风险买断合同》决定，并由基金管理人在该保本周期开始前公告；基金份额持有人购买基金份额的行为视为同意和接受届时按本基金合同约定披露的有效保证合同或风险买断合同的约定。

就本基金第二个保本周期而言，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；本基金第二个保本周期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本招募说明书第五部分“基金担保人”相关内容。

## （二）保证合同及担保期

担保人与基金管理人签订《金鹰元安保本混合型证券投资基金第二个保本周期保证合同》（全文详见附件，本节以下简称《保证合同》）。基金份额持有人购买基金份额的行为视为同意《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其保本额的金额。

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 20 亿元人民币。

## （三）例外情形处置

保本周期内，担保人出现足以影响其履行《保证合同》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介上公告上述情形。当确定担保人丧失履行《保证合同》项下担保责任能力或宣告破产的情况下，基金管理人应在接到通知之日起 60 日内召集基金份额持有人大会，就如下事项进行表决：

- （1）更换担保人；
- （2）变更基金类别；
- （3）《基金合同》终止；
- （4）法律法规或中国证监会规定的其他事项。





#### **(四) 更换担保人**

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介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。

#### **(五) 保本赔付差额的赔付**

如果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累计分红金额之和低于其保本额(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 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），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。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。担保人承担担保责任的最高限额不超过 20 亿元人民币。

#### （六）担保人责任

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；

（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）赎回或转换转出的基金份额；

（3）基金份额持有人在第二个保本周期内申购或转换转入的基金份额；

（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，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；

(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。

#### **（七）转入下一保本周期**

保本周期届满时，符合法律法规有关担保人或保本义务人资质要求、并经基金管理人认可的其他机构，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“金鹰元安债券型证券投资基金”，担保人不再为该债券型基金承担担保责任。

#### **（八）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，按年度支付。

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基金合同生效日起，至担保人解除保证责任之日或保本周期到期日较早者止，起始日及终止日均应计入期间。

#### **（九）担保合同**

基金管理人可在指定媒介上公告其出具的《金鹰元安保本混合型证券投资基金保证合



同》。

#### **(十)《保证合同》的主要内容**

详见附件《保证合同》。

## **十六、基金的投资**

### **(一) 保本周期内的投资**

#### **1、投资目标**

本基金运用投资组合保险策略,严格控制投资风险,在为符合保本条件的投资金额提供保本保障的基础上,力争在保本周期到期时实现基金资产的稳健增值。

#### **2、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,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相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金按照固定比例组合保险策略将投资对象主要分为安全资产和风险资产,其中安全资产为国内依法公开发行的各类债券(包括国债、央行票据、公司债、企业债、短期融资券、资产支持证券、可转换债券、分离交易可转债和债券回购等)、银行存款等固定收益类金融工具。本基金投资的风险资产为股票、权证等权益类金融工具。

本基金按照固定比例组合保险策略对各类金融工具的投资比例进行动态调整。其中,



股票、权证等风险资产占基金资产的比例不超过 40%；债券、货币市场工具等安全资产占基金资产的比例不低于 60%，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%。

### 3、投资策略

本基金在投资组合管理过程中采取主动投资方法，通过数量化方法严格控制风险，并通过有效的资产配置策略，动态调整安全资产和风险资产的投资比例，以确保保本周期到期时实现基金资产的稳健增值。

#### (1) 保本策略

本基金采用固定比例组合保险策略（CPPI），该策略是国际通行的一种投资组合保险策略。其基本原理是将基金资产按一定比例划分为安全资产和风险资产，其中安全资产遵循保本要求将投资于各类债券及银行存款，以保证投资本金的安全性，进而起到到期保本的效果；而除安全资产外的风险资产主要投资于股票、权证等权益类资产，以提升基金投资者的收益。具体的比例确认方式如下：

1) 根据基金资产的期末最低保本额和根据安全资产平均到期收益率确定的合理贴现率计算当前基金资产的价值底线；

2) 根据价值底线计算基金资产的安全垫，即最大止损额；

3) 按照优选的风险乘数将安全垫放大，将该部分投资于风险资产，其余资产投资于安全资产。

假设本基金保本期结束时的保本额度为： $V_{ur}$ ，当前时点距离保本周期到期日的时间长度为  $T$  期，期间安全资产的连续时间收益率为  $r$ ，则本基金组合的价值底线为： $V = V_{ur} \times e^{-rT}$ ，假设当前时刻（ $t$ ）基金资产净值为  $V_t$ ，则基金资产的安全垫为  $V_t - V$

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

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

投资于安全资产的额度为： $B_t = V_t - S_t$

本基金通过数量分析，根据市场的波动来动态调整风险资产的风险乘数，以确保投资组合在一段时间以后的价值不低于事先设定的目标价值，从而达到对投资组合保值增值的目的。



## (2) 资产配置策略

### 1) 大类资产的配置策略

本基金采用固定比例组合保险策略进行投资,其中风险乘数对于确定风险资产和安全资产的配置额具有相当重要的作用。风险资产主要以权益类资产为代表,安全资产主要以固定收益类资产为代表。故本基金以风险乘数的设定作为大类资产配置的关键变量。

本基金综合考虑国内外政治经济环境、资本市场运行状况、固定收益类与权益类资产风险收益特征、基金净资产和价值底线等因素,结合资产配置研究结果和市场运行状态,动态调整安全资产和风险资产的配置比例,力争在确保本金安全的前提下,稳健获取投资收益。

### 2) 债券类资产的配置策略

为实现基金资产的本金保障目标,本基金的部分债券类资产按照剩余存续期与本基金剩余保本期限匹配的原则,采取买入并持有的长期投资策略,以回避利率风险以及再投资风险;对于此类配置着重考虑债券的信用风险、到期收益率以及剩余期限是否与剩余保本期限匹配等因素。同时为保证基金的流动性及更高的收益率,本基金小部分债券类资产将采取主动灵活的配置策略,积极布局各类债券资产,以追求更高的收益率。

#### ①债券类资产的期限配置

本基金根据宏观经济走势、CPI 与利率变化、央行货币政策、财政政策、剩余保本期等因素,通过审慎分析与测算,确定最优的债券组合久期。当预期利率下降时,适当延长久期,以分享债券的上涨收益;当预期利率上升时,适当缩短久期,以规避债券的下跌风险。

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,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

本基金通过分析宏观经济走势、利率的变动趋势、各类债券的收益率水平与流动性、基金申购与赎回的情况以及股票市场的运行状况,确定国债、央票、金融债、信用债等大类债券市值占基金债券类资产总市值的相对比例,以获取不同债券类属之间利差变化所带来潜在投资收益。

#### ③债券品种选择

为保障本基金本金安全、防范信用风险,本基金将在严格的内部评级基础上选择债券品种。通过严格的内部评级,挑选金融债、企业债、公司债、资产支持证券、短期融资券等券



种。

#### A、国债与央票

本基金对国债与央行票据原则上采取买入并持有的投资策略。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。

#### B、金融债

在内部评级的基础上，本基金将根据未来宏观经济走势、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。

#### C、普通企业债与公司债

本基金根据债券的信用评级、债券市场收益率数据，并结合流动性、息票率、税赋、提前偿付与赎回等因素，运用债券定价模型对单个债券进行估值，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。

#### D、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，作为此类债券估值的主要依据。

可转换公司债券同时具有股票特性与债券特性，确保基金最低资产价值底线不被击破，同时避免在市场处于熊市末端因基金资产完全转变为债券资产而丧失市场随后反转的投资机遇。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、未来宏观经济走势以及股票市场运行趋势，来鉴别可转债的期权价值，优先选择期权价值被低估的可转债，以获取投资收益。

#### E、资产支持证券

本基金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



基础性资产的提前偿还率、违约率、资产池结构。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变动，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。

#### F、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，积极参与债券回购交易，放大固定收益类资产投资比例，追求债券资产的超额收益。

#### 3) 货币市场类资产的配置策略

根据宏观经济走势、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，各类货币市场工具的流动性、收益率的变化，确定本基金配置在现金、活期存款及1年期以下存款（含1年期），1年期以上存款上的资金量占货币类资产总量的相对比例，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，严格控制货币市场类资产的加权平均剩余期限。

#### 4) 股票资产的配置策略

本基金着重于对股市趋势的研究，在股票投资限额之下，发挥择时能力，控制股票市场下跌风险，分享股票市场成长收益。

##### ①股票一级市场申购策略

本基金通过对首次发行股票(IPO)及增发新股的上市公司基本面因素进行定性与定量分析，结合股票市场整体定价水平、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以及拟参与申购的新股之实际发行规模，估计中签率，测算该次新股申购的预期收益率，从而制定相应的新股申购策略。

##### ②股票二级市场投资策略

基金管理人将把握股票市场出现的趋势性或结构性投资机会，在《基金合同》约定范围内直接投资二级股票市场，努力获取超额收益。在股票投资方面，将遵循稳健和灵活兼顾的投资思路。

基金管理人在剔除流动性差或公司经营存在重大问题且近期无解决方案的上市公司股票后，形成股票初选库。在稳健投资方面，选取现金流充沛、行业竞争优势明显、具有良好





现金分红记录或分红潜力的优质公司作为主要投资目标。在灵活投资方面，以主题投资为主线，着重投资于在中国经济增长过程和股票市场发展中有代表性的投资主题所覆盖的优质上市公司股票。

### ③风格追踪

本基金将密切追踪大盘股与中小盘股、成长股与价值股、低价股与高价股、低PB与高PB等不同市场风格股票的切换，关注地理区域板块、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。

### ④个股选择

本基金将坚持价值投资理念，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，以基本面分析为核心，力求挖掘出具有长期增长能力的价值低估型公司的股票，买入并长期持有，将中国经济长期增长的潜力最大程度地转化为投资者的稳定收益。

### 5) 权证投资策略

本基金将因为上市公司进行增发、配售以及投资分离交易的可转换公司债券等原因被动获得权证，或者在进行套利交易、避险交易以及权证价值严重低估等情形下投资权证。

本基金将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上，充分考虑其收益性、流动性及风险性特征，并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；继而构建套利交易、避险交易组合以及投资价值显著低估的权证品种。

## 4、业绩比较基准

### 2 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 2 年期银行定期存款利率（税后）；并随着 2 年期银行定期存款利率的调整而动态调整。

本基金选择 2 年期银行定期存款利率（税后）作为业绩比较基准，主要理由：

(1) 与本基金的保本期限相同。本基金的保本期为 2 年，对于认购本基金的投资者而言，将持有到保本期末时的收益率与另一个可替代的投资方向——2 年期银行定期存款利率（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。



如果今后法律法规发生变化,推出更具权威性的业绩比较基准或者市场出现更加适用于本基金的业绩比较基准时,本基金将与托管人协商一致后,报中国证监会备案变更业绩比较基准并及时公告。

## 5、风险收益特征

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

### (二) 变更后的“金鹰元安债券型证券投资基金”的投资

#### 1、投资目标

在控制风险与保持资产流动性的前提下,通过对资本市场运行趋势的判断和严格的信用分析,追求基金资产的长期稳健增值,力争获得超越业绩比较基准的投资回报。

#### 2、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,主要投资于国债、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、中小企业私募债券、货币市场工具等固定收益类证券品种、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)、权证,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)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

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)等权益类资产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。





### 3、投资策略

#### (1) 大类资产配置策略

本基金变更为“金鹰元安债券型证券投资基金”后,在大类资产配置比例上将不再遵守保本周期内适用的固定比例组合保险策略投资策略。

本基金采用自上而下与自下而上相结合的投资策略,灵活确定大类资产配置比例,并将实际运作中根据证券市场走势以及本基金业绩表现不断对大类资产配置比例进行调整,在科学分析与有效管理信用风险的基础上,实现风险与收益的最佳配比。

#### (2) 债券类资产配置策略

##### 1) 债券类资产的期限配置

本基金根据宏观经济走势、CPI 与利率变化、央行货币政策、剩余保本期等因素,通过审慎分析与测算,确定投资组合的加权平均久期。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。

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,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

本基金通过分析宏观经济走势、利率的变动趋势、各类债券的收益率水平与流动性、基金申购与赎回的情况以及股票市场的运行状况,确定国债、央票、金融债、信用债等大类债券市值占基金债券类资产总市值的相对比例,以获取不同债券类属之间利差变化所带来潜在投资收益。

##### 3) 债券品种选择

本基金将在严格的内部评级基础上选择债券品种。通过严格的内部评级,挑选政府债券、央票、金融债、信用债券、可转换债券等券种。

##### A、国债与央票

本基金对国债与央行票据原则上采取买入并持有的投资策略。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。

#### B、金融债

在内部评级的基础上，本基金将根据未来宏观经济走势、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。

#### C、普通信用债券

普通信用债包括企业债、公司债、金融债（政策性金融债除外）、地方政府债、短期融资券、中期票据、次级债券、中小企业私募债券等普通债权形式的非国家信用担保的固定收益类金融工具。本基金对普通信用债券的投资，将根据债券的信用评级（内部评级与外部评级）、信用利差分析，并结合流动性、息票率、税赋、提前偿付与赎回等因素，选择具有比较优势的品种进行投资。

同时本基金将对债券的信用风险和信用利差进行持续评估，预判整体与个券的信用利差曲线走势，据此对本基金的信用债配置比例和个券构成进行调节，优化组合收益。

对于中小企业私募债券的投资，在审慎评估中小企业私募债券信用风险和信用利差的基础上，本基金还将结合中小企业私募债券的流动性状况、到期期限、本基金申赎情况、可交易对手的数量和分布结构，合理确定本基金中小企业私募债券的投资比例和持有中小企业私募债券的期限分布和平均久期，以在获取中小企业私募债券收益的同时，维持本基金的流动性。

#### D、可转换公司债券

可转换公司债券同时具有股票特性与债券特性，确保基金最低资产价值底线不被击破，同时避免在市场处于熊市末端因基金资产完全转变为债券资产而丧失市场随后反转的投资机遇。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、未来宏观经济走势以及股票市场运行趋势，来鉴别可转债的期权价值，优先选择期权价值被低估的可转债，以获取投资收益。

#### E、资产支持证券

本基金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提前偿还率、违约率、资产池结构。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变动，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。

#### 4) 债券交易策略

在债券配置策略外，本基金亦将根据宏观经济运行状况、证券市场走势、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，以争取更大的投资回报。本基金的交易策略包括但不限于：

##### A、跨市场套利策略

跨市场套利是针对因投资主体、交易方式等不同而导致相同的投资品种在各细分投资市场之间存在的价差而进行套利操作，以获得投资收益。

债券市场分为银行间市场和交易所市场两个子市场，两个子市场的投资群体、交易方式不尽相同，造成一定程度的市场分割、信息不对称，可能会造成市场在短期内的非有效性，导致两个市场的资金价格在一定期间内可能存在定价偏离；两个市场的非有效性为本基金提供了一定的套利机会。在充分论证这种套利机会可行性的基础上，基金将寻找最佳时机，实施跨市场套利策略，积极把握市场当中出现的套利机会。

由于新股、新债发行以及季节效应等因素会使市场资金供求关系短期内发生变化，这种变化很可能引发市场短期收益率的上升，本基金将积极利用这种机会获得投资收益。

##### B、跨品种套利策略

跨品种套利是针对各品种间因流动性、税收等因素的不同而导致的资产定价偏离进行套利操作，以获得投资收益。由于不同投资群体对于流动性、税收等因素的不同偏好，可能会造成发行条件相似的品种之内在价值发生明显偏离，本基金将在保持流动性的基础上，进行品种间的套利操作。

基于本基金研判分析结果，识别出被市场错误定价的债券，进而采取适当的交易方式以获取收益。一方面，可通过利率期限结构分析，在现金流特征相近且处于同一风险等级的多只债券品种中寻找价值被高估或低估的品种；另一方面，通过分析债券的信用等级、债券息票率、发债企业所处行业的属性等因素，评估判断风险债券与无风险债券间的合理息差。

##### C、跨期限套利策略

由于投资群体的差异、信息不对称、投资者对于某种期限的偏好等因素可能会造成市场对于不同期限的相似投资标的错误定价，本基金将在保持流动性的基础上，实施跨期限套利，以获取投资收益。



#### D、回购策略

当预期市场利率下跌或走势平稳时，将债券进行正回购，融资后再购买票息较高债券，若融资成本低于所购入债券的票息，该策略便可实现正收益。

根据市场利率的波动性特征，利用市场时机（例如：季节性因素、突发事件等）造成的短期市场失衡带来的交易机会，获取投资收益。比如在季末或新股发行时，利用市场资金面趋紧、利率走高时机进行逆回购。

#### E、一级市场参与策略

积极参与债券、票据等品种的一级市场投标，以求突破二级市场建仓时的流动性限制与冲击成本；同时，还可以获取一级市场与二级市场间的价差，扩大盈利空间。本基金将基于二级市场的收益水平和市场资金面的状况，对一级市场的招标利率进行预测，以确定本基金的投标价。

##### （3）股票资产的配置策略

本基金着重于对股市趋势的研究，在股票投资限额之下，发挥择时能力，控制股票市场下跌风险，分享股票市场成长收益。

##### 1) 股票一级市场申购策略

本基金通过对首次发行股票(IPO)及增发新股的上市公司基本面因素进行定性与定量分析，结合股票市场整体定价水平、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以及拟参与申购的新股之实际发行规模，估计中签率，测算该次新股申购的预期收益率，从而制定相应的新股申购策略。

##### 2) 股票二级市场投资策略

基金管理人将把握股票市场出现的趋势性或结构性投资机会，在《基金合同》约定范围内直接投资二级股票市场，努力获取超额收益。在股票投资方面，将遵循稳健和灵活兼顾的投资思路。

基金管理人在剔除流动性差或公司经营存在重大问题且近期无解决方案的上市公司股票后，形成股票初选库。在稳健投资方面，选取现金流充沛、行业竞争优势明显、具有良好现金分红记录或分红潜力的优质公司作为主要投资目标。在灵活投资方面，以主题投资为主线，着重投资于在中国经济增长过程和股票市场发展中有代表性的投资主题所覆盖的优质上市公司股票。



### 3) 风格追踪

本基金将密切追踪大盘股与中小盘股、成长股与价值股、低价股与高价股、低PB与高PB等不同市场风格股票的切换,关注地理区域板块、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。

### 4) 个股选择

本基金将坚持价值投资理念,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,以基本面分析为核心,力求挖掘出具有长期增长能力的价值低估型公司的股票,买入并长期持有,将中国经济长期增长的潜力最大程度地转化为投资者的稳定收益。

#### (4) 权证投资策略

本基金将因为上市公司进行增发、配售以及投资分离交易的可转换公司债券等原因被动获得权证,或者在进行套利交易、避险交易以及权证价值严重低估等情形下投资权证。

本基金将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上,充分考虑其收益性、流动性及风险性特征,并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;继而构建套利交易、避险交易组合以及投资价值显著低估的权证品种。

#### (5) 其他创新或者衍生产品的投资策略

本基金将根据基金的特点和要求,结合创新或者衍生产品的特征,在进行充分风险控制和严格遵守法律法规的前提下,制定合适的投资策略进行该类产品的投资。

## 4、业绩比较基准

本基金业绩比较基准:

中国债券综合指数(全价)×90%+沪深300指数×10%。

本基金选择中国债券综合指数(全价)作为业绩比较基准,主要理由是:

(1) 样本债券涵盖的范围广。中国债券综合指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的中国全市场债券指数,除了美元债、资产支持证券和部分在交易所发行上市的债券以外,其他所有债券均纳入样本债券范围,且待偿期在一年以内的债券亦进入指数样本券,能够较好地反映债券市场整体状况。中国债券综合指数样本债券涵盖的范围与本基金可投资的债券类属基本一致;



(2) 时间序列完整。其全价指数序列、净价指数序列、平均市值法到期收益率等一系列指标的起始时间点均为 2002 年 1 月 4 日，较长的时间序列有利于本基金更加深入地研究和分析债券市场。

沪深 300 指数由中证指数公司编制并发布，指数样本覆盖了沪深两地大部分流通市值，成分股均为 A 股市场中代表性强且流动性高的主流投资股票，能够反映中国证券市场股票价格变动的概貌和运行状况，适合作为本基金权益类资产投资的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的债券指数时，本基金将与托管人协商一致后，报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

#### 5、风险收益特征

本基金为债券型基金，属于证券投资基金当中风险较低的品种，其长期平均风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金，高于货币市场基金。

### (三) 投资禁止行为与限制

#### 1、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- (1) 承销证券；
- (2) 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，但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外；
- (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、行政法规和国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

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投资限制：

(1) 在保本周期内，本基金股票、权证占基金资产的比例不超过 40%，债券等固定收益类品种占基金资产的比例不低于 60%；若本基金变更为“金鹰元安债券型证券投资基金”后，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、权证等其他金融工具的投资比例不超过基金资产的 20%；

(2) 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；

(3) 本基金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%；

(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

(5) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

(6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

(7) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

(8) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

(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) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。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 3 个月内予以全部卖出；

(13) 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的总资产，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；

(14) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

(15) 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；



(16) 一只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%；一只基金持有的所有流通受限证券，其市值不得超过该基金资产净值的 10%；经基金管理人和托管人协商，可对以上比例进行调整；

(17) 本基金若变更为“金鹰元安债券型证券投资基金”后，持有单只中小企业私募债券的市值不超过本基金资产净值的 10%。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

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。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

#### **(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。





本基金的托管人根据本基金合同的规定，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 9 月 30 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              | 36,342,115.44  | 3.67         |
|    | 其中：股票             | 36,342,115.44  | 3.67         |
| 2  | 固定收益投资            | 702,322,120.80 | 70.89        |
|    | 其中：债券             | 702,322,120.80 | 70.89        |
|    | 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          | 212,242,980.75 | 21.42        |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | 52,242,740.75  | 5.27         |
| 6  | 银行存款和结算备付金合计      | 31,862,341.78  | 3.22         |
| 7  | 其他各项资产            | 7,914,324.96   | 0.80         |
| 8  | 合计                | 990,683,883.73 | 100.00       |

#### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

##### (1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 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              | 23,309,575.44 | 3.27         |
| 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          | 3,024,000.00  | 0.42 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业     | 5,659,740.00  | 0.79 |
| 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      | 817,800.00    | 0.11 |
| 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         | 3,531,000.00  | 0.49 |
| R | 文化、体育和娱乐业       | -             | -    |
| S | 综合              | -             | -    |
|   | 合计              | 36,342,115.44 | 5.09 |

## (2) 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期内未通过沪港通投资股票。

## 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  | 000662 | 天夏智慧  | 250,000   | 6,700,000.00 | 0.94         |
| 2  | 600428 | 中远航运  | 1,003,500 | 5,659,740.00 | 0.79         |
| 3  | 000725 | 京东方 A | 1,900,000 | 4,503,000.00 | 0.63         |
| 4  | 300436 | 广生堂   | 67,000    | 3,855,850.00 | 0.54         |
| 5  | 000778 | 新兴铸管  | 790,000   | 3,744,600.00 | 0.52         |
| 6  | 300347 | 泰格医药  | 110,000   | 3,531,000.00 | 0.49         |
| 7  | 002221 | 东华能源  | 200,000   | 3,024,000.00 | 0.42         |



|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 8  | 300114 | 中航电测 | 90,206  | 2,349,866.30 | 0.33 |
| 9  | 300122 | 智飞生物 | 120,000 | 2,110,800.00 | 0.30 |
| 10 | 300404 | 博济医药 | 20,000  | 817,800.00   | 0.11 |

## 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      | 58,034,600.00  | 8.13         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | -              | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -              | -            |
| 4  | 企业债券      | 300,605,386.30 | 42.11        |
| 5  | 企业短期融资券   | 50,125,000.00  | 7.02         |
| 6  | 中期票据      | 244,077,000.00 | 34.19        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 215,134.50     | 0.03         |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | 49,265,000.00  | 6.90         |
| 10 | 合计        | 702,322,120.80 | 98.38        |

## 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  | 088040    | 08 铁道 01        | 500,000.00 | 51,610,000.00 | 7.23         |
| 2  | 122324    | 14 国电 01        | 500,000.00 | 51,120,000.00 | 7.16         |
| 3  | 101553018 | 15 联通<br>MTN002 | 500,000.00 | 50,895,000.00 | 7.13         |
| 4  | 122394    | 15 中银债          | 500,000.00 | 50,855,000.00 | 7.12         |
| 5  | 136039    | 15 石化 01        | 500,000.00 | 50,535,000.00 | 7.08         |

## 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

本基金本报告期内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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内暂不投资股指期货。

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

本基金本报告期内暂不投资国债期货。

(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

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   | 163,721.94   |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 7,748,671.07 |
| 5  | 应收申购款   | 1,931.95     |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |



|   |    |              |
|---|----|--------------|
| 9 | 合计 | 7,914,324.96 |
|---|----|--------------|

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 十七、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。本基金托管人复核了基金业绩，且无异议。

本基金业绩经托管人复核无误。

### (一) 业绩比较

本基金合同生效以来（截至2016年9月30日）的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示：

#### 1、元安保本A

| 阶段                       | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|--------------------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 2013. 5. 20-2013. 12. 31 | 0.38%  | 0.23%     | 2.38%      | 0.01%         | -2.00% | 0.22% |
| 2014. 1. 1-2014. 12. 31  | 12.94% | 0.34%     | 3.83%      | 0.01%         | 9.11%  | 0.33% |
| 2015. 1. 1-2015. 12. 31  | 15.82% | 0.22%     | 2.79%      | 0.01%         | 13.03% | 0.21% |
| 2016. 1. 1-2016. 9. 30   | 0.13%  | 0.16%     | 1.59%      | 0.01%         | -1.46% | 0.15% |
| 2013. 5. 20-2016. 9. 30  | 31.48% | 0.25%     | 11.01%     | 0.01%         | 20.47% | 0.24% |

#### 2、元安保本C

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|

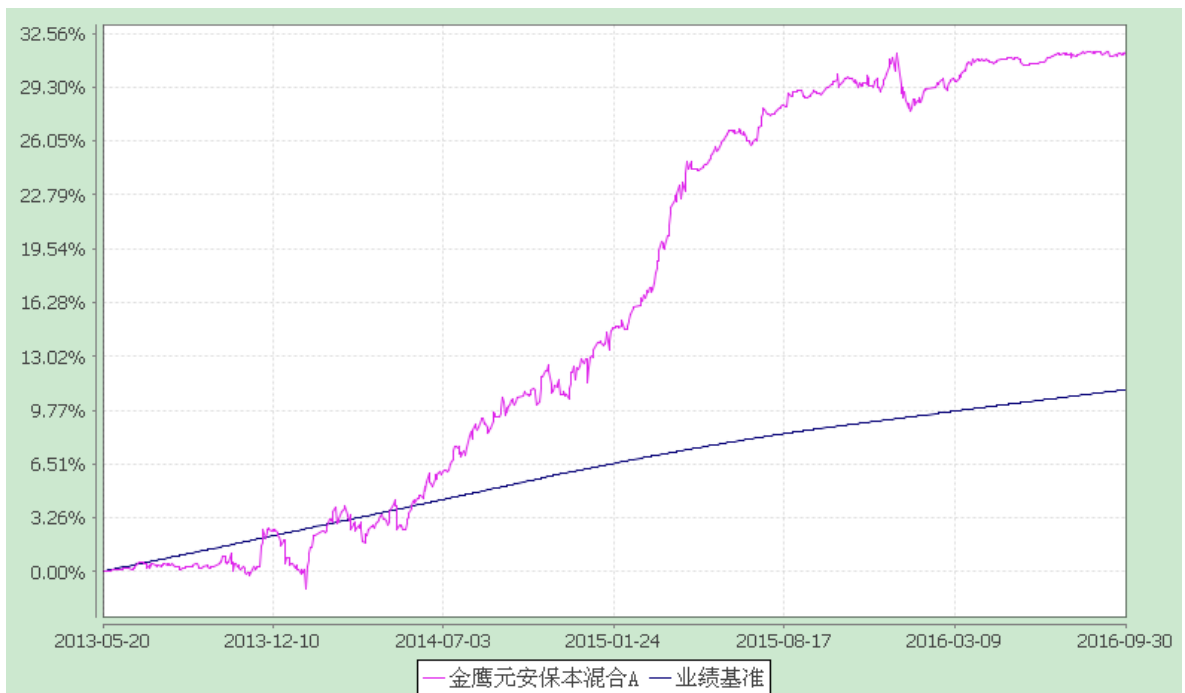


| 阶段                      | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④   |
|-------------------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 2016. 3. 10-2016. 9. 30 | 0.25%  | 0.04%     | 1.20%      | 0.01%         | -0.95% | 0.03% |

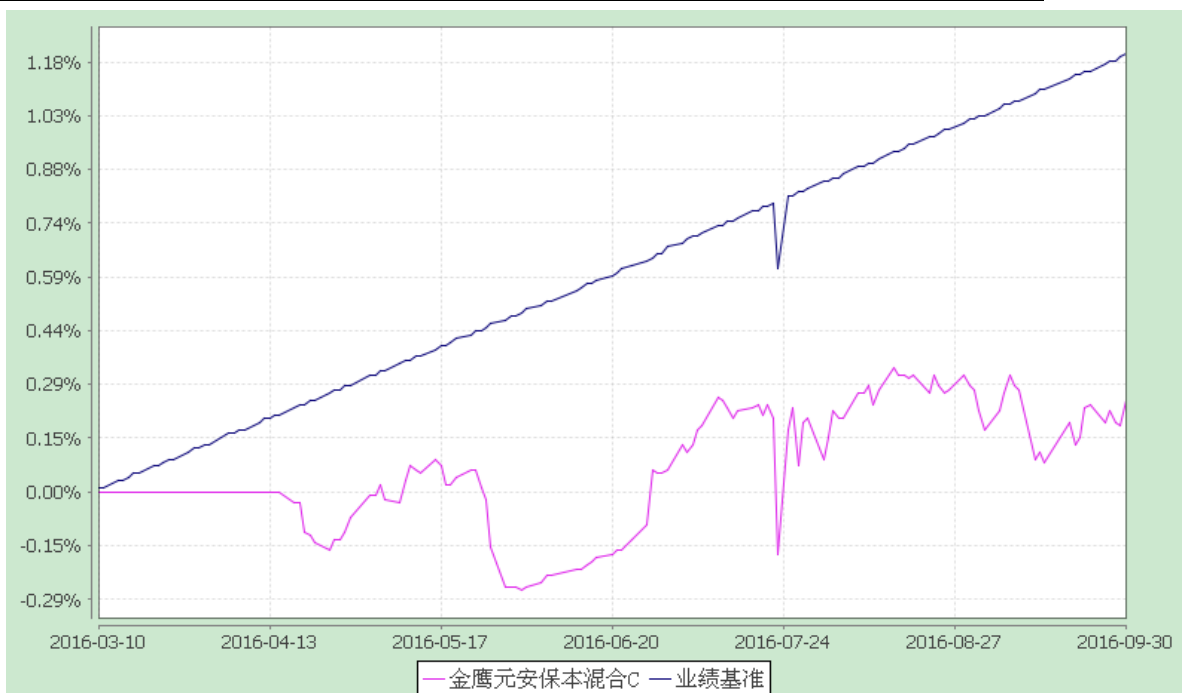
## (二) 增长率走势

金鹰元安保本混合型证券投资基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2013 年 5 月 20 日至 2016 年 9 月 30 日)

### 1. 金鹰元安保本混合 A:



### 2. 金鹰元安保本混合 C:



注：（1）本基金合同生效日期为2013年5月20日。（2）本基金于2015年5月28日起转入第二个保本周期运作，各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。（3）元安保本C2016年3月10日设立。（4）本基金的业绩比较基准为：2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、基金资产的估值

## (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

（1）、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

（2）基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

## （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或第三方估值机构提供的相应品种估值净价估值，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价或第三方估值机构提供的相应品种估值净价估值。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）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或第三方估值机构提供的相应品种估值净价进行估值；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或第三方估值机构提供的相应品种估值净价进行估值。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、其它情形

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。

(1) 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。

(2) 在证券交易所进行转让的非公开发行的中小企业私募债券，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。



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。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，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。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，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见，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

## （六）估值错误的处理

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。当基金份额净值小数点后 4 位以内（含第 4 位）发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

### 1、估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述估值错误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。

### 2、估值错误处理原则

（1）估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任。



责任；若估值错误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。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。

(2) 估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

(3) 因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。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”)，则估值错误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估值错误责任方。

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明估值错误发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方；

(2) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；

(3) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基金登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

### 4、基金份额净值估值错误处理的方法

(1) 基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2) 错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；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。



(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

### **(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) 基金净值的确认**

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，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额净值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净值予以公布。

### **(九) 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资产净值的1.2%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的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 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

在保本周期内，本基金的担保费用从基金管理人的管理费收入中列支。

### (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资产净值的0.2%年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的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 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休



日等, 支付日期顺延。

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“金鹰元安债券型证券投资基金”的基金份额, 管理费按前一日基金资产净值的0.75%的年费率计提, 托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。计算方法同上。

(3) 本条第(一)款第一条第(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、费用确定

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、费率调整

基金管理人可以在基金合同规定的范围内调整上述费率。上述费率如发生变更, 基金管





理人应按照《信息披露办法》或其他相关规定于新的费率实施前在至少一种指定媒体公告。调整后的上述费率还应在最新的招募说明书中列示。

基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划, 针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间, 基金管理人在与托管人协商一致后可以 对促销活动范围内的投资者调低基金申购、赎回费率, 并报中国证监会备案。

### (三) 税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体, 依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

## 二十一、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、分红原则

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 80%, 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；投资者可以在不同销售机构对本基金设置为相同的分红方式，亦可设置为不同的分红方式，即同一基金账户对本基金在各销售机构设置的分红方式相互独立、互不影响。

### 3、补充说明

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；

- (1) 每一基金份额享有同等分配权；
- (2) 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

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。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) 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**

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 50%;
- (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 30%;
- (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 0.5%;
- (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“金鹰元安债券型证券投资基金”，基金管理人将在临时公告或《金鹰元安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。

本基金若变更为“金鹰元安债券型证券投资基金”后，基金管理人应在本基金投资中小企业私募债券后两个交易日内，在中国证监会指定媒体披露所投资中小企业私募债券的名称、数量、期限、收益率等信息，并在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露中小企业私募债券的投资情况。

## 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。

### （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，保本周期为二年，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，也将会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）本基金过渡期内暂停办理日常赎回和转换出业务。因此，基金份额持有人存在该区间内无法全部或部分赎回其持有的本基金基金份额或将相应基金份额全部或部分转换入本基金管理人管理的其他基金的风险。

此外，依照基金合同的约定，本基金若变更为“金鹰元安债券型证券投资基金”后，将可投资于中小企业私募债券，受其低流动性和较高信用风险的影响，相对于普通的债券型基金，届时本基金面临相对较高的流动性风险和信用风险。

## （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，即本基金保本周期届满时，符合法律法规有关担保人或保本义务人资质要求、并经基金管理人认可的其他机构，为本基金下一保本周期提供保本保障，并且基金管理人与之签订《保证合同》或《风险买断合同》，同时本基金满足法律法规和本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、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“金鹰元安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）保本周期到期的处理规则

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。

#### 1、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（含）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，但接受赎回和转换出申请。

（3）在到期操作期间，除无法变现的资产外，基金管理人原则上应使基金财产保持为现金形式，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。



## 2、到期操作

(1) 在本基金保本周期到期操作期间，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1.0000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“金鹰元安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“金鹰元安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操作期间，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“金鹰元安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，在保本周期到期日后的到期操作期间的基金净值波动，由投资者自行承担。

(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）保本周期到期的保本条款

（1）过渡期申购、或从上一保本周期转入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“金鹰元安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）若过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额持有人选择在持有到期后赎回基金份额、转换到本基金管理人管理的其他基金，或者选择或默认选择转入下一保本周期的基金份额或继续持有转型后的“金鹰元安债券型证券投资基金”的基金份额，而相应基金份额的可赎回金额加上其当期保本周期内的累计分红金额之和低于其认购、或过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期基金份额的保本额，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）在到期操作期间，无论采取何种方式作出到期选择，基金份额持有人将自行承担保本周期到期日后（不含保本周期到期日）的基金份额净值波动风险。

### （四）本基金转入下一保本周期的方案

保本周期届满时，符合法律法规有关担保人或保本义务人资质要求、并经基金管理人认可的其他机构，为本基金下一保本周期提供保本保障，并且基金管理人与之签订《保证合同》或《风险买断合同》，同时本基金满足法律法规和本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。

#### 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；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不低于法律法规允许的本基金下一保本周期的募集规模上限，则基金管理人将不设立过渡期申购。

## 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%，具体费率在《招募说明书》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，除无法变现的资产外，基金管理人原则上应使基金财产保持为现金形式，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

如果保本周期到期日基金份额持有人过渡期申购、或从上一保本周期转入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当期保本周期内的累计分红金额之和低于其过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期基金份额的保本额，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。

对于投资者过渡期申购的基金份额，或从上一保本周期转入当期保本周期的基金份额，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 1.0000 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日的，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其保本额，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×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。

#### **（五）转为变更后的“金鹰元安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“金鹰元安债券型证券投资基金”。如果保本期到期日基金份额持有人过渡期申购、或从上一保本周期转入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的当期保本周期内的累计分红金额之和低于过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期基金份额的保本额，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到期操作期间的基金份额，选择或默认选择转为变更后的“金鹰元安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“金鹰元安债券型证券投资基金”的基金份额在“金鹰元安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。

#### **（六）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“金鹰元安债券型证券投资基金”，基金管理人将在临时公告或《金鹰元安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。

#### **（七）保本周期到期的赔付**

（1）在发生保本赔付的情况下，基金管理人在保本周期到期日后 20 个工作日内向基金份额持有人履行保本赔付差额的支付义务；基金管理人不能全额履行保本差额支付义务的，基金管理人应于保本周期到期日后 5 个工作日内向担保人发出书面《履行保证责任通知书》。担保人收到基金管理人发出的《履行保证责任通知书》后 5 个工作日内，将需代偿的金额划



入基金管理人指定的本基金在基金托管人处开立的账户中。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。

(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) 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或保本义务人或保本保障机制,但因担保人或保本义务人发生合并或分立,由合并或分立后的法人或者其他组织承继担保人或保本义务人的权利和义务的除外;

(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“金鹰元安债券型证券投资基金”除外;

(8) 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“金鹰元安债券型证券投资基金”并按《基金合同》约定的“金鹰元安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;

(9) 本基金与其他基金的合并;

(10) 变更基金份额持有人大会召开程序;

(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) 其他可能对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项;

(14) 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。



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“金鹰元安债券型证券投资基金”，并按《基金合同》约定的“金鹰元安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) 保本周期内因担保人或保本义务人发生合并或分立，由合并或分立后的法人或者其他组织承继担保人的权利和义务，或某一个保本周期结束后，更换下一个保本周期的担保人或保本义务人或保本保障机制；
- (8) 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、基金合同变更的持有人大会决议公告

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》及有关法律的规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律的规定，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》及有关法律的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) 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) 严格遵守基金合同中有关保本和保本条款的约定;

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; 如果基金管理人有未执行《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任何原因，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或保本义务人或保本保障机制，但因担保人或保本义务人发生合并或分立，由合并或分立后的法人或者其他组织承继担保人或保本义务人的权利和义务的除外；
  - 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“金鹰元安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“金鹰元安债券型证券投资基金”并按照《基金合同》约定的“金鹰元安债券型证券投资



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) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

14) 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“金鹰元安债券型证券投资基金”，并按照《基金合同》约定的“金鹰元安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) 保本周期内因担保人或保本义务人发生合并或分立，由合并或分立后的法人或者其他组织承继担保人的权利和义务，或某一个保本周期结束后，更换下一个保本周期的担保人或保本义务人或保本保障机制；

8) 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前及时公告。

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。

### （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

在保本周期到期日，本基金的保本额为：过渡期申购并持有到期的基金份额在当期保本周期之份额折算日的资产净值，以及上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额在当期保本周期之份额折算日的资产净值。

在保本周期到期日：

如基金份额持有人过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额的可赎回金额加上其过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额在当期保本周期内的累计分红款项之和低于其过渡期申购并持有到期的基金份额的保本额、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额的保本额，则由基金管理人或保本义务人将该差额支付给基金份额持有人。

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。

基金份额持有人未持有到期而赎回或转换转出的基金份额，或基金份额持有人在保本周期内申购或转换转入的基金份额，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

2 年。

本基金的第二个保本周期自本基金第二个保本周期起始日起至 2 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。

保本周期届满时，在符合保本基金存续条件下（符合法律法规有关担保人或保本义务人资质要求、并经基金管理人认可的其他机构，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），本基金继续存续并进入下一保本周期，该保本周期仍为 2 年，具体起讫日期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“金鹰元安债券型证券投资基金”。

### 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) 对于过渡期申购并持有到期、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的份额，基金份额持有人无论选择赎回、转换为基金管理人管理的其他基金、本基金转入下一保本周期或是转型为“金鹰元安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) 基金份额持有人过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额的可赎回金额加上其过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额在当期保本周期内的累计分红款项之和不低于其过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额的保本额；

(2) 基金份额持有人过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期，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或转换转入的基金份额；

(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；

(6) 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；

(7) 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。

### 5、保本责任的担保

为确保履行保本条款，保障基金份额持有人利益，本基金为履行保本责任提供担保人，



就基金管理人对该条款的履行提供不可撤销的连带清偿责任担保。

#### （四）基金保本的保证

（1）本部分所述基金保本的保证责任仅适用于本基金第二个保本周期。自第二个保本周期起的后续各保本周期的保本保障机制，由基金管理人与担保人或保本义务人届时签订的《保证合同》或《风险买断合同》决定，并由基金管理人在该保本周期开始前公告；基金份额持有人购买基金份额的行为视为同意和接受届时按本基金合同约定披露的有效保证合同或风险买断合同的约定。

就本基金第二个保本周期而言，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；本基金第二个保本周期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本合同第八部分“基金担保人基本情况”。

（2）担保人与基金管理人签订《金鹰元安保本混合型证券投资基金第二个保本周期保证合同》（全文详见附件，本节以下简称《保证合同》）。基金份额持有人购买基金份额的行为视为同意《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其保本额的金额。

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 20 亿元人民币。

（3）保本周期内，担保人出现足以影响其履行《保证合同》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《保证合同》项下担保责任能力或宣告破产的情况下，基金管理人应在接到通知之日起 60 日内召集基金份额持有人大会，就如下事项进行表决：



- 1) 更换担保人;
- 2) 变更基金类别;
- 3) 《基金合同》终止;
- 4) 法律法规或中国证监会规定的其他事项。

(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) 如果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累计分红金额之和低于其保本额 (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 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），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。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。担保人承担担保责任的最高限额不超过 20 亿元人民币。

（6）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；

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）赎回或转换转出的基金份额；

3) 基金份额持有人在第二个保本周期内申购或转换转入的基金份额；

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,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;

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,符合法律法规有关担保人或保本义务人资质要求、并经基金管理人认可的其他机构,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“金鹰元安债券型证券投资基金”,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。

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 $\times$ 0.12% $\times$ 1/当年天数。

担保费的计算期间为基金合同生效日起,至担保人解除保证责任之日或保本周期到期日较早者止,起始日及终止日均应计入期间。

(9) 基金管理人可在指定媒体上公告其出具的《金鹰元安保本混合型证券投资基金保证合同》。

## (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,即本基金保本周期届满时,符合法律法规有关担保人或保本义务人资质要求、并经基金管理人认可的其他机构,为本基金下一保本周期提供保本保障,并且基金管理人与之签订《保证合同》或《风险买断合同》,同时本基金满足法律法规和本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止日期、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“金鹰元安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、保本周期到期的处理规则

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。

### (1) 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(含)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转入业务，但接受赎回和转换出申请。

3) 在到期操作期间，除无法变现的资产外，基金管理人原则上应使基金财产保持为现金形式，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。

### (2) 到期操作

1) 在本基金保本周期到期操作期间，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赎回基金份额；

②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1.0000元；

④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“金鹰元安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“金鹰元安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) 保本周期到期操作期间,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“金鹰元安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,在保本周期到期日后的到期操作期间的基金净值波动,由投资者自行承担。

#### 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、保本周期到期的保本条款

(1) 过渡期申购、或从上一保本周期转入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“金鹰元安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) 若认过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额持有人选择在持有到期后赎回基金份额、转换到本基金管理人管理的其他基金,或者选择或默认选择转入下一保本周期的基金份额或继续持有转型后的“金鹰元安债券型证券投资基金”的基金份额,而相应基金份额的可赎回金额加上其当期保本周期内的累计分红金额之和低于其认购、或过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期基金份额的保本额,



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）在到期操作期间，无论采取何种方式作出到期选择，基金份额持有人将自行承担保本周期到期日后（不含保本周期到期日）的基金份额净值波动风险。

#### 4、本基金转入下一保本周期的方案

保本周期届满时，符合法律法规有关担保人或保本义务人资质要求、并经基金管理人认可的其他机构，为本基金下一保本周期提供保本保障，并且基金管理人与之签订《保证合同》或《风险买断合同》，同时本基金满足法律法规和本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。

##### （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；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不低于法律法规允许的本基金下一保本周期的募集规模上限，则基金管理人将不设立过渡期申购。

##### （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%, 具体费率在《招募说明书》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, 除无法变现的资产外, 基金管理人原则上应使基金财产保持为现金形式, 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

如果保本周期到期日基金份额持有人过渡期申购、或从上一保本周期转入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当期保本周期内的累计分红金额之和低于其过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期基金份额的保本额, 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。

对于投资者过渡期申购的基金份额, 或从上一保本周期转入当期保本周期的基金份额, 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 1.0000 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日的，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其保本额，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。

## 5、转为变更后的“金鹰元安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“金鹰元安债券型证券投资基金”。如果保本期到期日基金份额持有人过渡期申购、或从上一保本周期转入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当期保本周期内的累计分红金额之和低于过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期基金份额的保本额，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到期操作期间的基金份额，选择或默认选择转为变更后的“金鹰元安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“金鹰元安债券型证券投资基金”的基金份额在“金鹰元安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。

## 6、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“金鹰元安债券型证券投资基金”，基金管理人将在临时公告或《金鹰元安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。

## 7、保本周期到期的赔付

(1) 在发生保本赔付的情况下，基金管理人在保本周期到期日后二十个工作日内向基金份额持有人履行保本差额的支付义务；基金管理人不能全额履行保本差额支付义务的，基金管理人应于保本周期到期日后五个工作日内向担保人发出书面《履行保证责任通知书》。担保人收到基金管理人发出的《履行保证责任通知书》后五个工作日内，将需代偿的金额划入基金管理人指定的本基金在基金托管人处开立的账户中。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。

(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。

## (六) 基金的收益与分配

### 1、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。

### 2、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。

### 3、基金收益分配原则

(1) 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 80%，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；投资者可以在不同销售机构对本基金设置为相同的分红方式，亦可设置为不同的分红方式，即同一基金账户对本基金在各销售机构设置的分红方式相互独立、互不影响。

(3) 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；

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 4、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。

#### 5、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。

#### 6、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。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元安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。

在上述(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。

## (七) 基金费用的提取、支付方式与比例

### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.2% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

在保本周期内，本基金的担保费用从基金管理人的管理费收入中列支。

### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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“金鹰元安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。





## **(八) 基金财产的投资方向和投资限制**

### **1、保本周期内的投资目标**

本基金运用投资组合保险策略,严格控制投资风险,在为符合保本条件的投资金额提供保本保障的基础上,力争在保本周期到期时实现基金资产的稳健增值。

### **2、保本周期内的投资范围**

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,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相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金按照固定比例组合保险策略将投资对象主要分为安全资产和风险资产,其中安全资产为国内依法公开发行的各类债券(包括国债、央行票据、公司债、企业债、短期融资券、资产支持证券、可转换债券、分离交易可转债和债券回购等)、银行存款等固定收益类金融工具。本基金投资的风险资产为股票、权证等权益类金融工具。

本基金按照固定比例组合保险策略对各类金融工具的投资比例进行动态调整。其中,股票、权证等风险资产占基金资产的比例不超过 40%;债券、货币市场工具等安全资产占基金资产的比例不低于 60%,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%。

### **3、变更为“金鹰元安债券型证券投资基金”后的投资目标**

在控制风险与保持资产流动性的前提下,通过对资本市场运行趋势的判断和严格的信用分析,追求基金资产的长期稳健增值,力争获得超越业绩比较基准的投资回报。

### **4、变更为“金鹰元安债券型证券投资基金”后的投资范围**

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,主要投资于国债、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、中小企业私募债券、货币市场工具等固定收益类证券品种、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)、权证,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)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

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)等权益类资产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。

## 5、投资限制

### (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) 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,但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外;
- 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、行政法规和国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

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) 投资组合限制

基金的投资组合应遵循以下投资限制:

(1) 在保本周期内,本基金股票、权证占基金资产的比例不超过 40%,债券等固定收益类品种占基金资产的比例不低于 60%;若本基金变更为“金鹰元安债券型证券投资基金”后,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、权证等其他金融工具的投资比例不超过基金资产的 20%;

(2) 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;

(3) 本基金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%;



- (4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- (5) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- (6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；
- (7) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；
- (8) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- (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) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。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 3 个月内予以全部卖出；
- (13) 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的总资产，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；
- (14) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；
- (15) 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；
- (16) 一只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%；一只基金持有的所有流通受限证券，其市值不得超过该基金资产净值的 10%；经基金管理人和托管人协商，可对以上比例进行调整；
- (17) 本基金若变更为“金鹰元安债券型证券投资基金”后，持有单只中小企业私募债券的市值不超过本基金资产净值的 10%。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。



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。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

### **（九）基金资产估值方法**

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或第三方估值机构提供的相应品种估值净价估值，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价或第三方估值机构提供的相应品种估值净价估值。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）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或第三方估值机构提供的相应品种估值净价进行估值；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或第三方估值机构提供的相应品种估值净价进行估值。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、补充说明

(1) 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。

(2) 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。

(3) 在证券交易所进行转让的非公开发行的中小企业私募债券，采用估值技术确定公允价值。

(4) 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。

(5) 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。

(6) 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见，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。



## (十) 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。

### (十一) 争议的处理

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华南分会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁,仲裁的地点在深圳,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。

《基金合同》受中国法律管辖。

### (十二) 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

法定代表人：凌富华

组织形式：有限责任公司

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

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：基金管理业务，发起设立基金，中国证监会或其授权机构批准的其他业务。

存续期间：持续经营

联系人：潘晓毅

电话：020-83282855

传真：020-83282856

网址：www.gefund.com.cn

#### 2、基金托管人

名称：广发银行股份有限公司

住所：广州市越秀区东风东路 713 号

办公地址：广州市越秀区东风东路 713 号

法定代表人：杨明生

成立时间：1988 年 7 月 8 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：154 亿人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会、中国银监会《关于核准广东发展银行证券投资



基金托管资格的批复》，证监许可[2009]363号

联系人：周小磊

联系电话：（010）65169562

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券等有价证券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；从事银行卡服务；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；外汇存、贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；结汇、售汇；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；自营和代客外汇买卖；代理国外信用卡的发行与付款业务；离岸金融业务；资信调查、咨询、见证业务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。

## （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**基金托管人**的业务核查

(1) 基金管理人**对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值凭证的保管

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。





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。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表



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，基金管理人和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日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华南分会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在深圳，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与年度对账单。

季度对账单在每季结束后的 15 个工作日内向有交易的基金份额持有人寄送,年度对账单在每年度结束后 15 个工作日内对所有基金份额持有人寄送。



对账单的寄送方式分为邮寄和电子邮件两种方式。如投资人需要重置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：<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 9:00-18:00 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。

客服电话：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、其他应披露事项

## （一）信息披露明细

|   | 公告   | 媒体    | 日期              |
|---|--|-------|-----------------|
| 1 | 关于金鹰旗下保本基金及未开放基金净值的公告                            | 证券时报等 | 2016 年 5 月 23 日 |
| 2 | 金鹰基金管理有限公司关于增加招商银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定投和转换业务的公告 | 证券时报等 | 2016 年 5 月 25 日 |
| 3 | 金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金费率优惠活动                         | 证券时   | 2016 年 5 月 27 日 |



|    |  |       |                 |
|----|--|-------|-----------------|
|    | 动的公告   | 报等    |                 |
| 4  | 关于金鹰旗下保本基金及未开放基金净值的公告                                      | 证券时报等 | 2016 年 5 月 30 日 |
| 5  | 金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增深圳市金斧子投资咨询有限公司为代销机构并开通定投以及参加其费率优惠活动的公告 | 证券时报等 | 2016 年 6 月 2 日  |
| 6  | 金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国中投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 年 6 月 7 日  |
| 7  | 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 年 6 月 8 日  |
| 8  | 关于金鹰旗下保本基金及未开放基金净值的公告                                      | 证券时报等 | 2016 年 6 月 13 日 |
| 9  | 金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中信证券（山东）有限责任公司的公告                      | 证券时报等 | 2016 年 6 月 15 日 |
| 10 | 关于金鹰旗下保本基金及未开放基金净值的公告                                      | 证券时报等 | 2016 年 6 月 20 日 |
| 11 | 金鹰基金管理有限公司关于中国工商银行股份有限公司代销旗下部分基金开通转换业务的公告                  | 证券时报等 | 2016 年 6 月 21 日 |
| 12 | 金鹰基金管理有限公司关于中国工商银行股份有限公司代销旗下部分基金开通定投并进行定投费率优惠的公告           | 证券时报等 | 2016 年 6 月 21 日 |
| 13 | 金鹰基金管理有限公司关于金鹰中证 500 指数分级证券投资基金停复牌的提示性公告                   | 证券时报等 | 2016 年 6 月 28 日 |
| 14 | 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 年 7 月 1 日  |
| 15 | 关于金鹰旗下保本基金及未开放基金净值的公告                                      | 证券时报等 | 2016 年 7 月 4 日  |



|    |   |       |                 |
|----|---|-------|-----------------|
|    |   | 报等    |                 |
| 16 | 金鹰基金管理有限公司关于增加武汉市伯嘉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 年 7 月 5 日  |
| 17 | 金鹰基金管理有限公司关于增加武汉市伯嘉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 年 7 月 6 日  |
| 18 | 关于金鹰旗下保本基金及未开放基金净值的公告                               | 证券时报等 | 2016 年 7 月 11 日 |
| 19 | 金鹰基金管理有限公司关于增加和耕传承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 年 7 月 15 日 |
| 20 | 关于金鹰旗下保本基金及未开放基金净值的公告                               | 证券时报等 | 2016 年 7 月 18 日 |
| 21 | 关于金鹰技术领先灵活配置混合型证券投资基金 C 类基金份额净值和份额累计净值计算与披露方法的说明公告  | 证券时报等 | 2016 年 7 月 20 日 |
| 22 | 金鹰基金管理有限公司关于增加乾道金融信息服务(北京)有限公司为旗下部分基金代销机构的公告        | 证券时报等 | 2016 年 7 月 22 日 |
| 23 | 金鹰基金管理有限公司关于增加南充市商业银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定投和转换业务的公告 | 证券时报等 | 2016 年 7 月 22 日 |
| 24 | 金鹰基金管理有限公司关于新增泰诚财富基金销售(大连)有限公司为我司旗下部分基金代销机构的公告      | 证券时报等 | 2016 年 7 月 25 日 |
| 25 | 关于金鹰旗下保本基金及未开放基金净值的公告                               | 证券时报等 | 2016 年 7 月 25 日 |
| 26 | 金鹰基金管理有限公司关于招商证券股份有限公司开通金鹰旗下部分基金定投及转换业务的公告          | 证券时报等 | 2016 年 8 月 4 日  |
| 27 | 关于暂停金鹰基金网上直销货币基金 T+0 快速赎回业                          | 证券时   | 2016 年 8 月 5 日  |



|    |  |       |                 |
|----|--|-------|-----------------|
|    | 务的公告   | 报等    |                 |
| 28 | 关于金鹰旗下保本基金及未开放基金净值的公告                              | 证券时报等 | 2016 年 8 月 8 日  |
| 29 | 关于金鹰旗下保本基金及未开放基金净值的公告                              | 证券时报等 | 2016 年 8 月 15 日 |
| 30 | 金鹰基金管理有限公司关于新增上海基煜基金销售有限公司为本公司旗下基金代销机构的公告          | 证券时报等 | 2016 年 8 月 16 日 |
| 31 | 关于金鹰旗下保本基金及未开放基金净值的公告                              | 证券时报等 | 2016 年 8 月 22 日 |
| 32 | 关于金鹰旗下保本基金及未开放基金净值的公告                              | 证券时报等 | 2016 年 8 月 29 日 |
| 33 | 金鹰基金管理有限公司关于新增北京汇成基金销售有限公司为本公司旗下基金代销机构的公告          | 证券时报等 | 2016 年 9 月 2 日  |
| 34 | 关于金鹰旗下保本基金及未开放基金净值的公告                              | 证券时报等 | 2016 年 9 月 5 日  |
| 35 | 金鹰基金管理有限公司关于新增北京格上富信投资顾问有限公司为本公司旗下基金代销机构的公告        | 证券时报等 | 2016 年 9 月 9 日  |
| 36 | 关于金鹰旗下保本基金及未开放基金净值的公告                              | 证券时报等 | 2016 年 9 月 12 日 |
| 37 | 金鹰基金管理有限公司关于新增微众银行为本公司旗下基金代销机构并开通定投业务的公告           | 证券时报等 | 2016 年 9 月 13 日 |
| 38 | 关于金鹰旗下保本基金及未开放基金净值的公告                              | 证券时报等 | 2016 年 9 月 19 日 |
| 39 | 金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告 | 证券时报等 | 2016 年 9 月 20 日 |





|    |   |       |                  |
|----|---|-------|------------------|
| 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的公告                  | 证券时报等 | 2016 年 9 月 22 日  |
| 41 | 金鹰基金管理有限公司关于新增北京肯特瑞财富投资管理有限公司为本公司旗下基金代销机构的公告                | 证券时报等 | 2016 年 9 月 23 日  |
| 42 | 关于金鹰旗下保本基金及未开放基金净值的公告                                       | 证券时报等 | 2016 年 9 月 26 日  |
| 43 | 金鹰基金管理有限公司关于新增深圳前海凯恩斯基金销售有限公司为本公司旗下部分基金代销机构的公告              | 证券时报等 | 2016 年 9 月 29 日  |
| 44 | 金鹰基金管理有限公司关于增加上海天天基金销售有限公司为本公司旗下部分基金代销机构的公告                 | 证券时报等 | 2016 年 9 月 30 日  |
| 45 | 关于金鹰旗下保本基金及未开放基金净值的公告                                       | 证券时报等 | 2016 年 10 月 10 日 |
| 46 | 金鹰基金管理有限公司关于新增北京新浪仓石基金销售有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务的公告 | 证券时报等 | 2016 年 10 月 14 日 |
| 47 | 金鹰基金管理有限公司关于新增厦门市鑫鼎盛控股有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务的公告   | 证券时报等 | 2016 年 10 月 14 日 |
| 48 | 关于金鹰旗下保本基金及未开放基金净值的公告                                       | 证券时报等 | 2016 年 10 月 17 日 |
| 49 | 金鹰基金管理有限公司关于新增上海万得投资顾问有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务的公告   | 证券时报等 | 2016 年 10 月 21 日 |
| 50 | 关于金鹰旗下保本基金及未开放基金净值的公告                                       | 证券时报等 | 2016 年 10 月 24 日 |



|    |   |       |                  |
|----|---|-------|------------------|
| 51 | 金鹰基金管理有限公司关于新增凤凰金信（银川）投资管理有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务的公告 | 证券时报等 | 2016 年 10 月 26 日 |
| 52 | 关于金鹰旗下保本基金及未开放基金净值的公告   | 证券时报等 | 2016 年 11 月 7 日  |
| 53 | 金鹰基金管理有限公司关于增加深圳前海微众银行股份有限公司为本公司旗下部分基金代销机构的公告                 | 证券时报等 | 2016 年 11 月 8 日  |
| 54 | 金鹰基金管理有限公司关于在广发证券股份有限公司开通本公司旗下部分基金定投及转换业务的公告                  | 证券时报等 | 2016 年 11 月 9 日  |
| 55 | 金鹰基金管理有限公司关于开展网上直销渠道费率优惠活动的公告                                 | 证券时报等 | 2016 年 11 月 9 日  |
| 56 | 金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增民生证券股份有限公司为代销机构的公告                        | 证券时报等 | 2016 年 11 月 11 日 |
| 57 | 关于金鹰基金管理有限公司新增中邮证券为代销机构并代销旗下部分基金的公告                           | 证券时报等 | 2016 年 11 月 11 日 |
| 58 | 金鹰基金管理有限公司关于安信证券股份有限公司代销旗下部分基金开通定投及转换业务的公告                    | 证券时报等 | 2016 年 11 月 11 日 |
| 59 | 金鹰基金管理有限公司关于广州证券股份有限公司代销旗下部分基金开通定投及转换业务的公告                    | 证券时报等 | 2016 年 11 月 11 日 |
| 60 | 关于金鹰旗下保本基金及未开放基金净值的公告   | 证券时报等 | 2016 年 11 月 14 日 |
| 61 | 金鹰基金管理有限公司关于新增天津国美基金销售有限公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务的公告     | 证券时报等 | 2016 年 11 月 16 日 |
| 62 | 金鹰基金管理有限公司关于增加北京肯特瑞财富投资管理有限公司为本公司旗下部分基金代销机构的公告                | 证券时报等 | 2016 年 11 月 17 日 |



## （二）重要事项提示

无

## 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元安保本混合型证券投资基金募集的文件（证监许可[2012]号）；
- （2）《金鹰元安保本混合型证券投资基金基金合同》；
- （3）《金鹰元安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。

金鹰基金管理有限公司

2016 年 12 月 28 日



## 附件：《保证合同》

金鹰元安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  
公司地址：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

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：

《金鹰元安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《金鹰元安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、不间断地持有所申购的基金份额的行为；基金份额的“可赎回金额”指在第二保本周期到期日，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 20 亿元人民币。金鹰元安保本混合型证券投资基金第二个保本周期的符合保本条件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 2 年，自《基金合同》生效之日起至 2 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中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：

1、在保本周期到期日，按基金份额持有人从上一保本周期选择或默认选择转入当期保本周期并持有到期的基金份额、过渡期申购并持有到期的基金份额与保本周期到期日基金份额净值的乘积加上相应基金份额累计分红款项之和不低于其保本额；

2、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；

3、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；

4、在第二个保本周期内发生《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；

8、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。