

# 金鹰基金管理有限公司

## 关于以通讯方式召开金鹰保本混合型证券投资基金 基金份额持有人大会的第一次提示性公告

金鹰基金管理有限公司已于2017年2月23日在《证券时报》及金鹰基金管理有限公司网站（www.gefund.com.cn）发布了《金鹰基金管理有限公司关于以通讯方式召开金鹰保本混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》。为使本次基金份额持有人大会顺利召开，现发布金鹰基金管理有限公司关于以通讯方式召开金鹰保本混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告。

### 一、会议基本情况

鉴于目前基金市场需求的变化，为维护基金份额持有人利益，提高产品的市场竞争力，根据《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》和《金鹰保本混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，金鹰保本混合型证券投资基金（以下简称“本基金”，A类份额基金代码：210006，C类份额基金代码：002425）的基金管理人金鹰基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）经与本基金的基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议修改本基金《基金合同》及《托管协议》的相关事宜。会议具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式

2、会议投票表决起止时间：2017年3月28日起，至2017年4月10日12:00止  
（以本基金管理人委托的公证机关收到表决票的时间为准）

3、会议通讯表决票的寄达地点

公证机关：北京市方正公证处

办公地址：北京市西城区西环广场塔3办公楼11层1113室

收件人：王顺心

电话：（010）58073628；13811865682

邮政编码：100044

会议议案咨询热线：400-6135-888（免长途话费），020-83936180

请在信封背面注明：“金鹰保本混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

## 二、会议审议事项

本次基金份额持有人会议审议事项为《关于金鹰保本混合型证券投资基金修改基金合同及托管协议的议案》（见附件一）。

上述议案的内容说明见《金鹰保本混合型证券投资基金修改基金合同及托管协议的说明书》（见附件二）。

## 三、权益登记日

本次大会的权益登记日为2017年3月27日，即该日日终在本基金注册登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人均享有本次会议的表决权。

## 四、投票方式

1、本次基金份额持有人大会的表决方式仅限于书面纸质表决。本次会议表决票见附件三。基金份额持有人可登录本基金管理人网站([www.gefund.com.cn](http://www.gefund.com.cn))下载并打印表决票或从相关报纸上剪裁、复印表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

（1）个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人身份证件正反面复印件；

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章或经授权的业务公章（以下合称“公章”），并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；合格境外机构投资者自行投票的，

需在表决票上加盖本单位公章(如有)或由授权代表在表决票上签字(如无公章),并提供该授权代表的身份证件、护照或其他身份证明文件的正反面复印件,该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件,以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件和证券账户卡复印件,以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件;

(3) 基金份额持有人可根据本公告“五、授权”中的规定授权其他个人或机构代其在本次基金份额持有人大会上投票。受托人接受基金份额持有人授权代理投票的,应由受托人在表决票上签字或盖章,并提供授权委托书原件以及本公告“五、授权 3、授权方式”中所规定的基金份额持有人以及受托人的身份证明文件或机构主体资格证明文件。

3、基金份额持有人或其受托人需将填妥的表决票和所需的相关文件自2017年3月28日起,至2017年4月10日12:00以前(以基金管理人委托的公证机关收到表决票时间为准)通过专人送交或邮寄方式送达至本公告列明的寄达地点,并请在信封背面注明:“金鹰保本混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

4、投资者如有任何疑问,可致电本基金管理人客户服务电话400-6135-888(免长途话费),020-83936180咨询。

## 五、授权

为便于基金份额持有人有尽可能多的机会参与本次大会,使基金份额持有人在本次大会上充分表达其意志,基金份额持有人除可以直接投票外,还可以授权他人代其在基金份额持有人大会上投票。根据法律法规的规定及《基金合同》的约定,基金份额持有人授权他人在基金份额持有人大会上表决需符合以下规则:

### 1、委托人

本基金的基金份额持有人自本公告发布之日起可委托他人代理行使本次基金份额持有人大会的表决权。

基金份额持有人在权益登记日是否持有基金份额以及所持有的基金份额的数额以注册登记机构的登记为准。

### 2、受托人

基金份额持有人可以委托本基金的基金管理人以及其他符合法律规定的机

构或个人，代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。

### 3、授权方式

本基金的基金份额持有人可通过纸面授权方式授权受托人代为行使表决权。授权委托书的样本请见本公告附件四。基金份额持有人可通过剪报、复印或登录基金管理人网站（[www.gefund.com.cn](http://www.gefund.com.cn)）下载等方式获取授权委托书样本。

（1）个人基金份额持有人委托他人投票的，受托人应提供由受托人签字或盖章的表决票，由委托人填妥并签署的授权委托书原件（授权委托书的格式可参考附件四的样本），并提供基金份额持有人的个人身份证件正反面复印件。如受托人为个人，还需提供受托人的身份证件正反面复印件；如受托人为机构，还需提供该受托人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

（2）机构基金份额持有人委托他人投票的，受托人应提供由委托人填妥的授权委托书原件（授权委托书的格式可参考附件四的样本）并在授权委托书上加盖该机构公章，并提供该机构持有人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等），以及有受托人签字或盖章的表决票。如受托人为个人，还需提供受托人的身份证件正反面复印件；如受托人为机构，还需提供该受托人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

（3）合格境外机构投资者委托他人投票的，应由受托人在表决票上签字或盖章，并提供该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件和证券账户卡复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件和填妥的授权委托书原件。如受托人为个人，还需提供受托人的身份证件复印件；如受托人为机构，还需提供受托人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）。

## 六、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由本基金管理人授权的两名监督员在基金托管人（中国工商银行股份有限公司）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。

2、基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权，且每份基金份额享有平等的表决权。

3、表决票效力的认定如下：

（1）纸面表决票通过专人送交或邮寄送达基金管理人委托的公证机关的，表决时间以收到时间为准。2017年4月10日12：00以后送达基金管理人委托的公证机关的，为无效表决。

（2）纸面表决票的效力认定

纸面表决票填写完整清晰，所提供文件符合本会议通知规定，且在截止时间之前送达基金管理人委托的公证机关的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

如纸面表决票上的表决意见未选、多选、模糊不清、相互矛盾或无法辨认，但其他各项符合会议通知规定的，视为弃权表决，计入有效表决票；并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

如纸面表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或受托人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送达基金管理人委托的公证机关的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

基金份额持有人重复提交纸面表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票；如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：

1）送达时间不是同一天的，以最后送达的填写有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；

2）送达时间为同一天的，视为在同一表决票上做出了不同表决意见，计入弃权表决票；

3) 送达时间按如下原则确定：专人送达的以实际递交时间为准，邮寄的以基金管理人委托的公证机关收到的时间为准。

## 七、决议生效条件

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基金总份额的二分之一（含二分之一），则本次通讯开会有效。

本会议表决的票数要求为：基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权，不足一份的基金份额不具有表决权。本次议案按一般决议处理，须经参加本次基金份额持有人大会的基金份额持有人及其受托人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效。

基金份额持有人大会表决通过的事项，基金份额持有人大会决定的事项自基金持有人大会表决通过之日起生效，将由本基金管理人在自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

## 八、二次召集基金份额持有人大会及二次授权

根据《基金法》及《基金合同》的规定，本次基金份额持有人大会需要出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的二分之一以上（含二分之一）方可举行。如果本次基金份额持有人大会不符合前述要求而不能成功召开，根据《基金法》及《基金合同》的规定，本基金管理人可在规定时间内就同一议案重新召集基金份额持有人大会。重新召开基金份额持有人大会时，除非授权文件另有载明，本次基金份额持有人大会授权期间基金份额持有人作出的各类授权依然有效，但如果授权方式发生变化或者基金份额持有人重新作出授权，则以最新方式或最新授权为准，详细说明见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知。

## 九、本次大会相关机构

1、召集人：金鹰基金管理有限公司

联系地址：广州市天河区珠江东路28号越秀金融大厦30楼

客服热线：400-6135-888（免长途话费），020-83936180

传真：020-83283445

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

邮箱：[csmail@gefund.com.cn](mailto:csmail@gefund.com.cn)

2、基金托管人：中国工商银行股份有限公司

3、公证机关：北京市方正公证处

4、律师事务所：广东岭南律师事务所

## 十、重要提示

1、投票截止时间为2017年4月10日12:00，请基金份额持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票。

2、基金管理人将在发布本公告后2个工作日内连续公布相关提示性公告，就基金份额持有人大会相关情况做必要说明，请予以留意。

3、本次基金份额持有人大会有关公告可通过本基金管理人网站查阅，投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话400-6135-888（免长途话费），020-83936180咨询。

4、本基金份额持有人大会召开期间，本基金日常申购赎回业务照常进行，投资者可以按照本基金招募说明书的相关规定办理申购赎回。

5、本公告的有关内容由金鹰基金管理有限公司负责解释。

金鹰基金管理有限公司

二〇一七年二月二十四日

附件一：《关于金鹰保本混合型证券投资基金修改基金合同及托管协议的议案》

附件二：《金鹰保本混合型证券投资基金修改基金合同及托管协议的说明书》

附件三：《金鹰保本混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决票》

附件四：《授权委托书》





附件一：

## 关于金鹰保本混合型证券投资基金 修改基金合同的议案

金鹰保本混合型证券投资基金基金份额持有人：

鉴于目前基金市场需求的变化，为维护基金份额持有人利益，提高产品的市场竞争力，根据《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》”）和《金鹰保本混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，金鹰保本混合型证券投资基金的基金管理人——金鹰基金管理有限公司经与基金托管人——中国工商银行股份有限公司协商一致，提议修改金鹰保本混合型证券投资基金的基金合同及托管协议。此次基金合同的修改，将对本基金保本周期到期后转型部分的基金名称、基金类别、投资目标、投资范围和投资策略、业绩比较基准、风险收益特征、基金投资组合比例限制、基金的费用等条款以及因法律法规变更而对基金合同部分条款进行修改。《金鹰保本混合型证券投资基金修改基金合同及托管协议的说明书》见附件二。

为确保本次基金合同修改的顺利完成，提议授权基金管理人根据基金份额持有人大会决议，并在不涉及基金合同当事人权利义务关系变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，对其余法律文件进行相应的修改和必要补充，并办理本次基金合同及托管协议修改的相关具体事宜。

以上议案，请予审议。

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

## 附件二：

# 金鹰保本混合型证券投资基金 修改基金合同及托管协议的说明书

## 一、 声明

金鹰保本混合型证券投资基金（以下或简称“金鹰保本”）经中国证监会证监许可[2011]436号文批准，于2011年5月17日成立，金鹰基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）为本基金的管理人，中国工商银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）为本基金的托管人。

鉴于目前基金市场需求的变化，为维护基金份额持有人利益，提高产品的市场竞争力，依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《金鹰保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，建议修改本基金基金合同。

本次金鹰保本混合型证券投资基金修改基金合同及托管协议的议案应当经参加大会的基金份额持有人(或其受托人)所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效，故本次修改基金合同及托管协议的议案存在无法获得基金份额持有人大会表决通过的可能。

持有人大会的决议自表决通过之日起生效。中国证监会对持有人大会表决通过的事项所作的任何决定或意见，均不表明其对本基金的价值或者投资人的收益做出实质性判断或保证。

## 二、金鹰保本混合型证券投资基金基金合同修改要点

### （一）基金合同修改要点

章节	原文内容	修订后内容
一、前言	为保护基金投资者合法权益，明确《基金合同》当事人的权利与义务，规范金鹰保本混合型证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）运作，依照《中华人民共和	为保护基金投资者合法权益，明确《基金合同》当事人的权利与义务，规范金鹰保本混合型证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）运作，依照《中华人民共和

	<p>国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《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》）、证券投资基金信息披露内容与格式准则第6号《基金合同的内容与格式》及其他有关规定，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上，特订立《金鹰保本混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“本合同”或“《基金合同》”）。</p>	<p>国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《<b>公开募集</b>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》）、证券投资基金信息披露内容与格式准则第6号《基金合同的内容与格式》及其他有关规定，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上，特订立《金鹰保本混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“本合同”或“《基金合同》”）。</p>
<p>二、 释 义</p>	<p>《运作办法》：《证券投资基金运作管理办法》</p> <p>《业务规则》：《金鹰基金管理有限公司开放式基金业务规则》</p> <p>保本周期到期后基金的存续形式： 保本周期届满时，若符合保本基金存续条件，本基金继续存续；否则，本基金变更为非保本的债券型基金，基金名称相应变更为“金鹰持续收益债券型证券投资基金”。<del>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</del></p>	<p>《运作办法》：《<b>公开募集</b>证券投资基金运作管理办法》</p> <p>《业务规则》：《金鹰基金管理有限公司<b>注册登记</b>业务规则》</p> <p>保本周期到期后基金的存续形式： 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<b>混合型</b>基金，基金名称相应变更为“金鹰元禧<b>混合型</b>证券投资基金”。</p>

五、基金备案	<p>(三) 基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模</p> <p><del>《基金合同》生效后, 基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元的, 基金管理人应当及时报告中国证监会; 连续 20 个工作日出现前述情形的, 基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。</del></p>	<p>(三) 基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模</p> <p>《基金合同》生效后, 连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不超过 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的, 基金管理人应当在定期报告中予以披露; 连续 60 个工作日出现前述情形的, 基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案, 如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等, 并召开基金份额持有人大会进行表决。</p>
六、基金份额的申购与赎回	<p>(七) 申购份额与赎回金额的计算</p> <p>3、本基金基金份额净值的计算:</p> <p>T 日的基金份额净值在当天收市后计算, 并在 T+1 日内公告。遇特殊情况, 经中国证监会同意, 可以适当延迟计算或公告。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码, 分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。本基金各类份额净值的计算, 均保留到小数点后 3 位, 小数点后第 4 位四舍五入, 由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p>	<p>(七) 申购份额与赎回金额的计算</p> <p>3、本基金基金份额净值的计算:</p> <p>T 日的基金份额净值在当天收市后计算, 并在 T+1 日内公告。遇特殊情况, 经中国证监会同意, 可以适当延迟计算或公告。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码, 分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。本基金各类份额净值的计算, 均保留到小数点后 4 位, 小数点后第 5 位四舍五入, 由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p>
七、	(一) 基金管理人	(一) 基金管理人

基金合同当事人权利义务	<p>1、基金管理人简况</p> <p>住所：广东省广州市天河区体育西路189号城建大厦22、23楼</p>	<p>1、基金管理人简况</p> <p>住所：广东省广州市天河区珠江东路28号越秀金融大厦30层</p>
九、基金份额持有人大会	<p>(一) 召开事由</p> <p>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：</p> <p>(7) 变更基金类别，但在保本到期后在《基金合同》规定范围内变更为“金鹰持续收益债券型证券投资基金”除外；</p> <p>(9) 变更基金投资目标、范围或策略，但在保本到期后在《基金合同》规定范围内变更为“金鹰持续收益债券型证券投资基金”并按照《基金合同》约定的“金鹰持续收益债券型证券投资基金”的投资目标、范围或策略执行的以及法律法规和中国证监会另有规定的除外；</p>	<p>(一) 召开事由</p> <p>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：</p> <p>(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“金鹰元禧混合型证券投资基金”除外；</p> <p>(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“金鹰元禧混合型证券投资基金”并按照《基金合同》约定的“金鹰元禧混合型证券投资基金”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；</p>
	<p>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：</p> <p>(1) 保本到期后，在《基金合同》规定范围内变更为“金鹰持续收益债券型证券投资基金”，并按</p>	<p>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：</p> <p>(1) 保本到期后，在《基金合同》规定范围内变更为“金鹰元禧混合型证券投资基金”，并按照《基</p>

<p>照《基金合同》约定的“金鹰持续收益债券型证券投资基金”的投资目标、范围或策略执行；</p> <p>(7) 除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。</p>	<p>金合同》约定的“金鹰元禧混合型证券投资基金”的投资目标、范围或策略执行；</p> <p>(7) 按照本基金合同的约定，变更业绩比较基准；</p> <p>(8) 在对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，基金管理人经与基金托管人协商一致，调整基金收益的分配原则和支付方式，或者于中国证监会允许的范围内推出新业务或服务；</p> <p>(9) 在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人经与基金托管人协商一致，对基金份额进行折算；</p> <p>(10) 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。</p>
<p>(二) 会议召集人及召集方式</p> <p>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。</p>	<p>(二) 会议召集人及召集方式</p> <p>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，并自出</p>

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

**具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。**

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，**单独或合计**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**召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。**

5、**单独或合计**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

<p>的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。</p>	<p>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。</p>
<p>（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式</p> <p>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。</p>	<p>（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式</p> <p>1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 天，在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。</p>
<p>（四）基金份额持有人出席会议的方式</p> <p>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。</p> <p>（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%）。</p>	<p>（四）基金份额持有人出席会议的方式</p> <p>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及法律法规、中国证监会允许的其他方式召开。</p> <p>（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%）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议</p>



		<p>事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。</p>
	<p>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。</p> <p>（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%）；</p>	<p>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或大会公告载明的其他方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或大会公告载明的其他方式进行表决。</p> <p>（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%）；若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表</p>

		决意见；
	无	<p>3、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明；在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。</p>
	<p>（八）生效与公告</p> <p>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。</p> <p><del>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。</del></p>	<p>（八）生效与公告</p> <p><b>基金份额持有人大会的决议，自表决通过之日起生效。</b></p> <p>基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。</p>
	无	<p>（九）本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修</p>

		改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人在履行适当程序并提前公告后，可对本部分内容进行修改和调整。
十三、基金的保本	<p>(三) 适用保本条款的情形</p> <p>2、对于持有到期的份额，基金份额持有人无论选择赎回、转换为基金管理人管理的其他基金、本基金转入下一保本周期或是转型为“金鹰持续收益债券型证券投资基金”，均适用保本条款。</p>	<p>(三) 适用保本条款的情形</p> <p>2、对于持有到期的份额，基金份额持有人无论选择赎回、转换为基金管理人管理的其他基金、本基金转入下一保本周期或是转型为“金鹰元禧混合型证券投资基金”，均适用保本条款。</p>
十四、基金保的保证	<p>(七) 保本周期届满时，基金管理人认可的其他符合条件的担保人或保本义务人为本基金下一保本周期提供保本保障，并与基金管理人就本基金下一保本周期签订担保合同或风险买断合同，同时本基金满足法律法规和《基金合同》规定的基金存续要求的，本基金将转入下一保本周期；否则，本基金变更为非保本的债券型基金，基金名称相应变更为“金鹰持续收益债券型证券投资基金”，担保人不再为该债券型基金承担担保责任。</p>	<p>(七) 保本周期届满时，基金管理人认可的其他符合条件的担保人或保本义务人为本基金下一保本周期提供保本保障，并与基金管理人就本基金下一保本周期签订担保合同或风险买断合同，同时本基金满足法律法规和《基金合同》规定的基金存续要求的，本基金将转入下一保本周期；否则，本基金变更为非保本的<b>混合型</b>基金，基金名称相应变更为“金鹰元禧混合型证券投资基金”，担保人不再为该<b>混合型</b>基金承担担保责任。</p>
十五、基金的投资	<p>(一) 保本周期内的投资</p> <p>3、投资范围</p> <p>本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市</p>	<p>(一) 保本周期内的投资</p> <p>3、投资范围</p> <p>本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市</p>

<p>其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。股票、权证占基金资产净值的比例为 0%~40%，其中，权证投资的比例范围占基金资产净值的 0%~3%；债券、资产支持证券、货币市场工具、现金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产净值的 <del>60%~100%</del>，其中，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，在基金合同和法律法规的允许范围内，本基金将积极参与一级市场新股、新债的申购。</p>	<p>其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。股票、权证占基金资产的比例为 0%~40%，其中，权证投资的比例范围占基金资产净值的 0%~3%；债券、资产支持证券、货币市场工具、现金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例不低于 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%。此外，在基金合同和法律法规的允许范围内，本基金将积极参与一级市场新股、新债的申购。</p>
<p>（二）变更后的“金鹰持续收益债券型证券投资基金”的投资</p> <p>1、投资目标</p> <p><del>通过对宏观经济、资本市场运行趋势的前瞻性研判，预测未来利率水平及其变化趋势，力求准确把握固定收益类、权益类资产的投资机会，在严格控制投资风险的前提下，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。</del></p> <p>2、投资理念</p> <p><del>坚持“深入研究、稳健投资、</del></p>	<p>（二）变更后的“金鹰元禧混合型证券投资基金”的投资</p> <p>1、投资目标</p> <p><b>本基金在有效控制风险的前提下，力争使基金份额持有人获得超额收益与长期资本增值。</b></p> <p>2、投资范围</p> <p><b>本基金的投资对象是具有良好的流动性的金融工具，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（包括国债、金融</b></p>

<p><del>主动管理、严控风险”的投资理念，在注重投资组合安全性与流动性的前提下，努力把握投资机会，追求基金资产的稳健增值。</del></p> <p>3、投资范围</p> <p><del>本基金主要投资于固定收益类证券，包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债（含分离交易可转债）、资产支持证券、短期融资券、回购等固定收益类证券品种，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。</del>本基金对固定收益类证券品种的投资比例不高于基金资产的80%；<del>对股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、货币等其它金融工具的投资比例不超过基金资产的20%，其中，权证投资的比例范围占基金资产净值的0~3%。为维持投资组合的流动性，本基金持有现金和到期日不超过一年的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金可在二级市场买卖股票、权证等权益类资产，也可参与一级市场新股申购或增发。</del></p> <p>4、业绩比较基准</p> <p><del>本基金业绩比较基准：—</del></p>	<p>债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可交换公司债券、可转换公司债券（含可分离交易可转债）、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券），以及权证、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货等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）。</p> <p>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。</p> <p>基金的投资组合比例：本基金投资于股票资产的比例为基金资产的0-40%，每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的保证金以后，本基金保留的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%。权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。</p> <p>当法律法规的相关规定变更时，基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。</p>
--	---

<p><del>中国债券综合指数（全价）。</del></p> <p><del>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。</del></p> <p><del>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，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。</del></p> <p>5、投资策略</p> <p><del>（1）投资策略依据</del></p>	<p>3、业绩比较基准</p> <p><b>本基金业绩比较基准：</b></p> <p><b>沪深300指数收益率×20%+中债总财富(总值)指数×80%</b></p> <p>如果指数编制单位停止计算编制以上指数或更改指数名称、或今后法律法规发生变化、或有更适当的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，本基金管理人在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，可以根据本基金的投资范围和投资策略，调整基金的业绩比较基准，但应在取得基金托管人同意后报中国证监会备案，并及时公告，无须召开基金份额持有人大会审议。</p> <p>本基金的业绩比较基准仅作为衡量本基金业绩的参照，不决定也不必然反映本基金的投资策略。</p> <p>4、投资策略</p> <p>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，注重风险与收益的平衡，力争实现基金资产长期稳健增值。</p> <p>（1）资产配置策略</p> <p>本基金采用固定比例组合保险</p>
---	---

1) “自上而下”为主，“自下而上”为辅

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

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

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，其中安全资产将投资于各类债券及银行存款，以保证投资本金的安全性；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。

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）债券组合管理策略

本基金将综合运用多种债券投资策略，实现组合增值。

### 1) 类属配置策略

本基金根据各具体债券的风险收益比、信用利差、流动性利差、债项评级及相对价差收益等特点，研究各类具体信用类债券的投资价值；在此基础上结合各细分种类债券供需状况、风险与收益率变化等因素谨慎进行类属配置。

### 2) 久期配置策略

益率持续上升或下降具有基本面因素的支撑，可持续，本基金将“自下而上”地重新调整个券、类属资产、大类资产的配置比例与期限结构。

2) 安全性与流动性优先，兼顾收益性

——就债券型基金份额持有人的风险偏好而言，大致可分为两类：风险偏好程度很低的投资者与风险偏好程度较高的投资者。风险偏好程度很低的投资者购买债券型基金之目的在于：获取稳健的投资收益，而不必承担过高的投资风险；风险偏好程度较高的投资者购买债券型基金之目的在于：暂时规避其他高风险资产的下跌风险。

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

#### (2) 投资策略方法

在投资组合管理过程中，本基金采取主动投资的方法，充分发挥金融工程与量化方法的决策辅助作用，以期提高投资决策的科学性与及时性，在控制风险的前提下，

本基金通过对宏观经济趋势、经济周期和政策动向进行分析，对未来利率走势进行判断，确定债券组合久期，并动态积极调整债券组合的平均久期及期限分布，以有效提高债券组合的总投资收益。

#### 3) 收益率曲线策略

通过对财政货币政策取向、流动性、债券供求、市场风险偏好等因素进行综合分析，在此基础上预测利率期限结构及收益率曲线的变化趋势以进行积极资产配置；并根据收益率曲线上不同年限收益率的息差特征，通过骑乘策略，投资于具备潜在价值的债券。

#### 4) 杠杆策略

本基金在考虑债券投资的风险收益情况，以及回购成本等因素的情况下，在风险可控的情况下，通过债券回购，放大杠杆进行投资操作。

#### 5) 相对价值投资策略

本基金将综合运用利率预期、收益率曲线估值、信用风险分析、流动性分析等方法来评估个券的投资价值，重点关注一定利率区间范围内且符合设定久期区间、具有较高评级及较好流动性的个券，或存在定价偏误、市场交易价格被低估



追求收益最大化。本基金的核心投资策略方法由两部分组成：基础性分析工具（市场利率预测、投资时钟所处象限的判断）与交易性策略。

本基金分别采用定性与定量的方法来预测利率的变化趋势与变化量。另外，本基金借鉴投资时钟的分析框架，通过对过去7年间投资时钟各象限内股票、债券、货币资产平均收益率的审慎考察，为本基金大类资产配置提供新的分析视角。

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

### （3）资产配置策略

本基金的资产配置策略分成：投资组合加权平均久期的确定、大类资产配置、债券类属配置、债券品种的选择这四个层面。在每一个

的优质个券。

### 6) 信用利差曲线策略

信用债收益率是在基准收益率基础上加上反映信用风险的信用利差，因此信用债利差曲线能够直接影响相应债券品种的信用利差收益率。本基金通过关注信用利差的变化趋势，精选利差趋向缩小的类属品种及个券。在信用利差曲线的分析上，本基金将重点关注经济周期、国家或产业政策、发债主体所属行业景气度、债券市场供求、信用债券市场结构、信用债券品种的流动性等因素对信用利差的影响，进而进行信用债投资。

### （3）股票投资策略

本基金将充分发挥基金管理人的研究优势，根据不同市场环境灵活运用成长、主题、动量、事件驱动等多种投资策略积极进行股票投资。通过对以上策略的综合运用，力争实现基金资产的稳健增值。

### 1) 成长策略

本基金所指的成长策略主要指本基金对新兴产业、行业景气度较高或处于上升阶段的转型行业及实现革新转型、持续增长的传统产业中具有成长风格的上市公司的投资策略。本基金将精选上述行业中代

<p>层面上,需要解决的问题各不相同。</p> <p>1) 确定投资组合的加权平均久期之目标范围</p> <p>本基金根据宏观经济走势及其所处投资时钟的象限、CPI 与利率变化趋势以及预测值、未来 1~12 个月央行可能的加减息幅度,通过审慎分析与测算,确定投资组合的加权平均久期。一般而言,当预期利率下降时,适当提升久期,以分享债券的上涨收益;当预期利率上升时,适当降低久期,以规避债券的下跌风险。</p> <p>当宏观经济处于投资时钟“过热”象限且政府已采取或预期将采取紧缩性政策、“滞涨”象限且预期政府短期内不会采取扩张性政策的情况下,将投资组合的加权平均久期维持在较低的水平;而在“滞涨”象限或“衰退”象限且政府已采取或预期将采取扩张性政策的情况下,将投资组合的加权平均久期维持在较高的水平;在“复苏”象限,视申购赎回的情况、相关券种的流动性等因素选择适当的加权平均久期,原则上,维持加权平均久期基本不变。</p> <p>2) 大类资产的配置策略</p> <p>本基金采用“自上而下”的投</p>	<p>表性较强、成长性良好、估值具有吸引力,预期业绩持续增长的成长型个股进行投资。</p> <p>2) 主题策略</p> <p>本基金将通过分析研究国内外实体经济、政府政策、科学技术、金融市场等投资主题对经济结构、产业结构或商业运作模式的影响力量,发掘和把握投资主题,积极挖掘和研究新的投资主题,并对主题投资方向做出适时调整,从而准确把握新旧投资主题的转换时机,分享不同投资主题所伴随的投资机遇。</p> <p>3) 动量策略</p> <p>本基金所指的动量策略是指市场在一定时期内呈现“强者恒强”的特征,通过买入过去一段时期的表现强势的个股以获得超越市场平均水平的收益的投资策略。本基金将综合分析各股票价格走势及价格动量特征,选择动量特征明显和价格趋势强劲的个股纳入投资组合。</p> <p>4) 事件驱动策略</p> <p>本基金所指的事件驱动策略是指在提前挖掘和深入分析可能造成股价异常波动的事件基础上,通过充分把握交易时机获取超额投资回报的投资策略。</p>
--	---

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

#### A、大类资产的比例配置

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

当宏观经济处于投资时钟“衰退”象限并预期“衰退”即将结束、“复苏”象限、“过热”象限但政府并未采取紧缩性政策,以及股票市场的上行阶段,将本基金权益类资产的配置比例维持在较高水平,债券类、货币类资产的配置比例随之而定;在“过热”象限且政府已采取或预期将采取紧缩性政策、“滞涨”象限并预期滞涨状态仍将持续的情况下,将债券类、权益类资产的配置比例均维持在较低水平,货币类资产的配置比例随之而定;在

#### (4) 中小企业私募债券投资策略

本基金将运用基本面研究结合公司财务分析方法,对债券发行人信用风险进行分析和度量,选择风险与收益相匹配的更优品种进行投资。深入研究债券发行人基本面信息,分析企业的长期运作风险;对债券发行人进行财务风险评估;利用历史数据、市场价格以及资产质量等信息,估算私募债券发行人的违约率及违约损失率并考察债券发行人的增信措施。综合上述分析结果,确定信用利差的合理水平,利用市场的相对失衡,确定具有投资价值的债券品种。

#### (5) 股指期货投资策略

本基金以套期保值为目的,参与股指期货交易。

本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素,结合定性和定量方法,确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模,以及中国证监会的相关限定和要求,确定参与股指期货交易的投资比例。

<p><del>“滞涨”象限并预期将滑入“衰退”象限、“衰退”象限，根据财政政策与货币政策的取向、股票市场的估值水平与运行状况，确定权益类资产的配置比例，同时，将债券类资产的配置比例维持在较高水平，货币类资产的配置比例随之而定。</del></p> <p><del>B、大类资产的期限配置</del></p> <p><del>根据宏观经济所处投资时钟的象限、加权平均久期的目标范围，确定本基金债券类资产的加权平均久期之目标区间、货币资产的加权平均期限之目标范围（股票资产不存在期限的问题）。</del></p> <p><del>在确定大类资产的配置比例与期限结构的过程中，必须针对债券市值相对于利率变化的敏感性进行严格的压力测试与情景模拟，根据压力测试与情景模拟的结果，制定审慎的配置方案。</del></p> <p><del>3) 债券类资产的配置策略</del></p> <p><del>A、债券类资产的期限配置</del></p> <p><del>在确定了债券类、货币类资产的配置比例与大致的期限结构之后，根据债券类资产的加权平均久期之目标区间，在投资时钟的分析框架下确定久期为1年以下、1~3年、3~5年、5年以上的债券品种之市值占本基金债券总市值的相对</del></p>	<p>基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。</p> <p>若相关法律法规发生变化时，基金管理人期货投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。</p> <p>(6) 国债期货投资策略</p> <p>国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。</p> <p>(7) 权证投资策略</p> <p>本基金将权证看作是辅助性投资工具，其投资原则为优化基金资产的风险收益特征，有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。</p>
---	---

<p>比例。</p> <p>B、债券类资产的类属配置</p> <p>本基金通过对未来利率的变动趋势、宏观经济所处投资时钟的象限、基金申购与赎回的情况、股票市场的运行状况等定性与定量因素的分析，确定国债、央票、金融债、企业债与公司债这四个子类债券市值占基金债券类资产总市值的相对比例。</p> <p>当宏观经济处于投资时钟“衰退”象限并预期“衰退”即将结束、“复苏”象限、“过热”象限但政府并未采取紧缩性政策，以及股票市场的上行阶段，将可转债的相对比例保持在一个较高的水平，以获取较高的投资收益，同时，将国债、央票、金融债配置的相对比例维持在一个较高的水平，以应对可能发生的净赎回与基金转换；当宏观经济处于“过热”象限且政府已采取或预期将采取紧缩性政策、“滞涨”象限，以及股票市场的下行阶段，降低企业债、公司债（尤其是可转债）的配置比例，提高国债、央票、金融债配置的相对比例。</p> <p>如果基金连续处于净赎回状态，则应提高国债、央票、金融债配置的相对比例，以提升资产组合</p>	<p>本基金将在权证理论定价模型的基础上，综合考虑权证标的证券的基本面趋势、权证的市场供求关系以及交易制度设计等多种因素，对权证进行合理定价。本基金权证主要投资策略为低成本避险和合理杠杆操作。</p> <p>(8) 资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将综合运用资产配置、久期管理、收益率曲线、信用管理和个券<math>\alpha</math>策略等策略积极主动进行资产支持证券产品投资。本基金管理人将坚持风险调整后收益最大化的原则，通过信用资质研究和流动性管理，遵守法律法规和基金合同的约定，严格控制投资风险，确保本金相对安全和基金资产具有良好流动性，以期获得长期稳定收益。</p> <p>5、风险收益特征</p> <p>本基金为混合型证券投资基金，其预期收益和风险水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。</p>
---	---

的流动性。

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

#### 4) 存款类资产的配置策略

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

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

#### 5) 债券品种选择

由于货币类资产的品种选择相对简单，故而，此处集中分析债券类资产的品种选择。

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

#### A、~~国债与央票~~

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

#### 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所处投资时钟的象限、未来利率的变化趋势、金融债各品种的到期收益率、换手率、外部评级、本基金投资组合的加权平均久期之目标范围等因素，审慎遴选具有比较优势的金融债品种。~~

#### C、~~普通企业债与公司债~~

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

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

#### 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（OAS），作为此类债券估值的主要依据。

可转换公司债券包含了股票买入期权，投资者既可以获得债券投资的固定收益，又可在一定期限之后转换为股票以分享公司股票价格上涨所带来的投资回报。本基金在对债转股条款、发债公司基本面进行深入分析的基础上，利用到期收益率来判别可转债的纯债价值，选择纯债价值被低估的可转债以提升



本金投资的安全性；通过对发债公司未来经营业绩的预测、股票估值模型、未来宏观经济所处投资时钟的象限以及股票市场运行趋势的判断，来鉴别可转债的期权价值。在宏观经济与股票市场下行周期的后半段与上升周期的前半段，优先选择期权价值被低估的可转债，以获取投资收益。

#### E、资产支持证券

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

#### 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，以短期品种为主，选择收益率相对高的回购品种进行投资。

#### G、金鹰债券综合评价模型

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

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

#### 6) 股票资产的配置策略

##### A、股票一级市场申购策略

本基金可参与一级市场新股申购或增发。本基金将利用公司自主开发的“金鹰行业评价模型”、“金鹰企业评价模型”，对新股所属行业属性与成长空间、新股的基本面做出定量分析，采用适当的估值模型对新股的投资价值进行评估，结合二级市场的平均估值水平、并参考类似新股上市之后的平均溢价率，给出合理的询价；根据新股发行价，估算新股上市后的合理定价；

根据二级市场的运行情况、新股发行的频度、近期参与一级市场新股申购的平均资金规模、拟参与申购的新股之实际发行规模，估计中签率，并据此测算该次新股申购的预期收益率，作出是否参与该次新股申购的决定。

#### B、股票二级市场投资策略

##### (A) 进取与防御的抉择

本基金根据宏观经济与资本市场的运行状况，判断所处投资时钟的象限，作出防御或者进取的抉择。在“衰退”象限且政府已经采取或预期将采取扩展性政策的情况下，采取“复苏”象限，“过热”象限但政府并未采取紧缩性政策的情况下，采取进取优先的策略；在“过热”象限且政府已经采取或预期将采取紧缩性政策的情况下，采取进取与防御并重的策略；在“滞涨”象限或“衰退”象限且预期政府短期内不会采取扩展性政策的情况下，采取防御优先的策略。

##### (B) 行业配置

确定了防御或者进取的投资取向之后，本基金审慎遴选重点配置的行业——根据进取优先的策略，本基金将重点配置强周期行业、高贝塔值的行业；根据防御优先的策

略，本基金将重点配置弱周期行业、生活必需品行业、生物医药行业；根据防御与进取并重的策略，本基金将在强周期与弱周期行业、高贝塔值与低贝塔值的行业之间寻求某种程度的折衷与平衡，随着宏观经济逐渐由“过热”象限滑向“滞涨”象限，投资组合渐近地偏向弱周期行业、低贝塔值行业、生活必需品行业、医药生物行业。

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

#### （C）风格追踪

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

#### （D）个股选择

基于行业配置策略与市场行情风格，本基金在各行业内遴选相应的投资标的。

根据防御原则，本基金将审慎

<p>甄别公司的核心价值,从公司治理、公司战略、行业地位等方面审视公司核心竞争力,通过自下而上的研究,以基本面分析为核心,力求挖掘出具有核心竞争力的稳健经营、价值低估型公司。</p> <p>根据进取原则,本基金将努力发掘那些可持续、可预见的成长型公司,重点在于对公司成长性的客观评价和比较上,不仅仅需要关注增长率之类的数量指标,同时还要关注成长的质量以及成长的可持续性。</p> <p>为了对个股的基本面情况与投资价值进行综合评价,本公司建立了“金鹰企业评价模型”,该模型可为本基金的个股选择提供定量化依据,避免了个股选择的盲目性与随意性。</p> <p>另外,对行情风格的密切追踪,可为个股选择提供新的视角,有利于提升个股选择的有效性。</p> <p>6、风险收益特征</p> <p>本基金为积极配置的债券型基金,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,但高于货币市场基金。</p>	
<p>三、投资限制</p>	<p>(三) 投资限制</p>

	<p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下投资限制：</p>	<p>2、投资组合限制</p> <p>本基金的投资组合将遵循以下限制：</p> <p>（1）在保本周期内，本基金股票、权证占基金资产的比例为0-40%，债券、资产支持证券、货币市场工具、现金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例不低于60%；若本基金变更为“金鹰元禧混合型证券投资基金”后，本基金投资组合中股票资产占基金资产的比例为0%-40%；</p> <p>（16）本基金若变更为“金鹰元禧混合型证券投资基金”后，如本基金参与股指期货、国债期货投资，则遵循以下投资限制：</p> <p>1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；</p> <p>2) 在任何交易日日终持有的买入国债期货合约和股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；</p> <p>3) 在任何交易日日终，持有的</p>
--	--	--

		<p>卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；</p> <p>4) 在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一个交易日基金资产净值的 20%；</p> <p>5) 基金所持有的股票市值、买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；</p> <p>6) 本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；</p> <p>7) 持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；</p> <p>8) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；</p> <p>9) 本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；</p> <p>如本基金未参与股指期货、国债期货的投资，则不受第（16）条的限制。</p> <p>（17）本基金的基金资产总值</p>
--	--	---

		不得超过基金资产净值的 200%。本基金若变更为“金鹰元禧混合型证券投资基金”后，本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；
十、基金资产估值	<p>(六) 基金份额净值的确认和估值错误的处理</p> <p>基金份额净值的计算保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入。</p>	<p>(六) 基金份额净值的确认和估值错误的处理</p> <p>基金份额净值的计算保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入。</p>
十八、基金费用与税收	<p>(二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>若保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，基金份额持有人将所持有本基金份额转为变更后的“金鹰持续收益债券型证券投资基金”的基金份额，管理费按前一日基金资产净值的 0.75% 的年费率计提，托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提，金鹰持续收益债券 C 类份额的销售服务费仍按前一日基金资产净值的 0.1% 计提。计算方法同上，此项调整无需召开基金份额持有人大会。</p>	<p>(二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>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“金鹰元禧混合型证券投资基金”的基金份额，管理费按前一日基金资产净值的 0.60% 的年费率计提，托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提，金鹰元禧混合型证券投资基金 C 类份额的销售服务费仍按前一日基金资产净值的 0.1% 计提。计算方法同上，此项调整无需召开基金份额持有人大会。</p>



<p>十九、基金的收益与分配</p>	<p>(六) 基金收益分配中发生的费用</p> <p>(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。</p>	<p>(六)基金收益分配中发生的费用</p> <p>(2) 保本周期届满后, 若本基金转型为非保本的金鹰<b>元禧混合型</b>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。</p>
<p>二十一、基金的信息披露</p>	<p>(五) 公开披露的基金信息</p> <p>7、临时报告</p> <p>(26) 与保本周期到期相关事项的公告:</p> <p>5) 保本周期届满时, 若不符合保本基金存续条件, 本基金将变更为“金鹰持续收益债券型证券投资基金”, 基金管理人将在临时公告或《金鹰持续收益债券型证券投资基金招募说明书》中公告相关规则;</p>	<p>(五) 公开披露的基金信息</p> <p>7、临时报告</p> <p>(26)与保本周期到期相关事项的公告:</p> <p>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<b>元禧混合型</b>证券投资基金”, 基金管理人将在临时公告或《金鹰<b>元禧混合型</b>证券投资基金招募说明书》中公告相关规则;</p>
<p>二十二、保本周到期</p>	<p>(一) 保本周期到期后基金的存续形式</p> <p>如保本到期后, 本基金未能符合上述保本基金存续条件, 则本基金将按《基金合同》的约定, 变更为“金鹰持续收益债券型证券投资基金”; 同时, 基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等相关内容也将根据《基金合同》约定相应变更。上述变更由基金管理人和基金托管人同意后, 可不经基金份额持有人大会决议, 在报中</p>	<p>(一)保本周期到期后基金的存续形式</p> <p>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<b>元禧混合型</b>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</p>

<p>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。</p> <p><del>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。</del></p>	<p>案后，提前在临时公告或更新的基金招募说明书中说明。</p>
<p>(二) 保本周期到期操作规则</p> <p>1、本基金保本周期到期后，基金份额持有人可以做出如下选择，其保本权利均适用保本条款：</p> <p>(4) 保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，基金份额持有人继续持有变更后的“金鹰持续收益债券型证券投资基金”的基金份额。</p> <p>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换为变更后的“金鹰持续收益债券型证券投资基金”后的费用，适用其所转入基金的费用、费率体系。</p> <p>4、本基金保本周期到期后，如基金份额持有人未进行到期操作，本基金符合保本基金存续条件，则基金管理人将默认基金份额持有人继续持有本基金基金份额；如基金份额持有人未进行到期操作，本基金不符合保本基金存续条件，则基金管理人将默认基金份额持有人选</p>	<p>(二) 保本周期到期操作规则</p> <p>1、本基金保本周期到期后，基金份额持有人可以做出如下选择，其保本权利均适用保本条款：</p> <p>(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“金鹰元禧混合型证券投资基金”的基金份额。</p> <p>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换为变更后的“金鹰元禧混合型证券投资基金”后的费用，适用其所转入基金的费用、费率体系。</p> <p>4、本基金保本周期到期后，如基金份额持有人未进行到期操作，本基金符合保本基金存续条件，则基金管理人将默认基金份额持有人继续持有本基金基金份额；如基金份额持有人未进行到期操作，本基金不符合保本基金存续条件，则基金管理人将默认基金份额持有人选</p>

<p>择了继续持有变更后的“金鹰持续收益债券型证券投资基金”基金份额。</p>	<p>择了继续持有变更后的“金鹰元禧混合型证券投资基金”基金份额。</p>
<p>(四) 保本周期到期的保本条款</p> <p>1、在当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期并持有到期的基金份额持有人，无论选择赎回、转换为基金管理人管理的其他基金、或者转入下一保本周期或继续持有变更后的“金鹰持续收益债券型证券投资基金”基金份额，其持有到期的基金份额均适用保本条款。</p> <p>4、若基金份额持有人选择继续持有进入下一保本周期的基金份额或变更后的“金鹰持续收益债券型证券投资基金”的基金份额，而基金份额的可赎回金额加上基金份额在持有期间的累计分红金额之和低于保本额，差额部分即为保本赔付差额，基金管理人应补足该差额，以保本额（扣除相应基金份额在持有期间的累计分红金额）作为转入下一保本周期或转入变更后的“金鹰持续收益债券型证券投资基金”的转入金额，担保人对此提供不可撤销的连带责任担保。</p>	<p>(四) 保本周期到期的保本条款</p> <p>1、在当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期并持有到期的基金份额持有人，无论选择赎回、转换为基金管理人管理的其他基金、或者转入下一保本周期或继续持有变更后的“金鹰元禧混合型证券投资基金”基金份额，其持有到期的基金份额均适用保本条款。</p> <p>4、若基金份额持有人选择继续持有进入下一保本周期的基金份额或变更后的“金鹰元禧混合型证券投资基金”的基金份额，而基金份额的可赎回金额加上基金份额在持有期间的累计分红金额之和低于保本额，差额部分即为保本赔付差额，基金管理人应补足该差额，以保本额（扣除相应基金份额在持有期间的累计分红金额）作为转入下一保本周期或转入变更后的“金鹰元禧混合型证券投资基金”的转入金额，担保人对此提供不可撤销的连带责任担保。</p>
<p>(六) 转为变更后的“金鹰持</p>	<p>(六) 转为变更后的“金鹰元禧</p>

<p>续收益债券型证券投资基金”资产的形成</p> <p>1、保本周期届满时，若不符合保本基金存续条件，本基金变更为“金鹰持续收益债券型证券投资基金”。如果保本期到期日基金份额持有人在当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期并持有到期的基金份额的可赎回金额加上相应基金份额在当期保本周期内的累计分红金额之和低于保本额，差额部分即为保本赔付差额，基金管理人应补足该差额并以现金形式支付给基金份额持有人。</p> <p>2、对于投资者在本基金在当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期的基金份额、当期保本周期内申购或转换入的基金份额，选择或默认选择转为变更后的“金鹰持续收益债券型证券投资基金”的，转入金额等于选择或默认选择转为“金鹰持续收益债券型证券投资基金”的基金份额在“金鹰持续收益债券型证券投资基金”基金合同生效日前一个工作日所对应的基金资产净值。</p>	<p>混合型证券投资基金”资产的形成</p> <p>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“金鹰元禧混合型证券投资基金”。如果保本期到期日基金份额持有人在当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期并持有到期的基金份额的可赎回金额加上相应基金份额在当期保本周期内的累计分红金额之和低于保本额，差额部分即为保本赔付差额，基金管理人应补足该差额并以现金形式支付给基金份额持有人。</p> <p>2、对于投资者在本基金在当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期的基金份额、当期保本周期内申购或转换入的基金份额，选择或默认选择转为变更后的“金鹰元禧混合型证券投资基金”的，转入金额等于选择或默认选择转为“金鹰元禧混合型证券投资基金”的基金份额在“金鹰元禧混合型证券投资基金”基金合同生效日前一个工作日所对应的基金资产净值。</p>
<p>(七) 保本周期到期的公告</p>	<p>(七) 保本周期到期的公告</p>

	<p>2、保本周期届满时，若不符合保本基金存续条件，本基金将变更为“金鹰持续收益债券型证券投资基金”，基金管理人将在临时公告或《金鹰持续收益债券型证券投资基金招募说明书》中公告相关规则。</p>	<p>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“金鹰元禧混合型证券投资基金”，基金管理人将在临时公告或《金鹰元禧混合型证券投资基金招募说明书》中公告相关规则。</p>
<p>二十三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算</p>	<p>(一) 《基金合同》的变更</p> <p>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：</p> <p>(6) 变更基金类别，但在保本到期后在《基金合同》规定范围内变更为“金鹰持续收益债券型证券投资基金”除外；</p> <p>(7) 变更基金投资目标、范围或策略，但在保本到期后在《基金合同》规定范围内变更为“金鹰持续收益债券型证券投资基金”并按《基金合同》约定的“金鹰持续收益债券型证券投资基金”的投资目标、范围和策略执行的以及法律法规和中国证监会另有规定的除外；</p> <p>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：</p> <p>(1) 保本到期后，在《基金合同》规定范围内变更为“金鹰持续</p>	<p>(一) 《基金合同》的变更</p> <p>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：</p> <p>(6) 变更基金类别，但在保本到期后在《基金合同》规定范围内变更为“金鹰元禧混合型证券投资基金”除外；</p> <p>(7) 变更基金投资目标、范围或策略，但在保本到期后在《基金合同》规定范围内变更为“金鹰元禧混合型证券投资基金”并按《基金合同》约定的“金鹰元禧混合型证券投资基金”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；</p> <p>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：</p> <p>(1) 保本到期后，在《基金合同》规定范围内变更为“金鹰元禧混合型证券投资基金”，并按《基</p>

<p>收益债券型证券投资基金”，并按《基金合同》约定的“金鹰持续收益债券型证券投资基金”的投资目标、范围和策略执行；</p>	<p>金合同》约定的“金鹰元禧混合型证券投资基金”的投资目标、范围和策略执行；</p>
--	---

## （二）授权基金管理人修改基金合同及托管协议等法律文件

自《金鹰保本混合型证券投资基金基金合同》生效以来，《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规陆续修改和实施，基金管理人需要根据法律法规要求修订基金合同及托管协议的相关内容。

本次基金份额持有人大会的议案及基金合同修改要点经基金份额持有人大会通过并依法生效后，将作为修改金鹰保本混合型证券投资基金的合法依据之一，基金管理人将根据基金合同修改要点修订基金合同及托管协议等法律文件的相关内容。

综上所述，基金管理人拟提请基金份额持有人大会授权基金管理人按照法律法规的规定，根据上述事项修订《基金合同》及《托管协议》等法律文件。修订后的《基金合同》及《托管协议》等法律文件报中国证监会备案。

## （三）本基金基金合同及托管协议的生效

基金份额持有人大会同意修改基金合同及托管协议的议案后，修订内容将在表决通过之日起生效，本基金基金合同当事人将按照修改后的《金鹰保本混合型基金基金合同》享有权利并承担义务。

# 三、修改基金合同及托管协议的可行性

## （一）法律方面

根据相关法律法规及《基金合同》约定，基金合同的修改需召开基金份额持有人大会。根据《基金合同》约定，本次基金合同的修改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。

因此，本次基金合同的修改符合《基金合同》关于召开基金份额持有人大会的各项要求，与《中华人民共和国证券投资基金法》及配套办法等有关法律法规的有关规定并无抵触。

## （二）修改基金合同后投资运作的可行性

为实现修改基金合同的顺利完成，基金管理人已根据相关法律法规及《基金合同》的约定，做好同时本公司在基金运行的系统环境、人员准备、客户服务和市场推广、风险管理与应急计划等方面均建立有完备制度与业务流程，力求最大化保障基金份额持有人的利益。

### **（三）关于本次修改基金合同的合规情况说明**

1、本基金托管人中国工商银行股份有限公司对本次修改基金合同及托管协议出具了无异议函。

2、本基金管理人聘请的法律顾问为本次修改基金合同及托管协议出具了法律意见书，认为本基金修改基金合同及托管协议的方案的内容符合《基金法》、《运作办法》等法律法规的规定以及《基金合同》的约定；修改后的基金合同及托管协议符合《基金法》、《运作办法》等法律法规的规定；本基金基金合同及托管协议的修改已向证监会备案，经基金份额持有人大会审议批准通过后方可生效。

## **四、修改基金合同及托管协议的主要风险及预备措施**

### **（一）修改基金合同及托管协议方案被持有人大会否决的风险**

为防范修改基金合同及托管协议的方案被基金份额持有人大会否决的风险，基金管理人已提前向基金份额持有人征询意见。如有必要，基金管理人将根据基金份额持有人意见，对修改基金合同的方案等进行适当的修订。基金管理人可在必要情况下，推迟基金份额持有人大会的召开时间，或更改其他会务安排，并予以公告。

如果修改基金合同的方案未获得持有人大会批准，基金管理人将按照基金合同及法律法规有关规定对修改基金合同的方案重新表决或二次召集持有人大会。

### **（二）修改基金合同后投资目标和风险收益特征发生变化的风险**

本次修改基金合同完成后，本基金结束保本周期后若不符合保本基金存续条件，将转型成为金鹰元禧混合型证券投资基金，与原基金的投资目标、投资范围和投资策略等将发生变化，风险收益特征也将发生变化，提示投资者关注基金修改基金合同事项。

### **（三）修改基金合同后遭遇大规模赎回的风险**

为应对修改基金合同后遭遇大规模赎回，本基金在召开持有人大会后将保证

投资组合的流动性，应对修改基金合同前后可能出现的大规模赎回，降低净值波动率。

#### **（四）预防及控制在修改基金合同过程中的操作及市场风险**

为维护基金份额持有人利益，防范大额申赎或市场风险对基金净值造成大幅波动，基金管理人将根据申购赎回情况及对可能存在的市场投资风险进行有效评估，保持相对合理的仓位水平，科学有效地控制基金的市场风险。



附件三：

金鹰保本混合型证券投资基金  
基金份额持有人大会表决票

基金份额持有人姓名/名称：			
基金份额持有人证件号码（身份证件/营业执照）：			
受托人姓名/名称：			
受托人证件号码（身份证件/营业执照）：			
审议事项	同意	反对	弃权
关于金鹰保本混合型证券投资基金修改基金合同及托管协议的议案			
基金份额持有人/受托人签名或盖章			
2017 年 月 日			

说明：

- 1、请就审议事项表示“同意”、“反对”或“弃权”，并在相应栏内画“√”，同一议案只能表示一项意见。
- 2、以上表决意见是持有人或其受托人就持有人持有的本基金全部份额做出的表决意见。
- 3、签字/盖章部分不完整、不清晰的，或未能提供有效证明持有人身份或受托人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送达本公告中表决票指定寄达地点的，均视为无效表决。
- 4、本表决票可从相关网站下载、从报纸上剪裁、复印或按此格式打印。
- 5、本表决票中“证件号码”，仅指基金份额持有人认购、申购本基金时所使用的证件号码或该证件号码的更新。

## 附件四：

### 授权委托书

兹全权委托            先生 / 女士或公司单位代表本人（或本机构）参加投票截止日为2017年4月10日12:00的以通讯方式召开的金鹰保本混合型证券投资基金基金份额持有人大会，并代为行使表决权。表决意见以受托人的表决意见为准。

若金鹰保本混合型证券投资基金重新召开审议相同议案的持有人大会的，本授权继续有效。

委托人姓名/名称（签名/盖章）：

委托人证件号码（身份证号/营业执照注册号）：

基金账户号：

受托人姓名/名称（签名/盖章）：

受托人证件号码（身份证号/营业执照注册号）：

委托日期： 年 月 日

1、此授权委托书剪报、复印或按以上格式自制、在填写完整并签字盖章后均为有效。

2、授权委托书中“委托人证件号码”，指基金份额持有人认购或申购本基金时的证件号码或该证件号码的更新。

3、如本次持有人大会权益登记日，投资者未持有本基金的基金份额，则其授权无效。