



**金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）**  
**更新招募说明书全文**  
**2017 年第 1 号**

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

## 【重要提示】

金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）由金鹰元盛分级债券型发起式证券投资基金转换而来。本基金的募集已获中国证监会证监许可【2013】13 号文核准。本基金的基金合同经中国证监会基金监管部于 2013 年 5 月 2 日备案确认（基金部函[2013]309 号）后正式生效。根据《基金合同》的有关规定，金鹰元盛分级债券型发起式证券投资基金在基金合同生效后 2 年期届满，无需召开基金份额持有人大会，已自动转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）” 金鹰元盛 A，元盛 B 的基金份额已转换为上市开放式基金（LOF）份额。本基金基金合同于 2013 年 5 月 2 日正式生效。

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、本基金特有的风险等等。本基金资产将有一定比例投资于中小企业私募债券，受其具低流动性和较高信用风险的影响，相较于不投资中小企业私募债券的信用债基金，本基金总体风险更高。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

投资人申购本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。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。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本招募说明书中基金投资组合报告和基金业绩中的数据已经本基金托管人

复核。除非另有说明，本招募说明书所载内容截止日为 2017 年 5 月 2 日，有关财务数据截止日为 2017 年 3 月 31 日，净值表现截止日为 2017 年 3 月 31 日，本报告中财务数据未经审计。

## 目 录

一、绪言.....	5
二、释义.....	5
三、基金管理人.....	13
四、基金托管人.....	25
五、相关服务机构.....	29
六、基金的基本情况.....	60
七、基金份额的分级.....	63
八、基金份额折算.....	67
九、基金的募集.....	70
十、基金合同的生效.....	70
十一、基金份额的申购与赎回.....	71
十二、定期定额投资计划.....	84
十三、非交易过户、基金的冻结与解冻.....	84
十四、基金的转换、转托管.....	85
十五、基金份额的上市交易.....	87
十六、基金转型后的基金转换.....	88
十七、基金的投资.....	90
十八、基金的业绩.....	102
十九、基金的财产.....	104
二十、基金财产的估值.....	105
二十一、基金的收益与分配.....	112
二十二、基金的费用和税收.....	114
二十三、基金的会计与审计.....	117
二十四、基金的信息披露.....	118
二十五、风险揭示.....	124
二十七、基金合同的终止与基金财产的清算.....	130
二十八、基金合同的内容摘要.....	133
二十九、基金托管协议的内容摘要.....	151
三十、对基金份额持有人的服务.....	161
三十一、其它应披露事项.....	163

三十二、招募说明书的存放及查阅方式 .....	170
三十三、备查文件 .....	170

## 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《金鹰元盛分级债券型发起式证券投资基金基金合同》等相关法律文件编写。

本招募说明书阐述了基金的投资目标、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等相关法律文件编写，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：

基金或本基金：	指金鹰元盛分级债券型发起式证券投资基金及其转换后的金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）；
基金合同：	指《金鹰元盛分级债券型发起式证券投资基金基金合同》及其的任何有效修订和补充；
LOF 基金：	自基金合同生效之日起，2 年期届满之后，转型而成的金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）
招募说明书：	指《金鹰元盛分级债券型发起式证券投资基金招募说明书》及其定期更新；
发售公告：	指《金鹰元盛分级债券型发起式证券投资基金基金份额发售公告》

托管协议	指《金鹰元盛分级债券型发起式证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充；
中国证监会：	指中国证券监督管理委员会；
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；
《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》及不时做出的修订；
《反洗钱法》：	指 2006 年 10 月 31 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第二十四次会议通过，自 2007 年 1 月 1 日起实施的《中华人民共和国反洗钱法》及颁布机关对其不时作出的修订；
《销售办法》：	指由中国证监会公布并于 2013 年 6 月 1 日起实施的《证券投资基金销售管理办法》及不时做出的修订；
《运作办法》：	指中国证监会 2004 年 6 月 29 日颁布、同年 7 月 1 日实施并于 2014 年 7 月 7 日修改的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及不时做出的修订；
《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》及对其不时作出的修订；
《业务规则》：	指《金鹰基金管理有限公司开放式基金业务规则》以及深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司发布实施的相关业务规定，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金注册登记方面的业务规则，由基金管理人和基金投资者共同遵守；
元：	指人民币元；
基金管理人：	指金鹰基金管理有限公司；
基金托管人：	指中国建设银行股份有限公司；
注册登记业务：	指本基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包 括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及

- 基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等；
- 注册登记机构：指办理本基金注册登记业务的机构。本基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司；
- 投资者：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者；
- 个人投资者：指符合法律法规规定的条件可以投资证券投资基金的自然人；
- 机构投资者：指符合法律法规规定可以投资证券投资基金的在中华人民共和国境内合法注册登记并存续或经政府有关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机构；
- 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》及其他相关法律法规规定的条件，经中国证监会批准可投资于中国证券市场，并取得国家外汇管理局额度批准的中国境外的机构投资者；
- 基金份额持有人：指依招募说明书和基金合同合法取得基金份额的基金投资者；
- 基金份额持有人大会：指按照基金合同第十二部分之规定召集、召开并由基金份额持有人或其合法的代理人进行表决的会议；
- 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；
- 基金合同生效日：指基金募集期结束后达到法律法规规定及基金合同约定的备案条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并收到其书面确认的日期；
- 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，按照基金合同规定的程序终止基金合同的日期；
- 存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限；
- 基金份额分级：自本基金成立之日起 2 年内，本基金的基金份额划分为元盛 A、元盛 B 两级份额；在基金合同生效日，两者的份额配比不超过 7:3；
- 元盛 A：金鹰元盛分级债券型发起式证券投资基金之元盛 A 份额。元盛 A 根据基金合同的规定获得预期收益，并



- 自基金合同生效之日起每满 6 个月开放一次, 接受申购与赎回;
- 元盛 B: 金鹰元盛分级债券型发起式证券投资基金之元盛 B 份额。元盛 B 在基金合同生效后封闭运作, 封闭期为 2 年。本基金在扣除元盛 A 的本金和应计收益后的全部剩余资产归元盛 B 享有, 亏损以元盛 B 的资产净值为限由元盛 B 承担;
- 发起资金 基金管理人股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员、基金经理等投资管理人员参与认购的资金。发起资金认购本基金的金额不低于 2,000 万元, 其中认购元盛 A 和元盛 B 的发起资金各不低于 1,000 万元; 且自基金合同生效日起 3 年内锁定发起资金认购的基金份额 (包括其 2 年期届满后转型后的份额)
- 元盛 A 的开放日: 元盛 A 的开放日为基金合同生效日起每满 6 个月的最后一个工作日 (若基金合同于 2013 年 5 月 2 日生效, 则满 6 个月的最后一个工作日为 2013 年 11 月 1 日, 满 12 个月的最后一个工作日为 2014 年 4 月 30 日, 如此类推);
- 元盛 B 的封闭期: 自基金合同生效之日起至 2 年后的对应日止 (对应日是指对应日期, 如 2013 年 5 月 2 日的 2 年后的对应日应为 2015 年的 4 月 30 日)。若该对应日为非工作日, 则顺延至下一个工作日;
- 基金合同生效后 2 年期届满日: 自基金合同生效之日起 2 年后的对应日 (对应日是指对应日期, 如 2013 年 5 月 2 日的 2 年后的对应日应为 2015 年的 4 月 30 日)。如该对应日为非工作日, 则顺延至下一个工作日。基金合同生效后 2 年期届满日与元盛 B 的封闭期届满日相同;
- 折算日: 为开放日 (不包括基金合同生效后满 24 个月的开放日) 或基金合同生效后 2 年期届满日。在开放日 (不包括基金合同生效后满 24 个月的开放日), 根据净资产不变的原则, 将元盛 A 的基金份额折算为份额净值等于 1.000 元的元盛 A 的份额若干; 在基金合同生效后 2 年期届满日, 根据净资产不变的原则, 将元盛 A、元盛 B 的基金份额折算为份额净值等于 1.000 元

- 的金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）份额若干；
- 元盛 A 的申购与赎回份额： 在元盛 B 的封闭期内，元盛 A 每隔半年开放一次申购赎回，采用金额申购、份额赎回的方式；若开放日发生折算，则元盛 A 申购与赎回的份额皆指折算后的份额；
- 基金合同生效后 2 年期届满时的基金转型： 基金合同生效后 2 年期届满，本基金将按照基金合同的约定转型为开放式基金（LOF）的行为。转型后的基金名称变更为：“金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）”；
- 上市交易公告书： 《金鹰元盛分级债券型发起式证券投资基金之元盛 B 份额上市交易公告书》及《金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）上市交易公告书》；
- 上市交易所： 深圳证券交易所；
- 上市交易： 投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为；
- 工作日： 指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日；
- 认购： 指在基金募集期间，基金投资者申请购买基金份额的行为；
- 申购： 指在基金存续期内，基金投资者申请购买基金份额的行为；
- 赎回： 指在基金存续期内，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求基金管理人将其持有的基金份额转换成现金的行为；
- 巨额赎回： 基金合同生效之日起 2 年内，在元盛 A 的单个开放日，元盛 A 的基金份额净赎回申请（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）超过前一日元盛 A 总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。基金合同生效后 2 年期届满，本基金转型为上市开放式基金（LOF）后，在单个开放日，本基金

的基金份额净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日本基金总份额的 10%的情形；

**基金转换：**指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效的业务规则进行的本基金份额与基金管理人管理的、由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金份额间的转换行为；

**场内：**指通过深圳证券交易所内的会员单位利用交易所开放式基金交易系统办理基金份额认购、申购、赎回和上市交易的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场内认购、场内申购、场内赎回；

**场外：**指通过基金管理人或代销机构办理基金份额认购、申购和赎回的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、申购、赎回也称为场外认购、场外申购、场外赎回；

**会员单位：**指具有开放式基金代销资格，经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的、可通过深圳证券交易所开放式基金销售系统办理开放式基金的认购、申购、赎回和转托管等业务的深圳证券交易所会员单位；

**注册登记系统：**中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统；

**证券登记结算系统：**中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统；

**转托管：**指基金份额持有人将其持有的同一基金账户下的基金份额全部或部分从一交易账户转移到另一交易账户的行为；

**系统内转托管：**基金份额持有人将其持有的基金份额在注册登记系统内不同交易账户之间或证券登记结算系统内不同

	会员单位（席位）之间进行转托管的行为；
跨系统转托管：	基金份额持有人将其持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转托管的行为；
指令：	指基金管理人在运用基金财产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令；
基金销售业务：	指基金的宣传推介、认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务；
销售机构：	指直销机构和代销机构；
代销机构：	指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并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；
直销机构：	指金鹰基金管理有限公司；
基金销售网点：	指直销机构的直销中心、金鹰 E 路通网上交易平台及代销机构的代销网点；
定期定额投资计划：	投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、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者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
指定媒体：	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体；
基金账户：	指注册登记机构为基金投资者开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户；
交易账户：	指销售机构为基金投资者开立的、记录基金投资者通过该销售机构办理交易业务而引起的基金份额的变动及结余情况的账户；
开放日：	指为基金投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日；
T 日：	指销售机构在规定时间受理基金投资者申购、赎回或其他基金业务申请的工作日；
T+n 日：	指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）；

交易时间：	指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段；
基金收益：	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；
基金资产净值：	指基金资产总值减去基金负债后的价值；
基金份额参考净值：	如果估值日（T 日）为非开放日且非基金合同生效后 2 年期届满日，基金管理人在基金份额净值计算的基础上，采用“虚拟清算”原则，即假定该日为本基金在元盛 B 封闭期内的提前终止日，本基金按照基金合同约定的份额收益分配和资产分配规则进行资产分配从而计算得到 T 日本基金两级基金份额的估算价值。基金份额参考净值是对两类基金份额价值的一个估算，并不代表基金份额持有人可获得的实际价值；
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的数值；
基金资产估值：	指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程；
法律法规：	指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、司法解释、部门规章、地方性法规、地方政府规章及其他对基金合同当事人有约束力的规范性文件及对该等法律法规不时作出的修订；
不可抗力：	指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服，且在基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使基金合同当事人无法全部或部分履行基金合同的任何事件。

### 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

设立日期：2002 年 12 月 25 日

法定代表人：凌富华

总经理：刘岩

联系人：潘晓毅

联系电话：020-83282855

注册资本：人民币 2.5 亿元

股权结构：

股东名称	出资额(万元)	出资比例
广州证券股份有限公司	12250	49%
广州白云山医药集团股份有限公司	5000	20%
美的集团股份有限公司	5000	20%
东亚联丰投资管理有限公司	2750	11%
总计	25000	100%

#### （二）主要人员情况

##### 1、董事会成员

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。

陈静先生，董事。华中科技大学管理学硕士。曾任国泰君安证券股份有限公司投资银行部助理董事。现任广州白云山医药集团股份有限公司董事会秘书。

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。

殷孟波先生，独立董事。西南财经大学金融学博士。历任西南财经大学金融学院院长、研究生部主任等职务，现任西南财经大学金融学院教授委员会主席。

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。

## 2、监事会成员

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。

## 3、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，博士研究生。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。经公司第五届董事会第四次会议审议通过，并已按规定报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，博士研究生。2004年9月至2006年10月在广东证券公司（原）任研究员职务，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。经公司第五届董事会第二十五次会议审议通过，并已按规定报中国证券投资基金业协会备案，2016 年 5 月 12 日起担任公司副总经理。

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。

#### 4、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。

戴俊先生，美国密歇根大学金融工程硕士研究生，历任国泰基金管理有限公司基金经理助理、东兴证券股份有限公司债券交易员等职务，2016 年 7 月加入金鹰基金管理有限公司，现任金鹰元盛债券型发起式证券投资基金 (LOF)、金鹰保本混合型证券投资基金及金鹰持久增利债券型证券投资基金 (LOF) 基金经理。

#### 5、投资决策委员会成员

本公司设投资决策委员会、固定收益类投资决策委员会，具体如下：

##### (1) 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；

冯俊先生 投资决策委员会委员， 总经理助理；

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；

#### （2）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；

冯俊先生 投资决策委员会委员， 总经理助理；

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；

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、自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

2、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；

3、配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购和赎回业务；

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

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财产分别管理，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、依法募集基金，办理或者委托经由证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和注册登记手续；

- 9、办理基金备案手续；
- 10、按规定受理基金份额的申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- 11、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- 12、采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回及注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；
- 13、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 14、编制季度、半年度和年度基金报告；
- 15、按照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收益；
- 16、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；
- 17、保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、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，不得向他人泄露；
- 18、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；
- 19、执行生效的基金份额持有人大会的决定；
- 20、建立并保存基金份额持有人名册；
- 21、按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；
- 22、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；
- 23、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 24、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；
- 25、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；
- 26、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，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- 27、基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利

益向基金托管人追偿；

28、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；

29、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，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

30、法律法规、基金合同以及中国证监会规定的其它义务。

#### （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；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；

(9) 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，扰乱市场秩序；

(10) 贬损同行，以提高自己；

(11) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

(12) 以不正当手段谋求业务发展；

(13) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；

(14) 参与洗钱或为洗钱活动提供协助；

(15) 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、岗位责任、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，维护内部控制制度的有效执行。

**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、会计工作操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各业务部门和工作人员是否遵守法律、法规、规章的有关规定；检查公司各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：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：田 青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于 1954 年 10 月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于 2005 年 10 月在香港联合交易所挂牌上市（股票代码 939），于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市（股票代码 601939）。

2015 年末，本集团资产总额 18.35 万亿元，较上年增长 9.59%；客户贷款和垫款总额 10.49 万亿元，增长 10.67%；客户存款总额 13.67 万亿元，增长 5.96%。净利润 2,289 亿元，增长 0.28%；营业收入 6,052 亿元，增长 6.09%，其中，利

息净收入增长 4.65%，手续费及佣金净收入增长 4.62%。平均资产回报率 1.30%，加权平均净资产收益率 17.27%，成本收入比 26.98%，资本充足率 15.39%，主要财务指标领先同业。

物理与电子渠道协同发展。营业网点“三综合”建设取得新进展，综合性网点数量达 1.45 万个，综合营销团队 2.15 万个，综合柜员占比达到 88%。启动深圳等 8 家分行物理渠道全面转型创新试点，智慧网点、旗舰型、综合型和轻型网点建设有序推进。电子银行主渠道作用进一步凸显，电子银行和自助渠道账务性交易量占比达 95.58%，较上年提升 7.55 个百分点；同时推广账号支付、手机支付、跨行付、龙卡云支付、快捷付等五种在线支付方式，成功实现绝大多数主要快捷支付业务的全行集中处理。

转型业务快速增长。信用卡累计发卡量 8,074 万张，消费交易额 2.22 万亿元，多项核心指标继续保持同业领先。金融资产 1,000 万以上的私人银行客户数量增长 23.08%，客户金融资产总量增长 32.94%。非金融企业债务融资工具累计承销 5,316 亿元，承销额市场领先。资产托管业务规模 7.17 万亿元，增长 67.36%；托管证券投资基金数量和新增只数均为市场第一。人民币国际清算网络建设再获突破，继伦敦之后，再获任瑞士、智利人民币清算行资格；上海自贸区、新疆霍尔果斯特殊经济区主要业务指标居同业首位。

2015 年，本集团先后获得国内外各类荣誉总计 122 项，并独家荣获美国《环球金融》杂志“中国最佳银行”、香港《财资》杂志“中国最佳银行”及香港《企业财资》杂志“中国最佳银行”等大奖。本集团在英国《银行家》杂志 2015 年“世界银行品牌 1000 强”中，以一级资本总额位列全球第二；在美国《福布斯》杂志 2015 年度全球企业 2000 强中位列第二。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII 托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等 10 个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工 220 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## 2、主要人员情况

赵观甫，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行

信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力铮，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部，并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

### 3、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2016 年一季度末，中国建设银行已托管 584 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行自 2009 年至今连续六年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”。

## （二）基金托管人的内部控制制度

### 1、内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，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

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管业务部专门设置了监督稽核处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

## 3、内部控制制度及措施

资产托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、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

#### 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等情况进行监控，如发现投资异常情况，向基金管理人进行风险提示，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，对指令要素等内容进行核查。

（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和投资独立性等方面进行评价，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、相关服务机构

### (一) 基金份额销售机构

场外销售机构：

#### 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

总经理：刘岩

成立时间：2002 年 12 月 25 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字【2002】97 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：2.5 亿元人民币

存续期间：持续经营

联系人：潘晓毅

联系电话：020-83282950

传真电话：020-83283445

客户服务及投诉电话：4006-135-888

电子邮箱：csmail@gefund.com.cn

网址：www.gefund.com.cn

#### 2、代销机构（排名不分先后）

##### (1) 中国工商银行股份有限公司

注册（办公）地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号



法定代表人：易会满

联系人：查樱

电话：010-66105662

客服电话：95588（全国）

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

(2) 中国建设银行股份有限公司

注册（办公）地址：北京市西城区金融大街 25 号

法定代表人：王洪章

联系人：田青

电话：010-67595096

客服电话：95533（全国）

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

(3) 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：张作伟

客服电话：95559

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

(4) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市北京东路 689 号东银大厦 17 楼

法定代表人：吉晓辉

联系人：吴斌

客服电话：95528

网址：<http://www.spdb.com.cn>

(5) 中国民生银行股份有限公司

注册（办公）地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

联系人：穆婷

联系电话：（010）58560666

客服电话：95568（全国）

网址：www.cmbc.com.cn

（6）名称：广发银行股份有限公司

注册（办公）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/>

（7）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：谢永林

联系人：张莉

电话：021-38637673

客服电话：95511

网址：www.bank.pingan.com

（8）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.nbc.com.cn



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

(10) 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)

(11) 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)

(12) 和讯信息科技有限公司

注册（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>)

(13) 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](http://www.xds.com.cn)

(14) 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](http://www.noah-fund.com)

(15) 深圳众禄基金销售有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 层 I、J 单元

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

电话：0755- 33227950

客服电话：4006-788-887

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

(16) 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))

(17) 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))

(18) 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)

(19) 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))

(20) 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)）

(21) 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)

(22) 上海利得基金销售有限公司

注册地址：宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

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/>

(23) 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)

(24) 北京创金启富投资管理有限公司

注册地址：北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A

办公地址：北京市西城区白纸坊东街 2 号经济日报社 A 综合楼 712 室

法定代表人：梁蓉

联系人：李婷婷

电话：010-66154828

客服电话：400-6262-818

网址：[www.5irich.com](http://www.5irich.com)

(25) 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](http://www.zcvc.com.cn)

(26) 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](http://www.chtfund.com)

(27) 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](http://www.fundzone.cn)

(28) 一路财富(北京)信息科技有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街 9 号院 5 号楼 702 室

办公地址：北京市西城区阜城门内大街 2 号万通大厦 22 层 2208 室

法定代表人：吴雪秀

联系人：徐越

电话：010-88312887

客服电话：400-001-1566

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

(29) 北京钱景基金销售有限公司

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：陈剑伟

电话：010-57418813

客服电话：400-893-6885

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

(30) 北京唐鼎耀华投资咨询有限公司

注册地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 236 室  
办公地址：北京市朝阳区东三环北路 38 号院 1 号泰康金融中心 38 层  
法定代表人：张冠宇  
联系人：刘美薇  
联系电话：010-85870662  
客服电话：400-819-9868  
公司网站：www.tdyhfund.com

(31) 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  
电话 010-60615657  
客服电话：010-62675369  
公司网站：www.xincai.com

(32) 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>

(33) 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>

(34) 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/>

(35) 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)

(36) 上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

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)



(37) 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)

(38) 深圳富济财富管理有限公司

注册（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)

(39) 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>

(40) 上海陆金所资产管理有限公司

注册（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)

(41) 珠海盈米财富管理有限公司

注册地址: 珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

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)

(42) 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)

(43) 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: 江卉

联系人: 徐伯宇

客服电话: 95118

公司网址: <http://fund.jd.com>

(44) 上海云湾投资管理有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层

办公地址：上海市浦东新区锦康路 308 号 6 号楼 6 楼

法定代表人：戴新装

联系人：江辉

联系电话：021-20538888

客服电话：4008201515

公司网站：www.zhengtongfunds.com

（45） 北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

办公地址：北京市朝阳区望京 SOHO 塔 2,B 座 2507

法定代表人：钟斐斐

联系人：戚晓强

联系电话：010-61840688

客服电话：400-0618-518

公司网站：www.danjuanapp.com

（46） 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

（47） 杭州科地瑞富基金销售有限公司

注册地址：杭州市下城区武林时代商务中心 1604 室

办公地址：杭州市下城区上塘路 15 号武林时代 20 楼

法定代表人：陈刚

联系人：胡璇

联系电话：0571-85267500

客服电话：0571-86655920

公司网站：www.cd121.com

(48) 中证金牛（北京）投资咨询有限公司

注册地址：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

办公地址：北京市宣武门外大街甲一号新华社第三工作区 A 座 5 层

法定代表人：钱昊旻

联系人：仲甜甜

联系电话：010-59336492

客服电话：4008-909-998

公司网站：www.jnlc.com

(49) 浙江金观诚财富管理有限公司

注册地址：拱墅区霞湾巷 239 号 8 号楼 4 楼 403 室

办公地址：杭州市教工路 18 号 EAC 欧美中心 A 座 D 区 8 层

法定代表人：徐黎云

联系电话：0571-56028617

客服电话：400-068-0058

公司网址：www.jincheng-fund.com

(50) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：杨德红

联系人：朱雅崑

电话：021-38676767

客服电话：95521

网址：http://www.gtja.com

(51) 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

（52） 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>

（53） 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)

（54） 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)

（55） 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)

（56） 海通证券股份有限公司

注册（办公）地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：周杰

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)

（57） 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：4008888999

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

（58） 万联证券有限责任公司

注册（办公）地址：广州市中山二路 18 号电信广场 36-37 层

法定代表人：张建军

联系人：罗创滨

电话：020-37865070

客服电话：4008888133

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

（59） 民生证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层

办公地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-20 层

法定代表人：冯鹤年

联系人：韩秀萍

电话：010-85127609

客服电话：400-619-8888

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

（60） 国元证券股份有限公司

注册（办公）地址：合肥市寿春路 179 号国元大厦

法定代表人：蔡咏

联系人：李蔡

电话：0551-2272101

客服电话：95578（全国）

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

（61） 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)

（62） 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)

(63) 东吴证券股份有限公司

注册（办公）地址：苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦

法定代表人：范力

联系人：陆晓

电话：0512-62938521

客服电话：0512-96288

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

(64) 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)

(65) 方正证券股份有限公司

注册（办公）地址：湖南长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

法定代表人：雷杰

联系人：邵艳霞

电话：0731-85832507

客服电话：95571（全国）

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

(66) 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：丁益

联系人：金夏

电话：0755-83516289

客服电话：400-6666-888

网址：www.cgws.com

（67） 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

（68） 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

（69） 东北证券股份有限公司

注册（办公）地址：吉林省长春市生态大街 6666 号

法定代表人 李福春

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)

(70) 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)

(71) 新时代证券有限责任公司

注册（办公）地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

法定代表人：刘汝军

联系人：孙恺

电话：010-83561149

客服电话：4006-989898

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

(72) 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)

(73) 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>

(74) 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>

(75) 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：詹露阳

联系人：周一涵

电话：021-38637436

客服电话：95511 转 8

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

(76) 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)

(77) 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)

(78) 财富证券有限责任公司

注册地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26-28 层

办公地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 36 层

法定代表人：蔡一兵

联系人：梁令安

电话：0731-88954613

客服电话：95317

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

(79) 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>

(80) 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

(81) 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

(82) 国盛证券有限责任公司

注册（办公）地址：江西省南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦

法定代表人：曾小普

联系人：俞驰

电话：0791-86283080

客服电话：400-822-2111

网址：www.gsstock.com

(83) 世纪证券有限责任公司

注册（办公）地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 41 楼

法定代表人：姜昧军

联系人：袁媛

电话：0755-83199511

客服电话：0755-83199599

网址：www.csc.com.cn

(84) 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)

（85） 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)

（86） 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)

（87） 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>



(88) 华福证券有限责任公司

注册（办公）地址：福州市鼓楼区温泉街道五四路 157 号 7-8 层

法定代表人：黄金琳

联系人：郭相兴

电话：021-20655175

客服电话：96326

网址：<http://www.hfzq.com.cn>

(89) 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：毕明建（代）

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)

(90) 财通证券股份有限公司

注册（办公）地址：杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心

法定代表人：沈继宁

联系人：陶志华

电话：0571-87789160

客服电话：95336,40086-96336

网址：<http://www.ctsec.com>

(91) 五矿证券有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心办公楼 47 层 01 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心大厦 47、48、49 层

法定代表人：赵立功

联系人：王鹏宇  
电话：0755-83219194  
客服电话：40018-40028  
网址：www.wkzq.com.cn

(92) 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

(93) 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

(94) 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

(95) 日信证券有限责任公司

注册（办公）地址：内蒙古自治区内蒙古呼和浩特市锡林南路 18 号

法定代表人：孔佑杰

联系人：陈韦杉

电话：010-88086830

客服电话：010-88086830

网址：www.rxzq.com.cn

(96) 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

(97) 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

(98) 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)

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

(100) 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)

(101) 华宝证券有限责任公司

注册（办公）地址：上海市陆家嘴环路未来资产大厦 27 层

法定代表人：陈林

联系人：宋歌

电话：021-50122086

客服电话：021-38929908、400-820-9898

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

(102) 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

（103） 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/>

（104） 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>

（105） 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>

(106) 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)

金鹰元盛债券（LOF）的场内销售机构为具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员。

基金管理人可根据有关法律、法规的要求，调整本基金代理销售机构。

(二) 注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

办公地址：北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

法定代表人：周明

电话：（010）58598839

传真：（010）58598907

联系人：朱立元

(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

### 六、基金的基本情况

#### （一）基金的名称

在基金合同生效之日起 2 年内，本基金的名称为“金鹰元盛分级债券型发起式证券投资基金”，本基金的基金份额分为元盛 A、元盛 B 两级份额；基金合同生效后 2 年期届满，本基金转型为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）”

#### （二）基金的类别

债券型证券投资基金

#### （三）基金的运作方式

上市契约型开放式、发起式

自基金合同生效之日起 2 年内，元盛 A 自基金合同生效之日起每满 6 个月开放一次，元盛 B 封闭并上市交易，元盛 A 和元盛 B 的基金资产合并运作。基金合同生效后 2 年期届满，本基金转型为上市开放式基金（LOF）。基金合同生效后 2 年期届满日为：自基金合同生效之日起 2 年后的对应日（对应日是指对应日期，如 2013 年 5 月 2 日的 2 年后的对应日应为 2015 年 4 月 30 日）。如该对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日。



#### （四）基金份额的分级

自本基金合同生效之日起 2 年内，根据运作方式和风险收益特征的不同，将本基金的基金份额分为元盛 A、元盛 B 两级份额；基金合同生效之日，元盛 A、元盛 B 的份额配比不超过 7:3。元盛 A 根据基金合同的规定获得约定收益，并自基金合同生效之日起每满 6 个月开放一次；元盛 B 在 2 年的封闭期内封闭运作并上市交易，本基金在扣除元盛 A 的本金和应计收益后的全部剩余资产归元盛 B 享有，亏损以元盛 B 的资产净值为限由元盛 B 承担。

本基金基金合同生效后 2 年期届满，本基金转型为上市开放式基金（LOF）后，本基金将不再进行基金份额分级。在本基金基金合同生效后 2 年期届满日之前一个工作日（即基金合同生效后满 24 个月的最后一个工作日），元盛 A 份额的持有人可赎回所持有的份额，若不赎回，则其持有的元盛 A 份额将被默认转入“金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）”份额；元盛 B 基金份额持有人所持有的元盛 B 份额将被默认为转入“金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）”。

#### （五）基金的封闭期限

##### 1、元盛 A 的开放日

本基金基金合同生效之日起 2 年内，元盛 A 在基金合同生效后每满 6 个月开放一次，接受投资者的申购与赎回。元盛 A 的第一次开放日为基金合同生效日至满 6 个月的最后一个工作日；第二次开放日为基金合同生效之日至满 12 个月的最后一个工作日；以此类推。例如：如果本基金基金合同于 2013 年 5 月 2 日生效，基金合同生效之日起满 6 个月、满 12 个月、满 18 个月的最后一个工作日分别为 2013 年 11 月 2 日、2014 年 4 月 30 日、2014 年 11 月 1 日，以此类推。

元盛 A 的开放日以及开放办理申购与赎回业务的具体安排以基金管理人届时发布的相关公告为准。如因不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回业务的，开放日为不可抗力或其他情形影响因素消除之日的下一个工作日。

##### 2、元盛 B 的封闭期及上市交易

元盛 B 的封闭期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，则顺延至下一个工作日。本基金基金合同生效后 2 年内，在符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的前提下，元盛 B 将申请在深圳证券交易所上市交易。本基金基金合同生效后 2 年期届满，本基金按照基金合同约定及深圳

证券交易所规则转型为上市开放式基金（LOF）份额，转型后的基金份额将继续在深圳证券交易所上市交易。

#### （六）基金的投资目标

在严格控制投资风险的前提下，通过积极主动的投资管理，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，实现基金资产的长期稳定增值。

#### （七）发起资金

本基金将以基金管理人股东、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员、基金经理等投资管理机构的认购金额作为发起资金，发起资金不低于 2,000 万元，其中认购元盛 A 和元盛 B 的资金各不低于 1,000 万元，且承诺自基金合同生效日起三年内锁定发起资金认购的基金份额（包括所持份额于基金合同生效后 2 年期届满后进行转型而得的份额）。

本基金发起资金的认购情况见基金管理人届时发布的公告。

#### （八）基金的最低募集份额总额和金额

基金募集份额总额不少于 5000 万份，基金募集金额不少于 5000 万元人民币。

#### （九）基金份额初始面值、认购费用、赎回费用

本基金基金份额、元盛 A 份额、元盛 B 份额的初始面值均为人民币 1.00 元。

本基金不收取认购费用；在元盛 B 的封闭期内，若元盛 A 的份额持有人于元盛 A 的开放日赎回所持有的元盛 A 的份额，不收取赎回费；自基金合同生效之日起 2 年期届满后，本基金转型为上市开放式基金（LOF），赎回费用由基金赎回人承担，赎回费率最高不超过 5%。

#### （十）基金存续期限

不定期，若《基金合同》生效之日起三年后的对应日，若基金资产规模低于 2 亿元，基金合同自动终止，法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

## 七、基金份额的分级

### (一) 基金份额的分级

自基金合同生效之日起 2 年内, 根据运作方式和风险收益特征的不同, 将本基金的基金份额分为元盛 A、元盛 B 两级份额; 在基金合同生效之日, 元盛 A、元盛 B 的份额配比不超过 7:3。自本基金基金合同生效之日起 2 年内, 元盛 A 和元盛 B 的基金资产合并运作。在元盛 A 的开放日 (不包括基金合同生效后满 24 个月的开放日), 基金管理人将对元盛 A 进行基金份额折算, 元盛 A 的基金份额净值调整为 1.000 元, 基金份额持有人持有的元盛 A 份额数按折算比例相应增减。在元盛 A 的单个开放日, 如果元盛 A 没有赎回或者净赎回份额极小, 元盛 A、元盛 B 在该次开放日后的份额配比可能会出现大于 7:3 的情形; 如果元盛 A 的净赎回份额较多, 元盛 A、元盛 B 在该次开放日后的份额配比可能会出现小于 7:3 的情形。

### (二) 基金份额的运作

#### 1、元盛 A、元盛 B 运作方式

本基金基金合同生效之日起 2 年内, 元盛 A 在基金合同生效后每满 6 个月开放一次, 接受投资者的申购与赎回。元盛 B 封闭运作并上市交易, 封闭期内不接受申购与赎回。元盛 B 的封闭期为自基金合同生效之日起至 2 年后对应日止, 若该对应日为非工作日, 则顺延至下一个工作日。

#### 2、基金份额配比与规模控制

元盛 A、元盛 B 的份额分开募集、资产合并运作。基金合同生效日, 元盛 A、元盛 B 的份额配比不超过 7:3。在每一个开放日 (T 日) 的下一个工作日, 即 T+1 日, 所有经确认有效的元盛 A 的赎回申请全部予以成交确认, 所有经确认有效元盛 A 的申购申请, 基金管理人按照历史累计申购份额数不超过历史累计赎回份额数的原则进行成交确认。

具体规模控制及其控制措施见招募说明书、发售公告以及基金管理人在指定媒体上发布的其他相关公告。

### (三) 元盛 A、元盛 B 基金份额收益划分规则

元盛 A 根据基金合同的规定获取约定收益, 其收益率将在每个开放日设定

一次并公告。计算公式为：

元盛 A 的年收益率(单利) =  $\max(1 \text{ 年期银行定期存款利率(税后)} + 1.5\%, 2.5\%)$

即元盛 A 的年收益率约定为 1 年期银行定期存款利率(税后) + 1.5% 之和与 2.5% 中的孰大值。元盛 A 的年收益率采用四舍五入法保留到以百分比表示的小数点后第 2 位。

在基金合同生效日当日，基金管理人将根据届时中国人民银行公布并执行的、该日适用的金融机构人民币 1 年期银行定期存款基准利率设定元盛 A 的首次年收益率；在元盛 A 的每个开放日，基金管理人将根据该日中国人民银行公布并执行的、该日适用的金融机构人民币 1 年期银行定期存款基准利率重新设定下一个半年内适用的、元盛 A 的年化约定收益率，并于次日执行新的约定收益率。第 3 个开放日（即基金合同生效后满 18 个月的最后一个工作日）设定的元盛 A 的年化约定收益率执行至基金合同生效后 2 年期届满日（含）止。

如届时法律法规及其他规定对 1 年期银行存款利息征收利息税，则元盛 A 的年收益率(单利)的计算公式中“1 年期银行定期存款利率(税后)”指征税后的利率。例如：假设某一开放日中国人民银行公布的 1 年期银行定期存款利率为 2.75%，利息税为 5%，则 1 年期银行定期存款利率(税后)为  $2.75\% \times (1 - 5\%) = 2.61\%$ 。若基金合同生效当日或元盛 A 的某开放日，1 年银行定期存款利率(税后) + 1.5% 之和小于 2.5%，则基金管理人将设定下一个半年内适用的、元盛 A 的年化约定收益率为 2.5%，并于次日执行新的约定收益率。

在基金合同生效后 2 年内，本基金的净资产将优先支付元盛 A 的本金及应计收益，在扣除元盛 A 的本金和应计收益后的全部剩余资产归元盛 B 享有；如本基金的净资产等于或低于元盛 A 的本金及其约定应得收益的总额，则本基金净资产全部分配予元盛 A 后，仍存在额外未弥补的元盛 A 本金及约定收益总和的差额，则不再进行弥补。

基金管理人并不承诺或保证元盛 B 的封闭期满时元盛 A 份额持有人的约定应得收益，即如果在元盛 B 的封闭期末本基金资产出现极端损失的情况下，元盛 A 仍可能面临无法取得约定应得收益乃至投资本金损失的风险。

#### (四) 基金份额发售

元盛 A、元盛 B 将分别通过各自销售机构的销售网点独立进行公开发售。

#### （五）本基金的基金份额净值计算

本基金的基金份额净值计算公式如下：

$T$ 日基金份额净值= $T$ 日闭市后的基金资产净值/ $T$ 日基金份额的余额数量

本基金基金合同生效之日起2年内， $T$ 日基金份额的余额数量为元盛A和元盛B的份额总额；本基金基金合同生效后2年期满并转为上市开放式基金（LOF）后， $T$ 日基金份额的余额数量为该LOF基金的份额总额。在开放日（不包括基金合同生效后满24个月的开放日）或基金合同生效后2年期届满日，折算前本基金基金份额净值的计算，保留到小数点后8位，小数点后第9位及第9位之后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产；在基金合同生效后满24个月的开放日，非开放日且非基金合同生效后2年期届满日，保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

$T$ 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在  $T+1$  日内公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

#### （六）折算前元盛 A 和元盛 B 基金份额参考净值的计算

按照前述本基金资产及收益划分规则，在开放日与基金合同生效后 2 年期届满日，对元盛 A 与元盛 B 单独进行基金份额净值计算，并按各自的基金份额净值进行份额折算，但元盛 A 于基金合同生效后满 24 个月的开放日不进行折算。

假设NAV为开放日或基金合同生效后2年期届满日（即 $T$ 日，以下简称该日）折算前本基金份额净值， $E_a$ 为该日元盛A的份额余额， $NAV_a$ 为该日折算前元盛A的基金份额净值， $E_b$ 为该日元盛B的份额余额， $NAV_b$ 为该日折算前元盛B的基金份额净值， $E$ 为该日元盛A与元盛B的份额之和， $NAV_{a\text{设定}}$ 为该日元盛A的基金份额在上一个开放日份额净值（折算为1.000元）的基础上按照年化单利 $r_i$ 增长计算而得的设定净值， $T_i$ 为自第 $i$ 个开放日以来的天数（不包括第 $i$ 个开放日）， $r_i$ 为第 $i$ 个开放日设定并于次日执行的、下一个半年内适用的、元盛A的年化约定收益率，则：

$$NAV_{a\text{设定}} = 1.000 \times \left( 1 + \frac{T_i}{\text{运作当年实际天数}} \times r_i \right)$$

开放日或基金合同生效后2年期届满日，折算前元盛A和元盛B基金份额净值

的计算公式如下：

1、若 $NAV \leq NAV_{a\text{设定}} \times E_a / E$ ，则该日折算前元盛A和元盛B的基金份额净值为：

$$NAV_a = NAV \times E / E_a;$$

$$NAV_b = 0;$$

2、若 $NAV > NAV_{a\text{设定}} \times E_a / E$ ，则该日折算前元盛A和元盛B的基金份额净值为：

$$NAV_a = NAV_{a\text{设定}};$$

$$NAV_b = (NAV \times E - NAV_a \times E_a) / E_b;$$

在元盛 A 开放日（不包括金合同生效后满 24 个月的开放日）或基金合同生效后 2 年期届满日，折算前元盛 A 与元盛 B 的份额净值均保留到小数点后第 8 位，小数点后第 9 位及第 9 位之后的部分四舍五入；在基金合同生效后满 24 个月的开放日，不进行折算，元盛 A 与元盛 B 的份额净值均保留到小数点后第 3 位，小数点后第 4 位及第 4 位之后的部分四舍五入；由于四舍五入所产生的计算误差归入基金资产，并由基金管理人通知基金托管人对账务进行调整。

#### （七）元盛 A 和元盛 B 的基金份额参考净值的计算

基金合同生效后 2 年内，在非开放日且非基金合同生效后 2 年期届满日，基金管理人在基金份额净值计算的基础上，采用“虚拟清算”原则计算并公告元盛 A 和元盛 B 基金份额参考净值。在元盛 B 封闭期间的基金份额参考净值是对两级基金份额价值的一个估算，并不代表基金份额持有人可获得的实际价值。

元盛 A 和元盛 B 基金份额参考净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内与本基金基金份额净值一同公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

当估值日（即 T 日，以下简称该日）为非开放日，也非基金合同生效后 2 年期届满日，该日介于元盛 B 的封闭期内元盛 A 第 i 个开放日与第 i+1 个开放日之间（ $i = 0 \sim 3$ ；若  $i=0$ ，第 0 个开放日并非真正的开放日，而是指基金合同生效日；若  $i=3$ ，则  $i+1=4$ ，第 4 个开放日为基金合同生效后 2 年期届满日之前一个工作日）， $NAV_t$  为该日基金份额净值， $NAV_{a,t}$  为该日元盛 A 的基金份额参考净值， $E_a$  为该日元盛 A 的份额余额， $NAV_{b,t}$  为该日元盛 B 的基金份额参考净值， $E_b$  为该日元盛 B 的份额余额， $E$  为该日元盛 A 与元盛 B 的份额之和， $NAV_{a\text{设定}}$  为该日元盛 A 的基金份额在上



一个开放日份额净值（折算为1.0000元）的基础上按照年化单利 $r_i$ 增长计算而得的设定净值； $T_i$ 为自第*i*个开放日以来的天数（不包括第*i*个开放日），运作当年实际天数是指元盛A上一次开放日（如T日之前元盛A尚未进行开放，则为基金成立日）所在年度的实际天数， $r_i$ 为第*i*个开放日设定并于次日执行的、下一个半年内适用的、元盛A的年化约定收益率， $NAV_{a,i}$ 为第*i*个开放日元盛A的基金份额参考净值，则：

$$NAV_{a\text{设定}} = 1.000 \times \left( 1 + \frac{T_i}{\text{运作当年实际天数}} \times r_i \right)$$

基金份额参考净值日（即T日），元盛A和元盛B基金份额参考净值的计算公式如下：

1、若 $NAV \leq NAV_{a\text{设定}} \times E_a/E$ ，则T日元盛A和元盛B的基金份额参考净值为：

$$NAV_{a,t} = NAV \times E/E_a;$$

$$NAV_{b,t} = 0;$$

2、若 $NAV > NAV_{a\text{设定}} \times E_a/E$ ，则T日元盛A和元盛B的基金份额参考净值为：

$$NAV_{a,t} = NAV_{a\text{设定}};$$

$$NAV_{b,t} = (NAV \times E - NAV_a \times E_a)/E_b;$$

在非开放日且非基金合同生效后2年期届满日，元盛A和元盛B基金份额参考净值的计算，保留到小数点后第3位，小数点后第4位及第4位之后的部分四舍五入。

## 八、基金份额折算

本基金折算基准日为元盛A的开放日（不包括基金合同生效后满24个月的开放日），和基金合同生效后2年期届满日，折算基准日的具体计算见前述相关内容。本基金在折算基准日进行折算，折算规则如下：在开放日，根据净资产不变的原则，将元盛A的基金份额折算为份额净值等于1.000元的元盛A的份额若干，但基金合同生效后满24个月的开放日不进行折算；在基金合同生效后2年期届满日，根据净资产不变的原则，将元盛A、元盛B的基金份额折算为份额净值等于1.000元的金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）份额若干。



### （一）元盛 A 的开放日

元盛 A 的开放日（不包括基金合同生效后满 24 个月的开放日）之份额折算开放日日终（不包括基金合同生效后满 24 个月的开放日），元盛 A 的基金份额净值调整为 1.000 元，折算后，基金份额持有人持有的元盛 A 的份额数按照折算比例相应增减。

元盛 A 的基金份额折算公式如下：

元盛 A 的折算比例 = 折算日折算前元盛 A 的基金份额净值 / 1.000

元盛 A 经折算后的份额数 = 折算前元盛 A 的份额数 × 元盛 A 的折算比例

元盛 A 经折算后的份额数采用截尾的方式保留到小数点后两位，小数点第 3 位及第 3 位以后的部分舍去，由此产生的误差计入基金财产。

在实施基金份额折算时，折算日折算前元盛 A 的基金份额净值、元盛 A 的折算比例的具体计算见基金管理人届时发布的相关公告。

例如，在折算日，折算前某基金份额持有人持有 10000 份、份额参考净值为 1.02536818 元元盛 A 的基金份额，则折算后该基金投资者持有 10253.68 份份额净值为 1.00 元的元盛 A 的基金份额。

### 2、折算日元盛 B 的暂停交易

为保证折算日本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停元盛 B 的上市交易等业务，详见基金管理人届时发布的相关公告。

### （二）基金合同生效后 2 年期届满日的份额转型折算

在基金合同生效后 2 年期届满日终，将元盛 A、元盛 B 以各自的基金份额净值为基准，转型折算成面值为 1.000 元的金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）后的基金份额若干。

#### 1. 元盛 A 的份额转型折算

元盛 A 的基金份额转型折算公式如下：

届满日元盛 A 的转型折算比例 = 届满日折算前元盛 A 的基金份额净值 / 1.000

届满日元盛 A 经转型折算后持有的 LOF 基金份额数 = 届满日折算前元盛 A 的份额数 × 届满日元盛 A 的转型折算比例

元盛 A 经转型折算后的持有的 LOF 基金份额数采用截尾的方式保留到小数点后两位, 小数点第 3 位及第 3 位以后的部分舍去, 由此产生的误差计入基金财产。

例如, 折算前某基金份额持有人持有 10000 份元盛 A 的基金份额, 元盛 B 封闭期截止日元盛 A 的份额参考净值为 1.02536818 元, 则折算后该基金投资者持有 10253.68 份金鹰元盛债券型发起式证券投资基金 (LOF) 基金场外份额, 不再持有元盛 A 的基金份额。

## 2、元盛 B 的份额转型折算

元盛 B 的基金份额转型折算公式如下:

届满日元盛 B 的转型折算比例 = 届满日折算前元盛 B 的基金份额净值 / 1.000

届满日元盛 B 经转型折算后持有的 LOF 基金份额数 = 届满日折算前元盛 B 的份额数 × 届满日元盛 B 的转型折算比例

在计算过程中, 元盛 B 经转型折算后的持有的 LOF 基金场内份额采用截尾法保留到整数位, 元盛 B 经转型折算后的持有的 LOF 基金场外份额采用截尾法保留到小数点后第 2 位, 小数点第 3 位及第 3 位以后的部分舍去, 由此产生的误差计入基金财产。

例如, 折算前, 某基金份额持有人持有 10000 份元盛 A 份额, 10000 份元盛 B 份额 (场内), 折算日元盛 A 的份额参考净值为 1.02536818 元, 元盛 B 的份额参考净值为 1.18031768 元, 则折算后该基金投资者持有 10253.68 份金鹰元盛债券型发起式证券投资基金 (LOF) 场外份额、11803 份金鹰元盛债券型发起式证券投资基金 (LOF) 场内份额, 不再持有元盛 A 与元盛 B 的份额。

## 3、基金合同生效后 2 年期届满日之后 (不含基金合同生效后 2 年期届满日) 的基金份额净值计算

$T$  日基金份额净值 =  $T$  日基金资产净值 /  $T$  日金鹰元盛债券型发起式证券投资基金 (LOF) 基金份额

## 4、基金合同生效后 2 年期届满日元盛 B 的暂停交易

为保证折算日本基金的平稳运作, 基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停元盛 B 的上市交易等业务, 详见基金管理人届时发布的相关公告。

### （三）基金份额折算的公告

1、基金管理人须最迟于基金份额折算方案实施日前 2 日，在至少一家指定媒体和基金管理人网站上公告，并报中国证监会备案。

2、基金管理人应在基金份额折算结束后 2 日内，在至少一家指定媒体和基金管理人网站上公告，并报中国证监会备案。

## 九、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》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证监会证监许可【2013】13 号文核准。基金存续期为不定期，基金类型为债券型基金。

本基金的运作方式为契约型开放式。

本基金自 2013 年 4 月 8 日开始募集，并于 2013 年 4 月 23 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《基金合同》生效之日起 2 年内，元盛 A 自《基金合同》生效之日起每满 6 个月开放一次，元盛 B 封闭运作并上市交易；本基金《基金合同》生效后 2 年期届满，本基金转型为上市开放式基金（LOF）。

## 十、基金合同的生效

1、本基金基金合同于 2013 年 5 月 2 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。

2、基金合同生效后的存续期内，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，基金管理人应当及时报告中国证监会；基金份额持有人数量连续 20 个工作日达不到 200 人，或连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金管理人应当及时向中国证监会报告，说明出现上述情况的原因并提出解决方案。《基金合同》生效之日起三年后的对应日，若基金资产规模低于 2 亿元，基金合同自动终止。

法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

## 十一、基金份额的申购与赎回

自本基金基金合同生效之日起 2 年内，投资者可在元盛 A 的开放日对元盛 A 进行申购与赎回；基金合同生效后 2 年期届满，本基金转型为上市开放式基金（LOF）后，投资者可通过场外或场内两种方式对本基金进行申购与赎回。

### （一）元盛 A 的申购与赎回

#### 1、元盛 A 的开放日

元盛 A 自基金合同生效后 2 年内每满 6 个月的开放日（T 日），接受投资者的申购与赎回申请。开放日的具体安排见基金合同“四、基金份额的分级”中有关元盛 A 的运作方式的相关内容。因不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放元盛 A 的申购与赎回的，开放日为不可抗力或其他情形影响因素消除之日的下一个工作日。

元盛 A 的开放日以及开放办理申购与赎回业务的具体安排以基金管理人届时发布的相关公告为准。

#### 2、申购与赎回的账户

投资者办理元盛 A 的申购、赎回应使用经本基金注册登记机构及基金管理人认可的账户（账户开立、使用的具体事宜见相关业务公告）。

#### 3、申购与赎回场所

元盛 A 的销售机构包括基金管理人直销机构和基金管理人委托的代销机构。投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理元盛 A 的申购与赎回。基金管理人可根据情况增减基金代销机构，并在指定媒体上公告。若基金管理人或代销机构开通电话、传真或网上交易业务的，基金投资者可以以电话、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。

#### 4、申购与赎回的原则

（1）在元盛 A 的前三个开放日，元盛 A 份额的申购与赎回价格按“确定价原则”以申请当日经折算后的基金份额净值 1.000 元为基准进行计算；在元盛 A 的第四个开放日，元盛 A 份额的申购与赎回价格按“未知价”原则，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）采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

(3) 元盛 A 的基金份额持有人赎回时, 除指定赎回外, 基金管理人按“先进先出”的原则, 对该基金份额持有人账户在该销售机构托管的基金份额进行处理, 即确认日期在前的基金份额先赎回, 确认日期在后的基金份额后赎回;

(4) 当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销。基金管理人、基金注册登记机构另有规定的, 从其规定;

(5) 基金管理人可根据基金运作的实际情况依法对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

## 5、申购与赎回的程序

### (1) 申购和赎回申请的提出

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。

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

### (2) 申购和赎回申请的确认

在每一个开放日 (T 日) 的下一个工作日 (T+1 日), 元盛 A 的基金注册登记机构对投资者的申购与赎回申请进行有效性确认和成交确认。在 T+2 日后 (包括该日) 投资者应及时向销售机构或以销售机构规定的方式查询申购与赎回的成交情况。

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。

### (3) 申购和赎回申请的成交确认原则

在每一个开放日的下一个工作日, 即 T+1 日, 所有经确认有效的元盛 A 的赎回申请全部予以成交确认, 所有经确认有效元盛 A 的申购申请, 基金管理人按照历史累计申购份额数不超过历史累计赎回份额数的原则进行成交确认。如果对元盛 A 的全部有效申购申请进行确认后, 元盛 A 的累计申购份额数小于或等于累计赎回份额数, 基金管理人将对全部有效申购申请进行成交确认; 如果元盛 A 的累计申购份额数大于累计赎回份额数, 则对全部有效申购申请按比例进行成

交确认。

元盛 A 每次开放日的申购与赎回申请确认办法及确认结果见基金管理人届时发布的相关公告。

基金销售机构对元盛 A 申购和赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到元盛 A 申购和赎回申请。元盛 A 申购和赎回申请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，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将基金投资者已缴付的申购款项本金退还给基金投资者，由此产生的利息等损失由基金投资者自行承担。

基金投资者赎回申请成功后，基金管理人将通过注册登记机构及其相关销售机构在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

### 6、申购与赎回的数额限制

（1）元盛 A 在代销机构的首次单笔最低申购金额为人民币 1,000 元，追加申购的单笔最低申购金额为人民币 500 元；本公司直销网点的首次单笔最低申购金额为人民币 1,000 元，追加申购的单笔最低认购金额为人民币 500 元。

各销售机构对最低申购限额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

（2）基金份额持有人可将其全部或部分元盛 A 份额赎回，单笔赎回不得少于 500 份。某笔赎回导致基金份额持有人在某一销售机构全部交易账户的元盛 A 份额余额少于 500 份的，基金管理人有权强制该基金份额持有人全部赎回其在该销售机构全部交易账户持有的基金份额。

（3）本基金对单个投资者累计持有的基金份额上限不作限制。

（4）基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述对申购的金额和赎回的份额的数量限制，基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定至少在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。

### 7、申购、赎回费用

（1）元盛 A 不收取申购费用；



(2) 元盛 A 不收取赎回费用;

(3) 基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式,基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前 2 个工作日在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。

## 8、申购份额与赎回金额的计算

(1) 元盛 A 申购份额的计算

元盛 A 申购份额的计算公式:

申购份额 = 申购金额 / 申购当日元盛 A 的份额净值

如受理申请当日元盛 A 发生折算,当日元盛 A 基金份额净值为 1.000 元。

例 7: 在元盛 A 的开放日,某投资者投资 10,000 元申购元盛 A 并获得成交确认,且当日元盛 A 发生折算,则其可得到的元盛 A 份额计算如下:

申购份额 =  $10,000 / 1.00 = 10,000$  份

(2) 元盛 A 赎回金额的计算

采用“份额赎回”方式,赎回金额计算公式:

赎回总金额 = 赎回份额 × 赎回当日元盛 A 的份额净值

净赎回金额 = 赎回总金额

如受理申请当日元盛 A 发生折算,当日元盛 A 基金份额净值为 1.000 元。

例 8: 在元盛 A 的开放日,某投资者赎回 10,000 份元盛 A,且当日元盛 A 发生折算,则其可得到的赎回金额计算如下:

赎回总金额 =  $10,000 \times 1.00 = 10,000$  元

净赎回金额 = 10,000 元

(3) 基金份额净值计算

本基金基金份额净值的具体计算公式见本招募说明书第六部分。

(4) 申购份额、余额的处理方式

元盛 A 的申购份额按实际确认的申购金额除以 1.000 元确定。元盛 A 的申购份额计算结果保留到小数点后 2 位,小数点后两位以后的部分舍去,由此产生的误差计入基金财产。

(5) 赎回金额的处理方式

元盛 A 的赎回金额按实际确认的有效赎回份额乘以 1.000 元为基准,赎回金额计算结果保留到小数点后 2 位,小数点后两位以后的部分舍去,由此产生的误差计入基金财产。

## 9、申购和赎回的注册登记

元盛 A 申购与赎回的注册登记业务，按照中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

投资者申购元盛 A 份额成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者登记权益并办理注册登记手续。

投资者赎回元盛 A 份额成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益的注册登记手续。

中国证券登记结算有限责任公司可依法对上述相关规定予以调整，并最迟于开始实施前 3 个工作日在至少一家指定媒体及基金管理人网站上公告。

## 10、拒绝或暂停申购的情形及处理方式

除非出现如下情形，基金管理人不得暂停或拒绝基金投资者对元盛 A 的申购申请，此时，基金份额持有人所提交的将基金管理人管理的其他基金转换为元盛 A 基金的转入申请可按同样的方式处理：

- （1）不可抗力的原因导致基金无法正常工作；
- （2）证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- （3）发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- （4）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；
- （5）元盛 A 的开放日，按基金管理人届时公告的申购确认规则和程序，当日已接受的申购申请已达到该开放日元盛 A 之规模上限，需进行比例成交确认；
- （6）法律法规规定或中国证监会认定的其他情形；
- （7）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（6）项暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体和基金管理人网站上刊登暂停申购公告。

## 11、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受基金投资者对元盛 A 的赎回申请或延缓支付赎回款项，此时，元盛 A 基金向基金管理人管理的其他基金的转出申请可按同样的方式处理：



- (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) 元盛 A 在开放日巨额赎回，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) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在当日向中国证监会备案并在指定媒体上和基金管理人网站上公告，已确认的赎回申请，基金管理人应按时足额支付；如暂时不能足额支付，可支付部分按单个账户申请量占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工作日予以支付。

#### (2) 巨额赎回的认定

单个开放日内，元盛 A 的基金份额净赎回申请（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）超过前一日元盛 A 总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

当出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定支付全部赎回款项或延缓支付部分赎回款项。

(1) 支付全部赎回款项：当基金管理人认为有能力支付投资者的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

(2) 延缓支付部分赎回款项：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请可能会对基金的资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金资产净值的 10%的前提下，对其余已经接受的有效赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒体公告。对于单个基金份额持有人的赎回申请，应当按照其申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该单个基金份额持有人当日办理的赎回份额。

(3) 巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并顺延赎回时，基金管理人应在 2 日内通过指定媒体或基金代销机构的网点刊登公告。

## （二）《基金合同》生效后 2 年期届满并进行基金转型后的申购与赎回

### 1、申购与赎回的开放日及时间

自转型为上市开放式基金（LOF）之日起不超过 30 日，开始办理上市开放式基金（LOF）的申购、赎回，基金管理人应在开始办理申购赎回的具体日期前 2 日在至少一家指定媒体及基金管理人互联网网站上（以下简称“网站”）公告。

申购和赎回的开放日为证券交易所交易日（基金管理人公告暂停申购或赎回时除外），投资者应当在开放日办理申购和赎回申请。开放日的具体业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所交易日的交易时间。投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或者转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

若出现新的证券交易市场或交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对申购、赎回时间进行调整，但此项调整应在实施日前 2 日在指定媒体公告。

### 2、申购与赎回场所

上市开放式基金（LOF）的场外销售机构包括基金管理人直销机构和基金管理人委托的代销机构，场外申购的上市开放式基金（LOF）份额登记在注册登记系统下；场内销售机构为具有相应业务资格的深圳证券交易所会员单位，场内申购的上市开放式基金（LOF）份额登记在证券登记结算系统下。

投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购与赎回。基金管理人可根据情况增减基金代销机构，并在指定媒体上公告。

若基金管理人或代销机构开通电话、传真或网上交易业务的，基金投资者可以以电话、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。

### 3、申购与赎回的账户

投资者办理本基金申购、赎回应使用经本基金注册登记机构及基金管理人认可的账户（账户开立、使用的具体事宜见相关业务公告）。

### 4、申购与赎回的原则

（1）“未知价”原则，即上市开放式基金（LOF）份额的申购与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）基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份

额申请；

（3）场外赎回按“先进先出”的原则，对该基金份额持有人账户在该销售机构托管的基金份额进行处理，即确认日期在前的基金份额先赎回，确认日期在后的基金份额后赎回，以确定所适用的赎回费率；

（4）当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间内撤销；

（5）基金管理人、注册登记机构或证券交易所在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前依照有关规定在指定媒体及基金管理人网站上予以公告。

## 5、申购与赎回的程序

### （1）申购和赎回申请的提出

基金投资者必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

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

### （2）申购和赎回申请的确认

T 日规定时间受理的申请，正常情况下，注册登记机构在 T+1 日内（包括该日）为基金投资者对该交易的有效性进行确认，基金投资者可在 T+2 日后（包括该日）到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。

销售机构对申购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购申请。申购的确认以注册登记机构的确认结果为准。

### （3）申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成或无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将基金投资者已缴付的申购款项本金退还给基金投资者。

基金投资者赎回申请成功后，基金管理人将通过注册登记机构及其相关销售机构在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照本基金基金合同有关条款处理。

## 6、申购与赎回的数额限制

(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) 本基金对单个投资者累计持有的基金份额上限不作限制。

(5) 基金管理人可根据市场情况, 在法律法规允许的情况下, 调整上述对申购的金额和赎回的份额的数量限制, 基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定至少在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。

## 7、申购费用和赎回费用

(1) 本基金不收取申购费用。

(2) 赎回费率

本基金的场外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:

持有期限 (T)	赎回费率
T < 90 天	0.1%
T ≥ 90 天	0

本基金的场内赎回费率为 0.1%。

(3) 本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取, 扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产, 赎回费归入基金财产的比例不得低于赎回费总额的 25%。

(4) 本基金由原有元盛 A、元盛 B 份额转入的场外份额不收取赎回费; 由原有元盛 A、元盛 B 份额转入的场内份额赎回费率为 0.1%。

(5) 基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式, 基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前 2 个工作日在至少一家指定

媒体上公告。

## 8、申购份额与赎回金额的计算

### (1) 本基金申购份额的计算

本基金申购份额的计算公式：

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

例 9：某投资者通过场外投资 10,000 元申购本基金，假定申购当日基金份额净值为 1.050 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{申购份额} = 10,000 / 1.050 = 9,523.80 \text{ 份}$$

### (2) 本基金赎回金额的计算

采用“份额赎回”方式，赎回价格以 T 日的基金份额净值为基准进行计算，计算公式：

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

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

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

例 10：某投资者赎回本基金 10,000 份，持有时间为 80 天，对应的赎回费率为 0.1%，假设赎回当日的基金份额净值是 1.050 元，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回总金额} = 10,000 \times 1.050 = 10,500 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 10,500 \times 0.10\% = 10.50 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 10,500 - 10.5 = 10,489.50 \text{ 元}$$

### (3) 本基金基金份额净值的计算

$$\text{T 日上市开放式基金 (LOF) 份额净值} = \text{T 日闭市后的上市开放式基金 (LOF) 资产净值} / \text{T 日上市开放式基金 (LOF) 份额的余额数量}$$

T 日的上市开放式基金 (LOF) 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。基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

### (4) 申购份额、余额的处理方式

场外申购时，申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以申请当日基金份额净值为基准计算，截尾法保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担；场内申购时，申购的有效份额为按实际确认的

申购金额在扣除相应的费用后，以申请当日基金份额净值为基准计算，保留到整数位，不足一份基金份额部分的申购资金零头由交易所会员单位返还给基金投资者。

例 11：如例 9，某投资者通过场外投资 10,000 元申购本基金，假定申购当日的基金份额净值为 1.050 元，则其可得到的申购份额为 9,523.80 份（截尾法保留到小数后 2 位）。

如果该投资者选择通过场内申购，则因场内份额保留至整数份，故投资者申购所得份额为 9,523 份，不足 1 份部分对应的申购资金返还给投资者。计算方法如下：

实际净申购金额 =  $9,523 \times 1.050 = 9,999.15$  元

退款金额 =  $10,000 - 9,999.15 = 0.85$  元

（5）赎回金额的处理方式：

赎回费用以人民币元为单位，计算结果按照截尾方法，保留小数点后两位；赎回金额计算结果按照截尾方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

## 9、申购和赎回的注册登记

上市开放式基金（LOF）申购与赎回的注册登记业务，按照中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

投资者申购基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者登记权益并办理注册登记手续，投资者自 T+2 日（含该日）后有权赎回该部分基金份额。

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

中国证券登记结算有限责任公司可依法对上述相关规定予以调整，并最迟于开始实施前 3 个工作日在至少一家指定媒体及基金管理人网站上公告。

## 10、拒绝或暂停申购的情形及处理方式

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受基金投资者的申购申请，此时，基金份额持有人所提交的将基金管理人管理的其他基金转换为上市开放式基金（LOF）的转入申请可按同样的方式处理：

- （1）不可抗力的原因导致上市开放式基金（LOF）无法正常运转；
- （2）证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日上市



开放式基金（LOF）资产净值；

（3）发生基金合同规定的暂停上市开放式基金（LOF）资产估值情况；

（4）上市开放式基金（LOF）资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或可能对上市开放式基金（LOF）业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益；

（5）法律法规规定或中国证监会认定的其他情形；

（6）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（5）项暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体和基金管理人网站上刊登暂停申购公告。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理，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。

#### 11、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受基金份额持有人的赎回申请或延缓支付赎回款项，此时，基金份额持有人所提交的将上市开放式基金（LOF）转换为基金管理人管理的其他基金的转出申请可按同样的方式处理：

（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上市开放式基金（LOF）资产净值；

（3）发生基金合同规定的暂停上市开放式基金（LOF）资产估值情况；

（4）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，导致上市开放式基金（LOF）的现金支付出现困难；

（5）法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在当日向中国证监会备案并在指定媒体和基金管理人网站上公告，已确认的赎回申请，基金管理人应按时足额支付；如暂时不能足额支付，可支付部分按单个账户申请量占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工作日予以支付。

同时，在出现上述第（4）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上公告。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上公告。

## 12、巨额赎回的情形及处理方式

### （1）巨额赎回的认定

在上市开放式基金（LOF）单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日基金总份额的 10%时，即认为发生了巨额赎回。

### （2）巨额赎回的处理方式

当上市开放式基金（LOF）出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分顺延赎回。

1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付基金份额持有人的赎回申请时，按正常赎回程序执行。

2) 部分顺延赎回：当基金管理人认为支付基金份额持有人的赎回申请有困难或认为支付基金份额持有人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额的 10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；基金份额持有人未能赎回部分，基金份额持有人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获赎回的部分申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以该开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额。如基金份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择，基金份额持有人未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

### （3）巨额赎回的公告

当发生巨额赎回并顺延赎回时，基金管理人应在 2 日内通过中国证监会指定媒体、基金管理人的公司网站上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，并通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个工作日内通知基金份额持有人，并说明有关处理方法。



连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；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，并应当在指定媒体和基金管理人网站上进行公告。

巨额赎回的处理方式按照中国证券登记结算有限公司有关业务规则执行。

### 13、重新开放申购或赎回的公告

（1）如发生暂停的时间为 1 日，第 2 个工作日基金管理人应依照有关规定在指定媒体和基金管理人网站上刊登上市开放式基金（LOF）重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个工作日的上市开放式基金（LOF）份额净值。

（2）如发生暂停的时间超过 1 日但少于 2 周（含 2 周），暂停结束，上市开放式基金（LOF）重新开放申购或赎回时，基金管理人应依照《信息披露管理办法》的有关规定，在指定媒体和基金管理人网站上刊登上市开放式基金（LOF）重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个工作日的上市开放式基金（LOF）份额净值。

（3）如发生暂停的时间超过 2 周，暂停期间，基金管理人应每 2 周至少刊登暂停公告 1 次。暂停结束，上市开放式基金（LOF）重新开放申购或赎回时，基金管理人应依照《信息披露管理办法》的有关规定，在指定媒体和基金管理人网站上刊登上市开放式基金（LOF）重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个工作日的上市开放式基金（LOF）份额净值。

## 十二、定期定额投资计划

在各项条件成熟的情况下，本基金可为基金投资者提供定期定额投资计划服务，具体实施方法以更新后的招募说明书和基金管理人届时公告为准。

## 十三、非交易过户、基金的冻结与解冻

### （一）基金的非交易过户

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的规定从某一基金份额持有人基金账户转移到另一基金份额持有人基金账户的行为或者按照相关法律法规或国家有权机关另有要求的方式进行处理

的行为，包括继承、捐赠、司法强制执行，以及基金注册登记机构认可的其它行为。无论在何种情况下，接受划转的主体必须是合格的个人投资者或机构投资者，但相关法律法规或者有权机关另有要求的除外。

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；捐赠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社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供注册登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请在注册登记机构规定的期限内办理，并按基金注册登记机构规定的标准收费。注册登记机构负责受理上述情况下的非交易过户，其他销售机构不得办理该项业务。

对于符合条件的非交易过户申请按《业务规则》的有关规定办理。

## （二）基金的冻结与解冻

基金账户和基金份额冻结、解冻的业务，由注册登记机构办理。

注册登记机构只受理国家有关机关依法要求的基金账户或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的基金账户或基金份额的冻结与解冻。基金账户或基金份额被冻结的，被冻结基金份额所产生的权益一并冻结，法律法规、中国证监会或法院判决、裁定另有规定的除外。被冻结部分份额仍然参与收益分配。

当基金份额处于冻结状态时，注册登记机构或其他相关机构应拒绝该部分基金份额的赎回申请、转出申请、非交易过户以及基金的转托管申请。

## 十四、基金的转换、转托管

### （一）基金的转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金基金合同的规定决定开办本基金（本基金基金合同生效之日起 2 年内，为元盛 A）与基金管理人管理的且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，具体业务办理时间、业务规则及转换费率由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告，并及时告知基金托管人与相关机构。

## （二）转托管

### 1、本基金基金合同生效之日起 2 年内的转托管

本基金基金合同生效之日起 2 年内，元盛 A 的基金份额登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下，基金份额持有人可将持有的元盛 A 份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间进行转托管，基金份额持有人在变更办理元盛 A 赎回业务的销售机构（网点）时，可办理已持有元盛 A 的基金份额的系统内转托管。具体办理方法参照《业务规则》的有关规定以及基金代销机构的业务规则。

元盛 B 的转托管与以下“本基金转型为上市开放式基金（LOF）后的转托管”相同。

### 2、本基金转型为上市开放式基金（LOF）后的转托管

本基金的份额采用分系统登记的原则。场外转入或申购买入的基金份额登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下；场内转入、申购或上市交易买入的基金份额登记在证券登记结算系统基金份额持有人证券账户下。登记在证券登记结算系统中的基金份额既可以在深圳证券交易所上市交易，也可以直接申请场内赎回。登记在注册登记系统中的基金份额可申请场外赎回。

本基金的转托管包括系统内转托管和跨系统转托管。

#### （1）系统内转托管

1) 系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为。

2) 基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理基金赎回业务的销售机构（网点）时，可办理已持有基金份额的系统内转托管。

3) 基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理上市交易或场内赎回的会员单位（席位）时，可办理已持有基金份额的系统内转托管。

具体办理方法参照《业务规则》的有关规定以及基金代销机构的业务规则。

#### （2）跨系统转托管

1) 跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转托管的行为。

2) 本基金跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

本基金相关转托管业务已于2013年6月5日开通，具体办理可参见相关规则。

## 十五、基金份额的上市交易

### （一）基金份额的上市交易

本基金《基金合同》生效后 2 年内，在元盛 B 符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，元盛 B 的基金份额将申请在深圳证券交易所上市交易。元盛 B 上市后，登记在证券登记结算系统中的元盛 B 份额可直接在深圳证券交易所上市交易；登记在注册登记系统中的元盛 B 份额可通过办理跨系统转托管业务将基金份额转托管在证券登记结算系统中，再上市交易。

本基金《基金合同》生效后 2 年期届满，本基金按照《基金合同》约定及深圳证券交易所规则转型为上市开放式基金（LOF）份额，转型后的基金份额将继续在深圳证券交易所上市交易。基金上市后，登记在证券登记结算系统中的基金份额可直接在深圳证券交易所上市交易；登记在注册登记系统中的基金份额可通过办理跨系统转托管业务将基金份额转托管在证券登记结算系统中，再上市交易。

### （二）上市交易的地点

深圳证券交易所。

### （三）上市交易的时间

元盛 B 在《基金合同》生效后三个月内申请在深圳证券交易所上市交易。元盛 B 已于 2013 年 6 月 5 日在深圳证券交易所上市交易。

本基金基金合同生效后 2 年期届满，本基金按照基金合同约定及深圳证券交易所规则转型为上市开放式基金（LOF）份额后，本基金将自转型为上市开放式基金（LOF）之日起 30 日内恢复在深圳证券交易所的上市交易。

### （四）上市交易的规则

1、元盛 B 上市首日的开盘参考价为其前一工作日的基金份额参考净值；

2、本基金转型为上市开放式基金 (LOF) 后, 本基金上市首日的开盘参考价为前一个工作日的基金份额净值;

3、本基金实行价格涨跌幅限制, 涨跌幅比例为 10%, 自上市首日起实行;

4、本基金买入申报数量为 100 份或其整数倍;

5、本基金申报价格最小变动单位为 0.001 元人民币;

6、本基金上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及相关规定。

#### (五) 上市交易的费用

本基金 (本基金基金合同生效之日起 2 年内, 指元盛 B) 上市交易的费用按照深圳证券交易所相关规则及有关规定执行。

#### (六) 上市交易的行情揭示

本基金 (本基金基金合同生效之日起 2 年内, 指元盛 B) 在深圳证券交易所挂牌交易, 交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示前一交易日的基金份额净值 (本基金基金合同生效之日起 2 年内, 为元盛 B 的基金份额参考净值)。

#### (七) 上市交易的停复牌与暂停上市、恢复上市和终止上市

本基金 (本基金基金合同生效之日起 2 年内, 指元盛 B) 的停复牌与暂停、终止上市按照相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所的相关规定执行。

#### (八) 其它情形

相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的, 本基金基金合同相应予以修改, 且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

### 十六、基金转型后的基金转换

#### (一) 基金转型后的基金存续形式

本基金基金合同生效后 2 年期届满, 无需召开基金份额持有人大会自动转型为上市开放式基金 (LOF), 本基金名称变更为“金鹰元盛债券型发起式证券投资

资基金（LOF）”。元盛A、元盛B的基金份额将以各自的基金份额净值为基准、根据净资产不变的原则，折算为上市开放式基金（LOF）份额，并办理基金的申购与赎回业务。

本基金转型为上市开放式基金（LOF）后，基金份额仍将在深圳证券交易所上市交易。

## （二）基金转型时元盛 A 的处理方式

本基金基金合同生效后2年期届满日之前一个工作日（即基金合同生效后满24个月的最后一个工作日），元盛A份额的持有人可赎回所持有的份额，若不赎回，则其持有的元盛A份额将被默认转入“金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）”份额。

本基金基金合同生效后 2 年期届满日前，基金管理人将提前进行提示性公告。

## （三）基金转型时的份额折算规则

### 1、基金合同生效后2年期届满日元盛B的暂停交易

为保证折算日本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停元盛 B 的上市交易等业务，详见基金管理人届时发布的相关公告。

### 2、折算方法

在基金合同生效后 2 年期届满日终，将元盛 A、元盛 B 按照各自的基金份额净值折算成面值为 1.000 元的上市开放式基金（LOF）后的基金份额若干。

具体折算方法，详见本基金基金合同“五、基金份额折算”。

在进行份额折算时，元盛 A、元盛 B 的场外份额将折算成上市开放式基金（LOF）场外份额，且均登记在注册登记系统下；元盛 B 的场内份额将折算成上市开放式基金（LOF）场内份额，仍登记在证券登记结算系统下。

在实施基金份额折算时，元盛 A 份额（或元盛 B 份额）的折算比率、元盛 A（或元盛 B）基金份额持有人持有的转型后上市开放式基金（LOF）份额的具体计算见基金管理人届时发布的相关公告。

### 3、份额转型后的基金运作

元盛 A、元盛 B 的份额全部折算为上市开放式基金（LOF）份额之日起 30



日内，本基金将上市交易，并接受场外与场内申购和赎回。份额折算后，上市开放式基金（LOF）上市交易、开始办理申购与赎回的具体日期见基金管理人届时发布的相关公告。

#### 4、份额折算的公告

（1）在本基金基金合同生效后 2 年期届满日前 30 个工作日，基金管理人将就本基金进行基金折算的相关事宜进行提示性公告。

（2）本基金基金合同生效后 2 年期届满时，本基金将转型为上市开放式基金（LOF），基金管理人将依照相关法律法规的规定就本基金进行基金折算的相关事宜进行公告，并报中国证监会备案；

（3）元盛 A、元盛 B 进行份额折算后，基金管理人应在至少一家指定媒体和基金管理人网站上公告，并报中国证监会备案。

#### （四）基金转型后基金的投资管理

本基金基金合同生效后 2 年期届满，本基金转型为上市开放式基金（LOF）后，除每日需持有现金和到期日不超过一年期的政府债券不低于基金资产净值的 5% 外，本基金的投资目标、投资理念、投资范围和投资限制、投资管理程序等保持不变。

## 十七、基金的投资

### （一）投资目标

在严格控制投资风险的前提下，通过积极主动的投资管理，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，实现基金资产的长期稳定增值。

### （二）投资理念

坚持“主动管理、严控风险、理性决策、稳健投资”的投资理念，在审慎权衡投资品种的安全性、收益性与流动性的基础上，努力把握投资机会，谋求基金资产的长期稳定增值。

### （三）投资范围

本基金主要投资于固定收益类金融工具，包括国债、央行票据、金融债、次级债、企业债、公司债、可转债（含分离交易可转债）、资产支持证券、中小企业私募债、短期融资券、债券回购、银行存款等固定收益类品种，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益证券品种（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，不参与一级市场新股的申购或增发，但可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资分离交易可转债而产生的权证等。因上述原因持有的股票和权证等资产，本基金将在其可交易之日起 90 个交易日内卖出。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，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金融工具的投资比例不低于基金资产的 80%，其中中小企业私募债券的投资比例不超过基金资产的 20%；为维持投资组合的流动性，元盛 A 的开放日或基金合同生效后 2 年期届满日之前的 4 个工作日起至元盛 A 的开放日（含）或基金合同生效后 2 年期届满日（含）止，以及本基金转型为金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）并开放申购赎回之后，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%；在其他时段，本基金持有现金和到期日不超过一年的政府债券可低于基金资产净值的 5%。

### （四）投资策略

#### 1、大类资产的配置策略

本基金大类资产配置采用自上而下的投资视角，定性分析与定量分析并用，结合国内外政治经济环境、宏观政策、利率变化等，合理确定基金在普通债券、货币市场工具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普通债券、货币市场工具等资产的比例与期限结构。

#### 2、债券投资策略

本基金通过自上而下与自下而上相结合的分析视角，预测利率和确定组合之加



权平均久期。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，决定本基金组合在各类属资产上的配置比例、期限结构与品种构成；自下而上是指当某一类资产投资收益率持续上升或下降时，本基金将审慎研判其基本面因素，重新调整个券、类属资产、大类资产的配置比例与期限结构。

#### （1）债券类资产的期限配置

本基金根据宏观经济走势、CPI、利率等因素，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、1~2 年、2~5 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、未来利率的变动趋势、证券市场运行状况等定性与定量因素的综合分析，确定国债、央票、金融债、信用债等类属债券市值占本基金债券总市值的相对比例。

在确定了各类属债券配置的相对比例后，本基金将根据各类属债券的流动性、换手率、债券类资产加权平均久期的目标区间，进一步确定各类属债券的期限构成。

#### （3）债券品种选择

本基金主要投资于国债、央票、政策性金融债、以及非国家信用担保的信用债。其中非国家信用担保的信用债券，主要包括企业债、公司债、非政策性金融债、地方政府债、短期融资券、中期票据、可转换债券、分离交易可转债、资产支持证券、以及中小企业私募债等非国家信用的固定收益类金融工具。

##### 1) 国债与央票

对于国债与央行票据，本基金原则上采取买入并持有的投资策略，但在持有过程中会结合利率走势、到期收益率、换手率、投资组合的加权平均久期之目标区间等，在不同剩余期限的国债与央票之间选取适当的品种。另外，本基金将审

慎评估回购收益率与国债、央票的到期收益率之间的利差，选择到期收益率高于回购收益率或者预期收益率有下降空间的国债、央票品种。

## 2) 政策性金融债

本基金将根据未来利率的变化趋势、政策性金融债各品种的到期收益率、换手率、外部评级、投资组合的加权平均久期之目标区间等因素，审慎筛选具有比较优势的政策性金融债品种。

## 3) 信用债券

本基金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信用债券品种进行投资。

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。

本基金对债券信用风险的评估主要包括发行人信用风险和债项风险。本基金将根据国内外宏观经济周期、行业周期与景气状况的变化，分析企业债券发行人所处行业的发展前景，发行人业务发展状况，在所属行业内的市场地位，相关财务指标，公司治理结构的有效性等因素，评价债券发行人的信用风险；在此基础上结合特定债券的发行条约，对该项债券信用风险进行评估。

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。同时，基金管理人将根据审慎原则，制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案，并经董事会批准，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

## (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。

### 1) 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。

## 2) 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。

## 3) 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。

## 4) 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。

#### 5) 一级市场参与策略

本基金积极参与债券、票据等品种的一级市场投标,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、货币市场类资产的配置策略

根据投资组合的加权平均久期的目标区间、未来利率的变化趋势、各期限货币市场类资产的流动性、收益率的变化等确定本基金在不同期限货币资产上的配置额占本基金货币资产总额的相对比例,并随着前述决策变量的变化,实时动态地调整配置的相对比例,严格控制货币资产的加权平均剩余期限。

## (五) 业绩比较基准

### 中国债券综合财富指数收益率

本基金选择中国债券综合财富指数作为业绩比较基准,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子类基本一致。(2)时间序列完整。其起始时间点为 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。

随着我国资本市场的发展,将来如有更合适作为本基金业绩比较基准的指数推出,基金管理人经与基金托管人达成一致后,可以在履行适当程序后变更本基金的业绩比较基准,并及时公告。

## (六) 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、混合型基金,但高于货币市场基金。

自《基金合同》生效之日起 2 年内,本基金的份额由元盛 A、元盛 B 构成,

元盛 A 的预期收益稳定、风险低，元盛 B 由于具有一定的杠杆倍数，其预期收益与风险较高。

## （七）投资禁止行为与限制

### 1、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- （1）承销证券；
- （2）向他人贷款或提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）买卖其他基金份额，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；
- （5）向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或债券；
- （6）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；
- （7）从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- （8）当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

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

基金的投资组合将遵循以下限制：

（1）本基金投资于固定收益类金融工具的比例不低于基金资产净值的 80%，其中对中小企业私募债券的投资比例不超过基金资产的 20%；对股票、权证等权益类金融工具的投资比例不超过基金资产净值的 20%；为维持投资组合的流动性，至少于元盛 A 的开放日、基金合同生效后 2 年期届满日前 4 个工作日起至元盛 A 的开放日（含）或基金合同生效后 2 年期届满日（含）止，以及本基金转型为金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）并开放申购赎回之后，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%；本基金转型前，在其他时段，本基金持有现金和到期日不超过一年的政府债券可低于基金资产净



值的 5%;

(2) 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%;

(3) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券, 不超过该证券的 10%;

(4) 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;

(5) 本基金在任何交易日买入权证的总金额, 不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%; 本基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%; 本基金管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%; 法律法规或中国证监会另有规定的, 遵从其规定;

(6) 本基金进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不得超过基金资产净值的 40%; 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年, 债券回购到期后不得展期;

(7) 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%;

(8) 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%;

(9) 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%;

(10) 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%;

(11) 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;

(12) 本基金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%;

(13) 本基金不得违反基金合同关于投资范围、投资策略和投资比例的约定;

(14) 法律法规或监管部门规定的其他限制。

3、法律法规或监管部门修改或取消上述限制规定时, 履行适当程序后, 本

基金不受上述投资组合限制并相应修改限制规定。

#### （八）投资组合比例调整

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使本基金投资比例不符合上述各项规定的投资比例，基金管理人应当在 10 个交易日内调整完毕。基金托管人对基金的投资比例的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

#### （九）基金管理人代表基金行使股东权利处理原则和方法

- 1、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；
- 2、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；
- 3、有利于基金财产的安全与增值；
- 4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

#### （十）基金投资组合报告（未经审计）

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已复核了本报告中的内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告有关数据截止日为 2017 年 3 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。

##### 1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-

	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	217,908,077.28	87.18
	其中：债券	217,908,077.28	87.18
	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	24,985,157.48	10.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	2,196,001.06	0.88
7	其他各项资产	4,871,894.84	1.95
8	合计	249,961,130.66	100.00

注：其他资产包括：交易保证金、应收利息、应收证券清算款、其他应收款、应收申购款。

## 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

本基金本报告期末未持有股票投资。

### (2) 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末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

本基金本报告期末未持有股票投资。

## 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	10,986,800.00	5.79
2	央行票据	-	-



3	金融债券	78,740,000.00	41.51
	其中：政策性金融债	78,740,000.00	41.51
4	企业债券	13,840,694.60	7.30
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	20,367,000.00	10.74
7	可转债（可交换债）	34,975,582.68	18.44
8	同业存单	58,998,000.00	31.11
9	其他	-	-
10	合计	217,908,077.28	114.89

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	150207	15 国开 07	600,000.00	60,300,000.00	31.79
2	111710113	17 兴业银行 CD113	300,000.00	29,664,000.00	15.64
3	111618317	16 华夏 CD317	300,000.00	29,334,000.00	15.47
4	160213	16 国开 13	200,000.00	18,440,000.00	9.72
5	122607	PR 渝地产	214,980.00	13,302,962.40	7.01

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

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投资。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

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) 报告期内基金投资的前十名股票未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	11,145.64
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,860,749.20
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,871,894.84

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110032	三一转债	4,553,460.00	2.40
2	110034	九州转债	2,412,185.40	1.27
3	110035	白云转债	4,167,297.40	2.20

4	113009	广汽转债	4,965,100.00	2.62
5	123001	蓝标转债	3,455,579.88	1.82
6	128009	歌尔转债	4,268,220.00	2.25

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票投资。

## 十八、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效日为2013年5月2日，2015年5月5日二年届满后转型为金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）。基金转型以来（截至2017年3月31日）的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示：

1、金鹰元盛债券型证券投资基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

(1) 金鹰元盛债券（LOF）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
2015.5.5-2015.12.31	7.90%	0.10%	5.71%	0.07%	2.19%	0.03%
2016.1.1-2016.12.31	0.74%	0.11%	1.85%	0.09%	-1.11%	0.02%
2017.1.1-2017.3.31	-0.37%	0.13%	-0.34%	0.07%	-0.03%	0.06%
2015.5.5-2017.3.31	8.30%	0.11%	7.30%	0.08%	1.00%	0.03%

(2) 金鹰元盛债券（LOF）E:

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

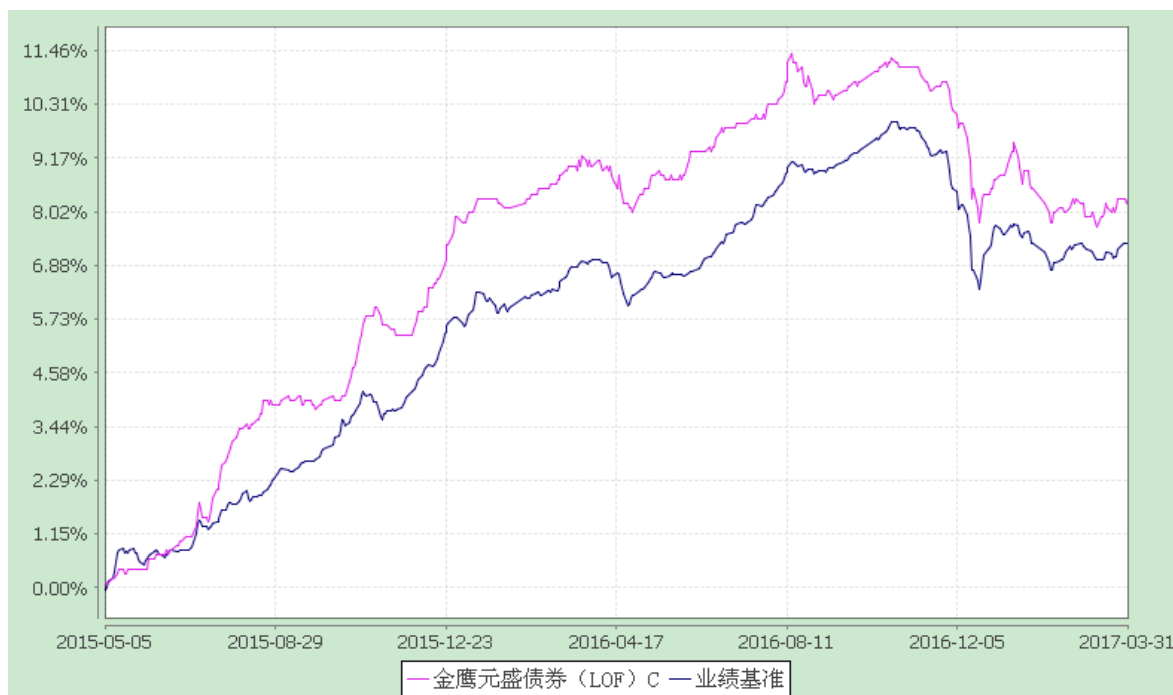
2017.2.14- 2017.3.31	0.09%	0.10%	0.34%	0.05%	-0.25%	0.05%
-------------------------	-------	-------	-------	-------	--------	-------

注：（1）金鹰元盛债券（LOF）E份额2017年2月14日设立；（2）本基金的业绩比较基准为：中国债券综合财富指数收益率。

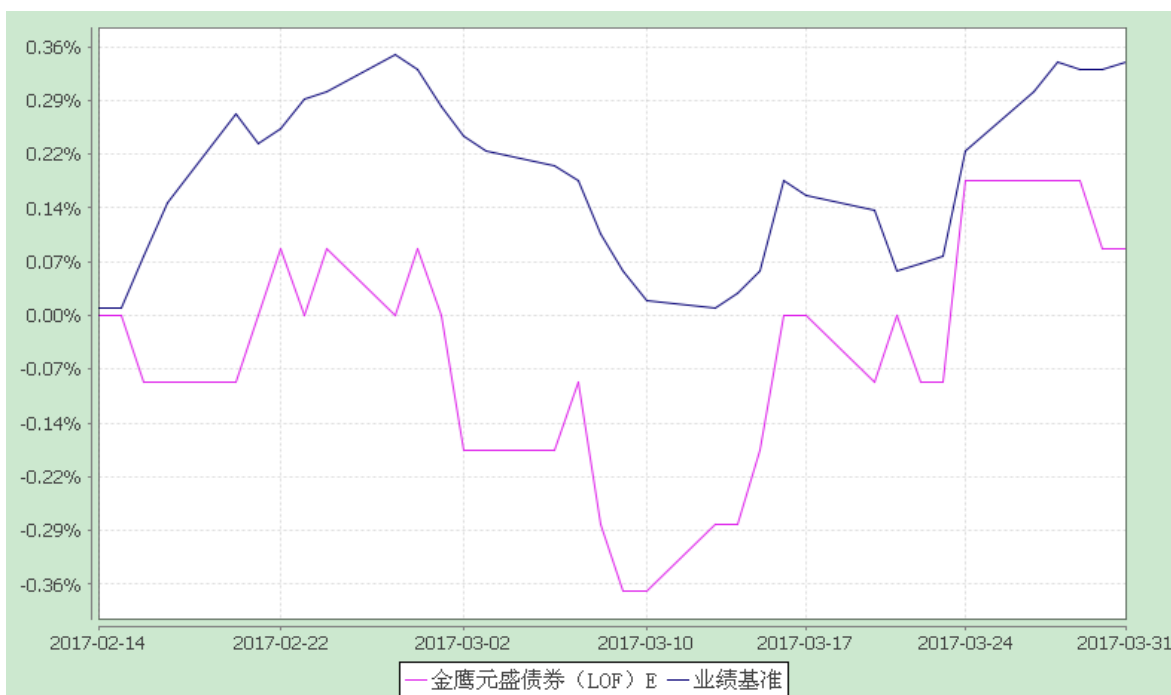
## 2、自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）  
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  
(2015年5月5日至2017年3月31日)

### （1）金鹰元盛债券（LOF）C:



### （2）金鹰元盛债券（LOF）E:



注：（1）本基金自 2015 年 5 月 5 日起转型。E 类基金份额于 2017 年 2 月 14 日设立。（2）截至报告期末，各项资产配置比例已符合基金合同约定。（3）本基金的业绩比较基准为：中国债券综合财富指数收益率。

## 十九、基金的财产

### （一）基金资产总值

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

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

本基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交

易清算资金的结算备付金账户，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。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）基金财产的处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费、销售服务费以及基金合同约定的其他费用。基金管理人、基金托管人以其自有财产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

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。

基金财产的债权，不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销；不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。

除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 二十、基金财产的估值

### （一）估值目的

基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金相关金融资产的公允价值，并为基金份额提供计价依据。

### （二）估值日

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

### （三）估值对象

基金依法拥有的股票、债券、权证及其他基金资产和负债。

### （四）估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

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

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

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

#### 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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



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

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

3、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。

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、中小企业私募债券采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

6、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。

7、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。

## （五）估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。

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 0.001 元，小数点后第四位四舍五入。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。

自本基金合同生效之日起 2 年内，在元盛 A 的开放日计算元盛 A 的基金份额净值；在元盛 B 的封闭期届满日分别计算元盛 A 和元盛 B 的基金份额净值。

自本基金合同生效之日起 2 年内，在非元盛 A 的开放日且非基金合同生效后 2 年期届满日，基金管理人在基金份额净值计算的基础上，按照《基金合同》的规定采用“虚拟清算”原则计算并公告元盛 A 和元盛 B 基金份额参考净值。基金份额参考净值是对两类基金份额价值的一个估算，并不代表基金份额持有人可获得的实际价值。元盛 A 与元盛 B 基金份额参考净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入。

自本基金合同生效之日起 2 年内，元盛 A 和元盛 B 各自的基金份额净值或基金份额参考净值，将并按规定公告。

基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式或其他方式报给基金托管人，基金托管人按法律法规、基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后返回给基金管理人，由基金管理人依据基金合同和有关法律法规的规定予以公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

#### （六）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。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### 1、差错类型

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

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

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

## 2、差错处理原则

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

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

（3）因差错而获得不当得利的当事人负有及时向受损方返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失，则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方；

（4）差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式；

（5）差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人的行为造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人的行为造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人、基金托管人及基金销售机构之外的第三方造成基金财产损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错责任方追偿；追偿过程中产生的有关费用，应列入基金费用，从基金资产中支付。

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

（7）按法律法规规定的其他方式处理差错。

## 3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

（1）查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确

定差错的责任方；

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

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

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

#### 4、基金份额（参考）净值差错处理的原则和方法

(1) 当基金份额（参考）净值小数点后 3 位以内（含第 3 位）发生差错时，视为基金份额（参考）净值错误；基金份额（参考）净值出现错误时，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；当错误达到或超过基金份额（参考）净值的 0.25% 时，基金管理公司应当及时通知基金托管人并报中国证监会；错误偏差达到基金份额（参考）净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案；当发生（参考）净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

(2) 当基金份额（参考）净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

1) 本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金会计责任方的建议执行，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付；

2) 若基金管理人计算的基金份额（参考）净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，基金份额（参考）净值出错且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对基金份额持有人或基金支付赔偿金，就实际向基金份额持有人或基金支付的赔偿金额，其中基金管理人与基金托管人按管理费与托管费的费率比例承担相应的赔偿责任；

3) 如基金管理人和基金托管人对基金份额（参考）净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额（参考）净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付；

4) 由于基金管理人提供的信息错误(包括但不限于基金申购或赎回金额等), 进而导致基金份额(参考)净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金的损失, 由基金管理人负责赔付。

(3) 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的(参考)净值计算尾差, 以基金管理人计算结果为准。

(4) 前述内容如法律法规或者监管部门另有规定的, 从其规定。如果行业有通行做法, 基金管理人和基金托管人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

#### (七) 暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;
- 2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;
- 3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变, 而基金管理人为保障基金份额持有人的利益, 已决定延迟估值;
- 4、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

#### (八) 特殊情形的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 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、由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误, 有关会计制度变化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而造成的基金份额净值计算错误, 基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。



## 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、公允价值变动损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损益后的余额。

### （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）收益分配原则

#### 1、本基金基金合同生效之日起 2 年内的收益分配原则

本基金基金合同生效之日起 2 年内，不进行收益分配；法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

#### 2、本基金转型为上市开放式基金（LOF）后的收益分配原则

（1）本基金的每份基金份额享有同等分配权；

（2）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 12 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%；

（3）本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资。

场外转入或申购的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值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；投资者在不同销售机构的不同交易账户可选择不同的分红方式；

场内转入、申购和上市交易的基金份额的分红方式为现金分红，投资者不能选择其他的分红方式，具体收益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

（4）分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红，分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红；

（5）基金红利发放日距离收益分配基准日（即期末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;

(7) 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止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

1、本基金收益分配方案由基金管理人拟定、由基金托管人核实后确定, 基金管理人按法律法规的规定公告并向中国证监会备案。

2、本基金收益分配的发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日。在分配方案公布后(依据具体方案的规定), 基金管理人就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令, 基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

3、法律法规或监管机关另有规定的, 从其规定。

#### (六) 收益分配中发生的费用

收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由基金份额持有人自行承担。当基金份额持有人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, 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。红利再投资的计算方法, 依照《业务规则》执行。收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。



## 二十二、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）基金销售服务费；
- （4）基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- （5）基金份额持有人大会费用；
- （6）基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- （7）基金的证券交易费用；
- （8）基金的银行汇划费用；
- （9）基金的上市初费和上市月费；
- （10）按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内按照公允的市场价格确定；本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金资产总值中扣除；法律法规和基金合同另有规定时从其规定。

#### 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0.70%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0.70%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

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

费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起五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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延至法定节假日、公休日结束之日起3个工作日内或不可抗力情形消除之日起3个工作日内支付。

## (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0.20%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0.20%年费率计提。计算方法如下:

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

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付指令,经基金托管人复核后于次月首日起五个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延至法定节假日、公休日结束之日起3个工作日内或不可抗力情形消除之日起3个工作日内支付。

## (3) 基金销售服务费

基金销售服务费用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。

本基金销售服务费率为年费率 0.4%。

本基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值 0.4%的年费率计提。基金销售服务费的计算方法如下:

$$H=E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付,管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法

按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

(4)、本条第（一）款第4 至第9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

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

### 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根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率和基金销售服务费。调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售服务费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；降低基金管理费率、基金托管费率或基金销售服务费率等费率的，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒体和基金管理人网站上刊登公告。

## (二) 与基金销售有关的费用

1、本基金申购费、赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“十一、基金份额的申购与赎回”中的的相关规定。

### 2、转换费率

本基金与基金管理人所管理的其他基金之间的转换费率由基金管理人根据有关法律法规和基金合同的原则另行制定并公告。

3、基金管理人可以在基金合同规定的范围内调整上述费率。上述费率如发生变更，基金管理人应按照《信息披露办法》或其他相关规定于新的费率实施前在至少一种指定媒体公告。调整后的上述费率还应在最新的招募说明书中列示。

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

购、赎回费率，并报中国证监会备案。

### （三）其他费用

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

### （四）税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

## 二十三、基金的会计与审计

### （一）基金的会计政策

- 1、基金管理人为本基金的会计责任方；
- 2、本基金的会计年度为公历每年的 1 月 1 日至 12 月 31 日；
- 3、本基金的会计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的会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人分别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、基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。

### （二）基金的审计

1、基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。

2、会计师事务所更换经办注册会计师时，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，经通报基金托管人，并报中国证监会备案后可以更换。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。

## 二十四、基金的信息披露

### （一）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指定媒体披露，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）本基金信息披露义务人承诺

信息披露义务人承诺在公开披露的基金信息时，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代销机构；
- 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 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和基金管理人网站上；基金管理人在公告的 15 日前向中国证监会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、基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制发售公告，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、上市交易公告书

本基金获准在深圳证券交易所上市交易后，基金管理人最迟在上市前 3 个工作日在至少一家指定媒体和基金管理人网站上公告。

## 5、基金资产净值、基金份额净值公告和基金份额累计净值公告

基金合同生效后，在元盛 B 上市交易前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值、基金份额净值以及元盛 A 和元盛 B 的基金份额参考净值。

在元盛 A 的首次开放日后或者元盛 B 上市交易后，基金管理人应当在每个交易日的次日，通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介，披露基金份额净值、元盛 A 和元盛 B 的基金份额参考净值以及各自的基金份额累计参考净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日（或自然日）基金资产净值、基金份额净值以及元盛 A 和元盛 B 的基金份额参考净值及各自基金份额的累计参考净值，并于前款规定的市场交易日（或自然日）的次日将基金资产净值、基金份额净值、元盛 A 和元盛 B 的基金份额参考净值以及各自的基金份额累计参考净值登载在指定媒体上。

本基金基金合同生效后 2 年期届满，本基金转型为上市开放式基金（LOF）后，基金管理人应当在每个交易日的次日，通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介，披露本基金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（或自然日）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上。

## 6、基金份额申购、赎回价格

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

## 7、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和基金管理人网站上。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和基金管理人网站上。

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。

本基金基金合同生效之日起 2 年内，基金定期报告中应公告元盛 A 当期所适用过的年约定收益率、元盛 A 和元盛 B 的份额配比。

## 8、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、销售服务费等费用计提标准、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) 基金变更、增加或减少销售代销机构；
- (20) 基金更换注册登记机构；
- (21) 元盛 A 办理申购、赎回；
- (22) 元盛 A、元盛 B 进行基金份额折算；
- (23) 元盛 A 的收益率设定及其调整；
- (24) 本基金基金合同生效后 2 年期届满时的基金转型；
- (25) 本基金基金合同生效后 2 年期届满，本基金转型为上市开放式基金（LOF）后的上市交易以及开始办理申购、赎回；
- (26) 本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- (27) 本基金发生巨额赎回并延期支付；
- (28) 本基金暂停接受申购、赎回申请；
- (29) 本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回申请；
- (30) 基金推出新业务或服务；
- (31) 中国证监会规定的其他事项。

## 9、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。

## 10、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案，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 30 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。

#### 11、中国证监会规定的其他信息。

基金管理人应在基金招募说明书的显著位置披露投资中小企业私募债券的流动性风险和信用风险，说明投资中小企业私募债券对基金总体风险的影响。本基金投资中小企业私募债券后两个交易日内，基金管理人应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。

### （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。

基金应当公开披露的信息包括定期报告和临时报告，信息披露义务人披露信息前，应当在第一时间将公告文稿和相关备查文件报送本基金上市的证券交易所。

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、元盛 A 的年收益率、元盛 A 和元盛 B 的份额配比、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报刊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。

#### （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、基金托管人和基金份额销售机构的住所，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。

本基金的上市交易公告书公布后，应当分别置备于基金管理人和本基金上市交易的证券交易所，以供公众查阅、复制。

基金投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

#### （八）暂停或延迟信息披露的情形

- 1、不可抗力；
- 2、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障基金份额持有人的利益，已决定延迟估值；
- 4、法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。

## 二十五、风险揭示

### （一）市场风险

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。主要的风险因素包括：

#### 1、政策风险

因政府政策（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。

#### 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；投资风险是指在进行正回购操作时，回购利率大于融入资金的投资收益率，或者逆回购操作时，回购利率小于融出资金潜在的投资收益率而导致的风险，以及由于正回购操作导致投资总量放大，致使整个组合风险放大的风险；而波动性加大的风险是指在进行正回购操作时，在对基金组合收益进行放大的同时，也对基金组合的波动性（标准差）进行了放大，即基金组合的风险将会加大。正回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对基金净值造成损失的可能性也就越大。



## （二）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。

## （三）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。

## （四）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。同时在开放式基金交易过程中，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。

## （五）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。

## （六）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，力争为投资者实现更多的资产增值，但同时也不可避免地给组合的风险控制带来一定的困难。在基金投资管理运作过程中，



可能因基金管理人对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。

### （七）本基金特有的风险

#### 1、投资风险

本基金结合定量分析与定性研判以辅助投资决策，若策略效果不佳或存在基金管理人事先未能识别的错误，则可能会导致本基金资产配置失当，进而影响投资业绩。基金管理人将在实际投资过程中，不断地改进与优化策略方法，以期投资为投资决策提供更为有效的支持。此外本基金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，本基金面临相对较高的流动性风险和信用风险。

#### 2、元盛A的特有风险

##### （1）流动性风险

自基金合同生效之日起每满6个月的最后一个工作日为元盛A的开放日，基金份额持有人只能在该日赎回元盛A的份额；而在非开放日，因不能赎回而出现流动性风险。另外，因不可抗力等原因，元盛A的开放日可能延后，导致基金份额持有人不能按期赎回而出现风险。

##### （2）约定收益率变动的风险

在元盛A的约定收益率每半年调整1次，如果金融机构人民币1年期银行定期存款基准利率下调，则元盛A的约定收益率将相应下调；另外，如果在元盛A的非开放日，金融机构人民币1年期银行定期存款基准利率利率上调，而元盛A的约定收益率不能立即进行相应调整，从而出现利率风险。

##### （3）极端情形下约定收益不能实现以及本金损失的风险

一般而言，元盛A的预期风险较低、预期收益较为稳定；但是，元盛A的约定收益并非保证收益，在极端情况下，如果本基金在短期内发生大幅度的投资亏损，则元盛A的约定收益可能无法实现，甚至其本金亦有可能受损。

#### 3、元盛B 的特有风险

##### （1）杠杆机制风险

自基金合同生效之日起2年内，元盛B存在杠杆倍数，因此，元盛B在可能获

取较高预期收益的同时，也将承担基金投资的全部亏损，极端情况下，元盛B的持有人可能会面临损失全部本金的风险。

#### （2）收益分配格局调整的风险

在元盛A的每一个开放日，元盛A的约定收益将重新确定，故而，元盛A与元盛B之间的收益分配格局将发生调整。

#### （3）上市交易风险以及折/溢价的风险

元盛B的封闭期为2年，封闭期内上市交易。元盛B上市交易后可能因信息披露导致基金停牌，投资者在停牌期间不能买卖元盛B份额，产生风险；元盛B上市后也可能因成交不活跃而给其持有人带来流动性风险。

另外，元盛B的交易价格将受市场供求关系的影响，而与其份额参考净值之间可能发生偏离从而出现折/溢价的风险。

### 4、杠杆倍数变动的风险

#### （1）份额配比变化导致杠杆倍数变动的风险

在基金合同生效日，元盛A、元盛B的份额配比不超过7：3，由于元盛A、元盛B独立发售，该日两级份额的实际配比可能会低于7：3，存在不确定性；另外，在元盛A的开放日，元盛A的持有人可申购或赎回元盛A的份额，基金管理人按照历史累计申购份额数不超过历史累计赎回份额数的原则对申购进行成交确认，该日元盛A的净申赎情况，将导致此后两级份额的实际配比发生变动；而两级份额配比的不确定性将导致元盛B的杠杆倍数发生变化：当开放日元盛A为净申购时，元盛B的杠杆倍数将增大；当开放日元盛A为净赎回时，元盛B的杠杆倍数将缩小。

#### （2）元盛B的份额净值变化导致杠杆倍数变动的风险

在两级份额配比保持不变的情况下，元盛B的基金份额参考净值越高，元盛B的杠杆倍数越低，收益放大效应减弱。

### 5、基金转型后风险收益特征错配的风险

基金合同生效2年期届满后，本基金将转型为上市开放式基金（LOF），转型后的上市开放式基金（LOF）并不包含杠杆机制，且其风险收益特性与元盛A、元盛B皆不相同。元盛A、元盛B的份额持有人之风险偏好可能与转型后的上市开放式基金（LOF）的风险收益特性之间存在错配。

### 6、折算风险

在元盛 A 的开放日（不包括基金合同生效后满 24 个月的开放日），本基金将根据净资产不变的原则，对元盛 A 的份额进行折算，折算后，元盛 A 份额数保留到小数点后 2 位；在本基金基金合同生效后 2 年期届满日，本基金将根据净资产不变的原则，对元盛 A、元盛 B 的份额进行折算，元盛 A 折算为场外 LOF 份额，元盛 B 折算为场内 LOF 份额，场外 LOF 份额数保留到小数点后 2 位，而场内 LOF 份额数采用截位法保留到整数位。

上述折算过程可能存在的计算误差将影响元盛 A、元盛 B 份额持有人的利益。

#### （八）其他风险

1、因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、风险管理和内控制度等方面不完善而产生的风险；

2、因金融市场危机、行业竞争压力可能产生的风险；

3、战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，可能严重影响证券市场运行，导致基金资产损失；

4、其他意外导致的风险。

### 二十七、基金合同的终止与基金财产的清算

#### （一）基金合同的变更

1、按照法律法规或基金合同的规定，对基金合同的变更应当召开基金份额持有人大会的，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议通过，并依法报中国证监会核准，自中国证监会核准之日起生效。

2、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变更后公布经修订的基金合同，并报中国证监会备案：

（1）调低基金管理费、基金托管费、基金销售服务费和其他应由基金或基金份额持有人承担的费用；

（2）在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率或收费方式、调低本基金的赎回费率或收费方式；

（3）法律法规要求增加的基金费用的收取；

（4）因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

- (5) 基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- (6) 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；
- (7) 经中国证监会的允许，基金管理人、基金注册登记机构或销售机构在法律法规规定的范围内调整有关基金交易、非交易过户、转托管等业务规则；
- (8) 按照法律法规或基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

## （二）基金合同的终止

有下列情形之一的，在履行相关程序后基金合同终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、《基金合同》生效之日起三年后的对应日，若基金资产规模低于 2 亿元，基金合同自动终止。
- 3、基金管理人、基金托管人职责终止，而在 6 个月内没有新的基金管理人、基金托管人承接的；
- 4、基金合同约定或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

(1) 自基金合同终止情形发生之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金清算小组，基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算。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基金托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

(2) 基金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。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

### 2、基金财产清算程序

- (1) 基金合同终止情形发生时，由基金清算小组统一接管基金财产；
- (2) 根据法律法规及基金财产的情况确定清算期限；
- (3) 对基金财产进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行估价和变现；
- (5) 制作清算报告；
- (6) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- (7) 聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (8) 将基金清算结果报告中国证监会；
- (9) 公布基金清算报告；
- (10) 对基金剩余财产进行分配。

### 3、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。

### 4、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。

#### 1) 本基金在基金合同生效之日起 2 年内清算时的基金清算财产分配

本基金基金合同生效之日起 2 年内，如果本基金发生基金财产清算的情形，则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，将优先满足元盛 A 的本金及应计收益分配，如有剩余部分，则由元盛 B 的基金份额持有人按其持有的基金份额比例进行分配。

#### 2) 本基金转型为上市开放式基金（LOF）后的基金清算财产分配

本基金基金合同生效后 2 年期届满，本基金转型为上市开放式基金（LOF）后，如果发生基金财产清算的情形，则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。

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。

#### 5、基金财产清算的公告

基金财产清算小组成立后 2 日内应就清算小组的成立在指定媒体上公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算小组做出的清算报告经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

#### 6、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。

### 二十八、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，依照有关法律法规和基金合同的规定独立运用基金财产；
- 3) 依照基金合同获得基金管理人报酬以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- 4) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- 5) 根据基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他基金当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会和银行业监督管理机构，并采取必要措施保护基金及相关基金当事人的利益；
- 6) 在符合有关法律法规和基金合同的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，决定基金的除调高托管费和管理费之外的费率结构和收费方式；
- 7) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回和转换申请；
- 8) 自行担任注册登记机构或选择、更换注册登记机构，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；



9) 选择、更换代销机构，并依据销售代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；

10) 依法召集基金份额持有人大会；

11) 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；

12) 依照有关规定为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

13) 根据国家有关规定，在法律法规允许的前提下，以基金的名义依法为基金融资、融券；

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

15) 法律法规、基金合同以及中国证监会规定的其他权利。

(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) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

2) 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；

3) 配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购和赎回业务；

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

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财产分别管理，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) 依法募集基金，办理或者委托经由证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和注册登记手续；

9) 办理基金备案手续；

10) 按规定受理基金份额的申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；



- 11) 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- 12) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回及注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；
- 13) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 14) 编制季度、半年度和年度基金报告；
- 15) 按照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收益；
- 16) 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；
- 17) 保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、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，不得向他人泄露；
- 18) 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；
- 19) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；
- 20) 建立并保存基金份额持有人名册；
- 21) 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；
- 22) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；
- 23) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 24) 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；
- 25) 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；
- 26) 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，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- 27) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
- 28) 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；

29) 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，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

30) 法律法规、基金合同以及中国证监会规定的其它义务。

## 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它权利。

(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，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；对所托管的不同基金财产分别设置账户，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) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

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

7) 按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；

9) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

10) 按照规定监督基金管理人的投资运作；

11) 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；

12) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

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

14) 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；

15) 根据基金合同和托管协议规定建立并保存基金份额持有人名册；

16) 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；

17) 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；

18) 参加基金财产清算组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

19) 因违反基金合同导致基金财产损失，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照法律法规规定和基金合同履行其义务，基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；

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

22) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

23) 法律法规、基金合同以及中国证监会规定的其他义务。

### 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) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- 4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- 5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- 6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- 7) 监督基金管理人的投资运作；
- 8) 对基金管理人、基金托管人、基金份额代销机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- 9) 法律法规、基金合同以及中国证监会规定的其他权利。

(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) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- 2) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规、基金合同和招募说明书规定的费用；
- 3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- 4) 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；
- 5) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- 6) 遵守基金管理人、基金托管人及销售机构和注册登记机构的相关交易及业务规则；
- 7) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利；
- 8) 法律法规、基金合同以及中国证监会规定的其他权利。

## （二）基金份额持有人大会

1、基金份额持有人大会由基金份额持有人，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。

（1）本基金基金合同生效之日起 2 年内，基金份额持有人大会的审议事项应分别由元盛 A、元盛 B 的基金份额持有人独立进行表决。元盛 A、元盛 B 的基金份额持有人持有的每一份基金份额在各自份额级别内拥有同等的投票权。

（2）本基金基金合同生效后 2 年期届满，本基金无需召开基金份额持有人大会，自动转型为上市开放式基金（LOF），上市开放式基金（LOF）份额持有人持有的每一基金份额享有同等的投票权。

### 2、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) 转换基金运作方式，但本基金在基金合同生效后 2 年期届满时转型为上市开放式基金（LOF）除外；
- 3) 变更基金类别；
- 4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- 5) 变更基金份额持有人大会程序；
- 6) 更换基金管理人、基金托管人；
- 7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- 8) 本基金与其他基金的合并；
- 9) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- 10) 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；

本基金基金合同生效之日起 2 年内，依据基金合同享有基金份额持有人大会召集提议权、自行召集权、提案权、会议表决权、新任基金管理人和基金托管人提名权的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

额持有人或类似表述均指“单独或合计持有元盛 A、元盛 B 各自的基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人”或其类似表述。

11) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；

12) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

(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) 调低基金管理费、基金托管费、其他应由基金或基金份额持有人承担的费用；

2) 在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率或收费方式、调低本基金的赎回费率；

3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

4) 基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；

5) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

6) 根据法律法规或中国证监会的相关规定，本基金推出新业务或服务；

7) 经中国证监会的允许，基金管理人、基金注册登记机构或代销机构在法律法规规定的范围内调整有关基金交易、非交易过户、转托管等业务规则；

8) 按照法律法规或基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

### 3、召集人和召集方式

(1) 除法律法规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。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

(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，应当自行召集并确定会议时间、地点、方式和权益登记日。

(4) 代表基金份额 10%以上（含 10%，以基金管理人收到书面提议当日的



基金份额计算,下同)的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起 60 日内召开;基金管理人决定不召集,代表基金份额 10%以上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%以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会,而基金管理人、基金托管人都不召集的,代表基金份额 10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会,但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。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。

#### 4、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) 基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会,召集人必须于会议召开日前 40 日在至少一家指定媒体和基金管理人网站上公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容:

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



（2）采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交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，不影响计票和表决结果。

## 5、基金份额持有人出席会议的方式

### （1）会议方式

1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。

2) 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席，基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。

3) 通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。在法律法规或监管机构允许的情况下，在符合会议通知载明形式的前提下，基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式表决。

4) 基金份额持有人大会具体召开的方式由召集人确定，但决定更换基金管理人或基金托管人的事宜，必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

### （2）召开基金份额持有人大会的条件

#### 1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

A、经核对、汇总，到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%，下同），（本基金基金合同生效之日起 2 年内，指“有效的元盛 A 和元盛 B 各自的基金份额分别合计不少于该级基金份额的 50%（含 50%）”；

B、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；

未能满足上述条件的情况下，则召集人可另行确定并公告重新开会的时间（至少应在 25 个工作日后）和地点，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

## 2) 通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

A、召集人按基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内在至少一家指定媒体上连续公布相关提示性公告；

B、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和统计基金份额持有人的书面表决意见，基金管理人或基金托管人经通知拒不参加收取和统计书面表决意见的，不影响表决效力；

C、本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%（含 50%），（本基金基金合同生效之日起 2 年内，指“基金份额持有人所持有的元盛 A 和元盛 B 各自的基金份额分别合计均不小于在权益登记日该级基金总份额的 50%（含 50%）”；

D、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表，同时提交的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和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金注册登记机构记录相符；

E、会议通知公布前报中国证监会备案。

如果开会条件达不到上述的条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间（至少应在 25 个工作日后），且确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决的投资者视为有效出席的投资者；其表决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。

## 6、议事内容与程序

### (1) 议事内容及提案权

1) 议事内容为基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容以及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。

2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10% 以上 (含 10%) 的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案; 也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案, 临时提案应当在大会召开日前 35 日提交召集人。召集人对于临时提案应当在大会召开日前 30 日公告。否则, 会议的召开日期应当顺延并保证至少与临时提案公告日期有 30 日的间隔期。

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

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

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

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

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

### (2) 议事程序

### 1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由基金管理人授权代表主持。在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）（本基金基金合同生效之日起 2 年内，指“出席大会的元盛 A 和元盛 B 各自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。

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

### 2) 通讯方式开会

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

(3) 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 7、决议形成的条件、表决方式、程序

(1) 基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。但在本基金基金合同生效之日起 2 年内，基金份额持有人大会的审议事项应分别由元盛 A、元盛 B 的基金份额持有人独立进行表决，且元盛 A、元盛 B 的基金份额持有人所持每份基金份额在其对应的基金份额级别内享有平等表决权。

(2) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

#### 1) 一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人及其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）（本基金基金合同生效之日起 2 年内，指“参加大会的元盛 A 和元

盛 B 各自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（2）所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过；

## 2) 特别决议

特别决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的三分之二（含三分之二）（本基金基金合同生效之日起 2 年内，指“参加大会的元盛 A 和元盛 B 各自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）”）通过方为有效；更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式（本基金在基金合同生效后 2 年期届满时转型为上市开放式基金（LOF）除外）、终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。

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

（4）采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表决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）基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

（6）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。

## 8、计票

### （1）现场开会

1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集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和代理人中推举 3 名基金份额持有人担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票



的效力及表决结果。

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

3) 如会议主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对投票数进行重新清点；如会议主持人未进行重新清点，而出席会议的基金份额持有人或代理人对会议主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，会议主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

4) 计票过程应由公证机关予以公证。

#### (2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人不派代表监督计票的，不影响计票效力及表决结果。但基金管理人或基金托管人应当至少提前两个工作日通知召集人，由召集人邀请无直接利害关系的第三方担任监督计票人员。

### 9、基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

(1) 基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效，并在生效后方可执行。

(2) 生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决定。

(3) 基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 个工作日内在至少一家指定媒体和基金管理人网站上公告。

(4) 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、公证机关、公证员姓名等一同公告。

### （三）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）按照法律法规或基金合同的规定，对基金合同的变更应当召开基金份额持有人大会的，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议通过，并依法报中国证监会核准，自中国证监会核准之日起生效。

（2）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变更后公布经修订的基金合同，并报中国证监会备案：

1) 调低基金管理费、基金托管费、基金销售服务费和其他应由基金或基金份额持有人承担的费用；

2) 在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率或收费方式、调低本基金的赎回费率或收费方式；

3) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

4) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

5) 基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；

6) 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；

7) 经中国证监会的允许，基金管理人、基金注册登记机构或销售机构在法律法规规定的范围内调整有关基金交易、非交易过户、转托管等业务规则；

8) 按照法律法规或基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

#### 2、《基金合同》的终止

有下列情形之一的，在履行相关程序后基金合同终止：

（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，而在 6 个月内没有新的基金管理人、基金托管人承接的；

（3）基金合同约定或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

1) 自基金合同终止情形发生之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金清算小组，基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算。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基金托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

2) 基金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。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

#### (2) 基金财产清算程序

- 1) 基金合同终止情形发生时，由基金清算小组统一接管基金财产；
- 2) 根据法律法规及基金财产的情况确定清算期限；
- 3) 对基金财产进行清理和确认；
- 4) 对基金财产进行估价和变现；
- 5) 制作清算报告；
- 6) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- 7) 聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- 8) 将基金清算结果报告中国证监会；
- 9) 公布基金清算报告；
- 10) 对基金剩余财产进行分配。

#### (3) 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。

#### (4) 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。

#### A、本基金在基金合同生效之日起 2 年内清算时的基金清算财产分配

本基金基金合同生效之日起 2 年内，如果本基金发生基金财产清算的情形，则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，将优先满足元盛 A 的本金及应计收益分配，如有剩余部分，则由元盛 B 的基金份额持有人按其持有的基金份额比例进行分配。

#### B、本基金转型为上市开放式基金（LOF）后的基金清算财产分配

本基金基金合同生效后 2 年期届满，本基金转型为上市开放式基金（LOF）后，如果发生基金财产清算的情形，则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。

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。

#### （5）基金财产清算的公告

基金财产清算小组成立后 2 日内应就清算小组的成立在指定媒体上公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算小组做出的清算报告经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

#### （6）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。

### （四）、争议的处理

对于因基金合同产生或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，仲裁费由败诉方承担。

除争议所涉内容之外，基金合同的其他部分应当由基金合同当事人继续履行。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

#### （五）、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，供基金投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅。基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。

## 二十九、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

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

邮政编码：510100

法定代表人：凌富华

成立时间：2002 年 12 月 25 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：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

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。

#### 2、基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

邮政编码：100033

法定代表人：王洪章

成立时间：2004 年 9 月 17 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、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；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服

务；经中国银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

## （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，对基金投资范围、投资对象进行监督。

2、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资、融券比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

（1）对基金的投资范围、投资对象进行监督；

（2）对基金的投资限制进行监督。

3、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下述基金投资禁止行为进行监督。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。根据法律法规有关基金禁止从事的关联交易的规定，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，对基金管理人选择存款银行进行监督。

7、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资流通受限证券进行监督。

8、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。

9、基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作中违反法律法规、基金合同和本托管协议的规定，应及时以书面形式通知基金管理人

限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，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上述规定期限内纠正的，基金托管人有权报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

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，并及时向中国证监会报告。

10、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事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

11、基金托管人发现基金管理人重大违法、违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

### （三）基金管理人对于基金托管人的业务核查

1、基金管理人对于基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括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、及时、准确复核基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、元盛 A 与元盛 B 的基金份额（参考）净值、元盛 A 的约定年收益率、根据基金管理人指令办理清算交收且如遇到问题应及时反馈、相关信息披露和监督基金投资运作是否对非公开信息保密等行为。

基金管理人定期和不定期地对基金托管人保管的基金资产进行核查。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。

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、本协议及其他有关规定时，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在下一工作日前及时核对确认并以书面形式向基金管理人发出回函，说明违规原因，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定限期内，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。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、基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

#### （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，确保基金财产的完整与独立。

（5）对于因为基金投资产生的应收资产和基金认购、申购过程中产生的应收资产，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账户的，基金托管人应及时通知并有义务配合基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，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任何责任。

（6）除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。



## 2、募集资金的验证

（1）基金募集期满或基金提前结束募集时，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，基金管理人应将属于本基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户，基金托管人在收到资金当日出具相关证明文件。

## 3、基金的银行账户的开立和管理

（1）基金托管人以本基金的名义在其营业机构开立基金的银行账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。

（2）基金银行账户的开立和使用，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假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

（3）基金银行账户的开立和管理应符合相关法律法规的有关规定。

## 4、基金证券账户与结算备付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结算备付金账户。

基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

若中国证监会或其他监管机构在本托管协议生效日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开设、使用的，按有关规定开设、使用并管理；若无相关规定，则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

## 5、债券托管账户的开设和管理

（1）基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管与结算账户并报中国人民银行备案，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人负责申请基金进入全国银行间同业拆借市场进行交易，由基金管理人在中国



外汇交易中心开设同业拆借市场交易账户。

(2) 基金管理人和基金托管人同时代表基金签订全国银行间国债市场回购主协议，协议正本由基金托管人保管，协议副本由基金管理人保存。

#### 6、其他账户的开设和管理

(1) 因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定，在基金管理人和基金托管人商议后由基金托管人负责开立。新账户按有关规则使用并管理。

(2) 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### 7、基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管，保管凭证由基金托管人持有，其中实物证券由基金托管人存放于托管银行的保管库，应与非本基金的其他实物证券分开保管；也可存入登记结算机构的代保管库。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由基金管理人、基金托管人保管，相关业务程序另有限制除外。除协议另有规定外，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。基金管理人应在重大合同签署后及时以加密方式将重大合同传真给基金托管人，并在 10 个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限为基金合同终止后 15 年。对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖授权业务章的合同传真件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

### (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基金份额总数的数值。基金管理人每工作日计算基金资产净值及基金份额净值，经基金托管人复核无误后，按规定公告。

自本基金合同生效之日起 2 年内：在元盛 A 的开放日计算元盛 A 的基金份额净值，在元盛 B 的封闭期届满日分别计算元盛 A 和元盛 B 的基金份额净值；在非元盛 A 的开放日且非基金合同生效后 2 年期届满日，基金管理人在基金份额净值计算的基础上，按照《基金合同》的规定采用“虚拟清算”原则计算并公告元盛 A 和元盛 B 的基金份额参考净值。

(2) 基金管理人每个估值日对基金资产进行估值后，将估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。

(3) 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。

## 2、基金会计核算

### (1) 基金账册的建立

基金管理人进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。基金管理人独立地设置、记录和保管本基金的全套账册。若基金管理人和基金托管人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。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

### (2) 基金定期报告的编制和复核

基金管理人应当及时编制并对外提供真实、完整的基金财务会计报告。月度报表的编制，基金管理人应于每月终了后 5 个工作日内完成；招募说明书在基金合同生效后每 6 个月更新并公告一次，于基金合同生效后每 6 个月结束之日起 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予以公告；半年度报告在会计年度半年终了后 40 日内编制完毕并于会计年度半年终了后 60 日内予以公告；年度报告在会计年度结束后 60 日内编制完毕并于会计年度终了后 90 日内予以公告。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。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。

基金管理人在月度报表完成当日，将报表盖章后提供给基金托管人复核；基金托管人在收到后应在 3 日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 5 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在半年度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 20 日内完成复核，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，基金托管人应在收到后 30 日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以加密传真的方式或双方商定的其他方式进行。

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；若双方无法达成一致，以基金管理人的账务处理为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖托管业务部门专用章或者出具加盖托管业务专用章的复核意见书，双方各自留存一份。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中国证监会备案。

#### （六）基金份额持有人名册的保管

本基金的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、基金权益登记日、基金份额持有人大会权益登记日、元盛 A 的开放日、元盛 B 封闭期届满日、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至少应包括持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由注册登记机构编制，由基金管理人审核并提交基金托管人保管。基金托管人有权要求基金管理人提供任意一个交易日或全部交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应及时提供，不得拖延或拒绝提供。

基金管理人应及时向基金托管人提交基金份额持有人名册。每年 6 月 30 日和 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、基金权益登记日、基金份额持有人大会权益登记日、元盛 A 的开放日、元盛 B 封闭期届满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。

基金管理人和基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册，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

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

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

本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

## （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，可以对协议进行修改。修改后的新协议，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）本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、破产或由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）基金财产清算组：自基金合同终止情形发生之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。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托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

（2）基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关

业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

（3）基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算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，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- 2) 根据法律法规及基金财产的情况确定清算期限；
- 3) 对基金财产进行清理和确认；
- 4) 对基金财产进行评估和变现；
- 5) 制作清算报告；
- 6) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- 7) 聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- 8) 将基金清算结果报告中国证监会；
- 9) 公布基金清算公告；
- 10) 对基金剩余财产进行分配。

（5）清算费用

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

（6）基金财产按如下顺序进行清偿：

- 1) 支付清算费用；
- 2) 缴纳所欠税款；
- 3) 清偿基金债务；
- 4) 剩余基金财产分配：

A、本基金在基金合同生效之日起 2 年内清算时的基金清算财产分配

本基金基金合同生效之日起 2 年内，如果本基金发生基金财产清算的情形，则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，将优先满足元盛 A 的本金及应计收益分配，如有剩余部分，则由元盛 B 的基金份额持有人按其持有的基金份额比例进行分配。

## B、本基金转型为上市开放式基金（LOF）后的基金清算财产分配

本基金基金合同生效后 2 年期届满，本基金转型为上市开放式基金（LOF）后，如果发生基金财产清算的情形，则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。

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。

## 三十、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### （一）资料寄送服务

#### 1、账户确认书

根据客户的需要，为客户寄送开放式基金账户确认书。

#### 2、对账单

基金投资人对账单包括季度对账单和年度对账单。其中，季度对账单在每季结束后的

20 个工作日内向有交易的持有人以书面或电子文件形式寄送；年度对账单在每年度结束后

25 个工作日内对所有持有人以书面或电子文件形式寄送。

如投资人需要更改寄送方式或寄送频率，请致电本公司客服中心或登陆公司网站。

3、其他相关的信息资料  
介绍公司最新动态、投资运作、新产品、国内外金融市场动态和投资机会等。

### （二）基金间转换服务

基金管理人在基金合同生效后的适当时候将为投资人办理基金间的转换业务，具体业务办理时间、业务规则及转换费率在基金转换公告中列明。



### (三) 定期投资计划

在技术条件成熟时,基金管理人将利用直销网点或代销网点为投资人提供定期投资的服务。通过定期投资计划,投资人可以通过固定的渠道,定期申购基金份额。该定期投资计划的有关规则另行公告。

### (四) 网络在线服务

通过本基金管理人网站的留言板和客户服务信箱,投资人可以实现在线咨询、投诉、建议和寻求各种帮助。

基金管理人网站提供了基金公告、投资资讯、理财刊物、基金常识等各种信息,投资人可以根据各自的使用习惯非常方便的自行查询或信息定制。

基金管理人网站将为投资人提供基金账户查询、交易明细查询、对账单寄送方式或频率设置、修改查询密码等服务。

公司网址: <http://www.gefund.com.cn>

电子信箱: [csmail@gefund.com.cn](mailto:csmail@gefund.com.cn)

### (五) 信息定制服务

在技术条件成熟时,基金管理人还可为基金投资人提供通过基金管理人网站、客户服务中心提交信息定制申请,基金管理人通过手机短讯、E-MAIL 定期为客户发送所定制的信息,内容包括:每笔交易确认查询、每月账户余额与损益查询、最近季度的基金投资组合、分红提示、公司最新公告、新产品信息披露、基金净值查询等。

### (六) 客户服务中心 (CALL-CENTER) 电话服务

呼叫中心自动语音系统提供 7×24 小时交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息查询。

呼叫中心人工座席每个交易日 9:00-17:00 为投资人提供服务,投资人可以通过该热线获得业务咨询,信息查询,服务投诉,信息定制,资料修改等专项服务。

客服电话: 4006135888、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。

## 三十一、其它应披露事项

### 1、本基金在本报告期内公开披露的信息内容

	公告	媒体	日期
1	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
2	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
3	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
4	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

5	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
6	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
7	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
8	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
9	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
10	金鹰基金管理有限公司关于新增北京微动利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 11 月 22 日
11	金鹰基金管理有限公司关于新增北京蛋卷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 25 日

12	金鹰基金管理有限公司关于新增上海云湾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 11 月 29 日
13	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 11 月 29 日
14	金鹰基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金申购赎回下限及最低转换份额限制的公告	证券时报等	2016 年 12 月 6 日
15	金鹰基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金直销柜台申购赎回下限及最低转换份额限制的公告	证券时报等	2016 年 12 月 7 日
16	金鹰基金管理有限公司关于增加上海好买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 12 月 8 日
17	金鹰基金管理有限公司关于新增北京唐鼎耀华投资咨询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 12 月 8 日
18	金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）更新招募说明书摘要（2016 年第 2 号）	证券时报等	2016 年 12 月 8 日

19	金鹰基金管理有限公司关于新增北京创金启富投资管理有限公司为代销机构并代销旗下部分基金的公告	证券时报等	2016 年 12 月 9 日
20	金鹰基金管理有限公司关于增加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的公告	证券时报等	2016 年 12 月 12 日
21	金鹰基金管理有限公司关于新增南京途牛金融信息服务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 12 月 21 日
22	金鹰基金管理有限公司关于新增南京苏宁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业务的公告	证券时报等	2016 年 12 月 22 日
23	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 12 月 22 日
24	金鹰基金管理有限公司关于增加蚂蚁（杭州）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、定投业务的公告	证券时报等	2016 年 12 月 23 日
25	金鹰基金管理有限公司关于新增中证金牛（北京）投资咨询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	证券时报等	2016 年 12 月 28 日

	业务的公告		
26	金鹰基金管理有限公司关于新增河南和信证券投资顾问股份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 12 月 28 日
27	金鹰基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新已过期身份证件的公告	证券时报等	2016 年 12 月 28 日
28	金鹰基金管理有限公司关于调整开户证件类型类型的再次提示公告	证券时报等	2016 年 12 月 29 日
29	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金参加中国工商银行“2017 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	证券时报等	2016 年 12 月 29 日
30	金鹰基金管理有限公司关于新增杭州科地瑞富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 12 月 29 日
31	金鹰基金管理有限公司关于新增浙江金观诚财富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 12 月 29 日
32	金鹰基金管理有限公司关于提醒投资者谨防虚假客服电话、防范金融诈骗的提示性公告	证券时报等	2016 年 12 月 30 日

33	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金参加中国光大银行股份有限公司费率优惠活动的公告	证券时报等	2016 年 12 月 30 日
34	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	2017 年 1 月 3 日
35	金鹰基金管理有限公司关于新增上海华信证券有限责任公司为本公司旗下部分基金代销机构并开通基金定投业务的公告	证券时报等	2017 年 1 月 10 日
36	金鹰基金管理有限公司关于新增北京植信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	2017 年 1 月 10 日
37	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本公司旗下部分基金代销机构并开通基金转换、定投业务的公告	证券时报等	2017 年 1 月 12 日
38	金鹰基金管理有限公司关于中信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	2017 年 1 月 19 日
39	金鹰元盛债券型发起式证券投资基金 (LOF) 2016 年第 4 季度报告	证券时报等	2017 年 1 月 20 日
40	金鹰基金管理有限公司关于招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	2017 年 1 月 21 日
41	金鹰元盛分级债券型发起式证券投资基金托管协议 (增设 E 类基金份额)	证券时报等	2017 年 2 月 9 日
42	金鹰元盛分级债券型发起式证券	证券时报等	2017 年 2 月 9 日

	投资基金基金合同（增设 E 类基金份额）		
43	金鹰基金管理有限公司关于金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）增加 E 类基金份额并相应修改基金合同及托管协议的公告	证券时报等	2017 年 2 月 9 日
44	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华龙证券股份有限公司为代销机构的公告	证券时报等	2017 年 2 月 17 日
45	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	2017 年 2 月 23 日
46	金鹰基金管理有限公司关于放开部分代销机构转换转入业务的公告	证券时报等	2017 年 3 月 3 日
47	金鹰基金管理有限公司关于新增上海华夏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	2017 年 3 月 23 日
48	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	2017 年 3 月 23 日
49	金鹰基金管理有限公司关于放开部分代销机构转换转入业务的公告	证券时报等	2017 年 3 月 24 日
50	金鹰基金管理有限公司关于新增湖北银行股份有限公司为本公司	证券时报等	2017 年 3 月 24 日



	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		
51	【年报】金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）2016 年年度报告（摘要）	证券时报等	2017 年 3 月 29 日
52	金鹰基金管理有限公司关于开放部分代销机构转换业务的公告	证券时报等	2017 年 4 月 11 日
53	金鹰元盛债券型发起式证券投资基金（LOF）2017 年第 1 季度报告	证券时报等	2017 年 4 月 24 日
54	金鹰基金管理有限公司关于增加湖北银行股份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	2017 年 4 月 27 日

## 2、其他重大事项

无

## 三十二、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。

## 三十三、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盛分级债券型发起式证券投资基金募集的文件（证监许可【2013】13号）；

（2）《金鹰元盛分级债券型发起式证券投资基金基金合同》；

（3）《金鹰元盛分级债券型发起式证券投资基金托管协议》；

（4）《金鹰元盛分级债券型发起式证券投资基金代销协议》；

（5）《金鹰元盛分级债券型发起式证券投资基金份额发售公告》；

（5）法律意见书；

（7）基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

（8）基金托管人业务资格批件、营业执照；

（9）《金鹰基金管理有限公司开放式基金业务规则》；

（10）中国证监会要求的其他文件。

查阅方式：投资者可在办公时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

咨询电话：400-6135-888

金鹰基金管理有限公司

2017年6月8日