

金鹰元丰债券型证券投资基金
更新的招募说明书

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

时间：二〇二六年十一月

【重要提示】

金鹰元丰债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）是根据《金鹰元丰保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，由金鹰元丰保本混合型证券投资基金第三个保本周期到期后转型而来。

金鹰元丰保本混合型证券投资基金根据 2012 年 11 月 19 日中国证券监督管理委员会《关于核准金鹰元丰保本混合型证券投资基金募集的批复》（证监许可【2012】1537 号）和 2012 年 12 月 17 日《关于金鹰元丰保本混合型证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函[2012]1131 号）进行募集。该基金的基金合同经中国证监会基金监管部于 2013 年 1 月 30 日备案确认（基金部函[2013]58 号）后正式生效。该基金第三个保本周期自 2016 年 3 月 14 日起至 2017 年 9 月 14 日止。该基金第三个保本周期到期后，根据《金鹰元丰保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，该基金保本周期到期后转型为非保本的债券型基金，名称相应变更为“金鹰元丰债券型证券投资基金”。

针对金鹰元丰保本混合型证券投资基金转型为金鹰元丰债券型证券投资基金，在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，依据《金鹰元丰保本混合型证券投资基金基金合同》约定的基金合同变更程序，经与基金托管人协商一致，基金管理人将《金鹰元丰保本混合型证券投资基金基金合同》修改为《金鹰元丰债券型证券投资基金基金合同》，并于 2017 年 9 月 7 日刊登了修改基金合同的公告，对基金合同修改部分进行了说明，本次修订后的基金合同于 2017 年 9 月 20 日起生效。前述修改变更事项已报中国证监会备案。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书根据本基金的基金合同编写，本基金的基金合同经中国证监会备案，但中国证监会对金鹰元丰保本混合型证券投资基金募集的注册以及其转型为本基金的备案，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。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，

并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险、与投资存托凭证相关的特定风险等等。当本基金持有特定资产且存在潜在重大赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启用侧袋机制，具体详见本招募说明书“侧袋机制”章节。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，并不办理侧袋账户的申购与赎回。侧袋账户对应特定资产的变现时间和最终变现价格都具有不确定性，并且有可能变现价格大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损失。请投资者仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。

本基金投资中小企业私募债券，该类债券是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的。受限于该类债券公开交易和发债主体自身资质，一般情况下潜在较大流动性风险和信用风险。当发债主体信用质量恶化或债券市场流动性受限时，可能会使得本基金总体风险水平增加，由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。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。

投资者应充分考虑自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。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。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本基金本次更新招募说明书因基金经理变更对基金管理人章节相关信息进行更新，相关信息更新截止日为 2026 年 11 月 3 日。除非另有说明， 本招募说明书所载内容截止日为 2026 年 8 月 31 日，有关财务数据截止日为 2026 年 6 月 30 日，净值表现截止日为 2026 年 6 月 30 日，本报告中财务数据未经审计。

目 录

一、绪言.....4
二、释义.....5
三、基金管理人.....10
四、基金托管人.....23
五、相关服务机构.....27
六、基金的募集.....52
七、基金合同的生效.....53
八、基金份额的申购与赎回.....54
九、基金的投资.....64
十、基金的业绩.....81
十一、基金的财产.....85
十二、基金资产的估值.....87
十三、基金的收益与分配.....92
十四、基金的费用和税收.....94
十五、基金的会计与审计.....96
十六、基金的信息披露.....97
十七、侧袋机制.....103
十八、风险揭示.....106
十九、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....111
二十、基金合同的内容摘要.....113
二十一、基金托管协议的内容摘要.....136
二十二、对基金份额持有人的服务.....153
二十三、其它应披露事项.....155
二十四、招募说明书的存放及查阅方式.....159
二十五、备查文件.....160

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》）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称《销售办法》）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)及其他有关规定以及《金鹰元丰债券型证券投资基金基金合同》编写。

本招募说明书阐述了金鹰元丰债券型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，本基金的基金合同经中国证监会备案。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	指金鹰元丰债券型证券投资基金；
基金合同	指《金鹰元丰债券型证券投资基金基金合同》及对其的任何有效修订和补充；
招募说明书	指《金鹰元丰债券型证券投资基金基金合同》及其更新；
发售公告	指《金鹰元丰债券型证券投资基金基金合同基金份额发售公告》；
托管协议	指《金鹰元丰债券型证券投资基金基金合同托管协议》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/或国家金融监督管理总局；
《基金法》	指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改<中华人民共和国港口法>等七部法律的决定》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订；
《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》	指中国证监会 2020 年 8 月 28 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订；
《运作办法》	指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订；
《信息披露办法》	指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的，

	并经 2020 年 3 月 20 日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决定》修正的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订；
元	指人民币元；
基金管理人	指金鹰基金管理有限公司；
基金托管人	指中国工商银行股份有限公司；
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金鹰基金管理有限公司或接受金鹰基金管理有限公司委托代为办理本基金注册登记业务的机构；
投资者	指个人投资者、机构投资者、合格境外投资者和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者；
个人投资者	指依据中华人民共和国有关法律法规可以投资于证券投资基金的自然人；
机构投资者	指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资于证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；
合格境外投资者	指符合《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》及相关法律法规规定，可以使用来自境外的资金投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者，包括合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者；
基金份额持有人大会	指按照基金合同第九部分之规定召集、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；
基金合同生效日	指《金鹰元丰债券型证券投资基金基金合同》生效起始日，《金鹰元丰保本混合型证券投资基金基金合同》自同一日起失效；
存续期	指基金合同生效至终止之间的不定期期限；
基金转换	投资者向基金管理人提出申请将其所持有的基金管理人管理

	的任一开放式基金（转出基金）的全部或部分基金份额转换为基金管理人管理的任何其他开放式基金（转入基金）的基金份额的行为；
转换入	投资者向基金管理人提出申请将其所持有的基金管理人管理的其他开放式基金的全部或部分基金份额转换为本基金的基金份额的行为；
转换出	投资者向基金管理人提出申请将其所持有的本基金的全部或部分基金份额转换为基金管理人管理的其他开放式基金的行为；
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；
申购	指在基金合同生效后的存续期间，投资者申请购买本基金基金份额的行为；
赎回	指在基金合同生效后的存续期间，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求基金管理人购回本基金基金份额的行为；
巨额赎回	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%时的情形；
转托管	指基金份额持有人将其基金账户内的某一基金的基金份额从一个销售机构托管到另一销售机构的行为；
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；
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接受基金管理人委托，代为办理基金认购、申购、赎回和其他基金业务的机构；
销售机构	指基金管理人及本基金代销机构；
基金销售网点	指基金管理人的直销中心及基金代销机构的代销网点；
基金账户	指注册登记机构为基金投资者开立的记录其持有的由该注册登记机构办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户；
交易账户	指销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理

	认购、申购、赎回、转换及转托管等业务而引起的基金份额的变动及结余情况的账户；
开放日	指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日；
封闭期	指基金成立后不办理申购、赎回的工作日，最长不超过自基金成立之日起三个月；
T 日	指销售机构受理投资者申购、赎回或其他业务申请的日期；
T+n 日	指 T 日后（不包括 T 日）第 n 个工作日，n 指自然数；
基金收益	指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息以及其他合法收入；
基金资产总值	指基金持有的各类有价证券、银行存款本息、应收申购款以及以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；
基金份额净值	针对本基金各类基金份额，指计算日某一类基金份额的基金资产净值除以计算日该类基金份额总数；
基金资产估值	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	指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、地方法规、地方规章、部门规章及其他规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充；
规定媒介	指符合中国证监会规定条件的全国性报刊及《信息披露办法》规定的互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介；
销售服务费	指从基金财产中计提的，用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用
A 类、D 类基金份额	指在投资者认购/申购时收取申购费用，而不计提销售服务费的基金份额
C 类基金份额	指在投资者认购/申购时不收取申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额
不可抗力	指任何无法预见、无法克服、无法避免的事件和因素，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、疫情、骚乱、火

	灾、政府征用、没收、法律变化、突发停电、电脑系统或数据传输系统非正常停止以及其他突发事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等。
业务规则	指《金鹰基金管理有限公司注册登记业务规则》
《流动性风险管理规定》	指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订
流动性受限资产	是指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等
摆动定价机制	指当开放式基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待
基金产品资料概要	《金鹰元丰债券型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新
侧袋机制	指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户
特定资产	包括：（1）无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性的资产；（2）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（3）其他资产价值存在重大不确定性的资产

三、基金管理人

（一）基金管理人简况：

名称：金鹰基金管理有限公司

注册地址：广州市南沙区横沥镇汇通二街 2 号 3212 房（仅限办公）

办公地址: 广东省广州市天河区珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 楼

法定代表人：姚文强

设立日期：2002 年 12 月 25 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会、证监基金字[2002]97 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：5.102 亿元人民币

存续期限：持续经营

联系人：范程程

联系电话：020-22825637

股权结构：

发起人名称	出资额（万元）	出资比例
东旭集团有限公司	33770	66.19%
广州越秀资本控股集团股份有限公司	12250	24.01%
广州白云山医药集团股份有限公司	5000	9.8%
总计	51020	100%

（二）主要人员情况

1、董事会成员

姚文强先生，经济学硕士。现任金鹰基金管理有限公司董事长、法定代表人。曾任上海中央登记结算公司深圳代办处财务部负责人、深圳代办处主管，浙江证券深圳营业部投资咨询部经理，大成基金管理有限公司市场部高级经理，汉唐证券有限责任公司市场总监，招商基金管理有限公司营销管理部总经理助理，国投瑞银基金管理有限公司华南总经理，博时基金管理有限公司零售南方总经理，金鹰基金管理有限公司总经理助理、副总经理、总经理等职务。

周蔚女士，经济学硕士。现任金鹰基金管理有限公司董事、总经理。曾任中国农业发展银行总行办公室、客户二部主任科员、业务主管，中诚信托有限责任公司团队负责人、投资管理部总经理助理，中泽香山（天津）文化发展集团有限公司副总裁，西藏金融租赁有限公司业务八中心主任、拟任副总裁，金鹰基金管理有限公司常务副总经理等职务。

牟敦国先生，新闻学学士。现任金鹰基金管理有限公司董事、副总经理兼首席运营官。曾任上海证券报社编辑、首席编辑，国投瑞银基金管理有限公司市场服务部副总监、总监，华泰资产管理有限公司产品研发负责人，华泰保兴基金管理有限公司董事总经理（MD）、产品战略开发部及客户服务部总经理，上海弘尚资产管理有限公司总经理助理，金鹰基金管理有限公司总经理助理兼市场服务部总经理、公司总经理助理兼首席运营官等职务。

颜康富先生，经济学学士。现任金鹰基金管理有限公司董事、广州越秀资本控股集团股份有限公司及广州越秀资本控股集团有限公司总法律顾问、风险管理与法务合规部总经理，广州越秀融资租赁有限公司董事，广州资产管理有限公司董事，广州越秀产业投资基金管理股份有限公司董事，越秀金融国际有限公司董事。曾任深圳发展银行股份有限公司（现平安银行股份有限公司）深圳分行彩田支行、长城支行副行长、总行信贷审批部风险管理高级经理等职务，广东南粤银行股份有限公司总行授信审批部副总经理（负责人）、广州分行副行长（分管风险，兼管合规）、惠州分行副行长等职务，广州越秀融资租赁有限公司首席风险官，广州越秀资本控股集团股份有限公司、广州越秀资本控股集团有限公司风险管理与法务合规部总经理，广州资产管理有限公司首席风险官等职务。

吴灏先生，经济学硕士。现任金鹰基金管理有限公司董事、广州越秀资本控股集团股份有限公司及广州越秀资本控股集团有限公司资本经营部总经理，广州期货股份有限公司董事，越秀金融国际控股有限公司董事，越秀证券控股有限公司董事。曾任长城证券股份有限公司投资银行事业部投行业务九部业务董事，广州越秀资本控股集团股份有限公司、广州越秀资本控股集团有限公司资本经营部副总经理等职务。

陈文霞女士，理学硕士。现任金鹰基金管理有限公司董事、广州白云山医药集团股份有限公司董事会秘书室副主任、广东省药学会药物制剂专委会委员、横琴粤澳深度合作区大健康生物医药产业协会副秘书长。曾任丽珠医药集团股份有限公司策略研究岗、投资关系主管、投资者关系经理、投资者关系高级经理、投资者关系总监等职务。

郝春莉女士，法学硕士。现任金鹰基金管理有限公司独立董事、北京市东卫律师事务所主任、律师。曾任中央政法干部管理学院教师，中国人民大学学报、中国人民大学出版社编

辑、副编辑，北京昆仑律师事务所、北京华堂律师事务所兼职律师等职务。

陆彬先生，工学硕士。现任金鹰基金管理有限公司独立董事、深圳正道科技创业投资有限责任公司风控总监、江苏高凯精密流体技术股份有限公司董事。曾任华中科技大学经济学院讲师、深圳蓝宝石钟表有限公司总经理助理兼财务经理、深圳中达信会计师事务所专业技术部副经理、高级项目经理、新一佳超市有限公司财务总监、监察审计总监、投资总监、深圳市鹭翔实业有限公司财务总监、广州鹭翔国际货运有限公司财务总监、深圳市鹭翔实业有限公司财务顾问、广州鹭翔国际货运有限公司财务顾问、深圳天兆基业有限公司财务顾问、深圳市蒙黛尔实业有限公司财务顾问、深圳市蒙黛尔时装股份有限公司财务总监等职务。

李国旺先生，经济学硕士。现任金鹰基金管理有限公司独立董事、中国人民大学重阳金融研究院高级顾问。曾任商业部商业信息中心副处长、中保信期货有限公司副总经理、中保信上海证券营业部总经理、中国银河证券股份有限公司战略发展部总监、上海证券有限责任公司研发中心总经理、银河基金管理有限公司市场总监、华宝证券股份有限公司研究所所长、中山证券有限责任公司首席经济学家及研究所所长、上海大陆期货有限公司首席经济学家等职务。

2、监事会成员

姜慧斌先生，管理学硕士。现任金鹰基金管理有限公司监事会主席、总经理助理、券商业务部总经理。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，金鹰基金管理有限公司综合管理部总经理助理、副总经理（主持工作）、总经理、战略运营部总经理等职务。

廖绮莉女士，荣誉理学学士学位。现任金鹰基金管理有限公司监事、广州白云山医药集团股份有限公司财务部高级经理。曾任NTUC Healthcare Cooperative Limited（新加坡）会计职务，立信羊城会计师事务所有限公司审计员、审计项目经理职务，广州白云山医药集团股份有限公司合并报表管理岗位，广州王老吉大健康产业有限公司财务人员。

黄定明先生，管理学硕士。现任金鹰基金管理有限公司监事、综合管理部总经理。曾任金鹰基金管理有限公司综合管理部人力资源、总经理助理、副总经理（主持工作）等职务。

3、公司高级管理人员

周蔚女士，经济学硕士。现任金鹰基金管理有限公司总经理。曾任中国农业发展银行总行办公室、客户二部主任科员、业务主管，中诚信托有限责任公司团队负责人、投资管理部

总经理助理，中泽香山（天津）文化发展集团有限公司副总裁，西藏金融租赁有限公司业务八中心主任、拟任副总裁，金鹰基金管理有限公司常务副总经理等职务。

凡湘平先生，经济学学士。现任金鹰基金管理有限公司督察长。曾任职于汉唐证券股份有限公司、广东证监局、广州越秀金融控股集团股份有限公司等单位。

刘盛先生，工学硕士。现任金鹰基金管理有限公司副总经理兼首席信息官。曾任长江证券有限公司电脑主管，平安证券有限公司电脑主管，巨田证券有限公司总裁助理，宏源证券股份有限公司技术总监，广州证券有限责任公司副总裁，天源证券有限公司总经理，广州证券股份有限公司副总裁，金鹰基金管理有限公司督察长等职务。

耿源先生，经济学硕士。现任金鹰基金管理有限公司副总经理。曾任职于北京市政府办公厅，北京宝德恒泰实业有限公司等单位。

牟敦国先生，新闻学学士。现任金鹰基金管理有限公司副总经理兼首席运营官。曾任上海证券报社编辑、首席编辑，国投瑞银基金管理有限公司市场服务部副总监、总监，华泰资产管理有限公司产品研发负责人，华泰保兴基金管理有限公司董事总经理（MD）、产品战略开发部及客户服务部总经理，上海弘尚资产管理有限公司总经理助理，金鹰基金管理有限公司总经理助理兼市场服务部总经理、公司总经理助理兼首席运营官等职务。

4、基金经理

林龙军先生，经济学硕士。现任金鹰基金管理有限公司绝对收益投资部总经理、基金经理。曾任兴全基金管理有限公司产品经理、研究员、基金经理助理、投资经理兼固收投委会委员，金鹰基金管理有限公司总经理助理等职务。林龙军先生管理过的基金如下：

管理过的公募基金名称	任职日期	离任日期
金鹰添裕纯债债券型证券投资基金	2018-05-17	2020-06-04
金鹰元安混合型证券投资基金	2018-05-17	2022-12-31
金鹰鑫益灵活配置混合型证券投资基金	2018-05-17	-
金鹰元丰债券型证券投资基金	2018-05-17	-
金鹰持久增利债券型证券投资基金（LOF）	2018-05-17	-
金鹰元祺信用债债券型证券投资基金	2018-06-02	-
金鹰民丰回报定期开放混合型证券投资基金	2018-06-02	-
金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金	2019-08-29	-
金鹰年年邮益一年持有期混合型证券投资基金	2021-03-09	-
金鹰民富收益混合型证券投资基金	2021-04-13	-
金鹰周期优选混合型证券投资基金	2022-12-31	-

吴海峰先生，金融硕士。现任金鹰基金管理有限公司绝对收益投资部基金经理。曾任国

金证券股份有限公司上海投资咨询分公司研究助理，金鹰基金管理有限公司研究员、基金经理助理。吴海峰先生管理过的基金如下：

管理过的公募基金名称	任职日期	离任日期
金鹰年年邮益一年持有期混合型证券投资基金	2025-04-03	-
金鹰民富收益混合型证券投资基金	2026-02-04	-
金鹰元祺信用债债券型证券投资基金	2026-04-30	-
金鹰悦享债券型证券投资基金	2026-04-30	-
金鹰元丰债券型证券投资基金	2026-11-03	-
金鹰民丰回报定期开放混合型证券投资基金	2026-11-03	-

历任基金经理变动如下：

基金经理	任职日期	离任日期
刘丽娟女士	2017-09-20	2018-03-20
汪伟先生	2017-09-21	2019-03-14
吴德瑄先生	2017-09-30	2019-03-19
林龙军先生	2018-05-17	-
吴海峰先生	2026-11-03	-

5、投资决策委员会成员

本公司采取集体投资决策制度，相关投资决策委员会成员有：

（1）公司投资决策委员会

周蔚女士，公司投资决策委员会主席，总经理；

牟敦国先生，公司投资决策委员会委员，副总经理兼首席运营官；

陈颖先生，公司投资决策委员会委员，总经理助理，首席投资官，成长投资部总经理，基金经理兼投资经理；

王怀震先生，公司投资决策委员会委员，总经理助理，混合投资部总经理，基金经理；

倪超先生，公司投资决策委员会委员，权益投资部总经理，基金经理兼投资经理；

杨刚先生，公司投资决策委员会委员，首席经济学家，权益研究部总经理，基金经理；

龙悦芳女士，公司投资决策委员会委员，固定收益部总经理，基金经理；

林龙军先生，公司投资决策委员会委员，绝对收益投资部总经理，基金经理；

韩广哲先生，公司投资决策委员会委员，基金经理兼投资经理。

（2）权益投资决策委员会

周蔚女士，权益投资决策委员会主席，总经理；

牟敦国先生，权益投资决策委员会委员，副总经理兼首席运营官；

陈颖先生，权益投资决策委员会委员，总经理助理，首席投资官，成长投资部总经理，基金经理兼投资经理；

倪超先生，权益投资决策委员会委员，权益投资部总经理，基金经理兼投资经理；

杨刚先生，权益投资决策委员会委员，首席经济学家，权益研究部总经理，基金经理；

杨晓斌先生，权益投资决策委员会委员，权益投资部副总经理，基金经理；

韩广哲先生，权益投资决策委员会委员，基金经理兼投资经理。

（3）固定收益投资决策委员会

周蔚女士，固定收益投资决策委员会主席，总经理；

牟敦国先生，固定收益投资决策委员会委员，副总经理兼首席运营官；

王怀震先生，固定收益决策委员会委员，总经理助理，混合投资部总经理，基金经理；

龙悦芳女士，固定收益投资决策委员会委员，固定收益部总经理，基金经理；

林龙军先生，固定收益投资决策委员会委员，绝对收益投资部总经理，基金经理；

孙倩倩女士，固定收益投资决策委员会委员，绝对收益投资部副总经理，基金经理。

上述人员之间均不存在近亲属关系。

（三）基金管理人的职责

1、权利

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）依法募集资金；

（2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；

（3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

（4）销售基金份额；

（5）按照规定召集基金份额持有人大会；

（6）依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

（7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

（9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；

（10）依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案；

（11）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

（12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东与债权人权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

（13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；

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

（15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商、期货经纪机构或其他为基金提供服务的外部机构；

（16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户等业务规则；

（17）在法律法规和基金合同规定的范围内决定除调高基金托管费、基金管理费之外的基金费率结构和收费方式；

（18）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

（1）依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

（2）办理基金备案手续；

（3）自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

（4）配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

（5）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

（6）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

（7）依法接受基金托管人的监督；

（8）采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；

（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（10）编制季度报告、中期报告和年度报告；

（11）严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

（12）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

（13）按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

（15）依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

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

（17）确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支

付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；

（18）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；

（19）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；

（20）因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

（21）监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

（22）当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

（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实施其他法律行为；

（24）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（25）建立并保存基金份额持有人名册；

（26）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（四）基金管理人的承诺

1、建立健全内部控制制度，防止违法行为发生

基金管理人承诺不从事违反《证券法》、《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、《指导意见》等法律法规的行为，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反行为的发生。

2、建立健全内部风险控制制度，有效防范风险

基金管理人承诺不从事以下禁止性行为，并承诺建立健全的内部风险控制制度，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）不公平地对待其管理的不同基金财产；

（3）利用基金财产或者职务之便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）侵占、挪用基金财产；

（6）泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

（7）玩忽职守，不按照规定履行职责；

（8）依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为及基金合同禁止的行为。

3、诚实信用，勤勉尽责

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）在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；

（5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；

（6）玩忽职守、滥用职权；

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

（8）除按本公司制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他股票投资；

（9）协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；

（10）违反证券交易场所业务规则，利用对敲倒、对仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；

（11）贬损同行，以提高自己；

（12）在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

（13）以不正当手段谋求业务发展；

（14）有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；

（15）其他法律、行政法规禁止的行为。

4、基金管理人关于禁止性行为的承诺

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

（1）承销证券；

（2）违反规定向他人贷款或者提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）买卖其他基金份额，但是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；

（6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，符合中国证监会的规定，并履行信息披露义务。

5、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）不能利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；

（3）不违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，不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；

（4）不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

（五）基金管理人的内部控制制度

1、内部控制的目标

（1）保证公司经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念。

（2）防范和化解经营风险，提高经营管理效益，确保经营业务的稳健运行和受托资产

的安全完整，实现公司的持续、稳定、健康发展。

（3）确保基金、公司财务和其他信息真实、准确、完整、及时。

2、内部控制的原则

（1）健全性原则。内部控制应当包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

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

（3）独立性原则。公司各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

（4）相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

（5）成本效益原则。公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

3、内部控制制度

公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章组成。

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，是各项基本管理制度的纲要和总揽，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。

基本管理制度包括风险控制制度、投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、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紧急应变制度。

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。

公司制定内部控制制度遵循了以下原则：

（1）合法合规性原则。公司内控制度应当符合国家法律、法规、规章和各项规定。

（2）全面性原则。内部控制制度应当涵盖公司经营管理的各个环节，不得留有制度上的空白或漏洞。

（3）审慎性原则。制定内部控制制度应当以审慎经营、防范和化解风险为出发点。

（4）适时性原则。内部控制制度的制定应当随着有关法律法规的调整和公司经营战

略、经营方针、经营理念等内外部环境的变化进行及时的修改或完善。

4、内部控制系统

公司的内部控制系统是一个分工明确、相互牵制、完备严密的系统。公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任，各个业务部门负责本部门的内部控制，督察长和合规风控部负责检查公司的内部控制措施的执行情况。具体而言，包括如下组成部分：

（1）董事会

负责制定公司的内部控制大纲，对公司内部控制负完全的和最终的责任。

（2）督察长

负责公司及其业务运作的监察稽核工作，对公司内部控制的执行情况进行监督检查。督察长对董事会负责，将定期和不定期向董事会报告公司内部控制的执行情况，并定期向董事会呈送督察长评估报告。

（3）合规风控部

合规风控部负责对公司各部门内部控制的执行情况进行监督。合规风控部对总经理负责，将定期和不定期对各业务部门内部控制制度的执行情况和遵守国家法律法规及其他规定的执行情况进行检查，适时提出修改建议，并定期向董事会呈送监察稽核报告。

（4）业务部门

内部控制是每一个业务部门的责任。各部门总监对本部门的内部控制负直接责任，负责履行公司的内部控制制度，并负责建立、执行和维护本部门的内部控制措施。

5、基金管理人关于内部控制的声明

基金管理人确知建立内部控制系统、维持其有效性以及有效执行内部控制制度是董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任；基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确，并承诺根据市场的变化和基金管理人的发展不断完善内部控制制度。

四、基金托管人

（一）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：廖林

注册资本：人民币 35,640,625.7089 万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

（二）主要人员情况

截至2026年6月，中国工商银行资产托管部共有员工209人，平均年龄38岁，99%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

（三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFI资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2026年6月，中国工商银行共托管证券投资基金1612只。自2003年以来，本行连续二十二年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的120项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

（四）基金托管人的内部控制情况

中国工商银行资产托管部在风险管理的实操过程中根据国际公认的内部控制COSO准则从控制环境、风险评估、控制活动、信息与沟通、内部监督五个方面构建起了托管业务内部风险控制体系，并纳入统一的风险管理体系。

中国工商银行资产托管部从成立之日起始终秉持规范运作的原则，将建立系统、高效的风险防范和控制体系视为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题新情况的不断出现，资产托管部自始至终将风险管理置于与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存与发展的生命线。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和相关业务岗位，每位员工均有义务对自己岗位职责范围内的风险负责。从 2005 年至今，中国工商银行资产托管部共十九次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的 ISAE3402 审阅，全部获得无保留意见的控制及有效性报告，充分表明独立第三方对中国工商银行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可，也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。

1.内部控制目标

（1）资产托管业务经营管理合法合规；

（2）促进实现资产托管业务发展战略和经营目标；

（3）资产托管业务风险管理的有效性和资产安全；

（4）提高资产托管经营效率和效果；

（5）业务记录、会计信息和其他经营管理相关信息的真实、准确、完整、及时。

2.内部控制的原则

（1）全面性原则。资产托管业务内部控制应贯穿决策、执行和监督全过程，覆盖资产托管业务各项业务流程和管理活动，覆盖所有机构、部门和从业人员。

（2）重要性原则。资产托管业务内部控制应在全面控制基础上，关注重要业务事项、重点业务环节和高风险领域。

（3）制衡性原则。资产托管业务内部控制应在机构设置、权责分配及业务流程等方面形成相互制约、相互监督的机制，同时兼顾运营效率。

（4）适应性原则。资产托管业务内部控制应当与经营规模、业务范围和风险特点相适应，并进行动态调整，以合理成本实现内部控制目标。

（5）审慎性原则。资产托管业务内部控制应坚持风险为本、审慎经营的理念，设立机构或开展各项经营管理活动均应坚持内控优先。

（6）成本效益原则。资产托管业务内部控制应权衡实施成本与预期效益，以合理成本实现有效控制。

3.内部控制组织结构

资产托管业务内部控制纳入全行统一的内部控制体系。

（1）总行资产托管部根据内部控制基本规定建立健全资产托管业务内部控制体系，作为全行托管业务的牵头管理部门，根据行内内部控制基本规定建立健全内部控制体系，建立与托管业务条线相适应的内部控制运行机制，确定各项业务活动的风险控制点，制定标准统一的业务制度；采取适当的控制措施，合理保证托管业务流程的经营效率和效果，组织开展资产托管业务内部控制措施的执行、监督和检查，督促各机构落实控制措施。

（2）总行内控合规部负责指导托管业务的内控管理工作，根据年度工作重点，定期或不定期在全行开展相关业务监督检查，将托管业务检查项目整合到全行业务监督检查工作中，将全行托管业务纳入内控评价体系。

（3）总行内部审计局负责对资产托管业务的审计与评价工作。

（4）一级（直属）分行资产托管业务部门作为内部控制的执行机构，负责组织开展本机构内部控制的日常运行及自查工作，及时整改、纠正、处理存在的问题。

4.内部控制措施

工商银行资产托管部重视内部控制制度的建设，坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中，建立了一整套内部控制制度体系，包括《资产托管业务管理规定》、《资产托管业务内部控制管理办法》、《资产托管业务全面风险管理办法》、《资产托管业务营运管理办法》、《资产托管业务合同管理办法》、《资产托管业务档案管理办法》、《资产托管业务系统管理办法》、《资产托管业务重大突发事件应急预案》、《资产托管业务从业人员管理办法》等，在环境、制度、流程、岗位职责、人员、授权、创新、合同、印章、服务质量、收费、反洗钱、防止利益冲突、业务连续性、考核、信息系统等全方面执行内部控制措施。

5.风险控制

资产托管业务切实履行风险管理第一道防线的主体职责，按照“主动防、智能控、全面管”的管理思路，主动将资产托管业务的风险管理纳入全行全面风险管理体系，以“管住人、管住钱、管好防线、管好底线”为管理重点，搭建适应资产托管业务特点的风险管理架构，通过推进托管业务体制机制与完善集约化营运改革、建立资产托管风险管理委员会机制、完善资产托管业务制度体系、加强资产托管业务队伍建设、科技赋能、建立健全应急灾备体系、建立审计发现问题整改台账、加强人员管理等措施，有效控制操作风险、合规风险、声誉风险、信息科技风险和次生风险。

6.业务连续性保障

中国工商银行制订了完善的资产托管业务连续性工作计划和应急预案，具备行之有效的灾备恢复方案、充足的移动办公设备、同城异城相结合的备份办公场所、必要的

工作人员、科学清晰的 AB 岗位设置及定期演练机制。在重大突发事件发生后，可根据突发事件的对托管业务连续性营运影响程度的评估，适时选择或依次启动“原场所现场+居家”、“部分同城异地+居家”、“部分异城异地+居家”、“异地全部切换”四种方案，由“总部+总行级营运中心+托管分部+境外营运机构”形成全球、全天候营运网络，向客户提供连续性服务，确保托管产品日常交易的及时清算和交割。

（五）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

根据《基金法》、基金合同、托管协议和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、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，其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议或有关基金法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

五、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

名称：金鹰基金管理有限公司

注册地址：广州市南沙区横沥镇汇通二街 2 号 3212 房（仅限办公）

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

法定代表人：姚文强

成立时间：2002 年 12 月 25 日

批准设立机关及批准设立文号：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：5.1020 亿元人民币

存续期间：持续经营

联系人： 蔡晓燕

电话：020- 22825633

传真：020-83283445

客户服务及投诉电话：020-83936180、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） 名称：中国工商银行股份有限公司

客服电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

（2） 名称：中国建设银行股份有限公司

客服电话：95533

网址：www.ccb.com

（3） 名称：交通银行股份有限公司

客服电话：95559

网址：www.bankcomm.com

（4） 名称：招商银行股份有限公司

客服电话：95555

网址：www.cmbchina.com

（5） 名称：中信银行股份有限公司

客服电话：95558

网址：www.citicbank.com

（6） 名称：上海浦东发展银行股份有限公司

客服电话：95528

网址：www.spdb.com.cn

（7） 名称：兴业银行股份有限公司

客服电话：95561

网址：www.cib.com.cn

（8） 名称：中国光大银行股份有限公司

客服电话：95595

网址：www.cebbank.com

（9） 名称：中国邮政储蓄银行股份有限公司

客服电话：95580

网址：www.psbc.com

（10） 名称：广发银行股份有限公司

客服电话：95508

网址：www.cgbchina.com.cn

（11） 名称：平安银行股份有限公司

客服电话：95511

网址：www.bank.pingan.com

（12） 名称：宁波银行股份有限公司

客服电话：95574

网址：www.nbcb.cn

（13） 名称：杭州银行股份有限公司

客服电话：95398

网址：www.hzbank.com.cn

（14） 名称：江苏银行股份有限公司

客服电话：95319

网址：www.jsbchina.cn

（15） 名称：东莞农村商业银行股份有限公司

客服电话：0769-961122

网址：www.drcbank.com

（16） 名称：广东顺德农村商业银行股份有限公司

客服电话：0757-22223388

网址：www.sdebank.com

（17） 名称：江苏江南农村商业银行股份有限公司

客服电话：96005

网址：www.jnbank.com.cn

（18） 名称：成都农村商业银行股份有限公司

客服电话：95392

网址：www.cdrcb.com

（19） 名称：四川天府银行股份有限公司

客服电话：400-16-96869

网址：www.tf.cn

（20） 名称：国泰海通证券股份有限公司

客服电话：95521

网址：www.gtht.com

（21） 名称：中信建投证券股份有限公司

客服电话：4008-888-108

网址：www.csc108.com

（22） 名称：国信证券股份有限公司

客服电话：95536

网址：www.guosen.com

（23） 名称：招商证券股份有限公司

客服电话：95565/0755-95565

网址：www.cmschina.com

（24） 名称：中信证券股份有限公司

客服电话：95548

网址：www.cs.ecitic.com

（25） 名称：中国银河证券股份有限公司

客服电话：4008-888-888 或 95551

网址：www.chinastock.com.cn

（26） 名称：长江证券股份有限公司

客服电话：95579 或 4008-888-999

网址：www.95579.com

（27） 名称：国投证券股份有限公司

客服电话：95517

网址：www.sdicsc.com.cn

（28） 名称：万联证券股份有限公司

客服电话：95322

网址：www.wlzq.cn

（29） 名称：渤海证券股份有限公司

客服电话：400-651-5988

网址：www.bhzq.com

（30） 名称：中信证券（山东）有限责任公司

客服电话：95548

网址：sd.citics.com

（31） 名称：东吴证券股份有限公司

客服电话：95330

网址：www.dwzq.com.cn

（32） 名称：中信证券华南股份有限公司

客服电话：95548

网址：www.gzs.com.cn

（33） 名称：国联民生证券股份有限公司

客服电话：95570

网址：www.glsc.com.cn

（34） 名称：国盛证券股份有限公司

客服电话：956080

网址：www.gszq.com

（35） 名称：华西证券股份有限公司

客服电话：95584

网址：www.hx168.com.cn

（36） 名称：中泰证券股份有限公司

客服电话：95538

网址：www.zts.com.cn

（37） 名称：第一创业证券股份有限公司

客服电话：95358

网址：www.firstcapital.com.cn

（38） 名称：西部证券股份有限公司

客服电话：95582

网址：www.west95582.com

（39） 名称：华龙证券股份有限公司

客服电话：95368

网址：www.hlzqgs.com

（40） 名称：财通证券股份有限公司

客服电话：95336

网址：www.ctsec.com

（41） 名称：国金证券股份有限公司

客服电话：95310

网址：www.gjzq.com.cn

（42） 名称：华宝证券股份有限公司

客服电话：400-820-9898

网址：www.cnhbstock.com

（43） 名称：开源证券股份有限公司

客服电话：95325

网址：www.kysec.cn

（44） 名称：广发证券股份有限公司

客服电话：95575 或 020-95575

网址：www.gf.com.cn

（45） 名称：申万宏源证券有限公司

客服电话：95523 或 4008895523

网址：www.swhysc.com

（46） 名称：兴业证券股份有限公司

客服电话：95562

网址：www.xyzq.com.cn

（47） 名称：西南证券股份有限公司

客服电话：95355

网址：www.swsc.com.cn

（48） 名称：湘财证券股份有限公司

客服电话：95351

网址：www.xcsc.com

（49） 名称：国元证券股份有限公司

客服电话：95578

网址：www.gyzq.com.cn

（50） 名称：山西证券股份有限公司

客服电话：95573

网址：www.i618.com.cn

（51） 名称：东兴证券股份有限公司

客服电话：95309

网址：www.dxzq.net

（52） 名称：信达证券股份有限公司

客服电话：95321

网址：www.cindasc.com

（53） 名称：方正证券股份有限公司

客服电话：95571

网址：www.foundersc.com

（54） 名称：长城证券股份有限公司

客服电话：95514；400-6666-888

网址：www.cgws.com

（55） 名称：光大证券股份有限公司

客服电话：95525

网址：www.ebscn.com

（56） 名称：东北证券股份有限公司

客服电话：95360

网址：www.nesc.cn

（57） 名称：上海证券有限责任公司

客服电话：4008-918-918

网址：www.shzq.com

（58） 名称：诚通证券股份有限公司

客服电话：95399

网址：www.cctgsc.com.cn

（59） 名称：大同证券有限责任公司

客服电话：4007-121212

网址：www.dtsbc.com.cn

（60） 名称：浙商证券股份有限公司

客服电话：95345

网址：www.stocke.com.cn

（61） 名称：平安证券股份有限公司

客服电话：95511 转 8

网址：www.stock.pingan.com

（62） 名称：华安证券股份有限公司

客服电话：95318

网址：www.hazq.com.cn

（63） 名称：国海证券股份有限公司

客服电话：95563；0771-95563

网址：www.ghzq.com.cn

（64） 名称：东莞证券股份有限公司

客服电话：95328

网址：www.dgzq.com.cn

（65） 名称：国都证券股份有限公司

客服电话：400-818-8118

网址：www.guodu.com

（66） 名称：东海证券股份有限公司

客服电话：95531；400-8888-588

网址：www.longone.com.cn

（67） 名称：申万宏源西部证券有限公司

客服电话：95523 或 4008895523

网址：www.swhysc.com

（68） 名称：世纪证券有限责任公司

客服电话：956019

网址：www.csco.com.cn

（69） 名称：金元证券股份有限公司

客服电话：95372

网址：www.jyzq.cn

（70） 名称：中航证券有限公司

客服电话：0791-95335

网址：www.avicsec.com

（71） 名称：德邦证券股份有限公司

客服电话：400-8888-128

网址：www.tebon.com.cn

（72） 名称：华福证券有限责任公司

客服电话：95547

网址：www.hfzq.com.cn

（73） 名称：中国国际金融股份有限公司

客服电话：(+86-10) 6505 1166

网址：www.cicc.com

（74） 名称：甬兴证券有限公司

客服电话：400-916-0666

网址：www.yongxingsec.com

（75） 名称：五矿证券有限公司

客服电话：40018-40028

网址：www.wkzq.com.cn

（76） 名称：华鑫证券有限责任公司

客服电话：95323 或 400-109-9918

网址：www.cfsc.com.cn

（77） 名称：中国中金财富证券有限公司

客服电话：95532；4006008008

网址：www.ciccwm.com

（78） 名称：中山证券有限责任公司

客服电话：95329

网址：www.zszq.com

（79） 名称：粤开证券股份有限公司

客服电话：95564

网址：www.ykzq.com

（80） 名称：江海证券有限公司

客服电话：956007

网址：www.jhzq.com.cn

（81） 名称：华源证券股份有限公司

客服电话：95305

网址：www.jzsec.com

（82） 名称：爱建证券有限责任公司

客服电话：4001-962-502

网址：www.ajzq.com

（83） 名称：英大证券有限责任公司

客服电话：400-0188-688

网址：www.ydsc.com.cn

（84） 名称：国新证券股份有限公司

客服电话：95390

网址：www.crsec.com.cn

（85） 名称：财达证券股份有限公司

客服电话：95363

网址：www.95363.com

（86） 名称：天风证券股份有限公司

客服电话：95391 或 400-800-5000

网址：www.tfzq.com

（87） 名称：华创证券有限责任公司

客服电话：4008-6666-89

网址：www.hczq.com

（88） 名称：中邮证券有限责任公司

客服电话：400-8888-005

网址：www.cnpsec.com.cn

（89） 名称：首创证券股份有限公司

客服电话：95381

网址：www.sczq.com.cn

（90） 名称：天府证券有限责任公司

客服电话：4008-366-366

网址：www.hxzq.cn

（91） 名称：太平洋证券股份有限公司

客服电话：95397

网址：www.tpyzq.com

（92） 名称：麦高证券有限责任公司

客服电话：400-618-3355

网址：www.wxzq.com

（93） 名称：联储证券股份有限公司

客服电话：956006

网址：www.lczq.com

（94） 名称：申港证券股份有限公司

客服电话：956029

网址：www.shgsec.com

（95） 名称：天相投资顾问有限公司

客服电话：010-66045555

网址：www.txsec.com

（96） 名称：深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

客服电话：400-166-1188 转 2

网址：www.new-rand.cn

（97） 名称：厦门市鑫鼎盛控股有限公司

客服电话：400-6533-789

网址：www.xds.com.cn

（98） 名称：大河财富基金销售有限公司

客服电话：400-888-0008

网址：www.urainf.com

（99） 名称：上海有鱼基金销售有限公司

客服电话：021-61265457

网址：www.youyufund.com

（100） 名称：青岛意才基金销售有限公司

客服电话：400-612-3303

网址：www.yitsai.com

（101） 名称：上海好买基金销售有限公司

客服电话：400-700-9665

网址：www.howbuy.com

（102） 名称：北京展恒基金销售股份有限公司

客服热线： 4008188000

网址： www.myfund.com

（103） 名称：北京中期时代基金销售有限公司

客服电话：95162

网址：www.cifcofund.cn

（104） 名称：泛华普益基金销售有限公司

客服电话：400-080-3388

网址：www.puyifund.com

（105） 名称：南京苏宁基金销售公司

客服电话：95177

网址：www.snjijin.com

（106） 名称：鼎信汇金（北京）投资管理有限公司

客服电话：400-158-5050

网址：www.tl50.com

（107） 名称：广州经传多赢投资咨询有限公司

客服电话：400-9088-988

网址：www.jingzhuan.cn

（108） 名称：深圳市米粒基金销售有限公司

客户服务电话:400-001-1566

网址:www.yilucaifu.com

（109） 名称：海银基金销售有限公司

客服电话：400-808-1016

网址：www.fundhaiyin.com

（110） 名称：和讯信息科技有限公司

客服电话：4009200022

网址：licaike.hexun.com

（111） 名称：天津国美基金销售有限公司

客服电话：010-59287822；400-111-0889

网址：www.gomefund.com

（112） 名称：北京新浪仓石基金销售有限公司

客服电话：010-62675369

网址：fund.sina.com.cn

（113） 名称：北京加和基金销售有限公司

客服电话：400-820-1115

网址：www.jiahejijin.com

（114） 名称：北京辉腾汇富基金销售有限公司

客服电话：400-829-1218

网址：www.htfund.com

（115） 名称：上海挖财基金销售有限公司

客服电话：021-50810673

网址：www.wacaijijin.com

（116） 名称：福克斯（北京）基金销售有限公司

客服电话：010-65042486

网址：www.haofunds.com

（117） 名称：众惠基金销售有限公司

客服电话：400-839-1818

网址：www.zhfundsales.com

（118） 名称：上海陆享基金销售有限公司

客服电话：400-168-1235

网址：www.luxxfund.com

（119） 名称：贵州省贵文文化基金销售有限公司

客服电话：0851-85407888

网址：www.gwcaifu.com

（120） 名称：腾安基金销售（深圳）有限公司

客服电话：95788

网址：www.txfund.com

（121） 名称：北京坤元基金销售有限公司

客服电话：010-86340269

网址:www.kunyuanfund.com

（122） 名称：北京度小满基金销售有限公司

客服电话：95055-4

网址：www.duxiaomanfund.com

（123） 名称：博时财富基金销售有限公司

客服电话：400-610-5568

网址：www.boserawealth.com

（124） 名称：上海凯石财富基金销售有限公司

客服电话：400-643-3389

网址：www.vstonewealth.com

（125） 名称：易方达财富管理基金销售（广州）有限公司

客服电话：4001608888

网址：www.efundcf.com.cn

（126） 名称：北京虹点基金销售有限公司

客服电话：400-035-5010

网址：www.hongdianfund.com

（127） 名称：深圳富济基金销售有限公司

客服电话：0755-83999907

网址：www.fujifund.cn

（128） 名称：诺亚正行基金销售有限公司

客服电话：400-821-5399

网址：www.noah-fund.com

（129） 名称：武汉佰鲲基金销售有限公司

客服电话：4000279899

网址：www.bestfunds.com.cn

（130） 名称：上海陆金所基金销售有限公司

客服电话：4008219031

网址：www.lufunds.com

（131） 名称：深圳众禄基金销售股份有限公司

客服电话：4006-788-887

网址：www.zlfund.cn/www.jjmmw.com

（132） 名称：和耕传承基金销售有限公司

客服电话：400-055-5671

网址：www.hgccpb.com

（133） 名称：上海天天基金销售有限公司

客服电话：95021

网址：www.1234567.com.cn

（134） 名称：北京懒猫基金销售有限公司

客服电话：010-85965200

网址：www.lanmao.com

（135） 名称：蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

客服电话：95188-8

网址：www.fund123.cn

（136） 名称：京东肯特瑞基金销售有限公司

客服电话：95118

网址：www.kenterui.jd.com

（137） 名称：上海长量基金销售有限公司

客服电话：400-820-2899

网址：www.erichfund.com

（138） 名称：浙江同花顺基金销售有限公司

客服电话：952555

网址：www.5ifund.com

（139） 名称：上海利得基金销售有限公司

客服电话：400-032-5885

网址：www.leadfund.com.cn

（140） 名称：嘉实财富管理有限公司

客服电话：400-021-8850

网址：www.harvestwm.cn

（141） 名称：北京创金启富基金销售有限公司

客服电话：010-66154828-8032

网址：www.5irich.com

（142） 名称：上海中欧财富基金销售有限公司

客服电话：400-100-2666

网址：www.zocaifu.com

（143） 名称：万家财富基金销售（天津）有限公司

客服电话：010-59013895

网址：www.wanjiawealth.com

（144） 名称：宜信普泽（北京）基金销售有限公司

客服电话：400-6099-200

网址：www.yixinfund.com

（145） 名称：北京格上富信基金销售有限公司

客服电话：400-080-5828

网址：www.licai.com

（146） 名称：华泰期货有限公司

客服电话：400-628-0888

网址：www.htfc.com

（147） 名称：中衍期货有限公司

客服电话：4006881117

网址：www.cdfco.com.cn

（148） 名称：深圳腾元基金销售有限公司

客服电话：400-990-8601

网址：www.tenyuanfund.com

（149） 名称：通华财富（上海）基金销售有限公司

客服电话：400-101-9301

网址：www.tonghuafund.com

（150） 名称：北京汇成基金销售有限公司

客服电话：010-63158805

网址：www.hcfunds.com

（151） 名称：北京广源达信基金销售有限公司

客服电话：400-616-7531

网址：www.guangyuandaxin.com

（152） 名称：上海大智慧基金销售有限公司

客服电话：021-20292031

网址：www.wg.com.cn

（153） 名称：北京济安基金销售有限公司

客服电话：400-673-7010

网址：www.jianfortune.com

（154） 名称：上海万得基金销售有限公司

客服电话：400-799-1888

网址：www.520fund.com.cn

（155） 名称：上海国信嘉利基金销售有限公司

客服电话：4000216088

网址：www.gxjlcn.com

（156） 名称：上海联泰基金销售有限公司

客服电话：400-118-1188

网址：www.66liantai.com

（157） 名称：上海汇付基金销售有限公司

客服电话：021-34013999

网址：www.hotjijin.com

（158） 名称：泰信财富基金销售有限公司

客服电话：400-004-8821

网址：www.taixincf.com

（159） 名称：上海基煜基金销售有限公司

客服电话：400-820-5369

网址：www.jiyufund.com.cn

（160） 名称：上海中正达广基金销售有限公司

客服电话：400-6767-523

网址：www.zzwealth.cn

（161） 名称：上海攀赢基金销售有限公司

客服电话：021-68889082

网址：www.pytz.cn

（162） 名称：珠海盈米基金销售有限公司

客服电话：020-89629066

网址：www.yingmi.cn

（163） 名称：奕丰基金销售有限公司

客服电话：400-684-0500

网址：www.ifastps.com.cn

（164） 名称：上海爱建基金销售有限公司

客服电话：021-64382660；400-803-2733

网址：www.ajwm.com.cn

（165） 名称：大连网金基金销售有限公司

客服电话：4000-899-100

网址：www.yibaijin.com

（166） 名称：上海证达通基金销售有限公司

客服电话：400-820-1515

网址：www.zhengtongfunds.com

（167） 名称：深圳市金斧子基金销售有限公司

客服热线：400-8224-888

网址：www.jfzinv.com

（168） 名称：北京雪球基金销售有限公司

客服电话：400-159-9288

网址：danjuanfunds.com

（169） 名称：东方财富证券股份有限公司

客服电话：95357

网址：www.18.cn

（170） 名称：深圳市排排网基金销售有限责任公司

客服电话：400-666-7388

网址：www.simuwang.com

（171） 名称：上海华夏财富投资管理有限公司

客服电话：400-817-5666

网址：www.amcfortune.com

（172） 名称：中信期货有限公司

客服电话：400-990-8826

网址：www.citicsf.com

（173） 名称：华瑞保险销售有限公司

客服电话：952303

网址：www.huaruisales.com

（174） 名称：玄元保险代理有限公司

客服电话：400-080-8208

网址：www.licaimofang.com

（175） 名称：阳光人寿保险股份有限公司

客服电话：95510

网址：fund.sinosig.com

（176） 名称：中国人寿保险股份有限公司

客服电话：95519

网址：www.e-chinalife.com

（177） 名称：湖北银行股份有限公司

客服电话：96599；400-85-96599

网址：www.hubeibank.cn

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构销售本基金。代销机构信息，以基金管理人网站公示为准。

（二）注册登记机构

名称：金鹰基金管理有限公司

注册地址：广州市南沙区横沥镇汇通二街 2 号 3212 房（仅限办公）

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

法定代表人：姚文强

电话：020- 22825649

传真：020-83282856

联系人：张盛

（三）律师事务所和经办律师

名称：广东岭南律师事务所

住所：广州市海珠区阅江西路 370 号广报中心北塔 15 楼

法定代表人：邓柏涛

电话：020-81836088

传真：020-31952316

经办律师：欧阳兵、谢洁、伍瑞祥

（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：江超杰、宋锦锋

六、基金的募集

（一）基金募集的依据

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 2012 年 11 月 19 日证监许可【2012】 1537 号文核准。

（二）基金存续期间

不定期

（三）基金类型

契约型开放式

（四）募集方式

本基金通过各销售机构的基金销售网点向投资人公开发售。

（五）募集期限

本基金自 2012 年 12 月 24 日起公开募集，并于 2013 年 1 月 24 日募集结束。

（六）募集对象

本基金份额的发售对象为中华人民共和国境内的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

（七）份额面值

本基金的初始份额面值为每份基金份额人民币 1.00 元。

七、基金合同的生效

本基金由金鹰元丰保本混合型证券投资基金第三个保本周期届满后转型而来。

金鹰元丰保本混合型证券投资基金经中国证监会《关于核准金鹰元丰保本混合型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2012]1537 号）核准募集，基金管理人为金鹰基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

金鹰元丰保本混合型证券投资基金自 2012 年 12 月 24 日至 2013 年 1 月 24 日进行公开募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理基金备案手续。经中国证监会书面确认，《金鹰元丰保本混合型证券投资基金基金合同》于 2013 年 1 月 30 日生效。

金鹰元丰保本混合型证券投资基金于 2017 年 9 月 14 日第三保本周期到期，由于不符合保本基金存续条件，按照《金鹰元丰保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，该基金保本周期到期后转型为非保本的债券型基金，名称相应变更为“金鹰元丰债券型证券投资基金”。金鹰元丰保本混合型证券投资基金的保本周期到期操作期间为保本周期到期日（含）及之后 3 个工作日（含第 3 个工作日），即 2017 年 9 月 14 日至 2017 年 9 月 19 日。自 2017 年 9 月 20 日起金鹰元丰保本混合型证券投资基金正式转型为金鹰元丰债券型证券投资基金，转型后的《金鹰元丰债券型证券投资基金基金合同》自该日起生效。

《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不超过 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

中国证监会另有规定的，按其规定办理。

八、基金份额的申购与赎回

（一）申购与赎回办理的场所

本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。

投资人可以在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购与赎回。本基金管理人可根据情况增减基金代销机构，并在基金管理人网站公示。

条件成熟时，投资人可以通过基金管理人或其指定的代销机构以电话、传真或网上交易等形式进行基金的申购和赎回，具体办法另行公告。

（二）申购与赎回办理的开放日及时间

1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

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

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前 2 日依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购或者赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接收的，其基金份额申购、赎回或转换价格为下一开放日该类别基金份额申购、赎回或转换的价格。

（三）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的对应份额类别基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资者认购、申购的先后次序进行顺序赎回，以确定所适用的赎回费率。对于由金鹰元丰保本混合型证券投资基金转型后基金的基金份额，其持有期将从原份额取得之日起连续计算；

5、基金管理人可在法律法规允许的情况下，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》的有关规定在规定媒介上公告。

（四）申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

投资人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。

2、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T 日)，在正常情况下，本基金登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人可在 T+2 日后(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。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。

3、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付款项，申购申请即为有效。

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

（五）申购和赎回的数额和价格

1、申购金额、赎回份额及余额的处理方式

（1）投资者通过各代销机构申购本基金时（含定期定额申购），申购最低金额为 1 元（含申购费，如有），追加申购单笔最低限额为人民币 1 元，超过部分不设最低级差限制。

（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），追加申购单笔最低限额为人民币 1 元，超过部分不设最低

级差限制。

（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），追加申购单笔最低限额为人民币1元，超过部分不设最低级差限制。

（4）投资者在各销售机构最低赎回份额、最低持有份额为1份，在各销售机构最低转换份额为10份。赎回、转换出后导致该基金份额不足1份的，基金管理人有权将投资者该基金的剩余份额全部自动赎回。

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

（6）基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额、赎回份额、单个投资者累计持有基金份额上限及单个交易账户的最低基金份额余额的数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

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

2、申购赎回费率

（1）申购费率：

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

本基金C类基金份额不收取申购费，A类基金份额、D类基金份额申购费率如下表：

A类基金份额申购费率如下：

申购金额（万元）	A 类基金份额申购费率
M ＜100	0.6%
100≤M ＜300	0.4%
300 ≤M ＜500	0.2%
M ≥500	每笔1000元

注：上表中，M为投资者申购金额。

D类基金份额申购费率如下：

申购金额（万元）	D类基金份额申购费率
M ＜500	0.5%

M ≥500	每笔 1200 元

注：上表中，M 为投资者申购金额。

（2）赎回费率

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

持有期（计为 T）	A 类基金份额	C 类基金份额	D 类基金份额
T＜7 天	1.50%	1.50%	1.50%
7 天≤T＜30 天	0.50%	0.50%	0.00%
30 天≤T＜1 年	0.10%	0.00%	0.00%
T≥1 年	0.00%	0.00%	0.00%

本基金的赎回费用由赎回基金份额的该类基金份额持有人承担，不低于赎回费总额 25%的部分归基金财产所有，其余部分用于支付注册登记费和其他必要的手续费。其中对于持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产。

基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率和赎回费率。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施 2 日前在规定媒介上刊登公告。

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

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

3、申购份额的计算方法如下：

（1）本基金 A 类、D 类基金份额的申购金额包括申购费用和净申购金额，申购的有效份额为净申购金额除以申购当日该类基金份额的基金份额净值，有效份额单位为份，计算公式如下：

申购费用采用比例费率时：

净申购金额＝申购金额/[1+对应份额类别的申购费率]

申购费用＝申购金额-净申购金额

申购份额＝净申购金额/申购当日该类基金份额净值

申购费用采用固定金额时：

申购费用=固定金额

净申购金额=申购金额-申购费用

申购份额=净申购金额/申购当日该类基金份额的基金份额净值

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

例：假定某投资人申购本基金 A 类基金份额 10,000 元，T 日本基金 A 类基金份额的基金份额净值为 1.1000 元。该笔申购的申购费用及获得的申购份额计算如下：

净申购金额＝10,000/[1+0.60%]＝9,940.35 元

申购费用＝10,000-9,940.35＝59.65 元

申购份额＝9,940.35/1.1000＝9036.68 份

即：投资者投资 10,000 元申购本基金 A 类基金份额，假设申购当日基金 A 类基金份额净值为 1.1000 元，则其可得到 9036.68 份 A 类基金份额。

（2）本基金 C 类基金份额不收取申购费，其申购份额的计算公式如下：

申购份额=申购金额/申购当日 C 类基金份额的基金份额净值

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

例：某投资者投资 100,000 元申购本基金 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.0500 元，则可得到的申购份额为：

申购份额 =100,000/1.0500 =95,238.09 份

即：投资者投资 100,000 元申购本基金 C 类基金份额，假设申购当日基金 C 类基金份额净值为 1.0500 元，则其可得到 95,238.09 份 C 类基金份额。

4、赎回金额的计算

投资人赎回本基金的金额为赎回总额扣减赎回费用。其中：

赎回总额＝赎回份数×T 日各类基金份额净值

赎回费用＝赎回总额×赎回费率

赎回金额＝赎回总额－赎回费用

上述计算结果均按截尾法，保留到小数点后两位。由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

（1）A 类基金份额赎回举例：

假定某投资人在 T 日赎回其持有的 A 类基金份额 10,000 份，持有时间为 20 天，对应

的赎回费率为 0.50%，假设赎回当日 A 类基金份额净值为 1.1000 元，则投资人获得的赎回金额计算如下：

赎回总额＝10,000×1.1000＝11,000.00 元

赎回费用＝11,000.00×0.50%＝55.00 元

赎回金额＝11,000.00-55.00＝10945.00 元

即：该投资者赎回本基金 10,000 份 A 类基金份额，持有时间为 20 天，假设赎回当日 A 类基金份额净值为 1.1000 元，则其可得到的赎回金额为 10945.00 元。

（2）C 类基金份额赎回举例：

某投资者赎回本基金 10,000 份 C 类基金份额，持有时间为 60 天，对应的赎回费率为 0%，假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.0800 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总金额=10,000×1.0800 =10,800.00 元

赎回费用=10,800.00×0% =0.00 元

净赎回金额=10,800.00-0.00 =10,800.00 元

即：投资者赎回本基金 10,000 份 C 类基金份额，持有时间为 60 天，假设赎回当日 C 类基金份额净值是 1.0800 元，则其可得到的赎回金额为 10,800.00 元。

5、基金份额净值的计算公式

本基金各类基金份额分别设置代码，分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。T 日的各类基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

（六）申购与赎回的注册登记

1、经基金销售机构同意，基金投资人提出的申购和赎回申请，在基金管理人规定的时间之前可以撤销。

2、投资人申购基金成功后，基金注册登记人在 T＋1 日为投资人增加权益并办理注册登记手续，投资人自 T＋2 日起有权赎回该部分基金份额。

3、投资人赎回基金成功后，基金注册登记人在 T＋1 日为投资人扣除权益并办理相应的注册登记手续。

4、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前 3 日予以公告。

（七）巨额赎回的认定及处理方式

1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内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)超过前一开放日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，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延期赎回。

（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资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开放日基金总份额 10%的前提下，可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；对于未能赎回部分，投资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，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的某一类别基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

（3）暂停赎回：连续 2 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，并应当在规定媒介上进行公告。

（4）当基金发生巨额赎回，在单个持有人的赎回申请超过上一开放日基金总份额 25%的赎回申请的情形下，基金管理人应当延期办理赎回申请。基金管理人在当日接受该基金份额持有人的全部赎回的比例不低于上一开放日基金总份额 25%的前提下，对该持有人其余赎回申请进行延期办理，当日未获受理的赎回申请将与下一开放日的赎回申请一并处理，直到全部赎回为止。如该持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

3、巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在 2 日内在规定媒介上刊登公告。

（八）拒绝或暂停接受申购、暂停赎回的情形及处理

1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

（1）因不可抗力导致基金无法正常运作。

（2）发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接收投资人的申购申请。

（3）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。

（4）基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

（5）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，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。

（6）基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形时。

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

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

（9）法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第（1）、（2）、（3）、（5）、（7）、（9）项暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

2、在以下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请：

（1）因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

（2）发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接收投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。

（3）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。

（4）连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

（5）当特定资产占前一估值日基金资产净值50%以上时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金申购赎回申请的措施。

（6）法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在在规定期限内在规定媒介上刊登公告。已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将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，未支付部分可延期支付。若出现上述（4）项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人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。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公告。

3、暂停基金的申购、赎回，基金管理人应在规定期限内在规定媒介上刊登暂停公告。

4、暂停申购或赎回期间结束，基金重新开放时，基金管理人应依法公告并报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

（1）如果发生暂停的时间为一天，基金管理人将于重新开放日，在至少一种规定媒介，刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公告最近一个开放日的各类基金份额净值。

（2）如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人将提前两日，在至少一种规定媒介，刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的各类基金份额净值。

（3）如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前两日，在至少一种规定媒介连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的各类基金份额净值。

（九）基金的转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理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，相关规则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，并提前告知基金托管人与相关机构。

（十）基金的非交易过户与转托管

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

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基金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按基金登记机构的规定办理，并按基金登记机构规定的标准收费。

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

（十一）基金份额的冻结、解冻及质押

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

（十二）定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

（十三）实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回

本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见本招募说明书“侧袋机制”部分的规定或相关公告。

九、基金的投资

（一）投资目标

通过对宏观经济、资本市场运行趋势的前瞻性研判，预测未来利率水平及其变化趋势，力求准确把握固定收益类、权益类资产的投资机会，在严格控制投资风险的前提下，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。

（二）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，主要投资于国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债（含分离交易可转债）、资产支持证券、短期融资券、回购、中小企业私募债券、货币市场工具等固定收益类证券品种、国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

本基金对固定收益类证券品种的投资比例不低于基金资产的 80%;对股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，权证投资的比例范围占基金资产净值的 0～3%。为维持投资组合的流动性，本基金持有现金和到期日不超过一年的政府债券不低于基金资产净值的 5%。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

（三）投资策略

（1）大类资产配置策略

本基金将综合考虑国内外政治经济环境、政策形势、宏观经济与资本市场运行状况、固定收益类与权益类资产风险收益特征，定性分析与定量分析并用，灵活确定大类资产配置比例，并将在实际运作中根据证券市场走势以及本基金业绩表现不断对大类资产配置比例进行调整，以期优化大类资产配置，力争获取超额投资收益。

（2）债券类资产配置策略

1）债券类资产的期限配置

本基金根据宏观经济走势、CPI 与利率变化、央行货币政策等因素，通过审慎分析与测算，确定投资组合的加权平均久期。当预期利率下降时，适当提升久期，以分享债券的上涨收益；当预期利率上升时，适当降低久期，以规避债券的下跌风险。

在确定了债券类、货币类资产的配置比例与大致的期限结构之后，根据债券类资产的加权平均久期之目标区间，确定久期为 1 年以下、1～3 年、3～5 年、5 年以上的债券品种之市值占本基金债券总市值的相对比例。

2）债券类资产的类属配置

本基金通过分析宏观经济走势、利率的变动趋势、各类债券的收益率水平与流动性、基金申购与赎回的情况以及股票市场的运行状况，确定国债、央票、金融债、信用债等大类债券市值占基金债券类资产总市值的相对比例。

3）债券品种选择

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

A、国债与央票

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

B、金融债

在内部评级的基础上，本基金将根据未来宏观经济走势、未来利率的变化趋势、金融债各品种的到期收益率、换手率、外部评级、本基金投资组合的加权平均久期之目标范围等因素，审慎遴选具有比较优势的金融债品种。

C、普通信用债券

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

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

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

D、可转换公司债券

对于可转换公司债券（包括分离交易可转债），本基金在对债转股条款、发债公司基本面进行深入分析的基础上，利用到期收益率来判别可转债的纯债价值，选择纯债价值被低估的可转债以提升本金投资的安全性；通过对发债公司未来经营业绩的预测、股票估值模型、未来宏观经济走势以及股票市场运行趋势，来判别可转债的期权价值，优先选择期权价值被低估的可转债。

E、资产支持证券

通过分析资产支持证券之支持资产的构成及质量，本基金将审慎对其支持资产的违约风险、发行条款、提前偿付风险、市场利率等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并考虑资产支持证券的风险溢价水平与流动性因素，评估资产支持证券的投资价值并做出相应的投资决策。

4）债券交易策略

在债券配置策略外，本基金亦将根据宏观经济运行状况、证券市场走势、CPI 与未来利率的变化趋势，灵活选择恰当的交易策略，在严格控制风险、保持投资组合流动性的前提下，以争取更大的投资回报。本基金的交易策略包括但不限于：

A、跨市场套利策略

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

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

施跨市场套利策略，积极把握市场当中出现的套利机会。

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

B、跨品种套利策略

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

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

C、跨期限套利策略

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

D、回购策略

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

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

E、一级市场参与策略

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

（3）股票资产的配置策略

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

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

1）风格追踪

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

2）个股选择

本基金将审慎甄别公司的核心价值，从公司治理、公司战略、行业地位等方面审视公司核心竞争力，以基本面分析为核心，力求挖掘出具有核心竞争力的稳健经营、价值低估型公司。

本基金在对公司成长性的客观评价和比较上基础上，努力发掘可持续、可预见的成长型公司。本基金综合若干企业评价指标，对个股的基本面情况与投资价值进行综合评价，重点关注利润增长率等指标，力求成长具有可持续性。

（4）存托凭证投资策略

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

（5）权证投资策略

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

本基金将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上，结合股价波动率等参数，运用数量化期权定价模型，确定其合理内在价值；继而构建套利交易、避险交易组合以及投资价值显著低估的权证品种。

（6）其他创新或者衍生产品的投资策略

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

（四）业绩比较基准

本基金业绩比较基准：中证可转换债券指数收益率*75%+沪深300指数收益率*20%+一年期定期存款基准利率*5%

1、业绩比较基准设定的原因

（1）基于基金投资范围以及预期投资的主要资产类别（债券、A股股票及现金类资产等），本基金相应选取与之匹配的债券指数、A股指数与一年期定期存款基准利率作为基准要素。同时基于本基金对固定收益类证券品种的投资比例不低于基金资产的80%，对股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）等权益类资产的投资比例不超过基金资产的20%，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%等投资比例限制，以及预期的资产配置比例中枢，本基金将债券资产、A股股票资产及现金类资产所对应的基准要素权重分别设置为75%、20%与5%。

（2）基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的债券资产主要通过期限配置、类属配置、债券品种选择、交易策略选择四个层次进行投资管理，在严格控制投资风险的前提下，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。综合考虑基准指数与产品定位和投资风格的匹配度，同时兼顾考虑基准指数的表征性、认可度，以及基准指数券种、久期、信用等级分布特征等，本基金选取中证可转换债券指数作为债券部分的业绩比较基准要素。

中证可转换债券指数的样本由在沪深证券交易所上市的可转换债券组成，以反映国内市场可转换债券的总体表现，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准要素。

（3）基于基金投资目标、投资范围和投资策略，本基金的股票投资部分将遵循稳健和灵活兼顾的投资思路，通过把握股票市场出现的趋势性或结构性投资机会，努力获取超额收益。综合考虑基准指数与产品定位和投资风格的匹配度，基准指数的表征性、认可度，以及指数市值覆盖、风格特征、行业与个股分布等，本基金选取沪深300指数作为A股股票的业绩比较基准要素。

沪深300指数由沪深A股中规模大、流动性好的最具代表性的300只股票组成，该指数样本对沪深市场的覆盖度高，能够综合反映沪深A股市场整体表现，具有良好的市场代表性和

市场影响力，适合作为本基金A股部分的业绩比较基准。

（3）本基金持有现金和到期日不超过一年的政府债券不低于基金资产净值的5%，综合考虑基准指数与产品定位和投资风格的匹配度，选取一年期定期存款基准利率作为本基金现金类资产的业绩比较基准要素。

综上，本基金选取的业绩比较基准与基金投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制相匹配。

2、业绩比较基准要素的基本信息

中证可转换债券指数由中证指数有限公司编制发布，指数代码为000832，具体信息详见中证指数有限公司网站，网址：www.csindex.com.cn。

沪深300指数由中证指数有限公司编制发布，指数代码为000300，具体信息详见中证指数有限公司网站，网址：www.csindex.com.cn。

一年期定期存款基准利率由中国人民银行发布，具体信息详见中国人民银行网站，网址：www.pbc.gov.cn。

3、业绩比较基准收益率的计算方法

本基金业绩比较基准收益率的计算方法以每日收益率为基础，以时间加权为计算原则。本基金先分别计算中证可转换债券指数、沪深300指数及一年期定期存款基准利率的每日收益率，再按照预设权重比例计算当日组合要素基准的日收益率，最后通过每日连乘的方式计算业绩比较基准收益率。

4、管理投资偏离业绩比较基准的定性或定量方法

本基金管理人对基金实际投资与业绩比较基准的偏离情况进行动态跟踪与监测评估，监测指标主要包括超额收益、配置偏离等，以更好管理基金实际投资与业绩比较基准的偏离情况，从而在控制风险的基础上追求超越业绩比较基准的投资回报。

本基金为主动管理型基金，其业绩比较基准是表征产品风格、衡量产品业绩、约束投资行为的参考标准，并非本基金的跟踪标的。基金管理人在基金合同约定的投资范围、投资限制内享有充分的投资决策自主权，可根据投资策略、市场研判等综合因素，自主构建投资组合，包括酌情投资于业绩比较基准要素成份证券外的证券。本基金投资组合相对业绩比较基准要素成份证券和权重可能存在偏离。

5、未来可能变更业绩比较基准的情况和程序

业绩比较基准变更符合下列条件之一且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，

基金管理人应当与基金托管人协商，在新业绩比较基准生效前三十日公告并充分说明变更原因、差异及影响，无需召开基金份额持有人大会：

（1）原有业绩比较基准的要素无法持续运作、编制方案发生重大修订等客观因素导致业绩比较基准无法再表征基金产品投资风格，或不再符合基金合同关于投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制等的约定，或与主要的资产类别、国别或地区、市场板块、货币类型等不再匹配；或业绩比较基准的要素不再具备市场代表性；

（2）调整业绩比较基准的要素权重、更换相同或相近特征的要素等，使新业绩比较基准代表性更强，且符合相关法律法规规定的；

（3）中国证监会认可的其他情形。

业绩比较基准变更涉及以下情形的，基金管理人应当按照规定履行变更注册、召开基金份额持有人大会等程序，法律法规、中国证监会另有规定的除外：

（1）基金投资目标、投资范围、投资策略、投资比例等拟进行重大调整，并变更业绩比较基准的；

（2）其他对基金份额持有人利益产生重大实质性影响的情形。

（五）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。

（六）投资决策依据及程序

1、投资决策依据

（1）有关法律、法规和基金合同的有关规定。

（2）经济运行状况和证券市场走势。

（3）各类资产的风险收益配比。

2、投资决策程序

（1）投资决策委员会：确定本基金总体资产分配和投资策略。投资决策委员会定期召开会议，如需做出及时重大决策或基金经理提议，可临时召开投资决策委员会会议。

（2）基金经理：设计和调整投资组合。设计和调整投资组合需要考虑的基本因素包括：每日基金申购和赎回净现金流量；基金合同的投资限制和比例限制；研究员的投资建议；基金经理的独立判断等。

（3）集中交易部：基金经理向集中交易部下达投资指令，集中交易部负责人收到投资

指令后分发予交易员，交易员收到基金投资指令后准确执行。

（4）绩效与风险评估：对基金投资组合进行评估，向基金经理提出绩效或风险建议。

（5）合规风控部：对投资流程等进行合法合规审核、监督和检查。

（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）违反规定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，但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外；

（5）向基金管理人、基金托管人出资；

（6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（7）依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

2、基金投资组合比例限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

（1）本基金对固定收益类证券品种的投资比例不低于基金资产的 80%；对股票、权证等其它金融工具的投资比例不超过基金资产的 20%；

（2）保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（3）本基金持有一家上市公司的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

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

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

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

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

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

（8）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

（9）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

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

（11）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%；

（12）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%；

（13）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%；

（14）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%；

（15）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%；

（16）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；

（17）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；

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

（19）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%；

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

（21）基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，除上述第（2）、（7）、（16）、（21）条规定的情形外，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

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

（八）基金管理人代表基金行使股东权利处理原则和方法

1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

2、有利于基金财产的安全与增值；

3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；

4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

（九）侧袋机制的实施和投资运作安排

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

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

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

（十）基金投资组合报告（未经审计）

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

本基金的托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同的规定，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 2026 年 6 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

1、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	585,344,407.46	16.16
	其中：股票	585,344,407.46	16.16
2	固定收益投资	2,757,260,632.16	76.13
	其中：债券	2,757,260,632.16	76.13
	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	-	-
	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	246,647,245.37	6.81
7	其他各项资产	32,347,307.89	0.89
8	合计	3,621,599,592.88	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、待摊费用。

2、 报告期末按行业分类的股票投资组合

（1）报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-

C	制造业	382,611,335.18	12.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,258,120.00	0.21
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	121,994,952.28	4.11
J	金融业	-	-
K	房地产业	74,480,000.00	2.51
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	585,344,407.46	19.74

（2）报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688256	寒武纪	48,000	76,586,400.00	2.58
2	600246	万通发展	3,920,000	74,480,000.00	2.51

3	688041	海光信息	186,000	68,875,800.00	2.32
4	688981	中芯国际	412,000	65,433,840.00	2.21
5	688008	澜起科技	190,000	58,881,000.00	1.99
6	603986	兆易创新	56,061	45,689,715.00	1.54
7	688521	芯原股份	118,000	43,794,520.00	1.48
8	300576	容大感光	773,719	39,629,887.18	1.34
9	002364	中恒电气	480,000	25,824,000.00	0.87
10	300308	中际旭创	20,000	25,400,000.00	0.86

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	305,401,001.76	10.30
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,451,859,630.40	82.67
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,757,260,632.16	92.97

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	019792	25 国债 19	3,022,000.00	305,401,001.76	10.30
2	113043	财通转债	1,380,900.00	179,768,777.80	6.06
3	113677	华懋转债	375,590.00	145,742,297.18	4.91
4	113697	应流转债	502,260.00	133,075,025.45	4.49
5	113699	金 25 转债	670,760.00	110,005,264.82	3.71

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。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（1）本期国债期货投资政策

无

（2）报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

11、投资组合报告附注

（1）基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

（2）本基金报告期内基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

（3）其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,222,006.45
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	31,125,301.44

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,347,307.89

（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	113043	财通转债	179,768,777.80	6.06
2	113677	华懋转债	145,742,297.18	4.91
3	113697	应流转债	133,075,025.45	4.49
4	113699	金 25 转债	110,005,264.82	3.71
5	118058	微导转债	102,942,512.52	3.47
6	118050	航宇转债	97,419,226.42	3.28
7	127070	大中转债	95,130,497.62	3.21
8	111000	起帆转债	87,941,498.14	2.97
9	123176	精测转 2	85,305,209.44	2.88
10	127092	运机转债	75,491,920.79	2.55
11	123247	万凯转债	73,584,186.11	2.48
12	118059	颀中转债	67,720,088.99	2.28
13	113667	春 23 转债	66,297,493.22	2.24
14	118060	瑞可转债	64,426,409.30	2.17
15	123263	鼎捷转债	64,223,568.15	2.17
16	123258	胜蓝转 02	62,096,259.40	2.09
17	123253	永贵转债	60,592,148.72	2.04
18	123259	锦浪转 02	55,913,794.60	1.89
19	123237	佳禾转债	52,428,932.67	1.77
20	118051	皓元转债	48,861,022.37	1.65
21	127104	姚记转债	46,531,356.16	1.57
22	118013	道通转债	42,492,700.80	1.43
23	127049	希望转 2	41,380,833.74	1.40
24	123213	天源转债	40,735,308.49	1.37
25	123131	奥飞转债	39,977,023.84	1.35
26	123241	欧通转债	38,924,598.23	1.31
27	113661	福 22 转债	38,415,651.32	1.30
28	123251	华医转债	38,131,789.01	1.29
29	123211	阳谷转债	33,588,055.55	1.13
30	118053	正帆转债	30,641,028.45	1.03

31	123261	普联转债	30,420,614.07	1.03
32	118062	天准转债	29,959,978.88	1.01
33	127084	柳工转 2	29,820,430.52	1.01
34	113691	和邦转债	22,695,934.25	0.77
35	127079	华亚转债	22,664,208.07	0.76
36	127088	赫达转债	20,488,415.38	0.69
37	118035	国力转债	18,429,475.08	0.62
38	111018	华康转债	18,291,625.86	0.62
39	123158	宙邦转债	9,643,084.95	0.33
40	123257	安克转债	4,338,050.04	0.15
41	113632	鹤 21 转债	4,110,348.49	0.14
42	118011	银微转债	3,993,563.29	0.13
43	113066	平煤转债	2,877,711.41	0.10
44	118036	力合转债	230,476.47	0.01

（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

（6）投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十、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。

（一） 业绩比较

基金合同生效日为 2017 年 9 月 20 日，基金合同生效以来（截至 2026 年 6 月 30 日）的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示：

金鹰元丰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

金鹰元丰债券A：

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
2018.1.1-2018.12.31	-2.47%	0.33%	1.51%	0.14%	-3.98%	0.19%
2019.1.1-2019.12.31	17.43%	0.48%	4.53%	0.12%	12.90%	0.36%
2020.1.1-2020.12.31	30.59%	1.28%	2.62%	0.14%	27.97%	1.14%
2021.1.1-2021.12.31	34.21%	1.16%	1.50%	0.13%	32.71%	1.03%
2022.1.1-2022.12.31	-21.87%	1.49%	-1.78%	0.13%	-20.09%	1.36%
2023.1.1-2023.12.31	-10.78%	0.86%	0.71%	0.09%	-11.49%	0.77%
2024.1.1-2024.12.31	-3.16%	1.23%	6.13%	0.13%	-9.29%	1.10%
2025.1.1-2025.12.31	32.44%	1.56%	0.30%	0.10%	32.14%	1.46%
2026.1.1-2026.6.30	20.75%	2.10%	1.62%	0.12%	19.13%	1.98%
2017.9.20-2026.6.30	114.61%	1.19%	17.73%	0.12%	96.88%	1.07%

金鹰元丰债券C：

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
2022.1.1-2022.12.31	22.42%	1.50%	-1.78%	0.13%	-20.64%	1.37%
2023.1.1-2023.12.31	-11.12%	0.86%	0.71%	0.09%	-11.83%	0.77%
2024.1.1-2024.12.31	-3.57%	1.23%	6.13%	0.13%	-9.70%	1.10%
2025.1.1-2025.12.31	31.93%	1.56%	0.30%	0.10%	31.63%	1.46%
2026.1.1-2026.6.30	20.50%	2.10%	1.62%	0.12%	18.88%	1.98%
2021.11.26-2026.6.30	6.14%	1.41%	7.54%	0.11%	-1.40%	1.30%

金鹰元丰债券D：

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
2025.1.1-2025.12.31	32.46%	1.56%	0.30%	0.10%	32.16%	1.46%
2026.1.1-2026.6.30	20.75%	2.10%	1.62%	0.12%	19.13%	1.98%
2024.11.8-2026.6.30	56.74%	1.71%	3.30%	0.11%	53.44%	1.60%

注：自 2026 年 7 月 27 日起，本基金业绩比较基准由“中国债券综合指数(全价)*90%+沪深 300 指数*10%”调整为“中证可转换债券指数收益率*75%+沪深 300 指数收益率*20%+一年期定期存款基准利率*5%”。基金业绩比较基准收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。

历任基金经理变动如下：

基金经理	任职日期	离任日期
刘丽娟女士	2017-09-20	2018-03-20
汪伟先生	2017-09-21	2019-03-14
吴德瑄先生	2017-09-30	2019-03-19
林龙军先生	2018-05-17	-
吴海峰先生	2026-11-03	-

（二）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

金鹰元丰债券型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017 年 9 月 20 日至 2026 年 6 月 30 日)

金鹰元丰债券 A：



金鹰元丰债券 C：



金鹰元丰债券 D：



注：1、本基金由原金鹰元丰保本混合型证券投资基金于 2017 年 9 月 20 日转型而来；

2、本基金自 2021 年 11 月 26 日起增设 C 类基金份额，自 2024 年 11 月 8 日起增设 D 类基金份额；

3、自 2026 年 7 月 27 日起，本基金业绩比较基准由“中国债券综合指数(全价)*90%+沪深 300 指数*10%”调整为“中证可转换债券指数收益率*75%+沪深 300 指数收益率*20%+一年期定期存款基准利率*5%”。基金业绩比较基准收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。

十一、基金的财产

（一）基金资产总值

基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

其构成主要有：

1、银行存款及其应计利息；

2、结算备付金及其应计利息；

3、根据有关规定缴纳的保证金及其应收利息；

4、应收证券交易清算款；

5、应收申购款；

6、股票投资及其估值调整；

7、债券投资及其估值调整和应计利息；

8、权证投资及其估值调整；

9、其他投资及其估值调整；

10、其他资产等。

（二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

（三）基金财产的账户

本基金以基金托管人的名义开立资金结算账户和托管专户用于基金的资金结算业务，并以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户、以本基金的名义开立银行间债券托管账户并报中国人民银行备案。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金代销机构和基金注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

（四）基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金代销机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产；基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或其他情形而取得的财产和收益，归入基金财产。基金管理人、基金托管人、基金注册登记机构和基金代销机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。

基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵消；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵消。

十二、基金资产的估值

（一）估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的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。

（二）估值对象

基金所拥有的股票、债券、权证和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产和负债。

（三）估值方法

本基金按以下方式进行估值：

1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票等），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或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，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或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，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）交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种（另有规定的除外），选取估值日第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值全价进行估值。

（3）交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值；对于含投资者回售权的固定受益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价，同时充分考虑发行人的信用风险变化对公允价值的影响。回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的，按照长待偿期所对应的价格进行估值。

（4）交易所市场上市交易的可转换债券，实行全价交易的选取估值日收盘价作为估值全价；实行净价交易的选取估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价。

（5）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。

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估值方法估值；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和债券，采用估值技术确定公允价值；

（3）在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

（4）对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。

3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值全价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价估值。对银行间市场上含投资者回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间按照第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价估值，同时充分考虑发行人的信用风险变化对公允价值的影响。回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值基准服务机构未提供估值价格的债券，采用估值技术确定公允价值。

4、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

5、本基金投资存托凭证的估值核算依照境内上市交易的股票执行。

6、如有充分理由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方法估值。

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，按照基金管理人对基金份额净值的计算结果对外予以公布。

（四）估值程序

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

每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额净值，并按规定公告。

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

（五）估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当任一类基金份额净值小数点后 4 位以内(含第 4 位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1、估值错误类型

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

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。

2、估值错误处理原则

（1)估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。

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

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

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

（2）错误偏差达到某类基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到某类基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告。

（3）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

（六）暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值；

4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

（七）基金净值的确认

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

（八）实施侧袋机制期间的基金资产估值

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

十三、基金的收益与分配

（一）基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

（二）基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

（三）基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

2、本基金收益分配方式：

基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；投资者可以在不同销售机构对本基金设置为相同的分红方式，亦可设置为不同的分红方式，即同一基金账户对本基金在各销售机构设置的分红方式相互独立、互不影响。

3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

4、由于本基金 A 类、D 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截至收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、

分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

（五）收益分配方案的确定、公告与实施

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

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。

（六）基金收益分配中发生的费用

当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为相应类别的基金份额：

现金红利转基金份额视同申购，但不收取申购费。

在（1）、（2）两种情形下，红利再投资的计算方法，均依照《业务规则》执行。

（七）实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配。

十四、基金的费用和税收

（一）基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、C 类基金份额的销售服务费；

4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；

6、基金份额持有人大会费用；

7、基金的证券交易费用；

8、基金的银行汇划费用；

9、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。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.75%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.75%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

2、基金托管人的托管费

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

H＝E×0.2%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

3、销售服务费

本基金A类基金份额、D类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额收取销售服务费。

本基金的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40%的年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

H＝E×0.40%÷当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代收后支付给销售机构。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第 4－8 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、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；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、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。

（四）实施侧袋机制期间的基金费用

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

（五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十五、基金的会计与审计

（一）基金会计政策

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；

2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于 2 个月，可以并入下一个会计年度；

3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；

4、会计制度执行国家有关会计制度；

5、本基金独立建账、独立核算；

6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；

7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

（二）基金年度审计

1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。

2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。

3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介及基金管理人网址公告。

十六、基金的信息披露

（一）披露依据

本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。

（二）信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点，按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊（以下简称“规定报刊”）及《信息披露办法》规定的互联网网站（以下简称“规定网站”）等媒介披露，并保证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）禁止行为

本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；

2、对证券投资业绩进行预测；

3、违规承诺收益或者承担损失；

4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；

5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；

6、中国证监会禁止的其他行为。

（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不同文本的内容一致。不同文本发生歧义的，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、基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

（1）《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

（2）基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在规定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

（3）基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

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

2、基金份额发售公告

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

3、《基金合同》生效公告

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

4、基金净值信息

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在规定网站披露一次各类基金份额的基金份额净值和各类基金份额累计净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点，披露开放日的各类基金份额的基金份额净值

和各类基金份额累计净值。

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

5、基金份额申购、赎回价格

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

6、基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，并将年度报告登载在规定网站上，将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。

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

基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在规定网站上，将季度报告提示性公告登载在规定报刊上。

《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

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

报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20%的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在在基金定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

7、临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，并登载在规定报刊和规定网站上。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：

（1）基金份额持有人大会的召开及决定的事项；

（2）《基金合同》终止、基金清算；

（3）转换基金运作方式、基金合并；

（4）更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；

（5）基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；

（6）基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；

（7）基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；

（8）基金募集期延长或提前结束募集；

（9）基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；

（10）基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；

（11）涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；

（12）基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；

（13）基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，中国证监会另有规定的情形除外；

（14）基金收益分配事项；

（15）管理费、托管费、申购费、赎回费、销售服务费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

（16）基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；

（17）本基金开始办理申购、赎回；

（18）本基金发生巨额赎回并延期办理；

（19）本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

（20）本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

（21）基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

基金管理人应在本基金投资中小企业私募债券后两日内，在中国证监会规定媒介披露所

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、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露中小企业私募债券的投资情况。

8、澄清公告

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

9、清算报告

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

10、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，应当依法报中国证券监督管理委员会备案，并予以公告。

11、投资存托凭证的信息披露

本基金投资存托凭证的信息披露依照境内上市交易的股票执行。

12、实施侧袋机制期间的信息披露

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

13、中国证监会规定的其他信息。

（六）暂停或延迟信息披露的情形

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、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值的；

5、法律法规规定、中国证监会或《基金合同》认定的其他情形。

（七）信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专门部门及高级管理人

员负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则等法规的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

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

基金管理人、基金托管人除依法在规定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于规定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并在《基金合同》终止后将相关档案保存不少于法律法规规定的最低年限。

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

（八）信息披露文件的存放与查阅

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

（九）本基金信息披露事项以法律法规规定及《基金合同》约定的内容为准。

十七、侧袋机制

（一）侧袋机制的实施条件、实施程序

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

基金管理人应当在启用侧袋机制后及时发布临时公告，并及时聘请符合《证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

（二）侧袋机制实施期间的基金运作安排

1、基金份额的申购与赎回

（1）启用侧袋机制当日，登记机构以基金份额持有人的原有账户份额为基础，确认基金份额持有人的相应侧袋账户份额；当日收到的申购申请，按照启用侧袋机制后的主袋账户份额办理；当日收到的赎回申请，仅办理主袋账户份额的赎回申请并支付赎回款项。

（2）侧袋机制实施期间，基金管理人不办理侧袋账户份额的申购、赎回和转换；同时，基金管理人按照基金合同和招募说明书的约定办理主袋账户份额的赎回，并根据主袋账户运作情况确定是否暂停申购。本招募说明书“基金份额的申购与赎回”部分的申购、赎回规定适用于主袋账户份额。

（3）基金管理人应按照主袋账户的份额净值办理主袋账户份额的申购和赎回。巨额赎回按照单个开放日内主袋账户份额净赎回申请超过前一工作日主袋账户总份额的10%认定。

2、基金的投资

侧袋机制实施期间，本招募说明书“基金的投资”部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标应当以主袋账户资产为基准。

基金管理人原则上应当在侧袋机制启用后 20 个交易日内完成对主袋账户投资组合的调整，但因资产流动性受限等中国证监会规定的情形除外。

基金管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操作。

3、基金的费用

侧袋机制实施期间，有关费用可酌情收取或减免，侧袋账户资产不收取管理费。与侧袋账户有关的费用从侧袋账户资产中列支，但应待特定资产变现后方可列支。

4、基金的收益分配

侧袋机制实施期间，在主袋账户份额满足基金合同收益分配条件的情形下，基金管理人可对主袋账户份额进行收益分配。侧袋账户不进行收益分配。

5、基金的信息披露

（1）基金净值信息

基金管理人应按照招募说明书“基金的信息披露”部分规定的披露方式和频率披露主袋账户的基金资产净值和份额净值。侧袋机制实施期间，基金管理人暂停披露侧袋账户份额净值。

（2）定期报告

侧袋机制实施期间，基金管理人应当在基金定期报告中披露报告期内特定资产处置进展情况，披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，需同时注明不作为基金管理人对特定资产最终变现价格的承诺。

（3）临时报告

基金管理人在启用侧袋机制、处置特定资产、终止侧袋机制以及发生其他可能对投资者利益产生重大影响的事项后应及时发布临时公告。

6、基金份额持有人大会的特殊约定

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

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

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

（3）通讯开会的直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

（4）在参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在

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

（5）现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人；

（6）一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过；

（7）特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。

同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。

7、特定资产处置清算

特定资产以可出售、可转让、恢复交易等方式恢复流动性后，基金管理人应当按照基金份额持有人利益最大化原则，采取将特定资产予以处置变现等方式，及时向侧袋账户份额持有人支付对应款项。

侧袋机制实施期间，无论侧袋账户资产是否全部完成变现，基金管理人都应当及时向侧袋账户全部份额持有人支付已变现部分对应的款项。若侧袋账户资产无法一次性完成处置变现，基金管理人在每次处置变现后均应按照相关法律法规要求及时发布临时公告。

8、侧袋的审计

基金管理人应当在启用侧袋机制和终止侧袋机制后，及时聘请符合《证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

（三）本部分关于侧袋机制的相关规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，或将来法律法规或监管规则针对侧袋机制的内容有进一步规定的，基金管理人经与基金托管人协商一致并履行适当程序后，在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

十八、风险揭示

（一）风险提示

基金主要投资于证券市场，而证券市场价格因受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而产生波动，从而导致基金收益水平发生变化，产生风险。

（二）证券市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生风险，主要包括：

1、政策风险

因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、产业政策、地区发展政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

2、经济周期风险

随着经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资的收益水平也会随之变化，从而产生风险。

3、利率风险

金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资的收益水平会受到利率变化的影响，从而产生风险。例如在利率上升时，基金持有的债券类资产价格将会下降，若基金组合加权平均久期过长，则将给基金资产带来较大的损失。

4、通货膨胀风险

通货膨胀风险也称购买力风险。基金持有人的收益将主要通过现金形式来分配，如果发生通货膨胀，现金的购买力会下降，从而影响基金的实际收益。

5、上市公司经营风险

上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但也不能完全规避。

6、债券收益率曲线变动的风险

债券收益率曲线变动风险是指与收益率曲线非平行移动相关的风险。由于不同期限债券的收益率变动程度不同，各期限债券的价格变动也会不同；基金组合单一的加权平均久期指标将不能充分反映这一债券收益率曲线非平行移动带来的风险。

7、再投资风险

再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响，这与利率上升所带来的价格风险（即利率风险）互为消长。具体为当利率下降时，基金从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时，将获得比以前较少的收益率。

8、信用风险

主要指债券、资产支持证券、票据等发行主体信用状况恶化，到期不能履行合约进行兑付；以及债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用资质降低导致债券价格下降的风险；信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险，以及上市公司信息披露不真实、不完整，而导致基金资产损失和收益变化的风险。

9、资产支持证券的提前偿付风险

基金投资资产支持证券品种时，证券化的信托财产中债务人提前还款会造成信托财产的现金流量失衡，从而与设计的现金流量规划不同，影响基金投资的资产支持证券的收益。除受债务人自身的财务状况影响外，市场利率的变化，其他融资成本的变化等因素都将影响债务人提前还款。由于影响因素多且不确定，因此债务人提前还款的时间和数量都很难准确预计。

10、股价波动风险

由于本基金可投资于权益类资产（含新股申购），本基金所投资的权益类资产在持有期内价格的波动将会对基金收益率产生影响；本基金进行新股申购时，由于资金的占用、中签率和首日开盘价的不确定性，以及某些申购成功的新股因锁定期而在一段时间内丧失流动性而带来的风险，也将会对基金资产的收益造成影响；另外基金投资的衍生品资产（包括含权债券），其内在价值也会因标的资产价格的波动以及距离到期的时间而变化，进而给基金组合的收益带来影响。

11、债券回购风险

债券回购为提升整体基金组合收益提供了可能，但也存在一定的风险。债券回购的主要风险包括信用风险、投资风险及波动性加大的风险，其中，信用风险指回购交易中交易对手

在回购到期时，不能偿还全部或部分证券或价款，造成基金净值损失的风险；投资风险是指在进行正回购操作时，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。

（三）管理风险

基金运作过程中由于基金投资策略、人为因素、管理系统设置不当造成操作失误或公司内部失控而可能产生的损失。管理风险包括：

1、决策风险

决策风险指基金投资的投资策略制定、投资决策执行和投资绩效监督检查过程中，由于决策失误而给基金资产造成的可能的损失；

2、操作风险

操作风险指基金投资决策执行中，由于投资指令不明晰、交易操作失误等人为因素而可能导致的损失；

3、技术风险

技术风险是指公司管理信息系统设置不当等因素而可能造成的损失。

（四）职业道德风险

职业道德风险是指公司员工不遵守职业操守，发生违法、违规行为而可能导致的损失。

（五）流动性风险

因市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地转变为现金的风险。同时在基金运作过程中，可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响基金份额净值。

启用侧袋机制对投资者的影响：

侧袋机制是一种流动性风险管理工具，是将特定资产分离至专门的侧袋账户进行处置清算，并以处置变现后的款项向基金份额持有人进行支付，目的在于有效隔离并化解风险。但

基金启用侧袋机制后，侧袋账户份额将停止披露基金份额净值，并不得办理申购、赎回和转换，仅主袋账户份额正常开放赎回，因此启用侧袋机制时持有基金份额的持有人将在启用侧袋机制后同时持有主袋账户份额和侧袋账户份额，侧袋账户份额不能赎回，其对应特定资产的变现时间具有不确定性，最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损失。

实施侧袋机制期间，本基金不披露侧袋账户份额净值，即便基金管理人在基金定期报告中披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，也不作为特定资产最终变现价格的承诺，对于特定资产的公允价值和最终变现价格，基金管理人不承担任何保证和承诺的责任。

基金管理人将根据主袋账户运作情况合理确定申购政策，因此实施侧袋机制后主袋账户份额存在暂停申购的可能。

启用侧袋机制后，基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅需考虑主袋账户资产，基金业绩指标应当以主袋账户资产为基准，因此本基金披露的业绩指标不能反映特定资产的真实价值及变化情况。

（六）合规性风险

指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者基金投资违反法规及基金合同有关规定的风险。

（七）投资管理风险

本基金根据宏观经济运行状况、金融市场环境及利率走势的综合判断，在控制利率风险、信用风险以及流动性风险等基础上，采取主动的自上而下的投资策略和自下而上的品种选择相互结合，力争为投资者在保障本金安全的情况下实现更多的资产增值，但同时也不可避免地带来了组合风险的增加。在基金投资管理运作过程中，可能因基金管理人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。

（八）本基金特有的风险

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，届时本基金面临相对较高的流动性风险和信用风险。

投资存托凭证的特定风险：

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

（九）本法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险

本基金法律文件投资章节有关风险收益特征的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述，代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构（包括基金管理人直销机构和代销机构）根据相关法律法规对本基金进行风险评价，不同的销售机构采用的评价方法也不同，因此销售机构的风险等级评价与法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同，投资人在购买本基金是需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

（十）其他风险

1、随着符合本基金投资理念的新投资工具的出现和发展，如果投资于这些工具，基金可能会面临一些特殊的风险；

2、因技术因素而产生的风险，如计算机系统不可靠产生的风险；

3、因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；

4、因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；

5、对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；

6、战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；

7、其他意外导致的风险。

十九、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

（一）《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或《基金合同》约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，自决议生效后两日内起在规定媒介公告。

（二）《基金合同》的终止

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

3、《基金合同》约定的其他情形；

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、基金财产清算程序：

（1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

（5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

（四）清算费用

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

（五）基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

（六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

（七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存不少于法律法规规定的最低年限。

二十、基金合同的内容摘要

一、基金合同当事人及权利义务

（一）基金管理人

1、基金管理人简况

名称：金鹰基金管理有限公司

住所：广州市南沙区横沥镇汇通二街 2 号 3212 房（仅限办公）

法定代表人：姚文强

设立日期：2002 年 12 月 25 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会，证监基金字【2002】97 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：5.102 亿元人民币

存续期限：持续经营

联系电话：020-83282855

2、基金管理人的权利与义务

（1）根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

1）依法募集基金；

2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；

3)依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

4）销售基金份额；

5）召集基金份额持有人大会；

6）依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；

10）依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案；

11）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

12）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；

13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；

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

15）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；

16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则；

17）法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

（2）根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

1）依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2）办理基金备案手续；

3）自《基金合同》生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

4）配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

5）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立 ,对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

6）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

7）依法接受基金托管人的监督；

8）采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；

9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

10）编制季度报告、中期报告和年度报告；

11）严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

12）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

13）按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

15）依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 20 年以上；

17）确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；

18）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；

19）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；

20）因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

21）监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

22）当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

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实施其他法律行为；

24）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

25）建立并保存基金份额持有人名册；

26）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（二）基金托管人

1、基金托管人简况

名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：廖林

成立时间：1984 年 1 月 1 日

批准设立机关和批准设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146 号）

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

存续期限：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会和中国人民银行证监基字【1998】3 号

联系电话：（010）66105799

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费用；

3）监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人有违反《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）根据相关市场规则，为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算。

5）提议召开或召集基金份额持有人大会；

6）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

7）法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

（2）根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

2）设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

3）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资

金划拨、账册记录等方面相互独立；

4）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

6）按规定开设基金财产的资金账户和证券账户,按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

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

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

9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

10）对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人有未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

11）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 20 年以上；

12）建立并保存基金份额持有人名册；

13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

14）依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

15）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份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

16）按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

17）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

18）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；

19）因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

20）按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

21）执行生效的基金份额持有人大会的决定；

22）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（三）基金份额持有人

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自依据《基金合同》取得的基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

（1）分享基金财产收益；

（2）参与分配清算后的剩余基金财产；

（3）依法申请赎回其持有的基金份额；

（4）按照规定要求召开基金份额持有人大会；

（5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

（6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

（7）监督基金管理人的投资运作；

（8）对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；

（9）法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

（1）认真阅读并遵守《基金合同》；

（2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自行承担投资风险；

（3）关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

（4）缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

（5）在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；

（6）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；

（7）执行生效的基金份额持有人大会的决定；

（8）返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

（9）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，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。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

（一）召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

（1）终止《基金合同》；

（2）更换基金管理人；

（3）更换基金托管人；

（4）转换基金运作方式；

（5）调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或调高销售服务费率，但法律法规要求提高该等报酬标准除外；

（6）变更基金类别；

（7）本基金与其他基金的合并；

（8）变更基金投资目标、范围或策略；

（9）变更基金份额持有人大会程序；

（10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

（11）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；

（12）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

（13）法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

（1）在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率、调低销售服务费率、对份额持有人利益无实质性不利影响的情况下调整基金份额类别、变更

或增加收费方式；

（2）法律法规要求增加的基金费用的收取；

（3）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

（4）对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；

（5）按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

（二）会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集；

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集。

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

5、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在规定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

（1）会议召开的时间、地点和会议形式；

（2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

（3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

（4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；

（5）会务常设联系人姓名及联系电话；

（6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

（7）召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

（四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）；若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

（2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见；

（4）上述第（3）项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记注册机构记录相符；

（5）会议通知公布前报中国证监会备案。

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

（1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

（2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

（六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三

分之二以上（含三分之二）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

（七）计票

1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

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

（3）如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

（4）计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

（八）生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在规定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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

（九）实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

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

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

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

3、通讯开会的直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

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

5、现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人；

6、一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过；

7、特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上

（含三分之二）通过。

同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。

三、基金的收益与分配

（一）基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

（二）基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

（三）基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式：

现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；投资者可以在不同销售机构对本基金设置为相同的分红方式，亦可设置为不同的分红方式，即同一基金账户对本基金在各销售机构设置的分红方式相互独立、互不影响。

3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

4、由于本基金 A 类、D 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、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

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

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过15个工作日。

（六）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足于支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为相应类别的基金份额。

现金红利转基金份额视同申购，但不收取申购费。

红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

（七）实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书的规定。

四、基金费用的计提方法、计提标准和支付方式

（一）基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.75%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.75%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

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

（二）基金托管人的托管费

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

H＝E×0.2%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支

取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

（三）销售服务费

本基金A类基金份额、D类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额收取销售服务费。

本基金的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40%的年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

H＝E×0.40%÷当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构,由登记机构代收后支付给销售机构。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

（四）实施侧袋机制期间的基金费用

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

五、基金财产的投资方向和投资限制

（一）投资目标

通过对宏观经济、资本市场运行趋势的前瞻性研判，预测未来利率水平及其变化趋势，力求准确把握固定收益类、权益类资产的投资机会，在严格控制投资风险的前提下，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。

（二）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，主要投资于国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债（含分离交易可转债）、资产支持证券、短期融资券、回购、中小企业私募债券、货币市场工具等固定收益类证券品种、国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，

可以将其纳入投资范围。

本基金对固定收益类证券品种的投资比例不低于基金资产的 80%;对股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，权证投资的比例范围占基金资产净值的 0～3%。为维持投资组合的流动性，本基金持有现金和到期日不超过一年的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

（三）投资限制

1、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

（1）承销证券；

（2）违反规定向他人贷款或者提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）买卖其他基金份额，但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外；

（5）向其基金管理人、基金托管人出资；

（6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（7）依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

2、投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制

（1）本基金对固定收益类证券品种的投资比例不低于基金资产的 80%；对股票、权证等其它金融工具的投资比例不超过基金资产的 20%；

（2）保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。；

（3）本基金持有一家上市公司的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

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

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

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

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

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

（8）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

（9）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

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

（11）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%；

（12）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%；

（13）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%；

（14）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%；

（15）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%；

（16）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；

（17）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；

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

（19）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%；

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

（21）基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，除上述第（2）、（7）、（16）、（21）条规定的情形外，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

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

六、基金资产估值方法

本基金按以下方式进行估值：

（一）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或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，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或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，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、交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种（另有规定的除外），选取估值日第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值全价进行估值。

3、交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值；对于含投资者回售权的固定受益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价，同时充分考虑发行人的信用风险变化对

公允价值的影响。回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的，按照长待偿期所对应的价格进行估值。

4、交易所市场上市交易的可转换债券，实行全价交易的选取估值日收盘价作为估值全价；实行净价交易的选取估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价。

5、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。

（二）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估值方法估值；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和债券，采用估值技术确定公允价值；

3、在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

4、对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。

（三）对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值全价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价估值。对银行间市场上含投资者回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间按照第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价估值，同时充分考虑发行人的信用风险变化对公允价值的影响。回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值基准服务机构未提供估值价格的债券，采用估值技术确定公允价值。

（四）同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。。

（五）本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。

（六）如有充分理由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方法估值。

（七）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，按照基金管理人对基金份额净值的计算结果对外予以公布。

估值程序

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

每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额净值，并按规定公告。

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

七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

（一）《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，自决议生效后两日内在规定媒介公告。

（二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

3、《基金合同》约定的其他情形；

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、基金财产清算程序：

（1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

（5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告。

（7）对基金财产进行分配；

5、基金财产清算的期限为 6 个月。

（四）清算费用

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

（五）基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产依次扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

（六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《中华人民共和国

证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

（七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 20 年以上。

八、争议的处理和适用法律

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

《基金合同》受中国法律管辖。

九、基金合同的效力

《基金合同》是约定基金当事人之间、基金与基金当事人之间权利义务关系的法律文件。

1、本基金根据《金鹰元丰保本混合型证券投资基金基金合同》的约定由金鹰元丰保本混合型证券投资基金第三个保本周期届满后转型而来。根据《金鹰元丰保本混合型证券投资基金基金合同》，自 2017 年 9 月 20 日“金鹰元丰保本混合型证券投资基金”正式转型为“金鹰元丰债券型证券投资基金”。金鹰元丰债券型证券投资基金基金合同及托管协议即日起生效。

2、《基金合同》的有效期自其生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会批准并公告之日止，对《基金合同》的有效修订或补充自该修订或补充界定的生效日起生效。

3、《基金合同》自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的《基金合同》各方当事人具有同等的法律约束力。

4、《基金合同》正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。

5、《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

二十一、基金托管协议的内容摘要

一、基金托管协议当事人

（一）基金管理人

名称：金鹰基金管理有限公司

住所：广州市南沙区横沥镇汇通二街 2 号 3212 房（仅限办公）

法定代表人：姚文强

设立日期：2002 年 12 月 25 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会、证监基金字【2002】97 号

注册资本：5.102 亿元人民币

组织形式：有限责任公司

经营范围：基金募集，基金销售、资产管理、特定客户资产管理和中国证监会许可的其他业务。

存续期间：持续经营

（二）基金托管人

名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100032）

法定代表人：廖林

电话：（010）66105799

传真：（010）66105798

联系人：郭明

成立时间：1984 年 1 月 1 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

批准设立机关和设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146 号）

存续期间：持续经营

经营范围：办理人民币存款、贷款、同业拆借业务；国内外结算；办理票据承兑、贴现、转贴现、各类汇兑业务；代理资金清算；提供信用证服务及担保；代理销售业务；代理发行、代理承销、代理兑付政府债券；代收代付业务；代理证券投资基金清算业务（银证转账）；保险代理业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；保管箱服务；发行金融债券；买卖政府债券、金融债券；证券投资基金、企业年金托管业务；企业年金受托管理服务；年金账户管理服务；开放式基金的注册登记、认购、申购和赎回业务；资信调查、咨询、见证业务；贷款承诺；企业、个人财务顾问服务；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外币兑换；出口托收及进口代收；外汇票据承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；自营、代客外汇买卖；外汇金融衍生业务；银行卡业务；电话银行、网上银行、手机银行业务；办理结汇、售汇业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

1、基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，对下述基金投资范围、投资对象进行监督。

本基金将投资于以下金融工具：

基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，主要投资于国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债（含分离交易可转债）、资产支持证券、短期融资券、回购、中小企业私募债券、货币市场工具等固定收益类证券品种、国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及《基金合同》禁止投资的投资工具。

2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督：

（1）按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：

本基金对固定收益类证券品种的投资比例不低于基金资产的 80%；对股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）等权益类资产的投资比例不超过基金资产的

20%，其中，权证投资的比例范围占基金资产净值的 0～3%。为维持投资组合的流动性，本基金持有现金和到期日不超过一年的政府债券不低于基金资产净值的 5%。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

因基金规模或市场变化等因素导致投资组合不符合上述规定的，基金管理人应在合理的期限内调整基金的投资组合，以符合上述比例限定。法律法规另有规定时，从其规定。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

（2）根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：

a、本基金对固定收益类证券品种的投资比例不低于基金资产的 80%；对股票、权证等其它金融工具的投资比例不超过基金资产的 20%；

b、保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

c、本基金持有一家上市公司的证券，其市值不得超过基金资产净值的 10%；

d、本基金管理人管理的且由本协议项下基金托管人托管的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

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

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

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

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

h、本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

i、本基金管理人管理的且由本协议项下基金托管人托管的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

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

k、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%；

l、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%；

m、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%；

n、本基金管理人管理的且由本协议项下基金托管人托管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%；

o、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%；

p、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；

q、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；

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

s、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%；

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

基金托管人对基金的投资的监督和检查自基金合同生效之日起开始。

（3）法规允许的基金投资比例调整期限

由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例，不在限制之内，但除上述第 b、g、p 条规定的情形外，基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。

（4）本基金可以按照国家的有关规定进行融资融券。

基金托管人对基金投资的监督和检查自《基金合同》生效之日起开始。

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：

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金禁止从事下列行为：

（1）承销证券；

（2）违反规定向他人贷款或提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）买卖其他基金份额，但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外；

（5）向基金管理人、基金托管人出资；

（6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（7）依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

4、侧袋机制的实施和投资运作安排

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

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

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

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。

（1）基金管理人应按照基金托管人确定的文件格式向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间市场交易对手的名单。基金托管人根据名单对基金管理人银行间市场交易进行监督。基金管理人拟增加或减少银行间市场交易对手的，应按照前述要求重新向基金托管人提交名单,并通过电话或邮件向基金托管人确认，拟调整名单经基金托管人确认后开始生效。因基金管理人未履行确认程序导致交易对手名单未变更的，基金托管人不承担责任。基金管理人知晓并同意新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。

如果基金托管人发现基金管理人与不在名单内的银行间市场交易对手进行交易，应及时提醒基金管理人撤销交易，经提醒后基金管理人仍执行交易并造成基金资产损失的，基金托管人不承担责任，发生此种情形时，基金托管人有权报告中国证监会。

（2）基金管理人未提供交易对手名单或交易对手名单文件格式不符合托管人要求的，均视为未提供名单。基金管理人同意，基金托管人无需履行前款项下监督职责。因此给基金造成的损失由基金管理人承担。

基金管理人未提供交易对手名单，但基金托管人发现基金管理人与银行间市场的丙类会员进行债券交易的，可以通过邮件、电话等双方认可的方式提醒基金管理人，基金管理人应及时向基金托管人提供可行性说明。基金管理人应确保说明内容真实、准确、完整。基金托管人不对基金管理人提供的可行性说明进行实质审查。基金管理人同意，经提醒后基金管理人仍执行交易并造成基金资产损失的，基金托管人不承担责任。

（3）基金管理人在银行间市场进行现券买卖和回购交易时，以 DVP(券款兑付)的交易结算方式进行交易。

6、基金托管人对基金管理人选择存款银行进行监督。

本基金投资银行存款的信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。基金管理人应基于审慎原则评估存款银行信用风险并据此自行选择存款银行。因基金管理人违反上述原则给基金造成的损失，基金托管人不承担任何责任，相关损失由基金管理人先行承担。基金管理人履行先行赔付责任后，有权要求相关责任人进行赔偿。基金托管人的职责仅限于督促基金管理人履行先行赔付责任。

7、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督

（1）基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

（2）流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

（3）基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前，向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票，基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。

基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管

人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内，以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

（4）基金投资流通受限证券前，基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息，包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期，基金拟认购的数量、价格、总成本、总成本占基金资产净值的比例、已持有流通受限证券市值占资产净值的比例、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整，并应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。

（5）基金托管人应对基金管理人是否遵守法律法规、投资决策流程、风险控制制度、流动性风险处置预案情况进行监督，并审核基金管理人提供的有关书面信息。基金托管人认为上述资料可能导致基金出现风险的，有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明，并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则，基金托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的，基金托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

如基金管理人和基金托管人无法达成一致，应及时上报中国证监会请求解决。如果基金托管人切实履行监督职责，则不承担任何责任。如果基金托管人没有切实履行监督职责，导致基金出现风险，基金托管人应承担连带责任。

（二）基金托管人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净值计算、各类基金份额净值计算、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。

（三）基金托管人发现基金管理人的投资运作及其他运作违反《基金法》、《基金合同》、基金托管协议有关规定时，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应在下一个工作日及时核对，并以书面形式向基金托管人发出回函，进行解释或举证。

在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因其违反《基金合同》而致使投资者遭受的损失。

对于依据交易程序尚未成交的且基金托管人在交易前能够监控的投资指令，基金托管人发现该投资指令违反关法律法规规定或者违反《基金合同》约定的，应当拒绝执行，立即

通知基金管理人，并向中国证监会报告。

对于必须于估值完成后方可获知的监控指标或依据交易程序已经成交的投资指令，基金托管人发现该投资指令违反法律法规或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。

基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，必须在规定时间内答复基金托管人并改正，就基金托管人的疑义进行解释或举证，对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠基金托管人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金托管人进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

三、基金管理人对基金托管人的业务核查

基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和各类基金份额净值、根据管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本托管协议及其他有关规定时，基金管理人应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正，并予协助配合。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。基金管理人有义务要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即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。

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。

基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠基金管理人根据本协议规定行使监督权，或采取拖

延、欺诈等手段妨碍基金管理人进行有效监督，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、基金财产保管

（一）基金财产保管的原则

1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

2、基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。

3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。

4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理，确保基金财产的完整与独立。

5、对于因基金认（申）购、基金投资过程中产生的应收财产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人对此不承担责任。

（二）募集资金的验证

募集期内销售机构按销售与服务代理协议的约定，将认购资金划入基金管理人在具有托管资格的商业银行开设的金鹰基金管理有限公司基金认购专户。该账户由基金管理人开立并管理。基金募集期满，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，由基金管理人聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字有效。验资完成，基金管理人应将募集的属于本基金财产的全部资金划入基金托管人为基金开立的资产托管专户中，基金托管人在收到资金当日出具确认文件。

若基金募集期限届满，未能达到《基金合同》生效的条件，由基金管理人按规定办理退款事宜。

（三）基金的银行账户的开立和管理

基金托管人以基金托管人的名义在其营业机构开设资产托管专户，保管基金的银行存款。该账户的开设和管理由基金托管人承担。本基金的一切货币收支活动，均需通过基金托管人的资产托管专户进行。

资产托管专户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管

理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用基金的任何银行账户进行本基金业务以外的活动。

资产托管专户的管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理暂行条例》、《人民币利率管理规定》、《利率管理暂行规定》、《支付结算办法》以及银行业监督管理机构的其他规定。

（四）基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开立基金证券交易资金账户，用于证券清算。

基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

（五）债券托管账户的开立和管理

1、《基金合同》生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管自营账户，并由基金托管人负责基金的债券的后台匹配及资金的清算。

2、基金管理人和基金托管人应一起负责为基金对外签订全国银行间国债市场回购主协议，正本由基金托管人保管，基金管理人保存副本。

（六）其他账户的开设和管理

在本托管协议订立日之后，本基金被允许从事符合法律法规规定和《基金合同》约定的其他投资品种的投资业务时，如果涉及相关账户的开设和使用，由基金管理人协助托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

（七）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的保管

基金财产投资的有关实物证券由基金托管人存放于基金托管人的保管库；其中实物证券也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管

理人的指令办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制或保管的证券不承担保管责任。

（八）与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别应由基金托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人在合同签署后 5 个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达基金托管人处。合同原件应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门 20 年以上。

五、基金资产净值计算和会计核算

（一）基金资产净值的计算

1、基金资产净值的计算、复核的时间和程序

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。各类基金份额净值是指计算日基金资产净值除以该计算日该类基金份额总份额后的数值。各类基金份额净值的计算保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

基金管理人应每工作日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算办法》及其他法律、法规的规定。基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金净值信息并以双方认可的方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后以双方认可的方式发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。因此，本基金的会计责任方是基金管理人，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。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。

（二）基金资产估值方法

1、估值对象

基金所拥有的股票、债券、权证和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

2、估值方法

本基金的估值方法为：

（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或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，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或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，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交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种（另有规定的除外），选取估值日第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值全价进行估值。

③交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值；对于含投资者回售权的固定受益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价，同时充分考虑发行人的信用风险变化对公允价值的影响。回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的，按照长待偿期所对应的价格进行估值。

④交易所市场上市交易的可转换债券，实行全价交易的选取估值日收盘价作为估值全价；实行净价交易的选取估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价。

⑤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。

（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估值方法估值；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和债券，采用估值技术确定公允价值；

③在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

④对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允

价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。

（3）对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值全价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价估值。对银行间市场上含投资者回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间按照第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价估值，同时充分考虑发行人的信用风险变化对公允价值的影响。回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值基准服务机构未提供估值价格的债券，采用估值技术确定公允价值。

（4）同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

（5）本基金投资存托凭证的估值核算依照境内上市交易的股票执行。

（6）如有充分理由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方法估值。

（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。

（三）估值差错处理

因基金估值错误给投资者造成损失的应先由基金管理人承担，基金管理人对不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。

当基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告的，由此造成的投资者或基金的损失，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，由基金管理人与基金托管人按照管理费率和托管费率的比例各自承担相应的责任。

由于一方当事人提供的信息错误，另一方当事人在采取了必要合理的措施后仍不能发现该错误，进而导致基金资产净值、各类基金份额净值计算错误造成投资者或基金的损失，以及由此造成以后交易日基金资产净值、各类基金份额净值计算顺延错误而引起的投资者或基金的损失，由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误

的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

当基金管理人计算的基金资产净值与基金托管人的计算结果不一致时，相关各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对，如果最后仍无法达成一致，应以基金管理人的计算结果为准对外公布，由此造成的损失以及因该交易日基金资产净值计算顺延错误而引起的损失由基金管理人承担赔偿责任，基金托管人不负赔偿责任。

（四）基金账册的建立

基金管理人和基金托管人在《基金合同》生效后，应按照相关各方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本基金的全套账册，对相关各方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金资产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。

经对账发现相关各方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，保证相关各方平行登录的账册记录完全相符。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。

（五）基金定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成。

《基金合同》生效后，基金招募说明书、基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书和基金产品资料概要并登载在规定网站上；基金招募说明书、基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新招募说明书和基金产品资料概要。基金管理人在每个季度结束之日起 15 个工作日内完成季度报告编制并公告；在上半年结束之日起两个月内完成中期报告编制并公告；在每年结束之日起三个月内完成年度报告编制并公告。

基金管理人在 5 个工作日内完成月度报告，在月度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核；基金托管人在 3 个工作日内进行复核，并将复核结果及时书面通知基金管理人。基金管理人在 7 个工作日内完成季度报告，在季度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 7 个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在一个月内完成中期报告，在中期报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后一个月内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金

管理人在一个半月内完成年度报告，在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后一个半月内复核，并将复核结果书面通知基金管理人。

基金托管人在复核过程中，发现相关各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，调整以相关各方认可的账务处理方式为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖业务印鉴或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书，相关各方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

基金托管人在对财务会计报告、中期报告或年度报告复核完毕后，需盖章确认或出具相应的复核确认书，以备有权机构对相关文件审核时提示。

（六）实施侧袋机制期间的基金资产估值

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

六、基金份额持有人名册的保管

基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册，包括《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权利登记日、每年 6 月 30 日、12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由基金的基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应按照目前相关规则分别保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。保管期限为 20 年。

基金管理人应当及时向基金托管人提交下列日期的基金份额持有人名册：《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权利登记日、每年 6 月 30 日、每年 12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。其中每年 12 月 31 日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交；《基金合同》生效日、《基金合同》终止日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生日后十个工作日内提交。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保存期限为 20 年。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其

他用途，并应遵守保密义务。

若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

七、争议解决方式

相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，除经友好协商可以解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在北京，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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

本协议受中国法律管辖。

八、基金托管协议的变更、终止与基金财产的清算

（一）托管协议的变更与终止

1、托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议的内容进行变更。变更后的托管协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准或备案后生效。

2、基金托管协议终止的情形

发生以下情况，本托管协议终止：

（1）《基金合同》终止；

（2）基金托管人解散、依法被撤销、破产或有其他基金托管人接管基金资产；

（3）基金管理人解散、依法被撤销、破产或有其他基金管理人接管基金管理权；

（4）发生法律法规或《基金合同》规定的终止事项。

（二）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》和本托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

3、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有

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

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

5、基金财产清算程序：

（1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

（5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

（6）将清算报告报告中国证监会备案并公告；

（7）对基金财产进行分配；

6、清算费用

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

7、基金财产按下列顺序清偿：

（1）支付清算费用；

（2）交纳所欠税款；

（3）清偿基金债务；

（4）按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款（1）—（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

（三）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于《基金合同》终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

（四）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 20 年以上。

二十二、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。以下是主要的服务内容，基金管理人将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

（一）基金份额持有人资料寄送

1、账户确认书

根据客户的需要，为客户发送电子邮件形式的开放式基金账户确认书。

2、对账单

（1）基金份额持有人可登录本公司网站（http://www.gefund.com.cn）查阅对账单。

（2）本公司至少每年度以电子邮件、短信或其他约定形式向有联系方式的基金份额持有人提供基金保有情况信息，基金份额持有人也可以向本公司定制电子邮件形式的月度或季度对账单。 具体查阅和定制账单的方法可参见本公司网站或拨打客服热线咨询。

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）网络在线服务

通过本基金管理人网站的客户服务信箱，投资者可以实现在线咨询、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，投资者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。

基金管理人网站为投资者提供基金账户查询、交易明细查询、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

（三）信息定制服务

基金管理人还可为基金投资者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 和公司微信平台定期为客户发送所定制的信息，内容包括：每笔交易确认、每月账户余额、基金净值查询等。

（四）网上交易服务

投资者可通过销售机构网站办理申购、赎回等交易及进行信息查询。投资者也可通过基金管理人网上直销平台（公司网址：http://www.gefund.com.cn）办理开户、认购、申购、赎回等业务。投资者在选用网上交易服务之前，请向相关机构咨询。

（五）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 9：00-11:30,13:00-17：00 为投资者提供服务，投资者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：4006-135-888

（六）投诉受理

投资者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者的投诉做出回复。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。

（七）如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，可通过上述方式联系本公司。本招募说明书与基金合同、基金托管协议不一致的，以基金合同、基金托管协议为准。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解了本招募说明书、基金合同、基金托管协议等相关法律文件。

二十三、其它应披露事项

（一） 基金信息披露明细

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告	证监会规定媒介	2025 年 9 月 3 日
2	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与泰信财富基金销售有限公司代销机构费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2025 年 9 月 9 日
3	金鹰元丰债券型证券投资基金更新的招募说明书	证监会规定媒介	2025 年 9 月 26 日
4	金鹰基金管理有限公司新增北京度小满基金销售有限公司为金鹰元丰债券型证券投资基金 C 类份额代销机构并开通基金转换、基金定投业务及费率优惠的公告	证监会规定媒介	2025 年 10 月 15 日
5	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与玄元保险代理有限公司代销机构费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2025 年 10 月 20 日
6	金鹰基金管理有限公司旗下基金 2025 年第三季度报告提示性公告	证监会规定媒介	2025 年 10 月 28 日
7	金鹰元丰债券型证券投资基金 2025 年第 3 季度报告	证监会规定媒介	2025 年 10 月 28 日
8	金鹰基金管理有限公司关于“金鹰基金”APP 业务迁移的公告	证监会规定媒介	2025 年 11 月 3 日
9	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告	证监会规定媒介	2025 年 11 月 27 日
10	金鹰基金管理有限公司关于终止北京微动利基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证监会规定媒介	2025 年 11 月 28 日
11	金鹰基金管理有限公司关于终止方正中期期货有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证监会规定媒介	2025 年 11 月 28 日
12	金鹰基金管理有限公司部分基金新增易方达财富管理基金销售(广州)有限公司为代销机构并开通基金转换、基金定投业务及费率优惠的公告	证监会规定媒介	2025 年 12 月 8 日

13	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告	证监会规定媒介	2026 年 1 月 13 日
14	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告	证监会规定媒介	2026 年 1 月 16 日
15	金鹰元丰债券型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	证监会规定媒介	2026 年 1 月 22 日
16	金鹰基金管理有限公司旗下基金 2025 年第四季度报告提示性公告	证监会规定媒介	2026 年 1 月 22 日
17	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京汇成基金销售有限公司代销机构费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2026 年 1 月 29 日
18	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2026 年 2 月 12 日
19	金鹰元丰债券型证券投资基金 2025 年年度报告	证监会规定媒介	2026 年 3 月 31 日
20	金鹰基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况(2025 年度)	证监会规定媒介	2026 年 3 月 31 日
21	金鹰基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	证监会规定媒介	2026 年 3 月 31 日
22	金鹰基金管理有限公司关于网上交易、微信理财宝系统暂停服务的公告	证监会规定媒介	2026 年 4 月 2 日
23	金鹰元丰债券型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	证监会规定媒介	2026 年 4 月 22 日
24	金鹰基金管理有限公司旗下基金 2026 年第一季度报告提示性公告	证监会规定媒介	2026 年 4 月 22 日
25	金鹰基金管理有限公司以股东身份(通过公募基金持股)参与股东大会投票信息披露	证监会规定媒介	2026 年 4 月 30 日
26	金鹰基金管理有限公司部分基金新增福克斯(北京)基金销售有限公司为代销机构并开通基金转换、基金定投业务及费率优惠的公告	证监会规定媒介	2026 年 5 月 18 日
27	金鹰元丰债券型证券投资基金(金鹰元丰债券 A)基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2026 年 5 月 29 日
28	金鹰元丰债券型证券投资基金(金鹰元丰债券 C)基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2026 年 5 月 29 日
29	金鹰元丰债券型证券投资基金(金鹰元丰债券 D)基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2026 年 5 月 29 日

30	金鹰基金管理有限公司关于终止中证金牛(北京)基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证监会规定媒介	2026 年 5 月 29 日
31	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告	证监会规定媒介	2026 年 6 月 24 日
32	金鹰元丰债券型证券投资基金基金合同更新	证监会规定媒介	2026 年 6 月 26 日
33	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告	证监会规定媒介	2026 年 6 月 27 日
34	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告	证监会规定媒介	2026 年 7 月 1 日
35	金鹰基金管理有限公司关于终止利和财富(上海)基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证监会规定媒介	2026 年 7 月 8 日
36	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告	证监会规定媒介	2026 年 7 月 14 日
37	金鹰元丰债券型证券投资基金 2026 年第 2 季度报告	证监会规定媒介	2026 年 7 月 21 日
38	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告	证监会规定媒介	2026 年 7 月 21 日
39	金鹰基金管理有限公司旗下基金 2026 年第二季度报告提示性公告	证监会规定媒介	2026 年 7 月 21 日
40	金鹰元丰债券型证券投资基金(金鹰元丰债券 A)基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2026 年 7 月 30 日
41	金鹰元丰债券型证券投资基金更新的招募说明书	证监会规定媒介	2026 年 7 月 30 日
42	金鹰基金管理有限公司关于终止浦领基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证监会规定媒介	2026 年 8 月 27 日
43	金鹰元丰债券型证券投资基金 2026 年中期报告	证监会规定媒介	2026 年 8 月 31 日
44	金鹰基金管理有限公司旗下基金 2026 年中期报告提示性公告	证监会规定媒介	2026 年 8 月 31 日

（二）重要事项提示

无。

二十四、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址进行查阅。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。

二十五、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丰保本混合型证券投资基金募集的文件（证监许可【2012】1537 号）；

2、《金鹰元丰债券型证券投资基金基金合同》；

3、《金鹰元丰债券型证券投资基金托管协议》；

4、法律意见书；

5、基金管理人业务资格批件、营业执照；

6、基金托管人业务资格批件、营业执照；

7、《金鹰基金管理有限公司开放式基金业务规则》；

8、中国证监会要求的其他文件。

金鹰基金管理有限公司

2026 年 11 月 4 日