

# 关于修订金鹰元丰保本混合型证券投资基金基金合同的公告

金鹰元丰保本混合型证券投资基金（以下使用其全称或简称“本基金”）基金合同于 2013 年 1 月 30 日生效。

本基金保本周期期限十八个月，第三个保本周期的开始日为 2016 年 3 月 14 日，到期日为满十八个月的对应日，即本基金的第三个保本周期的到期日为 2017 年 9 月 14 日。根据基金合同的约定：“如保本到期后，本基金未能符合上述保本基金存续条件，则本基金将按《基金合同》的约定，变更为“金鹰元丰债券型证券投资基金”；同时，基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等相关内容也将根据《基金合同》约定相应变更。上述变更由基金管理人和基金托管人同意后，可不经基金份额持有人大会决议，在报中国证监会备案后，提前在临时公告或更新的基金招募说明书中予以说明。”

根据上述约定，变更后基金合同、托管协议和招募说明书分别修订为《金鹰元丰债券型证券投资基金基金合同》、《金鹰元丰债券型证券投资基金托管协议》和《金鹰元丰债券型证券投资基金招募说明书》，调整的内容包括但不限于保留并适用《金鹰元丰保本混合型证券投资基金基金合同》关于变更后的金鹰元丰债券型证券投资基金的基金名称、投资目标、投资范围、投资策略、投资比例、业绩比较基准、估值方法以及基金费率等条款的约定，并根据现行有效的法律法规规定，在对基金份额持有人无实质性不利影响的前提下对基金合同的其他条款进行了修订。修订内容详细请见附件。

自 2017 年 9 月 20 日起，修订后的《金鹰元丰债券型证券投资基金基金合同》生效，《金鹰元丰保本混合型证券投资基金基金合同》自同日起失效。金鹰元丰保本混合型证券投资基金变更为金鹰元丰债券型证券投资基金。前述修改变更事项已报中国证监会备案。

金鹰元丰债券型证券投资基金的投资目标、投资范围、投资策略、投资比例、业绩比较基准、估值方法、基金费率、业务开通情况、销售机构及其他具体操作事宜按照该基金基金合同及招募说明书等相关规定进行运作，详见 2017 年 9 月 7 日刊登在金鹰官网（[www.gefund.com.cn](http://www.gefund.com.cn)）上的《金鹰元丰债券型证券投资基金基金合同摘要》及《金鹰元丰债券型证券投资基金招募说明书》。

《金鹰元丰债券型证券投资基金基金合同》及《金鹰元丰债券型证券投资基金托管协议》同时登载于本公司网站。

特此公告。

附件：《金鹰元丰保本混合型证券投资基金基金合同》的修改说明

金鹰基金管理有限公司

2017 年 9 月 7 日

附件：《金鹰元丰保本混合型证券投资基金基金合同》的修改说明

附件：《金鹰元丰保本混合型证券投资基金基金合同》的修改说明

附件二:基金合同的修订内容

章节原文内容修订后内容

第一部分前言

2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《关于保本基金的指导意见》(以下简称“《指导意见》”)和其他有关法律法规。

2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)和其他有关法律法规。

三、证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)核准。

中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

三、金鹰元丰债券型证券投资基金由金鹰元丰保本混合型证券投资基金转型而来。金鹰元丰保本混合型证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)核准。

中国证监会对金鹰元丰保本混合型证券投资基金募集的核准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。

第二部分释义

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

1、基金或本基金：指金鹰元丰债券型证券投资基金

4、基金担保人：亦称担保人，指根据《基金合同》的约定，为本基金份额持有人的保本提供不可撤销的连带责任保证的担保人。本基金第三个保本周期的担保人为深圳市高新投集团有限公司或《基金合同》约定的其他机构

5、保本义务人：指与基金管理人签订风险买断合

同，为本基金的某保本周期承担保本偿付责任并放弃对基金管理人进行追偿权利的机构

6、基金合同或本基金合同：指《金鹰元丰保本混合型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充

7、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《金鹰元丰保本混合型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

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

9、基金份额发售公告：指《金鹰元丰保本混合型证券投资基金基金份额发售公告》

4、基金合同或本基金合同：指《金鹰元丰债券型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充

5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《金鹰元丰债券型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书：指《金鹰元丰债券型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新

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

25、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

删除释义中原“基金募集期”、“保本周期”、“保本周期起始日”、“保本周期到期日”，“持有到期”、“到期操作”、“到期操作期间”、“实际净认购金额”、“持有到期的基金份额的可赎回金额”、“认购并持有到期的基金份额的可赎回金额”、“保本额”、“保本赔付差额”、“保本”、“担保”、“过渡期”、“过渡期申购”、“折算日”、“基金份额折算”、“保本基金存续条件”、“转入下一保本周期”、“保本基金到期后基金的存续形式”、“认购”、“当期保本周期之份额折算日”

无

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

34、《业务规则》：《金鹰基金管理有限公司注册登记业务规则》第三部分基金的基本情况

## 一、基金名称

金鹰元丰保本混合型证券投资基金

## 一、基金名称

金鹰元丰债券型证券投资基金

## 二、基金的类别

混合型证券投资基金

## 二、基金的类别

债券型证券投资基金

## 四、基金的投资目标

本基金运用投资组合保险策略，在严格控制投资风险、保证本金安全的基础上，力争在保本周期结束时，实现基金资产的稳健增值。

## 四、基金的投资目标

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。

删除原“五、基金的最低募集份额总额”、“六、基金份额面值 and 认购费用”、“八、基金担保人”、“九、基金募集规模上限”、“十、基金保本周期”、“十一、基金的保本”、“十二、基金保本的保证”、“十三、保本周期到期后基金的存续形式”

无

## 第四部分基金的历史沿革

### 史沿革

删除原“第四部分基金份额的发售”整章内容

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

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。

## 第五部分基金的存

续

### 一、基金备案的条件

本基金自基金份额发售之日起3个月内，在基金募集份额总额不少于2亿份，基金募集金额不少于2亿元人民币且基金认购人数不少于200人的条件下，基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在10日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起10日内，向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

### 二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式

如果募集期限届满，未满足募集生效条件，基金管理人应当承担下列责任：

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在基金募集期限届满后30日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期存款利息。
- 3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

### 三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，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。

法律法规另有规定时，从其规定。

《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满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。

法律法规另有规定时，从其规定。

## 第六部分基金份额

### 的申购与赎回

4、赎回遵循“后进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行逆序赎回；

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；

### 六、申购和赎回的价格、费用及其用途

1、本基金份额净值的计算，保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

### 六、申购和赎回的价格、费用及其用途

1、本基金份额净值的计算，保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

6、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、6项暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体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。

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、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项暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体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。

发生上述情形时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，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，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。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。

发生上述情形时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，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。

## 第七部分基金合同

### 当事人及权利义务

#### （一）基金管理人简况

住所：广东省广州市天河区体育西路 189 号城建大厦 22 楼

法定代表人：凌富华

联系电话：020-83936180

#### （一）基金管理人简况

住所：广东省广州市天河区珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

法定代表人：刘岩

联系电话：020-83282855

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：

（24）基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

（27）严格遵守基金合同中有关保本和保本条款的约定；

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：

#### （一）基金托管人简况

法定代表人：姜建清

注册资本：人民币 349,018,545,827 元

#### （一）基金托管人简况

法定代表人：易会满

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

联系电话：（010）66105799

## 原第八部分基金担

保人基本情况

删除整章内容无

## 第八部分基金份额

持有人大会

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：

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

(6) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；

(7) 变更基金类别，但在保本到期后在《基金合同》规定范围内变更为“金鹰元丰债券型证券投资基金”除外；

(9) 变更基金投资目标、范围或策略，但在保本到期后在《基金合同》规定范围内变更为“金鹰元丰债券型证券投资基金”并按照《基金合同》约定的“金鹰元丰债券型证券投资基金”的投资目标、范围或策略执行的以及法律法规和中国证监会另有规定的除外；

#### 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：

(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；

(8) 变更基金投资目标、范围或策略；

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

(1) 保本到期后，在《基金合同》规定范围内变更为“金鹰元丰债券型证券投资基金”，并按照《基金合同》约定的“金鹰元丰债券型证券投资基金”的投资目标、范围或策略执行；

(2) 调低基金管理费、基金托管费；

(4) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率；

(7) 保本周期内因担保人或保本义务人发生合并或分立，由合并或分立后的法人或者其他组织承继担保人的权利和义务，或某一个保本周期结束后，更换下一个保本周期的担保人或保本义务人或保本保障机制；

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；

#### 四、基金份额持有人出席会议的方式

1、现场开会。



(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%)。

## 2、通讯开会。

(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%);

## 四、基金份额持有人出席会议的方式

### 1、现场开会。

(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。

(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;

## 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 日内报中国证监会核准或者备案。

基金份额持有人大会的决议自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

## 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。

## 第九部分基金管理

### 人、基金托管人的

### 更换条件和程序

## 二、基金管理人和基金托管人的更换程序

### (一) 基金管理人的更换程序

2、决议: 基金份额持有人大会在基金管理人职责终止后 6 个月内对被提名的基金管理人形成决议, 该

决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的2/3以上（含2/3）表决通过；

4、核准：基金份额持有人大会选任基金管理人的决议须经中国证监会核准生效后方可执行；

5、公告：基金管理人更换后，由基金托管人在中国证监会核准后2个工作日内在指定媒体公告。

## 二、基金管理人和基金托管人的更换程序

### （一）基金管理人的更换程序

2、决议：基金份额持有人大会在基金管理人职责终止后6个月内对被提名的基金管理人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的2/3以上（含2/3）表决通过，并自表决通过之日起生效；

4、备案：基金份额持有人大会选任基金管理人的决议须报中国证监会备案；

5、公告：基金管理人更换后，由基金托管人在更换基金管理人的基金份额持有人大会决议生效后2个工作日内在指定媒介公告。

### （二）基金托管人的更换程序

2、决议：基金份额持有人大会在基金托管人职责终止后6个月内对被提名的基金托管人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的2/3以上（含2/3）表决通过；

4、核准：基金份额持有人大会更换基金托管人的决议须经中国证监会核准生效后方可执行；

5、公告：基金托管人更换后，由基金管理人在中国证监会核准后2个工作日内在指定媒体公告。

### （二）基金托管人的更换程序

2、决议：基金份额持有人大会在基金托管人职责终止后6个月内对被提名的基金托管人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的2/3以上（含2/3）表决通过，并自表决通过之日起生效；

4、备案：基金份额持有人大会更换基金托管人的决议须报中国证监会备案；

5、公告：基金托管人更换后，由基金管理人在更换基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后2个工作日内在指定媒介公告。

（三）基金管理人与基金托管人同时更换的条件和程序。

3、公告：新任基金管理人和新任基金托管人应在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议获得中国证监会核准后2日内在指定媒体上联合公告。

### （三）基金管理人与基金托管人同时更换的条件和程序。

3、公告：新任基金管理人和新任基金托管人应在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后2个工作日内在指定媒体上联合公告。

## 第十一部分基金份额

### 额的登记

#### 四、基金登记机构的义务

基金登记机构承担以下义务：

3、保持基金份额持有人名册及相关的认购、申购与赎回等业务记录 15 年以上；

#### 四、基金登记机构的义务

基金登记机构承担以下义务：

3、妥善保管登记数据，并将基金份额持有人名称、身份信息及基金份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构，其保存期限自基金账户销户之日起不得少于 20 年；

## 原第十三部分基金

### 的保本

删除整章内容无

## 原第十四部分基金

### 保本的保证

删除整章内容无

## 第十二部分基金的

### 投资

删除原“一、保本周期内的投资”整部分内容无

二、变更后的“金鹰元丰债券型证券投资基金”的投资

无

#### （三）投资策略

##### 1、大类资产配置策略

本基金变更为“金鹰元丰债券型证券投资基金”

后，在大类资产配置比例上将不再遵守保本周期内适用的固定比例组合保险策略投资策略。

##### 2、债券类资产配置策略

###### （1）债券类资产的期限配置

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

##### 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。

#### 三、投资策略

##### 1、大类资产配置策略

## 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。

### E、资产支持证券

本基金将综合运用资产配置、久期管理、收益率曲线、信用管理和个券  $\alpha$  策略等策略积极主动进行资产支持证券产品投资。本基金管理人将坚持风险调整后收益最大化的原则，通过信用资质研究和流动性管理，遵守法律法规和基金合同的约定，严格控制投资风险，确保本金相对安全和基金资产具有良好流动性，以期获得长期稳定收益。

## 三、投资限制

### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 在保本周期内，本基金股票、权证占基金资产的比例不超过 30%，债券等固定收益类品种占基金资产的比例不低于 70%；若本基金变更为“金鹰元丰债券型证券投资基金”后，本基金对固定收益类证券品种的投资比例不低于基金资产的 80%；对股票、权证、货币等其它金融工具的投资比例不超过基金资产的 20%；

(3) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；

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

## 六、投资限制

### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(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%；

(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%；

(12) 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%；

(2) 向他人贷款或者提供担保；

(4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；

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，符合国务院证券监督管理机构的规定，并履行信息披露义务。

(2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；

(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；

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。

#### 第十四部分 基金资产

##### 估值

##### 三、估值方法

###### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

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

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

(4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证

券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

### 三、估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化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和含权固定收益品种按估值日第三方估值机构提供的相应品种估值净价估值，如最近交易日后经济环境发生了重大变化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，采用估值技术确定公允价值；

(3) 交易所上市交易的可转换债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化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；

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

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

4、因持有股票而享有的配股权，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

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

6、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

7、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

#### 3、银行间市场交易的固定收益品种的估值

(1) 银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机

构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记截止日（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。

（2）对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的固定收益品种，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

#### 四、估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到0.001元，小数点后第4位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

#### 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。当基金份额净值小数点后3位以内(含第3位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

#### 四、估值程序

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

#### 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。

#### 第十五部分 基金费用与税收

##### 用与税收

#### 1、基金管理人的管理费

在保本周期内，本基金的担保费用从基金管理人的管理费收入中列支。

#### 2、基金托管人的托管费

若保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，基金份额持有人将所持有本基金份额转为变更后的“金鹰元丰债券型证券投资基金”的基金份额，管理费按前一日基金资产净值的0.75%的年费率计提，托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法同上。

#### 1、基金管理人的管理费

## 2、基金托管人的托管费

### 第十六部分基金的

#### 收益与分配

##### 2、本基金收益分配方式：

(1) 保本周期内：仅采取现金分红一种收益分配方式，不进行红利再投资；

(2) 转型后：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。

##### 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。

#### 六、基金收益分配中发生的费用

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

(1) 在保本周期内（包括但不限于第一个保本周期），现金红利转基金份额视同保本周期内的申购，红利再投资的金额不保本，也不收取申购费。

(2) 保本周期届满后，若本基金转型为非保本的“金鹰元丰债券型证券投资基金”，现金红利转基金份额视同申购，但不收取申购费。

红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

#### 六、基金收益分配中发生的费用

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

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。

### 第十八部分基金的

#### 信息披露

(六) 基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告



正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒体上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

(六) 基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定媒体上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

报告期内出现单一投资者持有基金份额比例超过 20% 的情形，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中“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产品的特有风险。

#### (七) 临时报告

#### 26、与保本周期到期相关事项的公告：

(1) 在保本周期到期前，基金管理人将进行提示性公告；

(2) 保本周期届满时，若发生保本赔付，赔付的具体操作细则由基金管理人提前公告；

(3) 过渡期的起止日期，以及过渡期申购的日期、时间、场所、方式和程序等事宜由基金管理人确定并提前公告；

(4) 保本周期届满时，若符合保本基金存续条件，本基金将继续存续并进入下一保本周期。基金管理人应依照法律法规的规定就该保本周期的具体起止日期、保本及担保安排等相关事宜进行公告；

(5) 保本周期届满时，若不符合保本基金存续条件，本基金将变更为“金鹰元丰债券型证券投资基金”，基金管理人将在临时公告或《金鹰元丰债券型证券投资基金招募说明书》中公告相关规则；

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

#### (七) 临时报告

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

#### 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、法律法规规定、中国证监会或《基金合同》认定的其他情形。

原第二十二部分保

本周期到期

删除整章内容无

第十九部分基金合

同的变更、终止与

基金财产的清算

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。

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。

第二十二部分基金

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、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方

盖章以及双方法定代表人或授权代表签字并在募集

结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手

续，并经中国证监会书面确认后生效。

《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。