金鹰持久回报分级债券型证券投资基金之回报B份额上市交易公告书

基金管理人:金鹰基金管理有限公司
基金托管人:中国邮政储蓄银行有限责任公司
注册登记人:中国证券登记结算有限责任公司

上市地点:深圳证券交易所
上市时间:2012年3月28日
公告日期:2012年3月23日

一、重要声明与提示

金鹰持久回报分级债券型证券投资基金(以下简称"本基金")之回报B上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号<上市交易公告书的内容与格式>》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,本基金管理人的董事会及董事保证本上市交易公告书(以下简称"本公告书")所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

本基金托管人保证本公告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、深圳证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。

本公告书第七节"基金财务状况"未经审计。

凡本公告书未涉及的有关内容,请投资者详细查阅本基金管理人2012年2月15日刊登在《证券时报》、2月16日刊登在《上海证券报》、2月20日刊登在《中国证券报》和本基金管理人网站(www.gefund.com.cn)的《金鹰持久回报分级债券型证券投资基金基金招募说明书》和《金鹰持久回报分级债券型证券投资基金基金合同》等相关法律文件。

二、基金概览

1、基金名称:金鹰持久回报分级债券型证券投资基金

基金简称:金鹰持久回报分级债券;场内简称:金鹰回报;基金代码:162105

(1)金鹰持久回报分级债券型证券投资基金之回报A份额,基金简称:回报A;基金代码:162106

(2)金鹰持久回报分级债券型证券投资基金之回报B份额,基金简称:回报B;场内简称:回报B;基金代码:150078

2、基金类型:债券型

3、基金运作方式:契约型

本基金(基金合同)生效后三年内(含三年)为基金分级运作期,回报A、B自本基金(基金合同)生效日起于回报A的开放日接受申购赎回,回报B封闭运作并在深圳证券交易所上市交易。本基金(基金合同)生效3年期届满,本基金转为上市开放式基金(LOF)。

4、基金份额分级:本基金(基金合同)生效之日起三年内,本基金通过基金收益分配的安排,将基金份额分成预期收益与风险不同的两个级别,即回报A和回报B。除收益分配、基金合同终止时的基金清算财产分配和基金转换运作方式时的基金份额折算外,每份回报A和每份回报B享有同等的权利和义务。回报A和回报B分别按照本基金《基金合同》约定的比例进行初始配比,所聚集的两级基金的基金资产合并运作。其中,回报A根据本基金《基金合同》的规定获取预期约定收益,并自基金合同生效之日起每满6个月开放一次,接受申购与赎回;本基金在扣除回报A的应计收益后的全部剩余收益归回报B享有、亏损以回报B的资产净值为限,由回报B承担;回报B在本基金《基金合同》生效后封闭运作并上市交易,封闭期为3年。

5、基金存续期限:不定期

6、基金份额总额:488,462,429.13份,其中,回报A为341,921,612.50份,回报B为146,540,816.63份(截至2012年3月21日)

7、回报B的基金份额参考净值:0.9945元(截至2012年3月21日,金鹰持久回报分级债券型证券投资基金份额净值为0.9995元,回报A的基金份额净值为1.0016元)

8、本次上市交易的基金份额简称:回报B

9、回报B本次上市交易的基金份额总额:74,350,197.00份(截至2012年3月21日)

10、回报B的交易代码:150078

11、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所

12、上市交易日期:2012年3月28日

13、基金管理人:金鹰基金管理有限公司

14、基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司

15、本次上市交易的基金份额注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司

三、回报B的募集与上市交易

(一)回报B上市前基金募集情况

1、基金募集申请的核准机构和核准文号:中国证券监督管理委员会证监许可【2012】111号

2、基金运作方式:契约型

3、基金合同期限:不定期

4、回报B发售日期:自2012年2月20日至2012年3月2日

5、回报B发售价格:1.00元人民币

6、回报B发售方式:场内和场外。

7、回报B发售机构:

(1)场外销售机构

1)直销机构:金鹰基金管理有限公司

2)代销银行:中国工商银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、东莞农村商业银行、浙江民泰商业银行股份有限公司。

3)代销券商:广州证券有限责任公司、华福证券有限责任公司、方正证券有限责任公司、东海证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、国都证券有限责任公司、东莞证券有限责任公司、天风证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、江海证券有限公司、海通证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、国海证券股份有限公司、东吴证券有限责任公司、华安证券有限责任公司、中航证券有限公司、民生证券有限责任公司、五矿证券有限公司、中信证券(浙江)有限责任公司、招商证券股份有限公司、日信证券有限责任公司、中信建投证券股份有限公司、中国银河证券有限责任公司、大同投资咨询有限公司、长城证券有限责任公司、财通证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、国信证券股份有限公司、世纪证券有限责任公司、宏信证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、财富证券有限责任公司、万联证券有限责任公司、广发证券股份有限公司、中国国际金融有限公司、平安证券有限责任公司、山西证券股份有限公司。

(2)场内销售机构

场内销售机构为具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位,具体名单可在深交所网站查询。

8、验资机构名称:立信会计师事务所(特殊普通合伙)

9、本基金募集备案情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等相关法律、法规的规定以及《金鹰持久回报分级债券型证券投资基金基金合同》(以下简称"基金合同")的有关约定,本基金募集结果符合备案条件,本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续,并于2012年3月9日获中国证监会书面确认,本基金合同自该日起正式生效,基金合同生效之日起,本基金管理人正式开始管理本基金。募集资金已于2012年3月8日全额划入本基金在基金托管人中国邮政储蓄银行开立的基金托管专户。

10、基金合同生效日:2012年3月9日

11、基金合同生效日的基金份额总额:488,462,429.13份,其中,回报A为341,921,612.50份,回报B为146,540,816.63份。

(二)回报B上市交易的主要内容

1、基金上市交易的核准机构和核准文号:深证上【2012】63号

2、上市交易日期:2012年3月28日

3、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所。投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。

4、基金名称:金鹰持久回报分级债券型证券投资基金之回报B份额

场内简称:回报B

5、交易代码:150078

6、本次上市交易份额:74,350,197.00

7、基金资产净值及份额参考净值的披露:开放式基金每个工作日交易结束后对基金资产净值进行的估值。基金管理人每日对基金资产估值。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算,基金托管人复核。基金管理人于每个工作日交易结束后将经过基金托管人复核的回报B的基金份额参考净值传给深交所,深交所于次日通过行情系统揭示。

8、未上市交易份额的流通规定:未上市交易的份额托管在场外,基金份额持有人将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

截至2012年3月21日的场内基金份额持有情况:

场内基金份额持有人户数:20户

平均每户持有的场内基金份额:3,717,509.85份

场内机构投资者持有的基金份额及占场内基金总份额比例:机构持有72,004,058.00份,占96.8445%

场内个人投资者持有的基金份额及占场内基金总份额比例:个人持有2,346,139.00份,占3.1555%

场内基金前十名持有人情况:

序号	持有人名称(全称)	持有基金份额(份)	占场内总份额比例(%)
1	广发证券股份有限公司	40,001,666.00	53.80
2	广州证券有限责任公司	10,000,833.00	13.45
3	中国对外经济贸易信托有限公司-富锦9号信托计划	5,000,416.00	6.73
4	平安信托有限责任公司-新价值成长一期	5,000,416.00	6.73
5	中信信托有限责任公司-新价值1期	5,000,416.00	6.73
6	中海信托股份有限公司-新股约定申购资金信托(10)	5,000,228.00	6.73
7	哈尔滨华利机械设备有限公司	2,000,083.00	2.69
8	何荣天	1,000,041.00	1.35
9	贾军生	200,016.00	0.27
10	吴文起	200,008.00	0.27
	合计	73,404,123.00	98.73

注:由于四舍五入的原因,占场内总份额比例分项之和与合计可能有尾差。

五、基金主要当事人简介

(一)基金管理人

1、名称:金鹰基金管理有限公司

2、法定代表人:刘东

3、总经理:殷克胜

4、注册资本:2.5亿元人民币

5、注册地址:广东省珠海市吉大九洲大道东段商业银行大厦7楼16单元

6、设立批准文号:中国证监会证监基字【2002】97号

7、工商登记注册的法人营业执照文号:440000000056278

8、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。

9、存续期间:持续经营

10、股东及其出资比例:公司股东由广州证券有限责任公司、广州药业股份有限公司、广东美的电器股份有限公司、东亚联丰投资管理有限公司组成,四家股东的出资比例分别为49%、20%、20%、11%。

11、内部组织结构及职能:

投资管理部:

负责公司公募基金的投资管理工作。

研究发展部

在公司既定的投资理念和研究理念的基础上,以系统性的研究方法和高质量的研究成果为公司投资部门提供持续有效的支持。

集中交易部

负责执行各基金的投资指令并及时反馈市场信息。

固定收益投资部

负责公司固定收益证券的研究、投资工作。

专户投资部

负责特定客户资产管理业务。

金融工程部

负责公司量化投资管理工作,包括投资管理的绩效评估、风险的计量和控制等。

产品研发部

跟踪证券市场,研发合适的基金品种以及专户理财产品等。

市场拓展部机构客户部

负责公司销售渠道管理及服务工作。

运作保障部

负责公司计算机设备的维护及基金后台运作支持工作;基金的注册登记、清算和会计工作等。

监察稽核部

负责对公司管理和基金运作合法合规性进行全方位的严格监控,及时防范风险事件的发生以及对外信息披露。

综合管理部

负责公司财务管理、人事劳资管理、日常行政事务管理。

北京分公司、上海分公司、广州分公司

负责所在辖区的业务拓展工作。

12、人员情况

截至2012年12月31日,公司员工总数120人。

员工学历分布为:博士10人,占员工总数8.34%;硕士43人,占员工总数35.84%;本科55人,占员工总数45.84%;大专及以下学历12人,占员工总数10%。

13、信息披露负责人及咨询电话

苏文锋 020/83282627

14、基金管理业务情况

截至2012年3月末基金管理人旗下共管理10只基金,分别是金鹰成份股优选证券投资基金、金鹰中小盘精选证券投资基金、金鹰红利价值证券投资基金、金鹰持久回报分级债券型证券投资基金、金鹰行业优势股票型证券投资基金、金鹰稳健成长股票型证券投资基金、金鹰主题优势股票型证券投资基金、金鹰保本混合型证券投资基金、金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金、金鹰策略配置股票型证券投资基金以及金鹰持久回报分级债券型证券投资基金。

15、本基金基金经理

邱新红先生,(XINHONG QIU),卡内基梅隆大学计算金融专业硕士,南京大学物理系应用物理专业学士,证券从业经历8年。曾任职于美国太平洋投资管理公司(PIMCO),担任投资组合经理助理,2008年3月到2010年6月担任Bayview资产管理公司的投资经理,负责债券投资组合管理。2010年8月加入金鹰基金管理有限公司,担任债券研究员。现任本基金以及金鹰保本混合型证券投资基金基金经理。

本基金历任基金经理情况:邱新红先生从本基金基金合同生效之日起至今一直担任本基金基金经理。

(二)基金托管人

1、基金托管人基本情况

名称:中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区金融大街3号

成立时间:2007年3月6日

法定代表人:李国华

注册资本:450亿元人民币

联系电话:010-68858126

联系人:上瑛

2、主要人员情况

徐进,托管业务部总经理,14年金融从业经历,曾就职于中国邮政储蓄银行汇兑业务部、代理业务部,具有丰富的金融业务管理经验。

3、基金托管业务经营情况

2009年7月23日,中国邮政储蓄银行经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会联合批准,获得证券投资基金托管资格,是我国第16家托管银行。中国邮政储蓄银行坚持以客户为中心,以服务为基础的经营理念,依托专业的托管团队、灵活的托管业务系统、规范的托管管理制度、健全的内控体系、高作高效的业务处理模式,为广大基金公募基金、证券投资基金、社保基金、企业年金、银行理财产品、信托计划、券商资产管理计划等各种资产管理机构提供安全、高效、专业、全面的托管服务,并获得了合作伙伴一致好评。

截至2011年12月31日,中国邮政储蓄银行托管的证券投资基金共8只,包括中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)(166006)、长信中短债证券投资基金(519985)、东方保本混合型开放式证券投资基金(400013)、万家添利分级债券型证券投资基金(161908)、长信利鑫分级债券型证券投资基金(163003)、天弘丰利分级债券型证券投资基金(164208)、鹏华丰泽分级债券型证券投资基金(160618)、东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金(400015)。托管的特定客户资产管理计划共10只,其中6只已到期,包括南方-灵活配置之出口复苏1号资产管理计划、景顺长城基金-邮储银行-稳健配置型特定多个客户资产管理计划、银华灵活精选资产管理计划、长盛灵活配置资产管理计划、富国基金-邮储银行-绝对回报策略混合型资产管理计划、光大保德信-邮储银行-灵活配置1号客户资产管理计划、大成-邮储银行-灵活配置1号特定多个客户资产管理计划、银华灵活配置资产管理计划、长盛-邮储-灵活配置2号资产管理计划、南方灵活配置2号资产管理计划等。至今中国邮政储蓄银行已形成涵盖证券投资基金、基金公司特定客户资产管理计划、信托计划、银行理财产品(本外币)、私募基金等多种资产类型的托管产品体系,托管规模达421.12亿元。

(三)基金验资机构

名称:立信会计师事务所(特殊普通合伙)

住所:上海市黄浦区南京东路61号四楼

法定代表人:朱建弟

联系电话:021-63391166

经办注册会计师:张宁、黄毅杰

六、基金合同摘要

基金合同内容摘要见附件。

七、基金财务状况(未经审计)

(一)基金募集期间费用

本基金募集期未收取任何费用。

(二)基金上市前重要财务事项

本基金募集结束后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

(三)基金资产负债表

截至2012年3月21日,本基金资产负债表如下:

单位:人民币元

项目	行次	2012年3月21日
资产:		
银行存款	1	14,846,143.30
结算备付金	2	-
存出保证金	3	-
交易性金融资产	4	88,979,932.30
其中:股票投资	5	-
基金投资	6	-
债券投资	7	88,979,932.30
资产支持证券投资	8	-
衍生金融资产	9	-
买入返售金融资产	10	350,000,000.00
应收证券清算款	11	33,126,552.43
应收利息	12	1,469,634.03
应收股利	13	-
应收申购款	14	-
递延所得税资产	15	-
其他资产	16	-
资产总计	17	488,422,262.06
负债和所有者权益		
负债:		
短期借款	18	-
交易性金融负债	19	-
衍生金融负债	20	-
卖出回购金融资产款	21	-
应付证券清算款	22	-
应付赎回款	23	-
应付管理人报酬	24	112,078.35
应付托管费	25	32,022.39
应付销售服务费	26	56,039.17
应付交易费用	27	-
应交税费	28	-
应付利息	29	-
应付利润	30	-
递延所得税负债	31	-
其他负债	32	9,152.60
负债合计	33	209,292.51
所有者权益:		
实收基金	34	488,462,429.13
未分配利润	35	-249,459.58
所有者权益合计	36	488,212,969.55
负债和所有者权益总计	37	488,422,262.06

注:报告截至日2012年3月21日,金鹰持久回报分级债券型证券投资基金份额净值0.9995元,基金份额总额488,462,429.13份;回报A份额净值1.0016元,基金份额总额341,921,612.50份;回报B份额净值0.9945元,基金份额总额146,540,816.63份。

八、基金投资组合

截至2012年3月21日,金鹰持久回报分级债券型证券投资基金的投资组合如下:

(一)基金资产组合情况

单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	88,979,932.30	18.22
	其中:债券	88,979,932.30	18.22
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	350,000,000.00	71.66
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	14,846,143.30	3.04
6	其他各项资产	34,596,186.46	7.08
7	合计	488,422,262.06	100.00

(二)按行业分类的股票投资组合

本基金截至2012年3月21日止未持有股票。

(三)按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

本基金截至2012年3月21日止未持有股票。

(四)按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	131,259.70	0.03
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	88,848,672.60	18.20
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	88,979,932.30	18.23

(五)截至2012年3月21日按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细:

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	122775	11武城投	180,000	18,360,000.00	3.76
2	122921	10郴州债	168,970	16,989,933.50	3.48
3	122874	10红投01	120,000	11,578,800.00	2.37
4	122944	09株城投	113,240	11,350,045.20	2.32
5	122875	10红投02	110,000	10,543,500.00	2.16

(六)股资组合报告附注

1、声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2、声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金截至2012年3月21日止未持有股票。

3、其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	33,126,552.43
3	应收股利	-
4	应收利息	1,469,634.03
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	34,596,186.46

4、本基金持有的处于转股期的可转换债券明细及资产支持债券、分离交易可转债

截至2012年3月21日,本基金未持有处于转股期的可转换债券明细及资产支持债券、分离交易可转债。

5、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。

九、重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺:

(一)严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

(二)真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件,披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息,并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。

(三)在知悉可能对基金份额产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后,将及时予以公开澄清。

十一、基金管理人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺:

(一)严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定,设立专门的基金托管部,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。

(二)根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

(三)基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,并在限期内,随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。

(四)基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,将立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。

十二、备查文件目录

本基金备查文件包括下列文件:

(一)中国证监会核准金鹰持久回报分级债券型证券投资基金募集的文件;

(二)《金鹰持久回报分级债券型证券投资基金基金合同》;

(三)《金鹰持久回报分级债券型证券投资基金托管协议》;

(四)《金鹰持久回报分级债券型证券投资基金招募说明书》;

(五)法律意见书;

(六)基金管理人业务资格批件、营业执照;

(七)基金托管人业务资格批件和营业执照;

(八)中国证监会要求的其他文件。

存放地点:基金管理人和基金托管人的住所

查阅方式:基金投资者可在营业时间免费查阅,或通过指定的信息披露媒体、本基金管理人网站(www.gefund.com.com)查阅。

金鹰基金管理有限公司
2012年3月23日

附件:基金合同摘要

一、基金回当事人及权利义务

(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

注册地址:广东省珠海市吉大九洲大道东段商业银行大厦7楼16单元

办公地址:广东省广州市天河区体育西路189号城建大厦22、23楼

邮政编码:510620

法定代表人:刘东

成立时间:2002年12月25日

批准设立机关:中国证券监督管理委员会

批准设立文号:证监基金字【2002】97号

组织形式:有限责任公司

注册资本:2.5亿元人民币

存续期间:持续经营

联系电话:020-83936180

2、基金管理人的权利

(1)依法募集基金;

(2)自本基金合同生效之日起,依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产;

(3)依照本基金合同获得基金管理人报酬以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用;

(4)在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;

(5)根据本基金合同及有关规定监督基金托管人,对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为,对基金财产、其他基金当事人的利益造成重大损失的情形,应及时呈报中国证监会和银行业监督管理机构,并采取必要措施保护基金及相关基金当事人的利益;

(6)在符合有关法律法规和本基金合同的前提下,制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则,决定基金的除调高托管费和管理费之外的费率结构和收费方式;

(7)在基金合同约定的范围内,拒绝或暂停受理申购、赎回和转换申请;

(8)自行担任注册登记机构或选择、更换注册登记机构,并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查;

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

(10)依法召集基金份额持有人大会;

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

(12)依照有关规定为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利;

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

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

(15)法律法规、基金合同以及中国证监会规定的其他权利。

3、基金管理人的义务

(1)自基金合同生效之日起,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产;

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

(3)配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购和赎回业务;

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

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

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

(7)依法接受基金托管人的监督;

(8)如果基金合同提前终止,应当及时通知托管人,并采取必要措施保护基金财产的安全;

(9)保证在基金合同生效后三个工作日内向基金托管人提交基金份额持有人名册;

(10)按照规定编制基金份额持有人大会的会议文件,提前30日公布召集基金份额持有人大会的议案、议题、议事程序及注意事项,确定和公布监票人,然后由大会主持人宣读提案,经讨论后进行表决,组合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由基金管理人授权代表主持。在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下,由基金托管人授权代表主持;如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会,则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的50%以上(含50%)(本基金基金合同生效之日起3年内,指"出席大会的回报A和回报B各自的基金份额持有人和代理人所持表决权的50%以上(含50%)")选举产生一名基金份额持有人,作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人不出席或主持基金份额持有人大会,不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

(2)通讯方式开会

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

3、基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

(4)大会议形成的条件、表决方式、程序

1、基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。但在本基金基金合同生效之日起3年内,基金份额持有人大会的审议事项应分别由回报A、回报B的基金份额持有人独立进行表决。回报A、回报B的基金份额持有人持有的每一份基金份额在各自份额级别内拥有同等的权利。

2、本基金基金合同生效后3年期届满,本基金无需召开基金份额持有人大会,自动转型为上市开放式基金(LOF),上市开放式基金(LOF)份额持有人持有的每一基金份额享有同等的投票权。

(C)召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的,应当召开基金份额持有人大会:

(1)终止基金合同;

(2)转换基金运作方式,但本基金在基金合同生效后3年期届满时转型为上市开放式基金(LOF)除外;

(3)变更基金类别;

(4)变更基金投资目标、投资范围或投资策略(法律法规和中国证监会另有规定的除外);

(5)变更基金份额持有人大会程序;

(6)更换基金管理人、基金托管人;

(7)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外;

(8)本基金与其他基金的合并;

(9)基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会;

(10)单独或合计持有本基金总份额10%以上(含10%)基金份额的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算,下同)就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会;

(11)法律法规、基金合同以及中国证监会规定的其他权利。

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

(1)遵守法律法规、基金合同及其他有关规定;

(2)缴纳认购、申购款项及法律法规、基金合同和招募说明书规定的费用;

(3)在持有的基金份额范围内,承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任;

(4)不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动;

(5)执行生效的基金份额持有人大会决议;

(6)遵守基金管理人、基金托管人及销售机构和注册登记机构的相关交易及业务规则;

(7)返还在基金交易过程中因任何原因,自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利;

(8)法律法规、基金合同以及中国证监会规定的其他权利。

二、基金的基本情况

(一)基金的名称

在本基金合同生效之日起3年内,本基金的名称为"金鹰持久回报分级债券型证券投资基金",本基金的基金份额分为回报A、回报B两级份额;本基金合同生效后3年期届满,本基金转型为上市开放式基金(LOF),基金名称变更为"金鹰持久增利债券型证券投资基金(LOF)"。

(二)基金的类别

债券型证券投资基金

(三)基金的运作方式

契约型。

自本基金合同生效之日起3年内,回报A自基金合同生效之日起每满6个月开放一次,回报B封闭并上市交易,回报A和回报B的基金资产合并运作。本基金合同生效后3年期届满,本基金转型为上市开放式基金(LOF)。

(四)基金份额的分级

根据运作方式和风险收益特征的不同,将本基金的基金份额分为回报A、回报B两级份额:本基金合同生效之日,份额配比原则上不超过7:3。回报A根据基金合同的规定获得预期收益,并自基金合同生效之日起每满6个月开放一次;回报B在3年的封闭期内封闭运作,本基金在扣除回报A的应计收益后的全部剩余收益归回报B享有,亏损以回报B的资产净值为限由回报B承担。

本基金基金合同生效后3年期届满,本基金转型为上市开放式基金(LOF)后,本基金将不再进行基金份额分级。本基金转型为上市开放式基金(LOF)时,回报A基金份额持有人可选择将其持有的回报A份额赎回或是转入"金鹰持久增利债券型证券投资基金(LOF)",若回报A的份额持有人未作选择,其持有的回报A份额将被默认为转入"金鹰持久增利债券型证券投资基金(LOF)"份额;回报B基金份额持有人所持有的回报B份额将被默认为转入"金鹰持久增利债券型证券投资基金(LOF)"。

(五)基金的封闭期限

1、回报A的开放日

本基金基金合同生效之日起3年内,回报A在基金合同生效后每满6个月开放一次,接受投资者的申购与赎回。回报A的第一次开放日为基金合同生效日至满6个月的最后一个工作日;第二次开放日为基金合同生效之日至满12个月的最后一个工作日;以此类推,例如:如果本基金基金合同于2012年3月26日生效,基金合同生效之日起满6个月、满12个月、满18个月的对应日分别为2012年9月25日、2013年3月25日、2013年9月25日,以此类推。

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

2、回报B的封闭期及上市交易

回报B的封闭期自基金合同生效之日起至3年后对应日止。如该对应日为非工作日,则顺延至下一个工作日。本基金基金合同生效后3年内,在符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的前提下,回报B将申请在深圳证券交易所上市交易。本基金基金合同生效后3年期届满,本基金按照基金合同约定及深圳证券交易所规则转型为上市开放式基金(LOF)份额,转型后的基金份额将继续在深圳证券交易所上市交易。

(七)基金的最低募集份额总额和金额

基金募集份额总额不少于2亿份,基金募集金额不少于2亿元人民币。

(八)基金份额初始面值、认购费用、赎回费用

本基金基金份额、回报A份额、回报B份额的初始面值均为人民币1.00元。

本基金不收取认购费用;在回报B的封闭期内,若回报A的份额持有人于回报A的开放日赎回所持有的回报A的份额,不收取赎回费;自基金合同生效之日起3年期届满后,本基金转型为上市开放式基金(LOF),赎回费用由基金赎回人承担,赎回费率最高不超过5%。

(九)基金存续期限

不定期

三、基金份额折算

在开放日,根据净资产不变的原则,将回报A的基金份额折算为份额净值等于1元的回报A的份额若干;在基金合同生效后3年期届满日,根据净资产不变的原则,将回报A、回报B的基金份额折算为份额净值等于1元的金鹰持久增利债券型证券投资基金(LOF)份额若干。

四、基金份额持有人大会

(一)基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。

1、本基金基金合同生效之日起3年内,基金份额持有人大会的审议事项应分别由回报A、回报B的基金份额持有人独立进行表决。回报A、回报B的基金份额持有人持有的每一份基金份额在各自份额级别内拥有同等的权利。

2、本基金基金合同生效后3年期届满,本基金无需召开基金份额持有人大会,自动转型为上市开放式基金(LOF),上市开放式基金(LOF)份额持有人持有的每一基金份额享有同等的投票权。

(二)召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的,应当召开基金份额持有人大会:

(1)终止基金合同;

(2)转换基运作方式,但本基金在基金合同生效后3年期届满时转型为上市开放式基金(LOF)除外;

(3)变更基金类别;

(4)变更基金投资目标、投资范围或投资策略(法律法规和中国证监会另有规定的除外);

(5)变更基金份额持有人大会程序;

(6)更换基金管理人、基金托管人;

(7)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外;

(8)本基金与其他基金的合并;

(9)基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会;

(10)单独或合计持有本基金总份额10%以上(含10%)基金份额的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算,下同)就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会;

2、除自法律法规、基金合同和公示通知的规定,并且持有基金份额的代理人持有基金份额的委托人持有基金份额的证券投资基金管理人持有的登记资料相符;

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

(3)通讯开会方式

在同时符合以下条件时,通讯会议方式可举行:

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

2)召集人在基金托管人(如果基金托管人为召集人,则为基金管理人)和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见,基金管理人或基金托管人经通知拒不参加收取和统计书面表决意见的,不影响表决效力;

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代表的基金份额应占权益登记日基金总份额的50%(含50%),(本基金基金合同生效之日起3年内,指"基金份额持有人所持有的回报A和回报B各自的基金份额分别合计不小于权益登记日该基金总份额的50%(含50%)")。

4)直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代表,同时提交的持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定,并且持有基金份额的凭证与基金注册登记机构记录相符;

5)会议通知公示前报中国证监会备案。

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