金鹰保本混合型证券投资基金更新的招募说明书摘要

2014年第1号

基金管理人:金鹰基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

2014年5月20日

【重要提示】

金鹰保本混合型证券投资基金(以下简称"本基金")根据2011年3月23日中国证券监督管理委员会《关于核准金鹰保本混合型证券投资基金募集的批复》(证监许可【2011】436号)和2011年3月31日《关于金鹰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【2011】196号)进行募集。本基金的基金合同经中国证监会基金监管部于2011年5月17日备案确认(基金部函【2011】315号)后正式生效。本基金的第一个保本期起始于 2011 年 5 月17 日,并于 2014 年5 月19日到期。本基金第一个保本周期到期后,根据在符合基金合同规定的保本基金存续的条件下,本基金转入第二个保本期并与第二保本周期保本责任的担保人广州越秀金融控股集团有限公司签订了保证合同。

针对本基金转入第二个保本周期以及第二个保本期担保人的变更, 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《金鹰保本混合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,基金管理人对《金鹰保本混合证券投资基金基金合同》进行了修改,并于 2014 年5月6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2014年5 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。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

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

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,应全面了解本基金的产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等等。

本基金为保本混合型基金,第二个保本周期为三年,投资者在第二个保本周期开始前的过渡期申购或从第一个保本周期转入到第二个保本周期,并持有到期的基金份额存在着仅能收回本金的可能性;未持有到期的基金份额,投资者赎回或转换出时不能获得保本担保,将承担市场波动的风险。此外,投资者投资于保本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构,如果发生《基金合同》约定的不适用保本条款的情形,投资者在第二个保本周期开始前的过渡期申购或从第一个保本周期转入到第二个保本周期,并持有到期的基金份额亦存在着无法收回本金的可能性。第二个保本周期到期后,本基金可能到期终止或转入下一保本周期或根据《基金合同》的约定转为其他类型基金,到期具体操作以届时公告为准。

投资人购买本基金时应认真阅读本基金的基金合同、担保合同、招募说明书。基金管理人建议投资人根据自身的风险收益偏好,选择适合自己的基金产品,并且中长期持有。投资者购买本基金份额的行为视为同意保证合同的约定。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本招募说明书已经本基金托管人复核。除非另有说明,本招募说明书所载内容截止日为2014年5月17日,有关财务数据截止日为2014年3月31日,净值表现截止日为2014年3月31日,本报告中财务数据未经审计。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:金鹰基金管理有限公司
注册地址:广东省珠海市吉大九洲大道东段商业银行大厦7楼16单元
办公地址:广东省广州市天河区体育西路189号22-23层
设立日期:2002年12月25日
法定代表人:刘东
联系电话:020-83282855
联系人:祝红
注册资本:人民币2.5亿元
股权结构:

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

(二)主要人员情况

1、公司董事和监事

刘东先生,董事长,经济学硕士,高级经济师。曾在中国现代国际关系研究所、中国信达信托投资公司驻武汉证券交易中心任职,历任中国信达信托投资公司北京营业部总经理、证券业务总部副总经理,新疆宏源信托投资股份有限公司总经理助理兼证券业务总部总经理,宏源证券股份有限公司党委委员、副总经理,宏源期货有限公司董事长,现任广州证券有限责任公司总经理。经公司第三届董事会第十六次会议选举通过,并报经中国证监会核准,2010年4月起担任公司董事长。

郑德珵先生,董事,留美经济学博士,教授,高级经济师。历任广州中山大学管理学院讲师、副教授,美国乔治华盛顿大学助教,美国华盛顿投资咨询公司副研究员,美国世界银行政策研究局转型经济处经济顾问。现任广州证券有限责任公司副总经理、首席经济学家,兼任广州风险投资促进会会长,广州市政协委员,上市公司独立董事等。

王静女士,董事,企业管理硕士。历任美的集团资本运营项目助理,资产重组经理,现任美的集团资产重组高级专员。

温婉容女士,董事,商科毕业。历任德盛安联资产管理香港有限公司市场及传媒经理、景顺投资管理亚洲有限公司副总裁、德意志资产管理(香港)有限公司区域销售总监、Societe Generale Asset Management Asia Ltd.高级副总裁、德盛安联资产管理香港有限公司行政总裁、香港财务策划师学会行政总裁等职。2011年7月加入东亚联丰投资管理有限公司,现任东亚联丰投资管理有限公司行政总裁。

陈炳华先生,董事,硕士,会计师。曾任广州白云山医药集团股份有限公司财务部部长,现任广州白云山医药集团股份有限公司财务总监。

吴晓球先生,独立董事,国民经济管理学博士。历任江西省余江县商业局秘书、中国人民大学经济研究所主任、中国人民大学财政金融学院副院长、中国人民大学研究生院副院长,现任中国人民大学校长助理、财政金融学院常务副院长、金融与证券研究所所长、教授、博导。

杜金岷先生,独立董事,博士、教授、博士生导师。历任高校讲师、副教授,现任暨南大学教授、暨南大学社会科学研究处处长、副院长,广东中青年经济工作者学会副秘书长,广东经济学会常务理事,中华外国经济学说研究会理事、广东金融学会理事、广州留学归国人员协会理事等。

黄元生先生,独立董事,经济学硕士、副教授、高级会计师。历任中山大学会计教研室主任及会计系副主任,广州市康乐会计师事务所副所长及所长,现任广州万隆康正会计师事务所主任会计师。

颜俊先生,独立董事,法学硕士、法学博士生,资深合伙人、律师。曾为广东华邦世纪律师事务所的创始合伙人、北京市金杜律师事务所资深合伙人。现任安徽国祯环保节能科技股份有限公司独立董事,北京市君泽君律师事务所资深合伙人。

刘晓东先生,监事,工商管理硕士。曾任深圳市审计局主任科员,招商银行总行稽核部高级审计师,鹏华基金管理有限公司监察稽核部副总监,金鹰基金管理有限公司监察稽核部总监。

曾巧女士,监事,管理学学士。历任佛山会计师事务所审计助理、美的集团审计部审计经理、美的集团审计监察部副部长,现任美的集团审计监察部总监。

姚万义先生,监事,大学本科。历任中共北京市纪律检查委员会北京市监察局办公厅主任、副局长、常委等职,中国证监会北京证管办副主任、巡视员等职,现任北京证券业协会顾问。

2、公司高级管理人员

殷克胜先生,总经理,经济学博士。曾在综合开发研究院(中国深圳)、深圳市体改办任职,历任深圳证监局法规处副处长、上市公司处处长,鹏华基金管理有限公司董事、常务副总经理,方正证券有限责任公司基金公司筹备组组长等职。经公司第三届董事会第十六次会议选举通过,并报经中国证监会核准,2010年4月起担任公司总经理。

刘葆先生,副总经理,经济学博士,副教授。历任深圳国资经营公司(商贸控股)资产经营部总经理助理,上海复旦大学博士后流动站(金融研究方向)博士后研究员,深圳华强集团资本经营部副部长,广州越秀集团资本经营部副经理,广州证券有限责任公司总经理助理兼资产管理总部总经理,金鹰基金管理有限公司总经理助理等职。经公司第二届董事会第二十一次会议审议通过,并报经中国证监会核准,2008年12月起担任公司副总经理。

郭容辰女士,副总经理,法律硕士。历任交通银行深圳分行公司业务部科长、交通银行深圳华富支行行长助理、交通银行深圳福田支行行长、交通银行深圳分行个人金融部总经理、零售信贷管理部总经理、华夏银行深圳分行个人业务部总经理等职。经公司第三届董事会第十九次会议审议通过,并报经中国证监会核准,2010年10月起担任公司副总经理。

苏文锋先生,督察长,经济学硕士。历任广州市经济管理干部学院外贸经济系党支部书记,南方证券广州分公司研究发展部总经理,南方证券广州分公司大德路营业部总经理,南方证券广州分公司办公室主任,南方证券广州分公司投资银行部总经理,华鼎担保投资有限公司副总经理等职,金鹰基金管理有限公司市场拓展部副总监等职。经公司第二届董事会第二十一次会议审议通过,并报经中国证监会核准,2008年9月起担任公司督察长。

3、本基金基金经理

邱新红(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11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,现任固定收益部总监,兼任本基金、金鹰持久回报分级债券型证券投资基金、金鹰元丰保本混合型证券投资基金、金鹰元盛分级债券型发起式证券投资基金以及金鹰元安保本混合型证券投资基金基金经理。

洪利平女士,西南财经大学金融学硕士毕业,证券从业经历5年。洪利平女士曾任职于生命人寿保险股份有限公司,任债券交易员。2010年7月加入金鹰基金管理公司任债券研究员,现任本基金、金鹰元丰保本混合型证券投资基金以及金鹰货币市场证券投资基金基金经理。

4、固定收益投资决策委员会成员

本基金采取集体投资决策制度,固定收益投资决策委员会成员有:
殷克胜先生,固定收益投资决策委员会主席,总经理;
邱新红先生,固定收益投资决策委员会委员,固定收益部总监,基金经理;
杨绍基先生,固定收益投资决策委员会委员,首席投资官,基金经理;
杨刚先生,固定收益投资决策委员会委员,研究发展部总监;
林昆先生,固定收益投资决策委员会委员,集中交易部总监。

5、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

本基金之基金托管人为中国工商银行股份有限公司,基本情况如下:
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,邮编:100140
成立时间:1984年1月1日
法定代表人:姜建清
注册资本:人民币349,018,545,827元
联系电话:010-66105799
联系人:赵会军

三、基金担保人

名称:广州越秀金融控股集团有限公司
住所:广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔写字楼第63层01-B单元
邮政编码:510620
注册地址:广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔写字楼第63层01-B单元
法定代表人:张招兴
成立日期: 1992年11月24日
注册资本: 30.537亿元人民币
联系人:王奇智
联系电话:(020)88836888
组织形式:有限责任公司(法人独资)
经营范围:利用自有资金进行对外投资(法律法规禁止投资的项目除外);企业管理。

四、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层
法定代表人:刘东
总经理:殷克胜
成立时间:2002年12月25日
批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基金字【2002】97 号
组织形式:有限责任公司
注册资本:2.5亿元人民币
存续期间:持续经营
联系人:潘晓毅
联系电话:020-83282950
传真电话:020-83283445
客户服务及投诉电话:4006-135-888
电子邮箱:csmail@gefund.com.cn
网址:www.gefund.com.cn

2、代销机构(排名不分先后)

(1)名称:中国工商银行股份有限公司
注册(办公)地址:北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人:姜建清
联系人:王佺
电话:010-66107900
客服电话:95588(全国)
网址:www.icbc.com.cn

(2)名称:中国银行股份有限公司
注册(办公)地址:北京市复兴门内大街1 号
法定代表人:田国立
联系人:宁敏
电话:010-66594977
客服电话:95566(全国)
网址:www.bankofchina.com

(3)名称:交通银行股份有限公司
注册(办公)地址:上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人:牛锡明
电话:(021)58781234
联系人:曹榕
客户服务电话:95559
网址:www.bankcomm.com

(4)名称:中信银行股份有限公司
注册(办公)地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
法定代表人:常振明
联系人:郭伟
电话:010-65557048
客服电话:95558(全国)
网址:bank.ecitic.com

(5)名称:中国民生银行股份有限公司
注册(办公)地址:北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人:董文标
联系人:董云巍
电话:010-58351666
客服电话:95568(全国)
网址:www.cmbc.com.cn

(6)名称:上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区浦东南路500号
办公地址:上海市中山东一路12号
法定代表人:吉晓辉
联系人:虞谷云
电话:021-61618888
客服电话:95528(全国)
网址:www.spdb.com.cn

(7)名称:广东顺德农村商业银行股份有限公司
注册(办公)地址:佛山市顺德区大良德和居委会拥翠路2号
法定代表人:吴海恒
联系人: 何浩华
联系电话:0757-22388928
客服电话:0757-22223388
网址:www.sdebank.com

(8)名称:宁波银行股份有限公司
注册(办公)地址: 宁波市江东区中山东路294 号
法定代表人:陆华裕
联系人:胡技勋
电话:021-63586210
客服电话:96528(上海地区962528)
网址:www.nbcb.com.cn

(9)名称:平安银行股份有限公司
注册(办公)地址:深圳市深南中路1099号平安银行大厦
法定代表人:孙建一
联系人:蔡宇洲
电话:0755-22197874
客服电话:4006699999
网址:bank.pingan.com

(10)名称:东莞农村商业银行股份有限公司
注册(办公)地址:东莞市南城路2号
法定代表人:何沛良
联系人:黄飞燕
电话:0769-23394102
客服电话:0769—961122
网址:www.dgrcc.com

(11)名称:华夏银行股份有限公司
注册(办公)地址:北京市东城区建国门内大街22号
法定代表人:吴建
联系人: 郑鹏
联系电话:010-85238667
客服电话:95577
网址:www.hxb.com.cn

(12)名称:浙江民泰商业银行股份有限公司
注册(办公)地址:浙江省温岭市三星大道168号
法定代表人:江建法
联系人: 刘兴龙
电话:0576-86109521
客服电话:96521 省外客服电话:4008896521
网址:www.mintaibank.com

(13)名称:成都农村商业银行股份有限公司
注册(办公)地址:四川省成都市武侯区科华中路88号
法定代表人:陈萍
联系人:张海涛
电话:028-85190961
客服电话:4006-028-666
网址:www.cdrcb.com

(14)名称:江苏江南农村商业银行股份有限公司
注册(办公)地址:常州市天宁区延陵中路668号
法定代表人:陆向阳
联系人:韩璐
联系电话:0519-89995066
客服电话:96005(全国)
网址:http://www.jnbank.cc/zh_CN/

(15)名称:包商银行股份有限公司
注册(办公)地址:内蒙古包头市钢铁大街6号
法定代表人:李镇西
联系人:刘芳
联系电话:0472-5109729
客服电话:96016(内蒙、北京),967210(深圳、宁波),65558555(成都)
网址:www.bsb.com.cn

(16)名称:浙江稠州商业银行股份有限公司
注册地址:浙江省义乌市江滨路义乌乐园东侧
办公地址:浙江省杭州市延安路128号
法定代表人:金子军
联系人:张予多
联系电话:(0571)96527
客服电话:(0571)96527
网址:www.czcb.com.cn

(17)名称:广州证券有限责任公司
注册(办公)地址:广东省广州市珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心19-20楼
法定代表人:刘东
联系人:林洁茹
联系电话:020-88836999
客服电话:020-961303
网址:www.gzs.com.cn

(18)名称:国泰君安证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区商城路618号
办公地址:上海市银河中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人:万建华
联系人:芮敏琪
电话:021-38676666-6161
客服电话:95521(全国)
网址:www.gtja.com

(19)名称:中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦2-6层
办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人:顾伟国
联系人:田薇
电话:010-66568430
客服电话:4008888888
网址:www.chinastock.com.cn

(20)名称:海通证券股份有限公司
注册(办公)地址:上海市淮海中路 98 号
法定代表人:王开国
联系人:王立群
电话:021-23219286
客服电话:95533(全国)、4008888001
网址:www.htsec.com

(21)名称:广发证券股份有限公司
注册(办公)地址:广州市天河区天河北路183-187号大都会广场43楼
法定代表人:孙树明
联系人:黄兰
电话:020-87555888-333
客服电话:95575(全国)
网址:www.gf.com.cn

(22)名称:国信证券股份有限公司
注册(办公)地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人:何如
联系人:周洋
电话:0755-82133066
客服电话:95536(全国)
网址:www.guosen.com.cn

(23)名称:招商证券股份有限公司
注册(办公)地址:深圳福田区益田路江苏大厦 38-45 层
法定代表人:宫少林
联系人:林生迎
电话:0755-82960223
客服电话:95565(全国)、4008888111
网址:www.newone.com.cn

(24)名称:光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闸路1508号
办公地址:上海市浦东新区浦东南路528号上海证券大厦南塔16楼
法定代表人:薛峰
联系人:李芳芳
电话:021-22169089
客服电话:95525(全国)、4008888788
网址:www.ebscn.com

(25)名称:中信万通证券有限责任公司
注册地址:青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层(1507-1510室)
办公地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层
法定代表人:杨宝林
联系人: 吴忠超
电话:0532-85022326
客服电话:0532-96577
网址:www.zxwt.com.cn

(26)名称:安信证券股份有限公司
注册(办公)地址:深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元
法定代表人:牛冠兴
联系人:郑向溢
电话:0755-82558038
客服电话:4008001001
网址:www.essence.com.cn

(27)名称:中国中投证券有限责任公司
注册(办公)地址:深圳福田区益田路6003号荣超商务中心A座18-21层
法定代表人:龙增来
联系人:范雪玲
电话:0755-82023431
客服电话:4006008008
网址:www.cjis.cn

(28)名称:平安证券有限责任公司
注册(办公)地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
法定代表人:杨宇翔
联系人:袁月
电话:0755-22627802
客服电话:4008816168
网址:www.stock.pingan.com

(29)名称:湘财证券有限责任公司
注册地址:湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴958号华能联合大厦5楼
法定代表人:林俊波
联系人:鲁雁先
电话:021-68865020
客服电话:4008881551、021-38784525
网址:www.xcsc.com

(30)名称:国元证券股份有限公司
注册(办公)地址:合肥市寿春路179号国元大厦
法定代表人:凤良志
联系人: 李蔡
电话:0551-2272101
客服电话:95578(全国)
网址:www.gyzq.com.cn

(31)名称:宏源证券股份有限公司
注册地址: 新疆乌鲁木齐市文艺路233 号
办公地址: 新疆乌鲁木齐市文艺路233 号宏源大厦
北京市西城区太平桥大街19 号
法定代表人:冯戎
联系人:李巍
电话:010-88085338
客服电话: 4008000562
网址:www.hysec.com

(32)名称:国盛证券有限责任公司
注册地址:江西省南昌市永叔路15号
办公地址:江西省南昌市永叔路15号信达大厦10-13楼
法定代表人:曾子普
联系人:徐美云
电话:0791-6285337
客服电话:0791-6272572
网址:www.gsstock.com

(33)名称:山西证券股份有限公司
注册(办公)地址:山西省太原市府西街69号国际贸易中心
法定代表人:侯巍
联系人:孟婉娉
电话:0351-8686703
客服电话:4006661618
网址:www.i618.com.cn

(34)名称:财通证券有限责任公司
注册(办公)地址:浙江省杭州市解放路111号金钱大厦
法定代表人:沈继宁
联系人:乔骏
电话:0571-87925129
客服电话:0571-96336(上海地区962336)
网址:www.ctsec.com

(35)名称:万联证券有限责任公司
注册(办公)地址:广州市中山二路18号电信广场36-37层
法定代表人:张建军
联系人:罗创滨
电话:020-37865070
客服电话:4008888133
网址:www.wlzq.com.cn

(36)名称:东莞证券有限责任公司
注册(办公)地址:广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼
法定代表人:张运勇
联系人:苏卓仁
电话:0769-22112062
客服电话:0769-961130
网址:www.dgzq.com.cn

(37)名称:西南证券股份有限公司
注册(办公)地址:重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦A幢
法定代表人:余维佳
联系人:米兵
电话: 023-63786922
客服电话:4008096096
网址:www.swsc.com.cn

(38)名称:东吴证券股份有限公司
注册(办公)地址:苏州工业园区翠园路181号商旅大厦
法定代表人:吴永敏
联系人:方晓丹
电话:0512-65581136
客服电话:0512-96288
网址:www.dwzq.com.cn

(39)名称:申银万国证券股份有限公司
注册(办公)地址:上海市常熟路171号
法定代表人:储晓明
联系人:曹晔
电话:021-54047892
客服电话:021-962505
网址:www.sywg.com

(40)名称:长江证券股份有限公司
注册(办公)地址:湖北省武汉市江汉区新华路特8号
法定代表人:胡运钊
联系人:李良
电话:021-63219781
客服电话:4008888999
网址:www.cjsc.com.cn

(41)名称:齐鲁证券有限公司
注册(办公)地址:山东省济南市经十路20518号
法定代表人:李玮
联系人:傅咏梅
电话:0531-87107718
客服电话:95538(全国)
网址:www.qlzq.com.cn

(42)名称:国联证券股份有限公司
注册(办公)地址:无锡市县前东街168号
法定代表人:雷建辉
联系人:徐欣
电话:0510-82831662
客服电话:4008885288、0510-82588168
网址:www.glsc.com.cn

(43)名称:爱建证券有限责任公司
注册(办公)地址:上海市南京西路758号23楼
法定代表人:郭林
联系人:陈敏
电话:021-32229888
客服电话:021-63340678
网址:www.ajzq.com

(44)名称:中国国际金融有限公司
注册(办公)地址:北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
法定代表人:金立群
联系人:黄峻敏
电话:0755-83196491
客服电话:010-65051166
网址:www.cicc.com.cn

(45)名称:财富证券有限责任公司
注册(办公)地址:长沙市芙蓉中路二段８０号顺天国际财富中心２６层
法定代表人:孙郑勇
联系人:郭蕾
电话:0731-84403319
客服电话:0731—84403350
网址:www.cfzq.com

(46)名称:信达证券股份有限公司
注册(办公)地址:北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层
法定代表:张志刚
联系人:唐静
电话: 010-63080985
客服电话:4008008899
网址:www.cindasc.com

(47)名称:华福证券有限责任公司
注册(办公)地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8层
法定代表:黄金琳
联系人:张腾
电话:0591-87383623
客服电话:0591-96326
网址:www.gfhfzq.com.cn

(48)名称:方正证券股份有限公司
注册(办公)地址:湖南长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
法定代表人:雷杰
联系人:邵艳霞
电话:0731-85832507
客服电话:95571(全国)
网址:www.foundersc.com

(49)名称:中信证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层
办公地址:北京市朝阳区新源南路6号京城大厦3层
法定代表人:王东明
联系人:陈忠
电话:010-84683893
客服电话:0755-83478806等
网址:www.cs.ecitic.com

(50)名称:长城证券有限责任公司
注册(办公)地址:深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层
法定代表人:黄耀华
联系人:匡婷
电话:0755-83516289
客服电话:4006666888
网址:www.cgws.com

(51)名称:财达证券有限责任公司
注册(办公)地址:河北省石家庄市自强路35号庄家金融大厦23层
法定代表人:翟建强
联系人:胡士光
电话:0311-66006403
客服电话:4006128888
网址:www.s10000.com

(52)名称:世纪证券有限责任公司
注册(办公)地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦41楼
法定代表人:卢长才
联系人:张婷
电话:0755-83199599-8246
客服电话:0755-83199599
网址:www.csco.com.cn

(53)名称:华龙证券有限责任公司
注册(办公)地址:甘肃省兰州市静宁路 308 号
法定代表人:李晓安
联系人:李昕田
电话:0931-4890208
客服电话:0931-8888088等
网址:www.hlzqgs.com

(54)名称:华泰证券股份有限公司
注册(办公)地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人:吴万善
联系人:程高峰、万鸣
电话:025-83290979
客服电话:95597
网址:www.htsc.com.cn

(55)名称:天风证券股份有限公司
注册(办公)地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼
法定代表人:余磊
联系人:陈璐
电话:027-87618882
客服电话:027-87618882
网址:www.tfzq.com

(56)名称:华安证券股份有限公司
注册地址:合肥市长江中路357号
办公地址:合肥市阜南路166号
法定代表人:李工
联系人:甘霖
电话:0551-5161821
客服电话:96518、4008-096-518
网址:www.hazq.com

(57)名称:民生证券股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区朝阳门外大街16号1901室
办公地址:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16层
法定代表人:岳献春
联系人:赵明
电话:010-85127622
客服电话:400-619-8888
网址:www.mszq.com

(58)名称:国都证券有限责任公司
注册(办公)地址: 北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
法定代表人: 常喆
联系人: 黄静
电话:010-84183389
客服电话: 400-818-8118
网址:www.guodu.com

(59)名称:华创证券有限责任公司
注册(办公)地址:贵州省贵阳市中华北路216号华创大厦
法定代表人:陶永泽
联系人:陈文静
联系电话:0851-8596285
客服电话:960872
网址:www.hczq.com

(60)名称:红塔证券股份有限公司
注册(办公)地址:云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
法定代表人:况雨林
联系人:刘晓明
电话:0871-3577942
客服电话:0871-3577888
网址:www.hongtastock.com

(61)名称:英大证券有限责任公司
注册(办公)地址:深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
法定代表人:赵文安
联系人:王睿
联系电话:0755-83007069
客服电话:4008-698-698
网址:www.ydsc.com.cn

(62)名称:天相投资顾问有限公司
注册地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座4层
法定代表人:林义相
联系人:莫晓丽
电话:010-66045529
客服电话:010-66045678
网址:www.txsec.com

(63)金元证券股份有限公司
注册地址:海口市南宝路36号证券大厦4楼
办公地址:深圳市深南大道4001号时代金融中心大厦17楼
法定代表人:陆涛
联系人:马贤清
联系电话:0755-83025022
客服电话:4008-888-228
网址: www.jyzq.cn

(64)名称:五矿证券有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公楼47层01单元
办公地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心49层
法定代表人:张永衡
联系人: 高克南
联系电话:0755-82545707
客服电话:40018-40028
网址:www.wkzq.com.cn

(65)名称:中航证券有限公司
注册(办公)地址:江西省南昌市红谷滩新区红谷大道1619号国际金融大厦A座41楼
法定代表人:王宜四
联系人:余雅娜
电话:0791-6768763
客服电话:400-8866-567
网址:www.avicsec.com

(66)名称:江海证券有限公司
注册(办公)地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人: 孙名扬
联系人: 高悦铭
联系电话:0451-82337802
客服电话:400-666-2288
网址:www.jhzq.com.cn

(67)名称:东海证券有限责任公司
注册地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18、19号楼
办公地址:上海浦东新区东方路989号中达广场
法定代表人:刘化军
联系人:霍晓飞
电话:021-50586660-8644
客服电话:4008888588、0519-88166222(常州地区)、021-52574550(上海地区)、0379-64902266(洛阳地区)
网址:www.longone.com.cn

(68)名称:日信证券有限责任公司
注册(办公)地址:内蒙古自治区内蒙古呼和浩特市锡林南路18号
法定代表人:孔佑杰
联系人:陈韦杉
联系电话:010-88086830
客服电话:010-88086830
网址:www.rxzq.com.cn

(69)名称:浙商证券股份有限公司
注册(办公)地址:浙江杭州市杭大路１号黄龙世纪广场Ａ－６／７楼
法定代表人:吴承根
联系人:许嘉行
联系电话:0571-87901912
客服电话:0571-967777
网址: www.stocke.com.cn

(70)名称:华宝证券有限责任公司
注册(办公)地址:上海市陆家嘴环路未来资产大厦27层
法定代表人:陈林
联系人:宋歌
联系电话:021-50122086
客服电话:021-38929908、400-820-9898
网址:www.cnhbstock.com

(71)名称:国海证券股份有限公司
注册(办公)地址:广西南宁市滨湖路46号
法定代表人:张雅锋
联系人:牛孟宇
电话:0755-83709350
客服电话:95563
网址:www.ghzq.com.cn

(72)名称:中信证券(浙江)有限责任公司
注册(办公)地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19-20层
法定代表人:沈强
联系人:丁思聪
电话:0571-87112510
客服电话:96598
网址:www.bigsun.com.cn

(73)名称:新时代证券有限责任公司
注册(办公)地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
法定代表人:刘汝军
联系人:孙恺
电话:010-83561149
客服电话:4006-989898
网址:www.xsdzq.cn

(74)名称:中信建投证券股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市朝阳门内大街188号
法定代表人:王常青
联系人:权唐
电话:010-85130577
客服电话:4008888108
网址:www.csc108.com

(75)名称:深圳众禄基金销售有限公司
办公(办公)地址:深圳市深南东路5047号发展银行大厦25层I、J单元
法定代表人:薛峰
联系人:张玉静
电话:0755-33227953
客服电话:4006-788-887
网址:众禄基金网(www.zlfund.cn)、基金买卖网(www.jjmmw.com)

(76)名称:上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址:上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906室
法定代表人:杨文斌
联系人:蒋章
电话:021-58870011-6618
客服电话:400-700-9665
网址:好买基金网(www.ehowbuy.com)

(77)名称:杭州数米基金销售有限公司
注册地址:杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号12层
法定代表人:陈柏青
联系人:周嬿旻
电话:0751-28829790
客服电话:4000-766-123、0571-28829123
网址:数米基金网(www.fund123.cn)

(78)名称:上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人:张跃伟
联系人:沈雯斌
电话:021-58788678-8201
客服电话:400-089-1289
网址:长量基金销售网(www.erichfund.com)

(79)名称:浙江同花顺基金销售有限公司
办公(办公)地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903
法定代表人:李晓涛
联系人:杨翼
电话:0571-88911818
客服电话:0571-88920897
网址:同花顺基金销售网(www.ijijin.cn)

(80)名称:诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴银城中路68号时代金融中心8楼801
法定代表人:汪静波
联系人:方成
电话:021-38602377
客服电话:400-821-5399
网址:www.noah-fund.com

(81)名称:北京展恒基金销售有限公司
注册地址:北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
办公地址:北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦6层
法定代表人:闫振杰
联系人:李二鋼
电话:010-85188234
客服电话:400-888-6661
网址:展恒基金理财平台(www.myfund.com)

(82)名称:上海天天基金销售有限公司
注册地址:浦东新区峨山路613号6幢551室
办公地址:上海市徐汇区龙田路195 号3C 座9 楼
法定代表人:其实
联系人:潘世友
电话:021-54509998
客服电话: 400-1818-188
网址:天天基金网(www.1234567.com.cn)

(83)名称:中期时代基金销售(北京)有限公司
办公地址:北京市朝阳区建国门外光华路16号1幢11层
法定代表人:路瑶
联系人:徐亮
电话:010-59539955
客服电话:95162或4008888160
网址:中期金融超市(www.cifcofund.com)

(84)名称:万银财富(北京)基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内3201单元
办公地址:北京朝阳区北四环中路27号盘古大观3201
法定代表人:李招弟
联系人:高晓芳
联系电话:010-59393923-811
客服电话:400-808-0069
网址:www.wy-fund.com

(85)名称:和讯信息科技有限公司
办公地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦1002室
法定代表人:王莉
联系人:李延鹏
电话:0755-82721122-8625
客服电话:400-920-0022
网址:和讯理财客(http://licaike.hexun.com)

(86)名称:北京钱景财富投资管理有限公司
注册地址:北京市海淀区海淀南路13号楼6层616室
办公地址:北京市海淀区中关村西区丹棱街中关村金融大厦10层1008室
法定代表人:赵荣春
联系人:魏争
联系电话:010-57418829
客服电话:400-688-5958
网址:www.eqianjing.com

(87)名称:北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室
办公地址:北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层
法定代表人:梁越
联系人:陈攀
联系电话:010-57756019
客服电话:4007-868-868
网址:www.chtfund.com

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代理销售本基金,并及时公告。

(二)注册登记机构

名称:金鹰基金管理有限公司
注册地址:广东省珠海市吉大九洲大道东段商业银行大厦7楼16单元
办公地址:广东省广州市天河区体育西路189号城建大厦22-23层
法定代表人:刘东
电话:020-83284983
传真:020-83282856
联系人:傅军

(三)律师事务所和经办律师

名称:广东岭南律师事务所
办公地址:广州市新港西路135号中山大学西门科技园601-605室
法定代表人:黄添顺
电话:020-84035397
传真:020-84113152
经办律师:江亚芳、陈进学、王欢

(四)会计师事务所和经办注册会计师

名称:中审亚太会计师事务所
住所:北京市海淀区复兴路47号天行建商务大厦22-23层
法定代表人:杨池生
电话:010-51716801、51716803、51716807
传真:010-51716790
邮编:100036
经办注册会计师:韩振平、王兵

五、基金的名称

本基金名称:金鹰保本混合型证券投资基金
本基金简称:金鹰保本混合
本基金代码:210006

六、基金的类型

本基金类型:契约型开放式

七、基金的保本

(一)保本

本基金为基金份额持有人在当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期并持有到期的基金份额提供的保本额为:在当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期并持有到期的基金份额×1.00元人民币。

在保本周期到期日, 如按基金份额持有人在当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上相应基金份额在当期保本周期内的累计分红款金额之和计算的总金额高于或等于保本额,基金管理人将按可赎回金额支付给基金份额持有人;如基金份额持有人在当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上相应基金份额在当期保本周期内的累计分红金额之和低于保本额,差额部分即为保本赔付差额。详细赔付程序请参见《招募说明书》"第十五、基金保本的保证"之第(五)条。但基金份额持有人未持有到期而赎回或转换出的,赎回或转换出的部分不适用本条款;在保本周期内申购的基金份额,除担保人书面对其承诺保本并提供担保外,不适用本条款。

(二)保本周期

3年,亦称为当期保本周期,特指本基金第二个保本周期。

本基金的第二个保本周期自第二个保本周期起始日起至3个公历年后对应日止。如果该对应日为非工作日,保本周期到期日顺延至下一个工作日。

第二个保本周期届满时,在符合保本基金存续条件下(担保人或基金管理人认可的其他符合条件的担保人或保本义务人为本基金下一保本周期提供保本保障,与基金管理人就本基金下一保本周期签订担保合同或风险买断合同,同时本基金满足法律法规和《基金合同》规定的基金存续要求),本基金继续存续并进入下一保本周期,该保本周期的具体起讫日期以本基金管理人届时公告为准。

(三)适用保本条款的情形

1、基金份额持有人在当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期并持有到期的基金份额。

2、对于持有到期的份额,基金份额持有人无论选择赎回、转换为基金管理人管理的其他基金、本基金转入下一保本周期或是转型为"金鹰持续收益债券型证券投资基金",均适用保本条款。

(四)不适用保本条款的情形

1、在保本周期到期日,本基金的基金份额净值与每份基金份额在保本周期内的累计分红金额之和等于或高于1.00元人民币;

2、基金份额持有人在当期保本周期开始前的过渡期申购或从上一保本周期转入到当期保本周期,但在基金保本周期到期日前(不包括该日)赎回或转换出的基金份额;

3、基金份额持有人在保本周期内申购的基金份额;

4、在保本周期内发生《基金合同》规定的《基金合同》终止的情形;

5、在保本周期内发生本基金与其他基金合并或更换基金管理人的情形,且担保人不同意继续承担担保责任;

6、在保本周期到期日之后(不包括该日)基金份额发生的任何形式的净值减少;

7、因不可抗力原因导致基金投资亏损;或因不可抗力事件直接导致基金管理人无法按约定履行全部或部分义务或延迟履行义务的,或《基金合同》规定的其他情形基金管理人免于履行保本义务的;

8、因不可抗力事件导致基金担保人无法按约定履行全部或部分义务或延迟履行义务的。

八、基金保本的保证

为确保履行保本条款,保障基金份额持有人利益,本基金由广州越秀金融控股集团有限公司作为担保人。

九、基金的投资

(一)投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。股票、权证占基金净资产的比例为0%~40%,其中,权证投资的比例范围占基金资产净值的0%~3%;债券、资产支持证券、货币市场工具、现金、以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金净资产的60%~100%,其中,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。此外,在基金合同和法律法规的允许范围内,本基金将积极参与一级市场新股、新债的申购。

(二)投资策略

1、投资策略依据

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

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

(2)本金安全性与流动性优先,兼顾收益性

就保本基金份额持有人的风险偏好而言,大致可分为两类:风险偏好程度很低的投资者与风险偏好程度较高的投资者。风险偏好程度很低的投资者购买保本基金之目的在于:在确保本金的安全性的同时,获取稳健的投资收益;风险偏好程度较高的投资者购买保本基金之目的在于:规避其他高风险资产在较长时段内的持续下跌风险。

显然,对于以上两类投资者而言,保本基金资产本金的安全性与流动性是第一位的,收益性是第二位的。为此,本基金坚持本金安全性与流动性优先、兼顾收益性的投资原则。

2、保本策略

在投资组合管理过程中,本基金采取主动投资的方法,发挥定量分析的决策辅助作用,以期提高投资决策的科学性与及时性,在控制风险的前提下,追求基金资产的稳健增值。本基金的保本策略为改进的固定比例组合保险策略(CPPI),改进的固定比例组合保险策略是本基金在传统固定比例组合保险策略的基础上经过改进而得的投资组合保险策略, 是本基金投资运作过程中的核心策略。该策略根据基金净资产、价值底线,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性,灵活动态地选取适当的风险乘数,以期对固定收益类与权益类资产之间的配置比例进行优化调节。

3、资产配置策略

(1)风险资产与安全资产的配置

风险乘数在很大程度上决定了风险资产与固定收益类资产的配置额,故而,本基金将风险乘数的设定作为风险资产(以权益类资产为代表)与安全资产(以固定收益类资产为代表)配置的关键变量。

本基金采用"自上而下"的投资视角,根据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性、基金净资产、价值底线,定性分析与定量分析并用,灵活动态地选取适当的风险乘数,以期对固定收益类与权益类资产之间的配置额进行优化调节,力争在确保本金安全的前提下,获取投资收益。

(2)大类资产的配置策略

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

(3)债券类资产的配置策略

为实现保本期结束时的本金保障目标,本基金债券类资产中相当大一部分将会采取买入并持有的策略;对于此类配置,债券的信用风险、到期收益率、以及剩余期限是否与剩余保本期匹配等因素将着重考虑。同时为了保证基金的流动性并追求更高的收益,本基金债券类资产的一小部分将采取主动灵活的配置策略,积极布局于各类债券资产,以追求更高的收益率。

(4)存款类资产的配置策略

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

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

(5)债券品种选择

由于货币类资产的品种选择相对简单,故而,此处集中分析债券类资产的品种选择。

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

(6)股票资产的配置策略

①股票一级市场申购策略

本基金可参与一级市场新股申购或增发。本基金将利用公司自主开发的"金鹰行业评价模型"、"金鹰企业评价模型",对新股所属行业属性与成长空间、新股的基本面做出定量分析,采用适当的估值模型对新股的投资价值进行评估,结合二级市场的平均估值水平、并参考类似新股上市之后的平均溢价率,给出合理的询价;根据新股发行价,估算新股上市后的合理定价;根据二级市场的运行情况、新股发行的频度、近期参与一级市场新股申购的平均资金规模、拟参与申购的新股之实际发行规模,估计中签率,并据此测算该次新股申购的预期收益率,作出是否参与该次新股申购的决定。

②股票二级市场投资策略

A、进取与防御的抉择

本基金根据宏观经济与资本市场的运行状况,判断所处投资时钟的象限,作出防御或者进取的抉择。在"衰退"象限且政府已采取扩张性政策或预期将采取扩张性政策的情况下,"复苏"象限,"过热"象限但政府并未采取紧缩性政策并预期在短期内不会采取紧缩性政策的情况下,采取进取优先的策略;在"过热"象限且政府已采取紧缩性政策或预期将采取紧缩性政策的情况下,采取进取与防御并重的策略;在投资时钟的"过热"象限且政府紧缩性政策的力度不断加大,在投资时钟的"滞胀"象限并预期宏观经济将进一步滑向"衰退"象限的情况下,或股票市场的估值水平已呈现下行的趋势以修复其"高估"状态并预期估值的此种下行趋势仍将持续的情况下,采取防御优先的策略。

B、行业配置

确定了防御或者进取的投资取向之后,本基金审慎遴选重点配置的行业——根据进取优先的策略,本基金将重点配置强周期行业、高贝塔值的行业;根据防御优先的策略,本基金将重点配置弱周期行业、生活必需品行业、生物医药行业;根据防御与进取并重的策略,本基金将在强周期与弱周期行业、高贝塔值与低贝塔值的行业之间寻求某种程度的折衷与平衡,随着宏观经济逐渐由"过热"象限滑向"滞胀"象限,投资组合渐近地偏向弱周期行业、低贝塔值行业、生活必需品行业、医药生物行业。

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

C、风格追踪

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

D、个股选择

基于行业配置策略与市场行情风格,本基金在各行业内遴选相应的投资标的。

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

根据进取原则,本基金将努力发掘那些可持续、可预见的成长型公司,重点在于对公司成长性的客观评价和比较上,不仅仅需要关注增长率之类的数量指标,同时还要关注成长的质量以及成长的可持续性。

为了对个股的基本面情况与投资价值进行综合评价,本公司建立了"金鹰企业评价模型",该模型可为本基金的个股选择提供定量化依据,避免了个股选择的盲目性与随意性。

另外,对行情风格的密切追踪,可为个股选择提供新的视角,有利于提升个股选择的有效性。

(7)其他金融工具的投资

若有中国证监会允许基金投资的其他金融工具推出(比如指数期权、个股期权等),本基金可在符合相关法律法规的规定下,进行投资,无需就投资该投资品种召开基金持有人大会。本基金将至少在开展新品种投资三个工作日前进行相应公告。

4、业绩比较基准

3年期银行定期存款利率(税后)

在基金合同生效日,业绩比较基准为中国人民银行公布的、该日适用的3年期银行定期存款利率(税后);并随着3年期银行定期存款利率的调整而动态调整。

本基金选择3年期银行定期存款利率(税后)作为业绩比较基准,主要理由是:(1)与本基金的保本期相同。本基金的保本期为3年,对于认购本基金的投资者而言,将持有到保本期结束时的收益率与另一个可替代的投资方向——3年期银行定期存款的利率(税后)相比较,可以反映出二者之间的优劣;(2)定期存款利率(税后)为投资者投资于定期存款实际可获得的收益率,将其作为本基金的业绩比较基准,有助于本基金份额的持有人理性地判断本基金的风险收益特性,准确地理解本基金本金保证的有效性。

随着市场环境的变化,如果上述业绩比较基准不适用本基金时,本基金管理人可以从维护基金份额持有人合法权益的原则出发,根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意,报中国证监会备案,基金管理人应在调整前3个工作日在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。

5、风险收益特征

本基金为积极配置的保本混合型基金,属于证券投资基金当中的低风险品种,其长期平均风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的债券型基金,但高于货币市场基金。

(三)投资禁止行为与限制

1、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,本基金禁止从事下列行为:
(1)承销证券;
(2)向他人贷款或提供担保;
(3)从事承担无限责任的投资;
(4)买卖其他基金份额,但法律法规或中国证监会另有规定的除外;
(5)向基金管理人、基金托管人出资;
(6)从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动;
(7)当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

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。

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;

(2)本基金持有一家上市公司的股票,其市值不得超过基金资产净值的10%;

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

(4)本基金持有的债券其信用级别不低于BBB级;

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

(6)本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;

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

(8)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。本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20个工作日内全部卖出;

(9)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%;

(10)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%;

(11)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%;

(12)本基金财产参与股票发行申购,所申报的金额不得超过本基金的总资产,所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

(13)本基金持有一家公司发行的流通受限证券,其市值不得超过基金资产净值的2%;本基金持有的所有流通受限证券,其市值不得超过基金资产净值的10%;经基金管理人和基金托管人协商,可对以上比例进行调整;

(14)本基金不得违反《基金合同》关于投资范围和投资比例的约定;

(15)法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定,履行适当程序后,本基金不受上述规定的限制。

(下转B47版)