证券代码:002362　证券简称:汉王科技　公告编号:2015-064

汉王科技股份有限公司关于购买理财产品的进展公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容真实、准确和完整,并对公告中的虚假记载、误导性陈述或重大遗漏承担责任。

汉王科技股份有限公司(以下简称"公司"或"汉王科技")于2015年7月30日召开的第四届董事会第三次会议及2015年8月10日召开的2015年第二次临时股东大会审议通过了《关于使用闲置超募资金及自有资金购买理财产品的议案》,同意公司及控股子公司滚动使用累计金额不超过人民币5亿元的闲置资金择机购买低风险短期理财产品(使用超募资金理财时必须有发行主体提供的保本承诺),其中,任一时点使用闲置超募资金及自有资金购买理财的金额分别不超过1.2亿元和2.5亿元。

公司董事会授权董事长在该额度范围内行使投资决策权,并签署相关合同文件等。具体内容详见2015年7月31日公司指定信息媒体《证券时报》、《中国证券报》和巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn)刊登的《关于使用闲置超募资金及自有资金购买理财产品的公告》。

根据上述股东大会、董事会决议,公司近期使用超募资金4000万元,自有资金13500万元购买了理财产品,具体如下:

一、本次购买理财产品情况

产品名称	产品类型	产品期限	认购金额(万元)	预期年化收益率	起息日	到息日	投资范围	资金来源
上海浦东发展银行股份有限公司月添利	非保本浮动收益	30天	1700	4.4%	2015.11.26	2015.12.26	现金、国债、地方政府债、央行票据、政策性金融债、评级在AA及以上的短期融资券、中期票据、次级债、企业债、公司债、非公开定向债务融资工具等信用类债券、回购、同业拆借、存款同业以及信贷资产等符合监管要求的非标准化债券资产等	汉王科技自有资金1700万元
北京银行稳健系列人民币40天期限现金流保证收益理财产品	保本保收益型	40天	2300	3.2%	2015.11.26	2016.01.05	在银行间市场、交易所及其他交易场所交易的各项固定收益类金融工具,具体投资品种包括存拆放交易、同业存款交易、同业借款交易、国债、金融债、企业债、银行次级债、央行票据、短期融资券、中期票据、债券回购交易、现金、银行存款、大额可转让存单、回购逆回购交易等	汉王科技超募资金2300万元
北京银行稳健系列人民币100天期限银行间保证收益理财产品	保本保收益型	100天	13500	3.3%	2015.12.25	2016.04.03		汉王科技自有资金13500万元

注:公司及汉王制造与浦发银行、北京银行无关联关系。

截至本公告日,公司及控股子公司累计使用超募资金16100万元、自有资金16200万元,共计32300万元购买理财产品,总金额占公司最近一期经审计净资产的44.12%,符合上述董事会、股东大会决议的要求。具体情况如下:

二、主要风险揭示

(1)产品不成立的风险:发生下述任一情形,银行有权宣布本产品不成立,客户将承担本产品不成立的风险:①符合产品合约约定的产品不成立的条件(如有);②本产品募集期结束时募集资金总额未达到必要的规模上限或/及下限;③国家相关法律、法规、监管规定、政策或要求出现重大变更,或者金融市场情况出现重大变化,经银行谨慎合理判断难以按照本合同规定向投资者提供本产品。

(2)市场风险:由于金融市场内在波动性,市场利率可能发生变化,关联标的价格走势可能对产品结构不利,本产品所投资的金融工具/资产的市场价格也可能发生不利变化,这些都可能使客户收益低于以定期存款或其他方式运用资金而产生的收益。

(3)流动性风险:本产品不允许客户提前终止或仅允许客户在特定期间并按照特定要求提前终止(具体以理财产品交易合同约定为准),客户需要资金时不能随时变现,可能使客户丧失其他投资机会。

(4)提前终止及再投资风险:理财期限内,如果银行认为有必要,有权随时提前终止本产品,一旦本产品被提前终止,则本产品的实际理财天数可能小于预定的理财天数,客户无法实现期初预期的全部收益,并且可能届时面临较差的再投资环境和机会。

(5)信息传递风险:本产品不提供对账单和报告,客户可根据理财合同所载明的信息披露方式查询本产品的相关信息。如果由于客户原因所致联系信息有误、客户未及时查询,或由于通讯故障、系统故障以及其他不可抗力等因素的影响使得客户无法及时了解本产品信息,因此而产生的责任和风险由客户自行承担。

(6)法令和政策风险:本产品是针对当前的相关法律法规、监管要求和政策设计的,如国家宏观政策以及相关法律法规、监管要求发生变化,将影响本产品发行、投资、兑付等工作的正常进行。

(7)不可抗力及意外事件风险:对于由不可抗力及意外事件风险导致的任何损失,客户须自行承担,北京银行对此不承担任何责任。

三、风险应对措施

公司严格按照深圳证券交易所《股票上市规则》等相关法律法规及公司《公司章程》、《对外投资管理办法》等要求,开展相关理财业务,认真执行公司各项内部控制制度,严控投资风险。

1、公司及其控股子公司将及时分析和跟踪理财产品投向、项目进展情况,一旦发现或判断有不利因素,将及时采取相应的保全措施,控制投资风险。

2、公司审计部负责对低风险投资理财资金使用与保管情况的审计与监督,每个季度末应对所有理财产品投资项目进行全面检查,并根据谨慎性原则,合理的预计各项投资可能发生的收益和损失,并向审计委员会报告。

3、独立董事、监事会有权对资金使用情况进行监督与检查,必要时可以聘请专业机构进行审计。一旦发现或判断有不利因素的情况,将及时采取相应的保全措施,控制投资风险,若出现产品发行主体财务状况恶化、所投资的产品面临亏损等重大不利因素时,公司将及时予以披露。

四、对公司日常经营影响

公司坚持规范运作、保值增值、防范风险,在不影响募投项目、公司正常经营和确保资金安全的前提下,以闲置资金适度进行低风险的投资理财业务,不会影响公司募集资金投资项目建设和主营业务的正常开展。通过适度理财,可以提高资金使用效率,获得一定的投资效益,为公司股东谋取更多的投资回报。

五、公告日前十二个月购买理财产品情况(不含前述购买理财产品情况)

产品名称	产品类型	产品期限	认购金额(万元)	预期年化收益率	起息日	到息日	投资盈亏金额(万元)	资金来源
北京银行稳健系列人民币115天期限银行间保证收益理财产品	保本保收益型	115天	7500	4.8%	2014.12.30	2015.04.24	113.424657	汉王科技超募资金6500万;汉王智学自有资金1000万元
上海浦东发展银行股份有限公司利多多财富班车4号	保本保收益型	180天	1000	4.6%	2015.01.13	2015.07.12	22.684932	汉王制造超募资金1000万元
北京银行稳健系列人民币63天期限银行间保证收益理财产品	保本保收益型	63天	7000	4.5%	2015.01.12	2015.03.16	54.369863	汉王科技自有资金5000万元,汉王智学及汉王蓝天自有资金各1000万元
北京银行稳健系列人民币35天期限银行间保证收益理财产品	保本保收益型	35天	1000	4.4%	2015.01.26	2015.03.02	4.219178	汉王科技超募资金1000万元
北京银行稳健系列人民币35天期限银行间保证收益理财产品	保本保收益型	35天	1000	4.19%	2015.01.29	2015.03.05	4.017808	汉王科技超募资金1000万元
上海浦东发展银行股份有限公司利多多财富班车2号	保本保收益型	60天	400	4.4%	2015.02.10	2015.04.10	2.989589	汉王制造超募资金400万元
中航证券添富保本收益凭证001期	本金保障型	309	5300	6%	2015.02.16	2015.12.21	269.210959	汉王科技自有资金4300万元,汉王制造自有资金1000万元
北京银行稳健系列人民币182天期限银行间保证收益理财产品	保本保收益型	182天	2300	4.4%	2015.03.09	2015.09.07	50.461370	汉王科技超募资金2300万元
长江证券收益凭证长江宝59号	本金保障型收益凭证	278天	8800	6.2%	2015.03.18	2015.12.21	415.552877	汉王科技自有资金8800万元
上海浦东发展银行股份有限公司利多多财富班车2号	保本保收益型	60天	400	4.4%	2015.04.21	2015.06.19	3.037808	汉王制造超募资金400万元
上海浦东发展银行股份有限公司利多多财富班车4号	保本保收益型	180天	6500	5%	2015.04.28	2015.10.24	161.164384	汉王科技超募资金6500万元
长江证券收益凭证长江宝99号	本金保障型收益凭证	89天	1700	6%	2015.04.29	2015.07.27	24.456712	汉王科技自有资金1700万元
北京银行天天金5号	保本保收益型	40天	500	2.9%	2015.05.07	2015.06.15	1.589041	汉王智远自有资金500万
北京银行天天金5号	保本保收益型	40天	500	2.9%	2015.06.18	2015.07.27	1.589041	汉王智远自有资金500万
上海浦东发展银行股份有限公司利多多财富班车4号	保本保收益型	180天	400	4.4%	2015.07.01	2015.12.28	8.679452	汉王制造超募资金400万元
北京银行天天金5号	保本保收益型	92天	500	3.2%	2015.07.16	2015.10.15	4.032877	汉王智远自有资金500万
上海浦东发展银行股份有限公司利多多财富班车2号	保本保收益型	60天	1000	3.85%	2015.07.21	2015.09.18	6.328767	汉王制造超募资金1000万元
上海浦东发展银行股份有限公司利多多惠至进取98天	非保本浮动收益	98天	1700	5.20%	2015.08.17	2015.11.23	23.734795	汉王科技自有资金1700万元
上海浦东发展银行股份有限公司利多多财富班车2号	保本保收益型	60天	1000	3.15%	2015.10.22	2015.12.22	5.178082	汉王制造超募资金1000万元
北京银行机构天天盈500	非保本浮动收益	不定期	1000	3%	2015.08.19	-		汉王科技自有资金1000万元
北京银行稳健系列人民币35天期限银行间保证收益理财产品	保本保收益型	35天	2300	3.5%	2015.9.14	2015.10.19	7.719178	汉王科技超募资金2300万元
北京银行稳健系列人民币35天期限银行间保证收益理财产品	保本保收益型	35天	2300	3.5%	2015.10.20	2015.11.24	7.719178	汉王科技超募资金2300万元
北京银行稳健系列人民币60天期限银行间保证收益理财产品	保本保收益型	60天	6500	3.0%	2015.10.29	2015.12.28	32.054795	汉王科技超募资金6500万元

六、备查文件

1、汉王科技与北京银行股份有限公司签署的《北京银行机构理财产品合约》2份。

特此公告

汉王科技股份有限公司董事会

2015年12月28日

证券代码:000750　证券简称:国海证券　公告编号:2015-108

国海证券股份有限公司第七届董事会第十五次会议决议公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

国海证券股份有限公司第七届董事会第十五次会议通知于2015年12月22日以电子邮件方式发出,会议于2015年12月25日在广西南宁市滨湖路46号国海大厦4楼会议室以现场会议方式召开,会议应到董事9人,实到董事9人。会议由公司董事长何春梅女士主持。会议的召集、召开、表决符合《公司法》及《公司章程》的规定,决议合法有效。会议以投票表决的方式通过了如下议案:

一、《关于公司关联交易的议案》

同意公司与第一大股东广西投资集团有限公司签订《广西投资集团有限公司2015年公司债券承销协议》。

表决结果:同意6票,反对0票,弃权0票。

关联董事何春梅女士、梁雄先生、崔薇薇女士回避表决。

本次关联交易具体内容详见公司登载于2015年12月29日的《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》以及巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)上的《国海证券股份有限公司关联交易公告》。

二、《关于发行证券公司短期融资券的议案》

审议通过了如下事项:

(一)同意公司通过全国银行间债券市场公开发行短期融资券;

(二)同意授权公司经营层在待偿还短期融资券余额不超过公司净资本60%范围内,根据《证券公司短期融资券管理办法》的规定,决定每期短期融资券的具体发行方案,包括发行规模、发行时间、发行利率、发行期限、发行方式等具体事项并办理相关手续;

(三)以上授权自股东大会审议通过之日起至本届董事会届满之日止。

表决结果:同意9票,反对0票,弃权0票。

本议案须提交股东大会审议。

特此公告。

国海证券股份有限公司董事会

二〇一五年十二月二十九日

证券代码:000750　证券简称:国海证券　公告编号:2015-109

国海证券股份有限公司关联交易公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、关联交易概述

(一)概述

公司与第一大股东广西投资集团有限公司(以下简称广西投资集团)于2015年12月25日在广西壮族自治区南宁市签订《广西投资集团有限公司2015年公司债券承销协议》,由公司作为其公开发行不超过20亿元公司债券项目的主承销商,如该关联交易实施完成,按照协议约定,公司预计获得承销收入不超过1,560万元,实际承销收入按实际发行总额确定。该承销事项尚需中国证监会核准。

按照《深圳证券交易所股票上市规则》的规定,上市公司应对与同一关联法人在连续十二个月内发生的交易金额进行累计计算。除上述关联交易外,公司与广西投资集团连续十二个月内发生的关联交易包括:

2015年10月27日,公司与广西投资集团签订非公开发行30亿元公司债券承销协议,按照协议约定,公司预计获得承销收入不超过2,340万元,实际承销收入按实际发行总额确定。该承销事项已获中国证监会核准,截至目前已完成第一期10亿元的发行工作,公司获得承销收入780万元。

2015年12月1日,公司与广西投资集团签订非公开发行30亿元永续公司债券承销协议,按照协议约定,公司预计首期获得承销收入不超过840万元,实际承销收入按实际发行总额确定。该承销事项尚需中国证监会核准。

2014年12月25日至2015年12月25日,公司向广西投资集团收取代理买卖证券手续费累计72.19万元。

上述公司与广西投资集团发生的关联交易均属于与日常经营相关的关联交易。除上述关联交易外,公司最近十二个月内未与广西投资集团发生其他关联交易。

截至本公告披露之日,公司与广西投资集团连续十二个月累计按协议约定的关联交易金额预计不超过4,812.19万元,超过公司截至2014年末经审计归属于上市公司股东净资产的0.5%,其中累计已实现关联交易收入852.19万元。

(二)交易各方的关联关系

1.截至本公告披露之日,广西投资集团为公司的第一大股东,持有公司22.34%的股份。

2.本次交易构成关联交易。

(三)本次关联交易的表决情况

公司于2015年12月25日召开第七届董事会第十五次会议,审议通过了《关于公司关联交易的议案》,表决情况如下:同意6票,反对0票,弃权0票,关联董事何春梅女士、梁雄先生、崔薇薇女士回避表决。

独立董事对本次关联交易进行了事前认可并发表了独立意见。

本次关联交易无需提交股东大会审议。

(四)本次关联交易不构成《上市公司重大资产重组管理办法》规定的重大资产重组,广西投资集团公开发行20亿元公司债券尚需中国证监会核准。

二、关联方基本情况

(一)基本信息

关联方名称:广西投资集团有限公司

住所及主要办公地点:南宁市青秀区民族大道109号广西投资大厦

企业性质:有限责任公司(国有独资)

注册地:广西壮族自治区南宁市

法定代表人:冯柳江

注册资本:475,414.47万元

税务登记证号码:450100198229061

主营业务:(一)对能源、矿业、金融业、文化旅游、房地产业、肥料行业的投资及管理;(二)股权投资、管理及相关咨询服务;(三)国内贸易;(四)进出口贸易;(五)房地产开发、经营;(六)高新技术开发、技术转让、技术咨询;(七)经济信息咨询服务。

实际控制人:广西壮族自治区人民政府国有资产监督管理委员会

(二)历史沿革、主要业务及财务数据

广西投资集团成立于1988年6月,注册资本47.54亿元,为广西壮族自治区人民政府直属国有独资企业,是广西壮族自治区重要的投融资主体和国有资产经营实体。

能源、铝业、金融是广西投资集团的主要产业,截至2014年12月31日,资产量分别占该公司目前总资产的30.34%、26.58%和33.58%。

1.能源板块:广西投资集团近年实施水火电并举,积极开发核电、天然气等新能源,大力推进热电联产、循环经济发展方式,从单一的火电产业发展成为集火电、水电、核电、天然气、煤炭、热电等于一体的多元化的能源产业。目前,广西投资集团已形成权益装机规模水电441.77万千瓦、火电434.68万千瓦、核电84.24万千瓦、风电4.49万千瓦,电力总权益装机960.69万千瓦,是广西区域最大的发电集团。

2.铝业板块:广西投资集团是广西最大的铝工业企业,拥有从矿石开采、冶炼、铝材加工直至贸易服务的完整产业链。截至目前,氧化铝、电解铝、铝棒加工、铝材加工能力分别达到200万吨/年、45万吨/年、120万吨/年、31.8万吨/年。

3.金融板块:截至2015年9月末,金融业资产达到1,523.58亿元。除国海证券外,广西投资集团还投资广西北部湾银行股份有限公司、国投创新(北京)投资基金有限公司、南宁市广源小额贷款有限责任公司、广西投资集团融资担保有限公司、广西小微互联网金融服务有限公司、广西融资租赁有限公司、广西黄金投资有限责任公司等金融类企业。

4.广西投资集团在不断做强做优主导产业的同时,积极发展相关多元产业,如管道天然气项目、防城港核电项目等。

截至2014年末,广西投资集团母公司总资产2,481,322.06万元,所有者权益1,007,326.27万元;2014年母公司实现营业收入9,550.23万元,净利润70,193.10万元。

截至2015年9月末,广西投资集团母公司总资产2,907,918.02万元,所有者权益1,073,968.70万元;2015年1-9月母公司实现营业收入6,998.61万元,净利润68,686.32万元。

(三)具体关联关系的说明

截至目前,广西投资集团为公司的第一大股东,持有公司22.34%的股份。公司董事长何春梅女士,董事梁雄先生、崔薇薇女士为广西投资集团推荐董事,其中何春梅女士任广西投资集团党委副书记、崔薇薇女士任广西投资集团总裁助理兼金融事业部总经理。

三、关联交易标的基本情况

公司本次关联交易标的的基本情况详见本公告"五、关联交易协议的主要内容"。

四、交易的定价政策及定价依据

本次交易根据资金市场情况、利率走势情况、公司债券业务特点、具体债券发行方案等因素综合确定价格。本次关联交易定价合理、交易公平。

五、关联交易协议的主要内容

(一)公司与广西投资集团以及中银国际一致同意,由公司作为本次公开发行不超过20亿元公司债券的牵头主承销商,协助广西投资集团完成本次债券的承销工作。

(二)本次债券承销费用为本期债券实际发行总额乘以承销费率,其中承销费率为0.8%。

(三)本次债券发行期限结束后第一个工作日17:00前,由公司归集募集款项,并将扣除承销费用后的募集款项净额按时、足额划入广西投资集团收款账户。

(四)本次债券承销协议约定任何一方因过错而造成其他一方或多方损失的,该方应承担由此产生的一切责任,并赔偿受损方的全部损失。

(五)本次债券承销协议自广西投资集团和各主承销商法定代表人或授权代表签署并加盖公章之日起生效;在协议约定不可抗力事件及免责、履行完毕或友好协商共同决定时终止本协议。

六、涉及关联交易的其他安排

无。

七、交易目的和对上市公司的影响

基于广西投资集团的债务直接融资需求,公司作为广西本土券商,能够有效与其实现信息对接,因此,为提高本次公开发行20亿元公司债券申报及发行效率,广西投资集团选择公司为本次债券的主承销商。如该关联交易实施完成,按照协议约定,公司预计承销收入将增加不超过1,560万元,净利润将增加不超过1,170万元,实际承销收入和净利润按实际发行总额确定。

八、2015年年初至披露日与该关联人累计已发生的各类关联交易的总金额

经统计,2015年年初至披露日,公司已向广西投资集团收取经纪业务手续费59.13万元,收取承销费用780万元,已累计实现关联交易收入839.13万元。除此之外,2015年年初至披露日,公司与广西投资集团签订的关联交易协议如下:

(一)2015年10月27日,公司与广西投资集团签订非公开发行30亿元公司债券承销协议,按照协议约定,公司预计获得承销收入不超过2,340万元,实际承销收入按实际发行总额确定。该承销事项已获中国证监会核准,截至目前已完成第一期10亿元的发行工作,公司获得承销收入780万元。

(二)2015年12月1日,公司与广西投资集团签订非公开发行30亿元永续公司债券承销协议,按照协议约定,公司预计首期获得承销收入不超过840万元,实际承销收入按实际发行总额确定。该承销事项尚需中国证监会核准。

九、独立董事事前认可和独立意见

公司独立董事认真审阅了上述关联交易相关资料,对本次关联交易进行了事前认可:

本次关联交易事项,符合公司日常经营和业务开展需要,有利于公司业务开展、提高公司盈利水平;不影响公司独立性,公司主要业务不因上述日常关联交易而对关联人形成依赖;价格公允,定价原则合理、公平,不存在损害公司和中小股东利益的情况;同意将《关于公司关联交易的议案》提交董事会审议。

公司独立董事就本次关联交易事项发表独立意见如下:

本次关联交易符合公司日常经营和业务开展需要,并按市场价格进行,实施上述关联交易不会影响公司的独立性,也不存在损害公司和中小股东利益的情况;公司对《关于公司关联交易的议案》的审议程序符合《深圳证券交易所股票上市规则》、《深圳证券交易所主板上市公司规范运作指引》等相关规则和《国海证券股份有限公司章程》、《国海证券股份有限公司关联交易管理制度》的规定,关联董事已按规定回避表决。同意公司第七届董事会第十五次会议审议通过的《关于公司关联交易的议案》。

十、备查文件

(一)第七届董事会第十五次会议决议

(二)广西投资集团有限公司2015年公司债券承销协议

(三)独立董事关于公司关联交易的事前认可函

(四)独立董事关于公司关联交易的独立意见

国海证券股份有限公司董事会

二〇一五年十二月二十九日

(上接B102版)

联系人:张燕
联系电话:010-83363099
客服电话:400-166-1188
网址:http://8.jrj.com.cn/
(108)名称:嘉实财富管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期46层4609-10单元
办公地址:北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层
法定代表人:赵学军
联系电话:010-85097570
客服电话:400-021-8850
网址:www.harvestwm.cn
(109)名称:大泰金石投资管理有限公司
办公地址:上海市长宁区虹桥路1386号文广大厦15楼
法定代表人:袁顾明
联系人:朱真卿
联系电话:021-22267943
客服电话:021-22267982
网址:http://www.dtfortune.com/
(110)名称:北京乐融多源投资咨询有限公司
办公地址:北京市朝阳区西大望路1号温特莱中心A座16层
法定代表人:董浩
联系人:于婷婷
电话:010-56409010
客服电话:400-068-1176
网址:www.jimufund.com
(111)名称:北京增财基金销售有限公司
注册地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室
办公地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208-1209室
法定代表人:罗细安
联系电话:010-67000988-6003
服电话:400-001-8811
网址:http://zcvc.com.cn/
(112)名称:一路财富(北京)信息科技有限公司
注册地址:北京市西城区车公庄大街9号院5号楼702室
办公地址:北京市西城区阜城门内大街2号万通大厦22层2208室
法定代表人:吴雪秀
联系电话:010-88312877
客服电话:400-001-1566
网址:http://www.yilucaifu.com
(113)名称:深圳富济财富管理有限公司
办公地址:深圳市南山区高新南七道12号惠恒集团二期418室
法定代表人:齐小贺
联系人:陈勇军
电话:0755—83999913
客服电话:0755—83999907
网址:www.jinqianwo.cn
(114)名称:上海凯石财富基金销售有限公司
办公地址:上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼
法定代表人:陈继武
联系人:李晓明
电话:021-63333319
服电话:4000-178-000
网址:www.lingxianfund.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
电话:020-38283037
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
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;如该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。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(但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、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,对利率走向与收益率曲线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撑,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:在确保本金安全的同时,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

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。

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匹配。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,有助于基金份额的持有人理性地判断本基金的风险收益特征,准确地理解本基金保证的有效性。

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。

(四)投资组合比例调整

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合《基金合同》的有关约定。由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动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,但基金管理人应在10个交易日内进行调整,以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

(五)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。

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本基金合同的规定,已复核了本报告中的内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告有关数据截止日为2015年9月30日,本报告中所列财务数据未经审计。

(一)报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,253,049.85	2.01
	其中:股票	1,253,049.85	2.01
2	固定收益投资	58,455,659.70	93.59
	其中:债券	58,455,659.70	93.59
	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	1,314,663.67	2.10
7	其他各项资产	1,437,452.81	2.30
8	合计	62,460,826.03	100.00

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合

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	1,251,000.00	2.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,049.85	0.00
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	1,253,049.85	2.14

(三)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	002191	劲嘉股份	100,000	1,251,000.00	2.14
2	603598	引力传媒	55	2,049.85	0.00

注:本基金期末仅持有二只股票。

(四)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	20,088,000.00	34.30
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	38,367,659.70	65.50
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	58,455,659.70	99.80

(五)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	019506	15国债06	200,000.00	20,088,000.00	34.30
2	124588	14济宁债	101,000.00	10,924,160.00	18.65
3	1480391	14常房债	100,000.00	10,669,000.00	18.21
4	122521	12筑金阳	101,000.00	10,525,210.00	17.97
5	124251	13鲁信投	50,000.00	5,043,000.00	8.61

(六)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。
(七)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属投资。
(八)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。
(九)报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
(1)报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货投资。
(2)本基金投资股指期货的投资政策
无
(十)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投资。
(3)本期国债期货投资评价
无
(十一)开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	287,597,380.42
报告期基金总申购份额	3,867,741.18
减:报告期基金总赎回份额	238,918,347.20
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	52,546,774.40

(十二)基金管理人运用固有资金投资本基金情况
(1)基金管理人持有本基金份额变动情况
本报告期,本基金管理人未运用固有资金投资本基金。
(2)基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
无。
(十三)投资组合报告附注
(1)本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
(2)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规定的备选股票库。
(3)其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	64,179.94
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,373,272.87
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,437,452.81

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002191	劲嘉股份	1,251,000.00	2.14	重大事项

(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。

十一、基金的业绩

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

本基金合同生效日为2011年5月17日,基金合同生效以来(截至2015年9月30日)的投资业绩,本基金托管人复核了本基金的业绩。

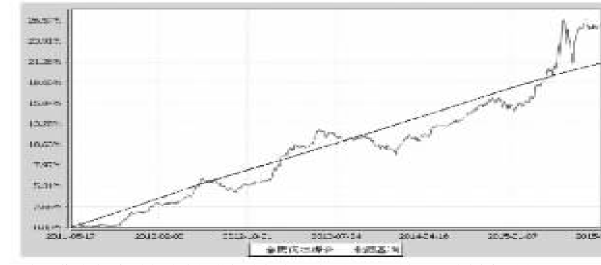
(一)收益率比较

金鹰保本混合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

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(%)
2011.5.17-2011.12.31	2.20%	0.08%	3.19%	0.01%	-0.99%	0.07%
2012.1.1-2012.12.31	3.91%	0.11%	4.79%	0.01%	-0.88%	0.10%
2013.1.1-2013.12.31	3.67%	0.15%	4.40%	0.01%	-0.73%	0.14%
2014.1.1-2014.12.31	4.99%	0.14%	4.37%	0.01%	0.62%	0.13%
2015.01.01-2015.09.30	8.99%	0.34%	2.73%	0.01%	6.26%	0.33%
2011.5.17-2015.09.30	26.00%	0.18%	21.06%	0.01%	4.94%	0.17%

(二)收益充走势图

金鹰保本混合型基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2011年5月17日至2015年9月30)



注:(1)截至报告日本基金各项投资比例符合基金合同规定的各项比例,即股票、权证占基金资产净值的比例为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资产净值的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%;(2)基金的业绩比较基准为:3年期银行定期存款利率(税后)。

十二、基金的费用和税收

(一)与基金运作相关的费用

1、与基金运作相关的费用种类

(1)基金管理人的管理费;

(2)基金托管人的托管费;

(3)因基金的证券交易或结算而产生的费用(包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等);

(4)基金合同生效以后的信息披露费用;

(5)基金份额持有人大会费用;

(6)基金合同生效以后的会计师费和律师费;

(7)基金资产的资金汇划费用;

(8)按照国家有关法律法规和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

2、与基金运作相关的费用之计提方法、计提标准和支付方式

(1)基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金财产净值的1.2%年费率计提。

在通常情况下,基金管理费按前一日基金财产净值的1.2%年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.2%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金财产净值

基金管理费每日计提,按月支付。基金管理人应于次月首日起5个工作日内做出划付指令;基金托管人应在次月首日起10个工作日内完成复核,并从该基金财产中一次性支付基金管理费给该基金管理人。

(2)基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金财产净值的0.2%年费率计提。

在通常情况下,基金托管费按前一日基金财产净值的0.2%年费率计提。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 为前一日的基金财产净值

基金托管费每日计提,按月支付。基金管理人应于次月首日起5个工作日内做出划付指令;基金托管人应在次月首日起10个工作日内完成复核,并从该基金财产中一次性支付托管费给该基金托管人。

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"金鹰持续收益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0.2%的年费率计提。计算方法同上。

(3)本条第1款第(3)至第(8)项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,列入当期基金费用。

3、不列入基金费用的项目

本条第1款约定以外的其他费用,以及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等不列入基金费用。

4、基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费,无须召开基金份额持有人大会。

(二)与基金销售有关的费用

1、申购费

(1)申购费率

投资人申购本基金需缴纳申购费,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。

申购费率如下:

申购金额(万元)	申购费率
A <100	1.0%
100 ≤ A <300	0.8%
300 ≤ A <500	0.6%
A ≥500	每笔1000元

注:上表中,A为投资者申购金额。

(2)申购份额的计算方法如下:

净申购金额=申购金额/[1+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/申购当日基金份额净值

以上计算结果(包括申购份额)以四舍五入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。

2、赎回费

(1)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(T为T)	赎回费率
T <1年	1.5%
1年 ≤ T <2年	1.2%
2年 ≤ T <3年	1.0%
T ≥3年	0%

本基金的赎回费用由赎回基金份额的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。

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日前在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登公告。

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。

(2)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

上述计算结果均按四舍五入方法,保留到小数点后两位。由此误差产生的损失由基金财产承担,产生的收益归基金财产所有。

3、转换费率

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

4、费率调整

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

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

(三)税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

十三、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对2015年6月19日刊登的《金鹰保本混合型证券投资基金更新招募说明书全文2015年1号》进行了更新,主要更新的内容如下:

(1)在"重要提示"部分,更新了招募说明书内容的截止日期;

(2)在"三、基金管理人"部分,更新了公司主要人员和个别投资决策委员会成员信息

(3)更新了"四、基金托管人"中的相关信息;

(4)更新了"五、基金担保人"中的相关信息;

(5)在"六、相关服务机构部分更新了相关信息;"

(6)在"十六、基金投资的第(六)投资组合报告"部分,按最新定期报告更新了投资组合报告;

(7)在"十七、基金的业绩"部分,更新了本基金基金合同生效以来投资业绩;

(8)在"二十八、托管协议摘要"部分,更新了托管人信息;

(9)在"三十一、其他应披露事项"部分,更新了本基金期间披露的公告及主要信息提示。

金鹰基金管理有限公司

2015年12月29日