金鹰持久增利债券型证券投资基金（LOF）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：中国邮政储蓄银行股份有限公司
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：2015年3月20日
公告日期：2015年3月17日

一、重要声明与提示

金鹰持久增利债券型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”或“金鹰持久增利基金”）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报告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报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、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。

凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅2012年2月15日登载于《证券时报》、2012年2月16日登载于《上海证券报》、2012年2月20日登载于《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招募说明书》及其更新。

二、基金概览

1、基金名称：金鹰持久增利债券型证券投资基金（LOF）

2、本次上市交易的基金简称及其基金代码，基金简称：持久增利，基金代码：162105；

3、基金类型：债券型

4、基金运作方式：契约型开放式

5、本基金的存续期限：不定期。

6、基金份额总额：截至2015年3月13日，本基金的基金份额总额为237,844,063.65份，

7、基金份额净值：截至2015年3月13日，金鹰持久增利基金的基金份额净值为1.0001元

8、本次上市交易的基金份额总额：167,097,445份。

9、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

10、上市交易日期：2015年3月20日

11、基金管理人：金鹰基金管理有限公司

12、基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

13、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深圳分公司

三、基金的历史、转型及折算后结果、上市交易和跨系统转托管

（一）本基金的历史

金鹰持久增利债券型证券投资基金（LOF）由金鹰持久回报分级债券型证券投资基金分级运作届满转型而成。

金鹰持久回报分级债券型证券投资基金经中国证监会许可【2012】111号文核准募集。

金鹰持久回报分级债券型证券投资基金基金管理人为金鹰基金管理有限公司，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。基金管理人于2012年3月9日获得中国证监会书面确认，《金鹰持久回报分级债券型证券投资基金基金合同》生效，基金募集规模489,462,429.13份。

（二）本基金的转型

根据《金鹰持久回报分级债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金《基金合同》生效后分级运作3年期届满，本基金无需召开基金份额持有人大会，即转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“金鹰持久增利债券型证券投资基金（LOF）”。基金管理人于2015年3月4日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所网站及本基金管理人网站上披露了《金鹰持久回报分级债券型证券投资基金3年期届满转型后基金名称变更及转换基准日等事项的公告》、《金鹰持久回报分级债券型证券投资基金之回报A份额开放赎回业务的公告》、《金鹰持久回报分级债券型证券投资基金之回报A、回报B份额折算方案的公告》、《金鹰持久回报分级债券型证券投资基金之回报A份额开放赎回期间回报B份额（150078）的风险提示公告》及《金鹰持久回报分级债券型证券投资基金之回报B终止上市的公告》。

本基金管理人于2015年3月9日对金鹰持久回报分级债券型证券投资基金进行了3年期分级运作届满到期后的基金转型工作。经本基金基金管理人计算并经本基金基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司确认，基金份额转换基准日（2015年3月9日）转型前金鹰持久回报分级债券型证券投资基金之回报A份额（以下简称回报A）的基金份额净值为1.02078082元，本基金管理人按照1.02078082:1的转换比例进行了折算，折算后基金份额净值为1.000元，折算后的原回报A的基金份额总额由30,072,039.81份调整为30,696,961.51份；转型前金鹰持久回报分级债券型证券投资基金之回报B份额（以下简称回报B）的基金份额净值为1.41357956元，本基金管理人按照1.41357956:1的转换比例进行了折算，折算后基金份额净值为1.000元，折算后的原回报B的基金份额由146,540,816.63份调整为207,147,102.14份；基金份额总额与持有人持有的基金份额数额将发生调整，份额折算对持有人的权益无实质性影响。本基金管理人已向中国证券登记结算有限责任公司提交份额变更登记申请并于2015年3月11日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、基金管理人网站及深圳证券交易所网站发布了《金鹰持久回报分级债券型证券投资基金三年运作期届满基金份额折算和转换结果的公告》。

（三）本基金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：深圳证券交易所深证上[2015]97号

2、上市交易日期：2015年3月20日

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

4、基金简称：金鹰持久增利（LOF）场内简称：持久增利

5、交易代码：162105

6、本次上市交易份额：167,097,445份（截至2015年3月13日）

7、基金资产净值的披露：每个工作日的次日公布金鹰持久增利债券型证券投资基金（LOF）的基金份额净值，并在深交所行情发布系统揭示。

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转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通。

（五）本基金转托管的主要内容：为了保证基金份额持有人的利益，本基金管理人向深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司提出申请，为基金份额持有人开通了转托管业务的办理事宜。

四、持有人户数、持有人结构及场内前十名持有人

（一）基金份额持有情况

截至2015年3月13日，金鹰持久增利基金的场内基金份额持有人户数：337户

平均每户持有的场内基金份额：495,838.12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138,399,339.00份，占82.83%

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28,698,106.00份，占17.17%

（二）截至2015年3月13日，场内金鹰持久增利基金份额前十名持有人情况：

序号	持有人名称(全称)	证券帐户号	持有基金份额	占场内基金份额的比例
1	金鹰基金管理有限公司	0511856584	30,961,543	18.53%
2	富安达基金-光大银行-富安达一利可1号资产管理计划	0899072366	13,934,687	8.34%
3	全国社保基金二零九组合	0899051598	9,813,071	5.87%
4	全国社保基金一零零三组合	0899056369	6,104,631	3.65%
5	中信证券-华夏银行-中信证券贵宾定制2号集合资产管理计划	0899057127	6,080,377	3.64%
6	全国社保基金二一四组合	0899058577	5,823,948	3.49%
7	华宝信托有限责任公司-曉阳2号集合资金信托	0899063789	5,812,512	3.48%
8	中欧盛世资本-广发银行-中欧盛世一利可3号资产管理计划	0899064379	4,947,528	2.96%
9	上海国际信托有限公司-多元凯利证券投资集合资金信托	0899066497	4,947,528	2.96%
10	安徽省电力公司企业年金计划-中国银行	0899051085	4,542,659	2.75%
合计			92,968,484	55.67%

（三）截至2015年3月13日，基金管理人的从业人员持有本基金份额的情况

本基金管理人的基金从业人员持有本基金份额总量为0.00份，占该基金总份额的比例为0.00%。其中，本基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量为0.00份，该只基金的基金经理持有该只基金份额总量为0.00份。

注：以上信息依据中国证券登记结算有限公司深圳分公司提供的持有人信息编制。

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：凌富华

3、总经理：刘岩

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：中国证监会证监基金字[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股份有限公司、广州白云山医药集团股份有限公司、美的集团股份有限公司及东亚联丰投资管理有限公司组成，出资比例分别为49%、20%、20%、11%。

11、内部组织结构及职能：

权益投资部

拟订有关基金投资、交易的管理制度和办法及部门行政管理制度，经公司批准后组织实施；监督基金经理组执行公司投资决策委员会批准的投资计划等。

研究发展部

负责宏观经济和政策的动态分析和研究，对证券市场的走势、市场动态进行研究，为投资管理的时机选择提供建议等。

集中交易部

实施公司投资决策委员会投资决策和投资计划，高效、准确地执行投资部门的投资指令；在公司投权范围内进行投资交易的风险控制，并对证券市场趋势进行跟踪分析，为公司投研团队提供辅助投资建议等。

固定收益投资部

负责公司有关固定收益证券以及债券、货币市场的宏观研究和跟踪工作及负责公司旗下产品的投资管理工作等。

专户投资部

负责专户投资策略的拟定、执行和反馈，以及投资组合管理等。

产品研发部

负责进行公募基金和专户新产品、新业务的研究开发，组织新产品、新业务的方案论证，组织提交产品可行性报告等。

指数及量化投资部

建立投资风险管理和绩效评估及分析体系，组织实施公司投资风险管理，定期评估基金的绩效表现和运行情况，为投资决策委员会、投资管理部门及基金经理的投资决策提供风险控制和组合优化建议。

市场拓展部

负责公司市场营销发展规划、战略目标的研究、制定及销售渠道的开拓、维护及管理等。

机构客户部

负责券商等代销渠道的开拓与维护工作；负责保险公司、信托公司、财务公司及券商资产管理、自营部门等机构客户的开拓与维护等工作。

品牌电子商务部

负责公司品牌宣传、媒介关系管理、广告业务管理等。

信息技术部

负责公司信息系统的规划、建设、维护和管理，保障公司信息系统安全运行等工作。

基金事务部

负责制定基金登记、存管、清算和结算等业务的规章制度，经批准后组织实施，负责建立和管理基金帐户，保管基金持有人名册并处理相关的注册登记业务等。

监察稽核部

根据国家有关法律法规，草拟公司稽核监察制度，经批准后组织具体实施，对公司各项内部控制制度及执行情况作出评价并提出建议等。

风险管理部

组织实施公司风险战略；起草风险管理相关制度规章及流程，并进行持续完善；对公司投资进行实时风险监控和管理等。

综合管理部

草拟公司财务管理、人力资源管理、行政秘书管理制度和办法，经批准后组织具体实施等。

广州、北京、上海、深圳、西安各分公司

负责与总部设在分支机构的日常沟通联系；协助公司总部进行基金产品的设计与开发；协助公司研究部门进行对投资项目的调研；负责分支机构所在地区的市场拓展业务，包括代销和直销等。

12、人员情况

截至2014年12月31日，公司员工人数116人，员工学历分布为：博士7人，占员工总数6.03%；硕士47人，占员工总数40.52%；本科53人，占员工总数45.69%；本科以下9人，占员工总数7.76%。

13、信息披露负责人及咨询电话

苏文锋，电话020-83282627

14、本基金基金经理

李涛，硕士，证券从业经历11年。历任光大银行总行资金部货币市场自营投资业务主管、中银国际证券研究部宏观研究员、广州证券资产管理总部投研总监。2014年11月加入金鹰基金管理有限公司。现任固定收益投资部副总监，金鹰保本混合型证券投资基金、金鹰持久回报分级债券型证券投资基金、金鹰元安保本混合型证券投资基金、金鹰元丰保本混合型证券投资基金基金经理。

马洪娟，暨南大学金融学专业硕士、博士，证券从业经历4年。2010年7月加入金鹰基金管理有限公司，任债券研究员。现任金鹰持久回报分级债券型证券投资基金基金经理。

（二）基金托管人

1.基本情况

名称：中国邮政储蓄银行股份有限公司（简称：中国邮政储蓄银行）

住所：北京市西城区金融大街3号

办公地址：北京市西城区金融大街3号A座

法定代表人：李国华

成立时间：2007年3月6日

组织形式：股份有限公司

注册资本：470亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：证监许可【2009】673号

联系人：王瑛

联系电话：010-68858126

经国务院同意并经中国银行业监督管理委员会批准，中国邮政储蓄银行有限责任公司（成立于2007年3月6日）于2012年1月21日依法整体变更为中国邮政储蓄银行股份有限公司。中国邮政储蓄银行股份有限公司依法承继原中国邮政储蓄银行有限责任公司全部资产、负债、机构、业务和人员，依法承担和履行原中国邮政储蓄银行有限责任公司在有关具有法律效力的合同或协议中的权利、义务，以及相应的债权债务关系和法律责任。中国邮政储蓄银行股份有限公司坚持服务“三农”、服务中小企业、服务城乡居民的大型零售商业银行定位，发挥邮政网络优势，强化内部控制，合规稳健经营，为广大城乡居民及企业提供优质金融服务，实现股东价值最大化，支持国民经济发展和社会进步。

2.主要人员情况

中国邮政储蓄银行股份有限公司总行设托管业务部，下设资产托管处、风险管理处、运营管理处等处室。现有员工20人，全部员工拥有大学本科以上学历及基金从业资格，80%员工具有三年以上基金从业经历，具备丰富的托管服务经验。

3.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。2012年7月19日，中国邮政储蓄银行经中国保险业监督管理委员会批准，获得保险资金托管资格。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、运作高效的业务处理模式，为广大基金份额持有人和众多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2014年12月31日，中国邮政储蓄银行托管的证券投资基金共27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）、长安宏观策略股票型证券投资基金（740001）、金鹰持久回报分级债券型证券投资基金（162105）、中欧信用增利分级债券型证券投资基金（166012）、农银汇理消费主题股票型证券投资基金（660012）、浦银安盛中证锐联基本面400指数证券投资基金（519117）、天弘现金管家货币市场基金（420006）、汇丰晋信恒生A股行业龙头指数证券投资基金（540012）、华安安心收益债券型证券投资基金（040036）、东方强化收益债券型证券投资基金（400016）、中欧纯债分级债券型证券投资基金（166016）、东方安心收益保本混合型证券投资基金（400020）、银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金（519662）、中欧纯债添利分级债券型证券投资基金（166021）、银河灵活配置混合型证券投资基金（519656）、天弘通利混合型证券投资基金（000573）、中加纯债一年定期开放债券型证券投资基金（000552）、南方通利债券型证券投资基金（000563）、中邮货币市场基金（000576）、易方达财富快钱货币市场基金（000647）。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、证券公司资产管理计划、保险资金等多种资产类型的托管产品体系，托管规模达8,908.14亿元。

（三）注册登记人

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街17号

办公地址：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：周明

联系电话：010-50938856

传真：010-50938907

联系人：崔巍

（四）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

邮编：200002

经办会计师：张宁、刘国棟

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、基金财务状况（未经审计）

（一）基金募集期间费用

本基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，未从基金资产中支付。

（二）基金上市前重要财务事项

本基金发售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

本基金2015年3月13日资产负债表如下：

单位：人民币元

资 产	2015年3月13日
资 产：	
银行存款	3,131,423.17
结算备付金	552,000.00
存出保证金	72,799.88
交易性金融资产	112,063,050.00
其中：股票投资	-
基金投资	-
债券投资	112,063,050.00
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	120,000,000.00
应收证券清算款	42,214.85
应收利息	2,924,359.76
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	238,785,847.66
负债和所有者权益	**2015年3月13日**
负 债：	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	66,360.37
应付托管费	18,960.12
应付销售服务费	33,180.18
应付交易费用	1,646.30
应交税费	1,915.88
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	784,297.92
负债合计	906,360.77
所有者权益：	
实收基金	173,652,382.46
未分配利润	64,227,104.43
所有者权益合计	237,879,486.89
负债和所有者权益总计	238,785,847.66

八、基金投资组合

截至2015年3月13日，本基金的投资组合如下：

（一）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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	112,063,050.00	46.93
	其中：债券	112,063,050.00	46.93
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	120,000,000.00	50.25
	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	3,683,423.17	1.54
6	其他各项资产	3,039,374.49	1.27
7	合计	238,785,847.66	100.00

（二）按行业分类的股票投资组合

截至2015年3月13日，本基金未持有股票。

（三）按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

截至2015年3月13日，本基金未持有股票。

（四）按券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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	82,100,050.00	34.51
5	企业短期融资券	20,026,000.00	8.42
6	中期票据	9,937,000.00	4.18
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	112,063,050.00	47.11

（五）按公允价值占净值比例大小排序的前五名债券明细

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	122865	10苏海发	300,100	30,160,050.00	12.68
2	122633	12嘉经债	200,000	20,800,000.00	8.74
3	122540	12宁浦口	200,000	20,740,000.00	8.72
4	071504002	15广发CP002	200,000	20,026,000.00	8.42
5	122676	12庐江债	100,000	10,400,000.00	4.37

（六）按公允价值占净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

截至2015年3月13日，本基金未持有资产支持证券。

（七）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

截至2015年3月13日，本基金未持有贵金属。

（八）按公允价值占净值比例大小排序的前五名权证投资明细

截至2015年3月13日，本基金未持有权证。

（九）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

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

3、本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

（十）投资组合报告附注

1、截至2015年3月13日，本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

2、基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	72,799.88
2	应收证券清算款	42,214.85
3	应收股利	-
4	应收利息	2,924,359.76
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,039,374.49

4、截至2015年3月13日，本基金持有的处于转股期的可转换债券明细。

截至2015年3月13日，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5、截至2015年3月13日，本基金前十名股票中存在流通受限情况的说明。

截至2015年3月13日，本基金未持有股票。

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。

九、重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易公告书公告前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

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：

（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）在知悉可能对基金价格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、基金托管人承诺

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》及其他证券法律法规、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、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

十三、备查文件目录

（一）备查文件目录

1、中国证监会批准金鹰持久回报分级债券型证券投资基金发行及募集的文件。

2、《金鹰持久回报分级债券型证券投资基金基金合同》。

3、《金鹰持久回报分级债券型证券投资基金托管协议》。

4、金鹰基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程。

5、基金托管人业务资格批件和营业执照。

6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、季度报告、更新的招募说明书及其他临时公告。

（二）存放地点

广州市天河区体育西路189号城建大厦22-23层

（三）查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅或按工本费购买复印件，也可登录本基金管理人网站查阅，本基金管理人网址：http://www.gefund.com.cn。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人客户服务中心，客户服务中心电话：4006-135-888或020-83936180。

金鹰基金管理有限公司
2015年3月17日

附件：金鹰持久回报分级债券型证券投资基金基金合同摘要

一、基金合同当事人的权利、义务

（一）基金管理人

1、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资产；

（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。

2、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，不得委托第三人运作基金财产；

（7）依法接受基金托管人的监督；

（8）依法募集基金，办理或者委托经由证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和注册登记事宜；

（9）办理基金备案手续；

（10）按规定受理基金份额的申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

（11）计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

（12）采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回及注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；

（13）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（14）编制季度、半年度和年度基金报告；

（15）按照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收益；

（16）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；

（17）保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、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，不得向他人泄露；

（18）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；

（19）执行生效的基金份额持有人大会的决定；

（20）建立并保存基金份额持有人名册；

（21）按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

（22）保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

（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者实施其他法律行为；

（24）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；

（25）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；

（26）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，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

（27）基金托管人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托管人追偿；

（28）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；

（29）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，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

（30）法律法规、基金合同以及中国证监会规定的其他义务。

（二）基金托管人

1、基金托管人的权利

（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收入；

（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）以基金托管人和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和深圳分公司开设证券账户；

（5）以基金托管人名义开立证券交易资金账户，用于证券交易资金清算；

（6）以基金的名义在中央国债登记结算有限公司开设银行间债券托管账户，负责基金投资债券的后台匹配及资金的清算；

（7）提议召开或召集基金份额持有人大会；

（8）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

（9）法律法规和基金合同规定的其他权利。

2、基金托管人的义务

（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，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；对所托管的不同基金财产分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、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）按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

（6）对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，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；

（7）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；

（8）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；

（9）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

（10）按照规定监督基金管理人的投资运作；

（11）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；

（12）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

（13）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应予保密，不得向他人泄露；

（14）按照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自行召集基金份额持有人大会；

（15）根据本基金合同和托管协议规定建立并保存基金份额持有人名册；

（16）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

（17）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；

（18）参加基金财产清算组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

（19）因违反基金合同导致基金财产损失，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照法律法规规定和基金合同履行其义务，基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；

（21）面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会和中国银监会，并通知基金管理人；

（22）执行生效的基金份额持有人大会的决定；

（23）法律法规、基金合同以及中国证监会规定的其他义务。

（三）基金份额持有人

基金投资者自依招募说明书、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当事人，直至其不再持有本基金的基金份额，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的完全承认和接受。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。

本基金基金合同生效之日起 3 年内，回报 A、回报 B 的基金份额持有人持有的每一份基金份额按照基金合同约定在各自份额级别内具有同等的合法权益；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，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》及其他有关法律法规的规定，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）依法转让或者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、基金份额代销机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；

（9）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）缴纳基金认购、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投票权。

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，应当召集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