(上接A31版)

3、基金季度报告：基金管理人应当在每个季度结束之日起15个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定报刊和基金管理人网站上。

4、基金合同生效不足2个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

5、基金定期报告应当在公开披露的第二个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

(四)基金资产净值公告、基金份额净值公告和基金份额累计净值公告

基金合同生效后，在开始办理金鹰中证500基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在中国证监会指定媒体上公告一次基金资产净值和金鹰中证500份额净值、金鹰中证500A与金鹰中证500B的份额参考净值。

在开始办理金鹰中证500基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的金鹰中证500份额净值和累计净值、金鹰中证500A与金鹰中证500B各自的份额参考净值和参考累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和金鹰中证500份额净值、金鹰中证500A与金鹰中证500B的份额参考净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、金鹰中证500份额净值和累计净值、金鹰中证500A与金鹰中证500B各自的份额参考净值和参考累计净值登载在中国证监会指定媒体上。

(五)临时报告与公告

基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在2日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：

1、基金份额持有人大会的召开及其通过的决议；
2、终止基金合同；
3、转换基金运作方式；
4、更换基金管理人、基金托管人；
5、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
6、基金管理人股东及其出资比例发生变更；
7、基金募集期延长；
8、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
9、基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十；
10、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过百分之三十；
11、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
12、基金管理人、基金托管人的基金托管部门受到监管部门的调查；
13、基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
14、重大关联交易事项；
15、基金收益分配事项；
16、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
17、金鹰中证500份额净值、金鹰中证500A与金鹰中证500B的份额参考净值计价错误达到相应级别基金份额净值或参考净值0.5%；
18、基金改聘会计师事务所；
19、变更基金代销机构；
20、更换基金注册登记人；
21、本基金开始办理申购、赎回；
22、本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
23、本基金发生巨额赎回并延期支付；
24、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
25、本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
26、本基金开始接受或暂停接受份额配对转换申请；
27、本基金暂停接受份额配对转换后恢复办理份额配对转换业务；
28、本基金实施基金份额折算；
29、金鹰中证500A份额与金鹰中证500B份额暂停上市、恢复上市或终止运作；
30、金鹰中证500A份额与金鹰中证500B份额终止运作后金鹰中证500A、金鹰中证500B的份额转换；
31、基金推出新业务或服务；
32、中国证监会规定的其他事项。

(六)澄清公告

在基金存续期内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

(七)中国证监会规定的其他信息

(八)信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和代销机构的住所，投资者可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。

基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，以及金鹰中证500A份额与金鹰中证500B份额上市交易的证券交易所，以供公众查阅、复制。本基金的上市交易公告书公布后，应当分别置备于基金管理人、金鹰中证500A与金鹰中证500B份额上市交易的证券交易所，以供公众查阅、复制。投资者可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。投资者也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。 本基金的信息披露事项将在至少一家指定媒体公告。

本基金的信息披露将严格按照法律法规和基金合同的规定进行，基金管理人和基金托管人应保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

二十、风险揭示

(一)市场风险

本基金主要投资于股票市场、债券市场，因而，影响证券市场价格的因素（政治因素、经济因素、投资心理和交易制度等各种因素）都将直接或间接地传导至本基金的投资组合，导致基金收益水平发生变化，产生风险。主要的风险因素包括：

1、政策风险

因财政政策、货币政策、产业政策、地区发展政策等国家宏观政策发生变化，导致市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

2、经济周期风险

随着经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化，基金投资的收益水平也会随之变化，从而产生风险。

3、利率风险

金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着企业的融资成本和利润水平，进而影响证券的价格和收益率。基金投资的权益类和债券类资产，其收益水平可能会受到利率波动的影响。

4、通货膨胀风险

基金投资的目的是基金资产的保值增值，如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

5、上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素的影响，如市场前景、行业竞争、技术更新、财务状况、管理能力、以及新产品研究开发等等都会导致公司盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。上市公司还可能出现经营风险，虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但并不能完全规避。

6、债券收益率曲线变动的风险

债券收益率曲线变动风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险，由于不同期限债券的收益率变动程度不同，各期限债券的价格变动也会不同；基金组合中债券类资产的单一的加权平均久期指标将不能充分反映这一债券收益率曲线非平行移动带来的风险。

7、再投资风险

市场利率下降将影响固定收益类证券和回购业务的再投资收益率，这与利率上升所带来的价格风险互为消长。具体为当利率下降时，基金从投资的固定收益证券和回购业务所得的利息收入进行再投资时，将获得比以前较少的收益率。

(二)信用风险

主要指基金投资的债券类资产的发行主体信用状况恶化，到期不能履行合约进行兑付，以及发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险。信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险，以及上市公司信息披露不真实、不完整，而导致基金资产损失和收益变化的风险。

(三)管理风险

基金管理人的专业技能、研究能力及投资管理水平直接影响到其对信息的占有、分析和对经济形势、证券价格走势的判断，进而影响基金的投资收益水平。同时，基金管理人的投资管理制度、风险管理和内部控制制度是否健全，能否有效防范道德风险和其他合规性风险，以及基金管理人的职业道德水平等，也会对基金的风险收益水平造成影响。

(四)流动性风险

基金投资组合中的股票、债券因各种原因面临较高的流动性风险，将使交易指令的执行难度提高，买入成本或变现成本增加。此外，当基金出现巨额赎回而导致基金现金支付出现困难或被迫以不利价格调整仓位时，基金净资产将会受到不利影响。

(五)操作和技术风险

基金的相关当事人在各业务环节的操作过程中，可能因内部控制不到位或者人为因素造成操作失误或违反操作规程而引致的风险，如越权交易、内幕交易、交易错误和欺诈等。

在开放式基金的后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而导致基金日常的注册登记系统瘫痪、申购赎回无法按正常时限完成、核算系统无法按正常时限显示产生净值、基金的投资交易指令无法及时传输而影响交易的正常进行等情况而导致基金份额持有人利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、基金托管人、注册登记人、销售机构、证券交易所和证券登记结算机构等。

此外，基金还面临临合计风险，其主要包括：基金数据维护风险、基金数据接收风险、基金估值风险。基金数据维护风险主要指需要人工维护的数据可能发生错误的风险，如债券信息、权益信息、银行间交易等；基金数据接收风险主要指外接收交易所、证券登记结算公司数据时可能存在缺失的风险；基金估值风险主要指每日基金估值可能发生错误的风险。

(六)合规性风险

指在基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规或基金合同有关规定的风险，或者基金投资违反法规及基金合同有关规定的风险。

(七)本基金特有的风险

本基金特有的风险主要包括：

1、被动投资的风险

(1)标的指数下跌的风险

本基金不低于90%的基金净资产将用于跟踪标的指数，业绩表现将会随着标的指数的波动而波动；同时本基金在多数情况下将维持较高的股票仓位，在股票市场下跌的过程中，可能面临基金净值与标的指数同步下跌的风险。

(2)跟踪偏离的风险

本基金投资组合收益率可能由于标的指数调整成分股或变更编制方法、成分股派发现金红利、流动性风险（成分股停牌、摘牌或流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合或承担较大的冲击成本）、本基金的运营费用（证券投资中的交易成本、基金管理费、托管费等）、估值费等原因导致基金的收益率与业绩比较基准收益率发生较大偏离。

(3)标的指数变更的风险

根据基金合同的规定，因标的指数的编制与发布等原因，导致原标的指数不宜继续作为本基金的投资标的指数及业绩比较基准，本基金可能变更标的指数，基金的投资组合将随之调整，基金的收益风险特征可能发生变化，投资者还须承担投资组合调整所带来的风险与成本。

2、份额分级、折算、上市交易的风险

金鹰中证500A份额和金鹰中证500B份额的运作有别于普通的开放式基金与封闭式基金。投资者投资于本基金还将面临以下特有风险。

(1)杠杆机制的风险

本基金为股票型指数基金，属于预期收益与风险较高的基金品种，一般而言，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

根据本基金的分级方案，金鹰中证500A份额的预期收益较为稳定，承受较小的波动性，预期风险相对较低；由于本基金分级方案内涵的杠杆机制设计，金鹰中证500B份额的具有一定的杠杆倍数，其净值的波动性往往大于金鹰中证500份额、金鹰中证500A份额。

(2)与上市交易有关的风险

1)停牌或终止上市的风险

依据基金合同，金鹰中证500A份额和金鹰中证500B份额将于基金合同生效后6个月内申请在深交所挂牌上市，可能因为信息披露等原因导致基金停牌，投资者在停牌期间不能买卖金鹰中证500A份额和金鹰中证500B份额从而产生风险。

在基金份额折算期间，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停金鹰中证500A份额和金鹰中证500B份额的上市交易和金鹰中证500份额的申购或赎回等业务，投资者的基金份额可能面临不能变现的风险。

另外，当基金份额持有人将份额转向场外交易后导致场内的基金份额或持有人不满足上市条件时，本基金存在暂停上市或终止上市的可能。

2)折/溢价交易风险

金鹰中证500A份额和金鹰中证500B份额在上市交易后，由于是通过集合竞价确定交易价格，受供求关系的影响，基金份额的交易价格可能偏离基金份额参考净值而出现折/溢价风险。尽管在基金份额配对转换机制下，一份金鹰中证500A份额和一份金鹰中证500B份额市价总和将趋近两份金鹰中证500份额的净值，但金鹰中证500A份额和金鹰中证500B份额之中的某一级份额仍然有可能存在折溢价的状态。此外，受基金份额配对转换机制带来的套利机会的影响，金鹰中证500A份额和金鹰中证500B份额的交易价格可能会互相影响。

3)流动性风险

在金鹰中证500A份额和金鹰中证500B份额上市交易后，金鹰中证500A份额和金鹰中证500B份额可能因为份额余额较小或交易量不足而导致投资者不能迅速、低成本的买入或卖出，从而产生流动性风险。

(3)与份额折算有关的风险

1)折算尾差的风险

在计算过程中，场内份额采用截位法保留到整数位，场外份额采用截位法保留到小数点后第2位，小数点第3位及第3位以后的部分舍去，由此产生的误差计入基金资产。因此，在基金份额折算过程中由于尾差处理而可能给投资者带来损失。

2)新增份额无法赎回的风险

此外，金鹰中证500A份额和金鹰中证500B份额的持有人折算后的新增份额还可能面临无法赎回的风险。由于在二级市场可以做交易的证券公司并不全部具备中国证券监督管理委员会颁发的基金代销资格，而只有具备基金代销资格的证券公司才可以允许投资者赎回基金份额。因此，如果投资者通过不具备基金代销资格的证券公司购买金鹰中证500A份额或金鹰中证500B份额，在其参与份额折算后，则折算新增的金鹰中证500份额并不能被赎回。此时，基金份额持有人可以选择将新增的金鹰中证500份额通过转托管业务转入具有基金代销资格的证券公司后赎回基金份额。

3)风险收益特性发生变化的风险

根据本基金的折算方案，本基金将进行定期折算与不定期折算。在定期折算日（每会计年度第一个工作日），金鹰中证500A上年度末份额参考净值超过1.0000元的部分将根据净资产不变的原则，折算为新增的金鹰中证500场内份额；在不定期折算日，金鹰中证500A和（或）金鹰中证500B份额参考净值超过1.0000元的部分，亦根据净资产不变的原则，分别折算为新增的金鹰中证500份额，折算完成后，单独持有金鹰中证500A或金鹰中证500B的基金份额持有人的风险收益特性将发生变化。

(4)与份额配对转换有关的风险

《基金合同》生效后，在金鹰中证500份额、金鹰中证500A份额和金鹰中证500B份额的存续期内，基金管理人将根据《基金合同》的约定办理金鹰中证500份额与金鹰中证500A份额、金鹰中证500B份额之间份额配对转换。一方面，份额配对转换业务的办理可能改变金鹰中证500A份额和金鹰中证500B份额的市场供求关系，从而可能影响其交易价格；另一方面，份额配对转换业务可能出现暂停办理的情形，投资者的份额配对转换申请也可能存在不能及时确认的风险。

(5)不进行收益分配的风险

在存续期内，本基金（包括金鹰中证500份额、金鹰中证500A份额和金鹰中证500B份额）将不进行收益分配。

在满足折算条件的情况下，本基金将进行定期折算与不定期折算。基金份额折算后，若有新增的金鹰中证500场内份额，投资者可赎回新增的金鹰中证500场内份额，以获取投资回报。但是，投资者赎回新增的金鹰中证500场内份额以获取投资收益的方式并不等同于基金收益分配；投资者须承担相应的交易成本。

(八)其他风险

1、因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、风险管理和内控制度等方面不完善而产生的风险；

2、因金融市场危机、行业竞争压力可能产生的风险；

3、战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，可能严重影响证券市场运行，导致基金资产损失；

4、其他意外导致的风险。

二十一、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

(一)基金合同的变更

1、基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议通过。以下变更《基金合同》的事项应经基金份额持有人大会决议通过：

(1)转换基金运作方式；
(2)变更基金类别；
(3)变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规、中国证监会和《基金合同》另有规定的除外）；
(4)变更基金份额持有人大会程序；
(5)更换基金管理人、基金托管人；
(6)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外；
(7)本基金与其他基金的合并；
(8)终止金鹰中证500A份额与金鹰中证500B份额的运作；
(9)对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；
(10)法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公告，并报中国证监会备案：

(1)调低基金管理费、基金托管费；
(2)在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；
(3)因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；
(4)基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系的调整；
(5)基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
(6)标的指数更换名称或指数公司调整指数编制方法；
(7)除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其它情形。

2、关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行，并自生效之日起2日内在至少一家指定媒体公告。

(二)基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

2、基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6个月内无其他适当的基金管理人承接其原有权利义务；

3、基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在6个月内无其他适当的托管人承接其原有权利义务；

4、法律法规和基金合同规定的其他情形。

(三)基金财产的清算

1、基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。

2、基金财产清算组

(1)自基金合同终止之日起30个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算；在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

(2)基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、基金注册登记人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

(3)基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

3、清算程序

(1) 基金合同终止后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
(2) 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
(3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
(4) 对基金财产进行评估和变现；
(5) 基金清算组做出清算报告；
(6) 会计师事务所对清算报告进行审计；
(7) 律师事务所对清算报告出具法律意见书；
(8) 将基金清算结果报告中国证监会；
(9) 公布基金清算公告；
(10)对基金剩余财产进行分配。

4、清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金清算组优先从基金财产中支付。

5、基金剩余财产的分配

基金财产按如下顺序进行清偿：

(1)支付基金财产清算费用；
(2)缴纳基金所欠税款；
(3)清偿基金债务；
(4)根据基金合同终止日金鹰中证500份额净值、金鹰中证500A份额与金鹰中证500B份额各自的基金份额参考净值分别计算金鹰中证500、金鹰中证500A与金鹰中证500B三类份额各自的应计分配比例，在此基础上，在金鹰中证500份额、金鹰中证500A份额与金鹰中证500B份额各自级别内，按照基金份额持有人实际持有上述各级别基金份额占该级别份额总额的比例进行分配。基金财产未按前款（1）-（3）项规定清偿前，不得分配给基金份额持有人。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准，在本基金的金鹰中证500A份额与金鹰中证500B份额终止运作后，如果本基金进行基金财产清算，则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占基金份额总额的比例进行分配。

6、基金财产清算的公告

清算小组成立后2日内应就清算小组的成立进行公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存不少于15年。若是基金托管人因解散、破产、撤销等事由导致基金清算的，清算账册及文件由基金管理人或相关当事人保存不少于15年。

二十二、基金合同的内容摘要

基金合同内容摘要

(一)基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

1、基金份额持有人的权利、义务

(1)基金投资者持有本基金基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，基金投资者自依据招募说明书、基金合同取得本基金的基金份额，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。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。金鹰中证500、金鹰中证500A、金鹰中证500B的每份基金份额在其各自的份额级别内具有同等的合法权益。

(2)基金份额持有人的权利

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、注册登记人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
9)法律法规、基金合同规定的其它权利。

(3)基金份额持有人的义务

1)遵守基金合同；
2)交纳基金认购、申购款项及基金合同规定的费用；
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合同当事人合法利益的活动；
5)执行生效的基金份额持有人大会决议；
6)返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及代销机构处获得的不当得利；
7)法律法规及基金合同规定的其他义务。

2、基金管理人的权利、义务

(1)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

(2)基金管理人的权利

1)依法募集基金，办理基金备案手续；
2)自基金合同生效之日起，依照法律法规和基金合同独立管理基金财产；
3)根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金募集、认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；
4)根据法律法规和基金合同的规定获得基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
5)在符合有关法律法规和基金合同的前提下，决定本基金的相关费率结构和收费方式；
6)根据法律法规和基金合同之规定销售基金份额；
7)依据法律法规和基金合同的规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
8) 根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；
9) 自行担任基金注册登记人或选择、更换基金注册登记代理机构，办理基金注册登记业务，并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查；
10) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；
11)在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资融券；
12)依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益的分配方案；
13)按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其它证券所产生的权利；
14)在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；
15)依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；
16) 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；
17)选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；
18)法律法规、基金合同以及依据基金合同制订的其它法律文件所规定的其它权利。

(3)基金管理人的义务

1)依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；如认为基金代销机构违反《基金合同》、基金销售与服务代理协议及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
2)办理基金备案手续；
3)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；
4)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；
5) 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；
6) 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；
7) 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资产相互独立，对所管理的不同基金和受托资产分别管理、分别记账，进行证券投资；
8) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得以基金财产为自己及任何第三人谋取非法利益，不得委托第三人运作基金财产；
9) 接受基金托管人依法进行的监督；
10)采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，按照有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；
11)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；
12)保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关法律法规另有规定外，在基金信息公开披露前，应予以保密，不得向他人泄露；
13)按基金合同确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
14)按照法律法规和本基金合同的规定受理申购和赎回等申请，及时、足额支付赎回和分红款项；
15)不谋求对上市公司的控股和直接管理；
16)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；
17)按规定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；
18)进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；
19)编制基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告；
20)确保需要向基金份额持有人提供的各项文件或资料，能在规定时间内发出；保证投资者能够按照基金合同约定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；
21)组织并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；
22)面临解散、依法被撤销、被依法宣告破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
23)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的合法权益，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
24)监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，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；
25)不从事任何有损基金财产及本基金其他当事人利益的活动；
26)公平对待所管理的不同基金和受托资产，防止在不同基金和受托资产间进行有损本基金基金份额持有人的利益的资源分配；
27)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，执行生效的基金份额持有人大会的决定；
28)在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，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；
29)建立并保存基金份额持有人名册，定期或不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册；
30)法律法规及基金合同规定的其他义务。

2、基金托管人的权利和义务

(1)基金托管人概况

名称：交通银行股份有限公司
住所：上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人：胡怀邦
成立日期：1987年3月30日
批准设立机关及批准设立文号：国务院国发（1986）字第81 号文和中国人民银行银发［1987］40号文
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字［1998］25号
组织形式：股份有限公司
注册资本：618.8561亿元人民币
存续期间：持续经营
经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项业务；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务；经营结汇、售汇业务。

(2)基金托管人的权利

1)依据法律法规和基金合同的规定保管基金财产；
2)依照基金合同的约定获得基金托管费；
3)监督基金管理人对本基金的投资运作，如托管人发现基金管理人的投资指令违反基金合同或有关法律法规的规定的，不予执行并向中国证监会报告；
4)在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；
5)依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；
6)依据法律法规和基金合同的规定监督基金管理人，如认为基金管理人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其它基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会，以及采取其它必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；
7)法律法规、基金合同规定的其它权利。

(3)基金托管人的义务

1)以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产；
2)设立专门的基金托管部门，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资产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金和受托资产分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金、受托资产之间在名册登记、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》、本基金合同及其他有关规定外，不以基金财产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；
6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
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) 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以保密，不得向他人泄露；
9) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值及基金份额申购、赎回价格；
10)办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
11)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；
12)按规定保存有关基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料，保存基金的会计账册、报表和记录等15 年以上；
13)根据有关法律法规，建立并保存基金份额持有人名册；
14)按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
15)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；
16) 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；
17)按照规定监督基金管理人的投资运作；
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)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；
20)按照规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，基金托管人应为基金向基金管理人追偿；
21)因违反基金合同导致基金财产的损失，应承担赔偿责任，其责任不因其退任而免除；
22)不从事任何有损基金及本基金合同其他当事人利益的活动；
23)执行生效的基金份额持有人大会的决定；
24)法律、法规、本基金合同所规定的其他义务。

(二)基金概况

1、基金名称
金鹰中证500指数分级证券投资基金。
2、基金的类别
股票型证券投资基金。
3、基金的运作方式
契约型开放式。
4、份额分拆规则

每2份金鹰中证500指数基金场内份额（初始面值为1元）按照1:1的比例，分拆成预期收益与风险特性不同的两种份额，即：优先获得收益分配权的优先级（称为金鹰中证500A，初始面值为1元），获得剩余收益分配权的进取级（称为金鹰中证500B，初始面值为1元），金鹰中证500A、金鹰中证500B两类基金份额的基金资产合并运作。

5、基金份额的上市交易

金鹰中证500A与金鹰中证500B的基金份额采用不同的交易代码同时在深圳证券交易所上市交易。基金份额持有人或投资者可通过二级市场交易金鹰中证500A或金鹰中证500B的基金份额。

6、金鹰中证500A与金鹰中证500B基金份额资产与收益的分配规则

金鹰中证500A、金鹰中证500B基金份额的资产及收益分配规则如下：

(1)金鹰中证500A基金份额约定的年收益率为：一年期银行定期存款年利率（税后）+3.5%。其中计算金鹰中证500 A份额约定年收益率的一年期银行定期存款年利率以当年1月1日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期定期存款基准利率为准；但基金合同生效日所在年度的年约定收益率为基金合同生效日中国人民银行公布的金融机构人民币一年期存款基准利率。

(2)对于已分拆的金鹰中证500指数基金份额而言，每2份已分拆的金鹰中证500指数基金份额所对应的净值优先支付1份金鹰中证500A基金份额的约定年收益和期初份额净值，剩余部分全部分配给1份金鹰中证500B份额的持有人。

(三)基金份额的折算

本基金份额的折算包括定期折算与不定期折算。

1、折算日

细分为定期折算日与不定期折算日。定期折算日为金鹰中证500指数分级基金存续期内每个会计年度第一个工作日；不定期折算日为折算前当日金鹰中证500B的份额参考净值小于0.2500（不含0.2500）或金鹰中证500基金份额净值大于2.0000（不含2.0000）元人民币的工作日；若定期折算日与不定期折算日为同一日，则按照不定期折算规则进行折算；若基金合同生效日为所处会计年度的第一个工作日则不进行折算。

2、折算对象

基金份额折算基准日登记在册的金鹰中证500A、金鹰中证500B、金鹰中证500份额。

3、折算的理念与目标

(1)折算的理念

为体现金鹰中证500A的优先分配权，本基金采取定期折算的措施；为防止金鹰中证500B的份额参考净值过低或过高，本基金采取不定期折算的措施。

(2)折算的目标

折算后，金鹰中证500A份额与金鹰中证500B份额的比例为1:1，并对金鹰中证500A、金鹰中证500B、金鹰中证500份额数与份额净值或参考作相应的调整。

(四)基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

1、本基金的基金份额持有人大会，由本基金的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。基金份额持有人大会的审议事项应分别由金鹰中证500、金鹰中证500A、金鹰中证500B的基金份额持有人独立进行表决。本基金的金鹰中证500、金鹰中证500A、金鹰中证500B的基金份额持有人在其对应的份额级别内享有平等的表决权，每一基金份额具有一票表决权。

2、有以下事由情形之一时，应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；
(3)更换基金托管人；
(4)更换基金管理人；
(5)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；
(6)本基金与其它基金的合并；
(7)变更基金类别；
(8)变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
(9)变更基金份额持有人大会程序；
(10)对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
(11)终止金鹰中证500A份额与金鹰中证500B份额的运作；
(12)基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
(13)单独或合计持有金鹰中证500份额、金鹰中证500A份额、金鹰中证500B份额各自10%以上（含10%，下同）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；
(14)法律法规、基金合同或中国证监会规定的其它应当召开基金份额持有人大会的事项。

3、以下情况不需召开基金份额持有人大会：

(1)调低基金管理费、基金托管费；
(2)在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、调低赎回费率或或变更收费方式；
(3)因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；
(4)基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系的调整；
(5)基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
(6)标的指数更换名称或指数公司调整指数编制方法；
(7)除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其它情形。

4、召集人和召集方式

(1)除法律法规或本基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

(2)基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

(3)单独或合计持有金鹰中证500、金鹰中证500A、金鹰中证500B各自基金份额10%以上（含10%，以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，单独或合计持有金鹰中证500、金鹰中证500A、金鹰中证500B各自基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开。

(4)单独或合计持有金鹰中证500、金鹰中证500A、金鹰中证500B各自基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计持有金鹰中证500、金鹰中证500A、金鹰中证500B各自基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前30日向中国证监会备案。

(5)基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

(6)基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

5、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

(1)召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前40天在至少一家指定媒体及基金管理人网站上公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

1)会议召开的时间、地点和方式；
2)会议拟审议的主要事项；
3)会议形式；
4)议事程序；
5)有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日；
6)授权委托书的内容要求（包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
7)表决方式；
8)会务常设联系人姓名、电话；
9)出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
10)召集人需要通知的其他事项。

(2)采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交和收取方式及截止时间。

(3)如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票结果。

6、基金份额持有人出席会议的方式

(1)会议方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。

现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席；基金管理人或托管人不派代表列席的，不影响表决效力。

通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定，基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址，以通讯的书面方式进行表决。

会议的召开方式由召集人确定，但决定更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式和终止基金合同事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

(2)召开基金份额持有人大会的条件

1)现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

A、对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，有效的金鹰中证500、金鹰中证500A、金鹰中证500B基金份额应占权益登记日各自级别基金份额的50%以上（含50%）；

B、到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符。

未能满足上述条件的情况下，则召集人可另行确定并公告重新开会的时间和地点，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。

2)通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

A、召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告；

B、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；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

C、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单独或合计持有的金鹰中证500、金鹰中证500A、金鹰中证500B基金份额应占权益登记日各自级别基金份额的50%以上（含50%）；

D、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其他代表，同时提交的持有基金份额的凭证符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与登记注册机构记录相符。

如果开会条件达不到上述条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间，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。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

7、议事内容与程序

(1)议事内容及提案权

1)议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

2)基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日金鹰中证500、金鹰中证500A、金鹰中证500B各自级别基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案。临时提案应当在大会召开日前35天提交召集人。召集人对于临时提案应当在大会召开日前30天公布。

3)对于基金份额持有人提交的提案（包括临时提案），大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

A、关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明。

B、程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

4)单独或合并持有权利登记日金鹰中证500、金鹰中证500A、金鹰中证500B各自级别基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案、基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于6个月。法律法规另有规定除外。

5)基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改或增加新的提案，应当最迟在基金份额持有人大会召开日前30日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有30日的间隔期。

(2)议事程序

1)现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议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，经讨论后在公证机关监督下进行表决，经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，则由出席大会的分别或合计持有金鹰中证500、金鹰中证500A、金鹰中证500B的基金份额持有人和代理人以所代表的各自级别基金份额50%以上多数选举产生一名代表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做出的决议的效力。

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，首先由召集人至少提前30天公布提案，在所通知的表决截止日期第2天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。

8、决议形成的条件、表决方式、程序

(1)金鹰中证500、金鹰中证500A、金鹰中证500B的基金份额持有人所持每一基金份额在其对应份额级别内享有平等的表决权。

(2)基金份额持有人大会决议分为特别决议和一般决议：

1)特别决议

特别决议须经出席会议的分别或合计持有金鹰中证500、金鹰中证500A、金鹰中证500B的基金份额持有人及其代理人所持各自级别表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效；更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同的重大事项必须以特别决议方式通过。

2)一般决议

一般决议须经出席会议的分别或合计持有金鹰中证500、金鹰中证500A、金鹰中证500B的基金份额持有人及其代理人所持各自级别表决权的50%以上（含50%）通过方为有效，除须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

(3)基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准，或者备案，并予以公告。

(4)基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

(5)基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

(6)基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人和基金托管人均有约束力。

9、计票

(1)现场开会

1)如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举3名基金份额持有人担任监票人。

2)监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点，由大会主持人当场公布计票结果。

3)如会议主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对投票数进行重新清点；如会议主持人未进行重新清点，而出席会议的基金份额持有人或代理人对会议主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，会议主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

4)计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不参加基金份额持有人大会或拒不配合计票的，不影响计票的效力。

(2)通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

10、基金份额持有人大会决议的生效与公告

(1)基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，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决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

(2)生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决定。

(3)基金份额持有人大会决议应自生效之日起2日内由相关信息披露义务人在至少一家指定媒体和基金管理人网站上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

(五)基金收益分配原则、执行方式

在存续期内，本基金（包括金鹰中证500份额、金鹰中证500A份额、金鹰中证500B份额）不进行收益分配。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准后，如果终止金鹰中证500A份额与金鹰中证500B份额的运作，本基金将根据基金份额持有人大会决议调整基金的收益分配。具体见基金管理人届时发布的相关公告。

(六)与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

1、基金费用的种类

(1)基金管理人的管理费；
(2)基金托管人的托管费；
(3)与基金使用相关指数有关的费用；
(4)基金的证券交易费用；
(5)基金合同生效以后的与基金相关的信息披露费用；
(6)基金份额持有人大会费用；
(7)基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费；
(8)基金银行汇划费用；
(9)基金上市初费和上市月费；
(10)账户开户费和账户维护费；
(11)按照国家有关规定可以从基金财产中列支的其他费用。

上述费用从基金财产中支付。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1)基金管理人的管理费

本基金的管理费率为年费率1.0%。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

H =E×年管理费率÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

(2)基金托管人的基金托管费

本基金的托管费率为年费率0.22%。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

H =E×年托管费率÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

(3)指数许可使用费用

基金管理人可与指数许可方签订书面协议，约定指数使用的费用及支付方式。指数使用费用为指数许可使用基点费。在通常情况下，指数许可使用基点费按前一日的基金资产净值的0.02%年费率计提，从基金财产中列支，每日计算，逐日累计，按季支付，计算方法如下：

H=E×0.02%/当年天数（H 为每日应付的指数许可使用基点费，E 为前一日的基金资产净值）

自基金合同生效日起，指数许可使用基点费每季度支付一次，指数许可使用基点费的收取下限为每季度人民币5 万元整（即不足5 万元时按照5 万元收取）。当年基金合同生效不足一个季度的，按照一个季度收费。

在通常情况下，标的指数许可使用基点费按照前一日基金资产净值的0.02%的年费率与收取下限的日均摊销数额两者孰高的原则进行计提。标的指数许可使用基点费每日计算，逐日累计。

计算方法如下：

收取下限的日均摊销数额=5 万元/季度×4 季度/年÷当年天数（365 天或366 天）≈548元/天

H=max（E×0.02%/当年天数，548）

在上式当中，H 为每日应计提的标的指数许可使用基点费，E 为前一日的基金资产净值，标的指数许可使用基点费的支付方式为每季支付一次，自基金合同生效日起，于每年1月、4 月、7 月、10 月的最后一个工作日前从基金财产中一次性向中证指数有限公司支付上一季度的标的指数许可使用基点费。

(4)本章第（六）条第1款之第（4）至第（11）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，列入或摊入当期基金费用。

3、不列入基金费用的项目

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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支。

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。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在至少一家中国证监会指定媒体及基金管理人网站上刊登公告。

5、其他费用

按照国家有关规定和基金合同约定，基金管理人可以在基金财产中列支其他的费用，并按照相关的法律法规的规定进行公告或备案。

(七)基金财产的投资方向和投资限制

1、投资目标

本基金为股票型指数基金，以跟踪指数为目标，力求将基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在0.35%以下、年跟踪误差控制在4%以下。

2、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）。股票资产占基金资产净值的比例为90%~95%，其中，中证500指数成分股和备选成分股占基金资产净值的比例不低于90%；债券、货币市场工具、现金、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及其他资产占基金资产净值的5%~10%，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%，权证投资的比例范围占基金资产净值的0%~3%。

3、投资禁止行为与限制

(1)禁止用本基金财产从事以下行为

1)承销证券；
2)向他人贷款或者提供担保；
3)从事承担无限责任的投资；
4)买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
5)向本基金的基金管理人、基金托管人出资或者买卖本基金的基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
6)买卖与本基金的基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与本基金的基金管理人、基金托管人有其他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；
7)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
8)依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

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)本基金持有的股票资产占基金资产净值的比例为90%~95%，其中，中证500指数成分股和备选成分股占基金资产净值的比例不低于90%；债券、货币市场工具、现金、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及其他资产占基金资产净值的5%~10%；

2)本基金参与股票发行申购，所申报的金额不超过本基金总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

3)在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不展期；

4)在银行间市场进行债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的40%；

5)基金的投资组合中保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%；

6) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得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，其市值不得超过基金资产净值的3%；本公司管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%。其他权证的投资比例，遵从法规或监管部门的相关规定；

7)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%；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%；本公司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%；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%，中国证监会规定的特殊品种除外。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，将在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

8) 流通受限证券投资遵照《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》（证监基金字［2006］141号）及相关规定执行；

9)法律、法规、基金合同及中国证监会规定的其他比例限制。

(3)法律法规或监管部门修改或取消上述限制规定（第1)项除外）时，本基金不受上述投资组合限制并相应修改限制规定。

4、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约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合基金合同约定的，基金管理人应当在限期内进行调整，法律法规另有规定的，从其规定。

(八)基金资产估值方法

1、股票估值方法

(1)上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

(2)未上市股票的估值：

1)首次发行的股票，采用估值技术确定公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2)首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日其所在证券交易所上市的同一股票以第（1）条确定的估值价格进行估值。

3)送股、转增股、配股和公开增发新股等方式发行的股票，按估值日该上市公司在证券交易所挂牌的同一流通股票以第（1）条确定的估值价格进行估值。

4)非公开发行有明确锁定期的股票按如下方法进行估值：

A、估值日在证券交易所上市交易的同一股票以第（1）条确定的估值价格低于非公开发行股票的初始取得成本时，应采用在证券交易所上市交易的同一股票以第（1）条确定的估值价格作为估值日该非公开发行股票的价值；

B、估值日在证券交易所上市交易的同一股票以第（1）条确定的估值价格高于非公开发行股票的初始取得成本时，应按下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值：

FV=C+（P-C）×（Dl-Dr）/Dl，其中：FV为估值日该非公开发行股票的价值；C为该非公开发行股票的初始取得成本（因权益业务导致市场价格除权时，应于除权日对其初始取得的成本作相应调整）；P为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价；Dl为该非公开发行股票锁定期所含的交易天数；Dr为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易所的交易天数，不含估值日当天。

(3)国家有最新规定的，按其规定进行估值。

2、债券估值方法

(1)在证券交易所市场挂牌交易的实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

(2) 在证券交易所市场挂牌交易的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，估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日债券收盘价减去所含的最近交易日债券应收利息后的净价进行估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价（净价）及重大变化因素，调整最近交易日收盘价（净价），确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价（净价）不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价（净价）进行调整，确定公允价值进行估值。

(3)首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(4) 在银行间债券市场交易的债券根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。

(5)国家有最新规定的，按其规定进行估值。

3、权证估值方法

(1)上市流通权证按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

(2)首次发行未上市的权证，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)停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

(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)国家有最新规定的，按其规定进行估值。

4、资产支持证券的估值方法

(1)交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，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。

(2)全国银行间市场交易的资产支持证券，根据行业协会指导的处理标准和意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。

(3)国家有最新规定的，按其规定进行估值。

5、其他资产的估值方法

其他资产按国家有关规定进行估值。

6、在任何情况下，基金管理人如采用上述估值方法对基金财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如基金管理人认为上述估值方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场各因素的基础上，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。

基金管理人、基金托管人发现基金估值违反《基金合同》订明的估值方法、程序以及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，发现方应及时通知对方，以约定的方法、程序和相关法律法规的规定进行估值，以维护基金份额持有人的利益。

根据《基金法》，本基金的基金会计责任方由基金管理人担任。因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，基金管理人有权按照其对基金净值的计算结果对外予以公布。由此给基金份额持有人和基金造成的损失以及因该交易日基金资产净值计算顺延错误而引起的损失，由基金管理人负责赔付。

(九)基金资产净值的计算方法和公告方式

1、基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

在不发生折算的情况下，金鹰中证500份额净值、金鹰中证500A和金鹰中证500B份额参考净值即为折算前的金鹰中证500份额净值或参考净值；在发生折算的情况下，金鹰中证500份额净值、金鹰中证500A和金鹰中证500B的份额参考净值为折算后的份额净值或参考净值，份额数则根据折算规则作相应的调整。

基金份额（参考）净值的计算结果，精确到0.0001 元，小数点第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

2、本基金的基金合同生效后，在开始办理金鹰中证500份额申购或者赎回前，基金管理人将在中国证监会指定媒体上，至少每周公告一次基金资产净值和金鹰中证500份额净值、金鹰中证500A和金鹰中证500B各自的份额参考净值；

在金鹰中证500A、金鹰中证500B份额上市交易或开始办理金鹰中证500份额申购或者赎回后，基金管理人将在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日金鹰中证500份额净值和累计净值、金鹰中证500A与金鹰中证500B各自的份额参考净值和参考累计净值；

基金管理人将公告半年度和年度最后一个市场交易日（或自然日）基金资产净值和金鹰中证500份额净值、金鹰中证500A与金鹰中证500B各自的份额参考净值。基金管理人应当在上述市场交易日（或自然日）的次日，将基金资产净值、金鹰中证500份额净值和累计净值、金鹰中证500A和金鹰中证500B各自的份额参考净值和参考累计净值登载在至少一家证监会指定媒体和基金管理人网站上。

(十)基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

1、基金合同的变更

基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。以下变更《基金合同》的事项应经基金份额持有人大会决议通过：

(1)转换基金运作方式；
(2)变更基金类别；
(3)变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规、中国证监会和《基金合同》另有规定的除外）；
(4)变更基金份额持有人大会程序；
(5)更换基金管理人、基金托管人；
(6)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外；
(7)本基金与其他基金的合并；
(8)终止金鹰中证500A份额与金鹰中证500B份额的运作；
(9)对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；
(10)法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公告，并报中国证监会备案：

(1)调低基金管理费、基金托管费；
(2)在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、调低赎回费率或或变更收费方式；
(3)因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；
(4)基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系的调整；
(5)基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
(6)标的指数更换名称或指数公司调整指数编制方法；
(7)除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其它情形。

关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行，并自生效之日起2日内在至少一家指定媒体公告。

2、基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同终止：

(1)基金份额持有人大会决定终止；
(2)基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6个月内无其他适当的基金管理人承接其原有权利义务；
(3)基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在6个月内无其他适当的托管人承接其原有权利义务；
(4)法律法规和基金合同规定的其他情形。

3、基金财产的清算

(1)基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。

(2)基金财产清算组

1)自基金合同终止之日起30个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算；在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

2)基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、基金注册登记人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

3)基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

(3)清算程序

1) 基金合同终止后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
2) 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
4) 对基金财产进行评估和变现；
5) 基金清算组做出清算报告；
6) 会计师事务所对清算报告进行审计；
7) 律师事务所对清算报告出具法律意见书；
8) 将基金清算结果报告中国证监会；
9) 公布基金清算公告；
10)对基金剩余财产进行分配。

(4)清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金清算组优先从基金财产中支付。

(5)基金剩余财产的分配

基金财产按如下顺序进行清偿：

1)支付基金财产清算费用；
2)缴纳基金所欠税款；
3)清偿基金债务；
4)根据基金合同终止日金鹰中证500份额净值、金鹰中证500A份额与金鹰中证500B份额各自的基金份额参考净值分别计算金鹰中证500、金鹰中证500A与金鹰中证500B三类份额各自的应计分配比例，在此基础上，在金鹰中证500份额、金鹰中证500A份额与金鹰中证500B份额各自级别内，按照基金份额持有人实际持有上述各级别基金份额占该级别份额总额的比例进行分配。基金财产未按前款1)-3)项规定清偿前，不得分配给基金份额持有人。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准，在本基金的金鹰中证500A份额与金鹰中证500B份额终止运作后，如果本基金进行基金财产清算，则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占基金份额总额的比例进行分配。

(6)基金财产清算的公告

清算小组成立后2日内应就清算小组的成立进行公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

(7)基金财产清算账册及文件由基金托管人保存15年以上。若是基金托管人因解散、破产、撤销等事由导致基金清算的，清算账册及文件由基金管理人或相关当事人保存15年以上。

(十一)争议解决方式

1、本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

2、本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可首先通过友好协商或调解解决。自一方书面要求协商解决争议之日起六十日内如果争议未能以协商或调解方式解决，则任何一方有权将争议提交在上海的中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会，根据提交仲裁时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

3、除争议所涉内容之外，本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。

(十二)基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、基金代销机构和注册登记机构的办公场所和营业场所，以及金鹰中证500A、金鹰中证500B上市交易的证券交易所查阅；投资者也可按工本费购买基金合同复制件或复印件，但内容应以基金合同正本为准。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

二十三、基金托管协议的内容摘要

(一)基金托管协议当事人

1、基金管理人

名称：金鹰基金管理有限公司
住所：广东省广州市天河区体育西路189号城建大厦22、23楼
法定代表人：刘东
设立日期：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
注册资本：2.5亿元人民币
组织形式：有限责任公司
经营范围：基金管理业务，发起设立基金，及中国证监会批准的其他业务。
存续期间：持续经营

2、基金托管人

名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）
住所：上海市浦东新区银城中路188号（邮政编码：200120）
办公地址：上海市浦东新区银城中路188号（邮政编码：200120）
法定代表人：胡怀邦
成立时间：1987年3月30日
批准设立机关及批准设立文号：国务院国发（1986）字第81号文和中国人民银行银发［1987］40号文
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字［1998］25号
经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项业务；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务；经营结汇、售汇业务。
注册资本：618.8561亿元人民币
组织形式：股份有限公司
存续期间：持续经营

(二)基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

1、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金的投资范围、投资对象进行监督。

2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资、融资比例进行监督。

3、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资禁止行为进行监督。

4、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

5、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人选择存款银行进行监督。

6、基金托管人根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资其他方面进行监督。

7、基金托管人应根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确认、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。如果基金管理人未经基金托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推广材料上，基金托管人对此不承担任何责任，并有权在发现后报告中国证监会。

8、基金托管人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，在规定时间内答复并改正，就基金托管人的疑义进行解释或举证。对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

(三)基金管理人对基金托管人的业务核查

根据《基金法》及其他有关法规、《基金合同》和本协议规定，基金管理人对基金托管人履行托管职责的情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人是否安全保管基金财产、开立基金财产的资金账户和证券账户及债券托管账户，是否及时、准确复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值，是否根据基金管理人指令办理清算交收，如遇到问题是否及时反馈，是否按照法规规定和《基金合同》规定进行相关信息披露和监督基金投资运作等行为，是否对非公开信息保密。

基金管理人定期和不定期地对基金托管人保管的基金资产进行核查。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复并改正。

基金管理人发现基金托管人未对基金资产实行分账管理、擅自挪用基金资产、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本协议及其他有关规定的，应及时以书面形式通知基金托管人在限期内纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。对基金管理人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金托管人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金托管人在限期内纠正。

(四)基金财产的保管

1、基金财产保管的原则

(1)基金托管人应安全保管基金财产。
(2)基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
(3)基金托管人按照规定开立基金财产的资金账户、证券账户和债券托管账户。
(4)基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整和独立。
(5)基金托管人应安全、完整地保管基金资产；未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。
(6)对于因为基金投资产生的应收资产和基金申购过程中产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金资产没有到达基金托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。基金托管人对此不承担任何责任。

2、募集资金的验证

基金募集期满之日起10日内，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签字有效。验资完成，基金管理人应将募集到的全部资金存入基金托管人为基金开立的基金银行存款账户中，基金托管人在收到资金当日出具相关证明文件。

3、基金的银行账户的开立和管理

(1)基金托管人应负责本基金银行存款账户的开立和管理。

(2)基金托管人以本基金的名义在其营业机构开立基金的银行存款账户，并根据中国人民银行规定计息。本基金的银行预留印鉴由基金托管人制作、保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益，均需通过本基金的银行存款账户进行。

(3)本基金银行存款账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借基金的名义开立其他任何银行存款账户；亦不得使用基金的任何银行存款账户进行基金业务以外的活动。

(4)基金托管人可以通过申请开通本基金银行账户的企业网上银行业务进行资金支付，并使用交通银行企业网上银行（简称"交通银行网银"）办理托管资产的资金结算汇划业务。

(5)基金银行存款账户的管理应符合《中华人民共和国票据法》、《人民币银行账户结算管理办法》、《现金管理条例》、《中国人民银行利率管理的有关规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及其他有关规定。

(6)基金托管人应严格管理基金在基金托管人处开立的银行存款账户、及时核查基金银行存款账户余额。

4、基金证券交收账户、资金交收账户的开立和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开立证券账户。

基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

基金管理人不得对基金证券交收账户、资金交收账户进行证券的超卖或超买。

若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，若无相关规定，则由基金管理人协助基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，开立有关账户，该账户按有关规则使用和管理。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，用于证券交易资金的结算。基金托管人以本基金的名义在托管人处开立基金的证券交易资金结算的二级结算备付金账户。

5、债券托管账户的开设和管理

(1)募集资金经验资后，基金托管人负责在中央国债登记结算有限责任公司以本基金的名义开立债券托管账户，并由基金托管人负责基金的债券及资金的清算。在上述手续办理完毕后，由基金托管人向人民银行进行报备。基金管理人负责申请基金进入全国银行间同业拆借市场进行交易，由基金管理人在中国外汇交易中心开设同业拆借市场交易账户。

(2)基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议，协议正本由基金托管人保管，协议副本由基金管理人保存。

6、基金实物证券、银行存款定期存单等有价凭证的保管

实物证券由基金托管人存放于托管银行的保管库，应与非本基金的其他实物证券分开保管。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的本基金资产不承担保管责任。

银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责保管。

7、与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别由基金托管人、基金管理人保管，相关业务程序另有限制除外。除本协议另有规定外，基金管理人在代基金签署与基金有关的重大合同时应尽可能保证持有二份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件，基金管理人应及时将正本送达基金托管人处。合同的保管期限按照国家有关规定执行。

对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖授权业务章的合同传真件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

(五)基金资产净值计算和会计核算

1、基金资产净值的计算

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

本基金的估值日为基金合同生效后相关的证券交易场所的正常工作日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非工作日。估值原则应符合《基金合同》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》及其他法律、法规的规定。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。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值，以双方约定的方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果进行复核后，将核对结果反馈给基金管理人。

2、基金会计核算

(1)基金账册的建立

基金管理人和基金托管人在《基金合同》生效后，应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本基金的全套账册，对相关各方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金财产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。

(2)基金定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后5个工作日内完成。定期报告文件应按中国证监会的《证券投资基金信息披露管理办法》要求公告。季度报表的编制，应于每季度终了后15个工作日内完成；更新的招募说明书在本基金合同生效后每6个月公告一次，于截止日后的45日内公告。半年度报告在基金会计年度前6个月结束后的60日内公告；年度报告在会计年度结束后90日内公告。

基金管理人完成报表后提供给基金托管人复核，并给基金托管人留足相应的复核时间。其中，月度报表不少于2个工作日，季度报表不少于5个工作日，半年报、年报不少于15个工作日。

基金托管人在对财务报表、季度报告、半年度报告或年度报告复核完毕后，出具复核确认书（盖章）或以其他双方约定的方式确认，以备有权机构对相关文件审核检查。

(六)基金份额持有人名册的保管

基金管理人可委托基金注册登记人登记和保管基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册，包括基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册、每年最后一个交易日的基金份额持有人名册，由基金注册登记人负责编制和保管，并对基金份额持有人名册的真实性、完整性和准确性负责。

基金托管人应根据基金托管人的要求定期和不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册。

基金管理人于《基金合同》生效日及《基金合同》终止日后10个工作日内向基金托管人提供由注册登记人编制的基金份额持有人名册；基金管理人于基金份额持有人大会权利登记日后5个工作日内向基金托管人提供由注册登记人编制的基金份额持有人名册；基金管理人于每年最后一个交易日后10个工作日内向基金托管人提供由注册登记人编制的基金份额持有人名册。

除上述约定时间外，如果确因业务需要，基金托管人与基金管理人商议一致后，由基金管理人向基金托管人提供由注册登记人编制的基金份额持有人名册。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保存期限为15年。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

(七)争议解决方式

相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，应通过友好协商或者调解解决。托管协议当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，任何一方当事人均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁裁决地点在上海，仲裁裁决是终局的，并对相关各方当事人均有约束力。

争议处理期间，相关各方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和本协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中华人民共和国法律管辖。

(八)基金托管协议的变更、终止与基金财产的清算

1、托管协议的变更

本协议相关各方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。修改后的新协议，应报中国证监会核准。

2、托管协议的终止

(1)《基金合同》终止；
(2)基金托管人解散、依法被撤销、破产，被依法取消基金托管资格或因其他事由造成其他基金托管人接管基金财产；
(3)基金管理人解散、依法被撤销、破产，被依法取消基金管理资格或因其他事由造成其他基金管理人接管基金管理权。
(4)发生《基金法》、《销售办法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

3、基金财产的清算

(1)基金财产清算组

在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》和本协议的规定继续履行保护基金资产安全的职责。

1)基金财产清算组组成：基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、基金注册登记人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

2)基金财产清算组职责：基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

(2)基金财产清算程序

1)《基金合同》终止后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
2)基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
3)基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
4)对基金财产进行评估和变现；
5)基金清算组做出清算报告；
6)会计师事务所对清算报告进行审计；
7)律师事务所对清算报告出具法律意见书；
8)将基金清算报告报中国证监会；
9)公布基金清算公告；
10)对基金剩余财产进行分配。

(3)清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

(4)基金剩余财产的分配

基金财产按如下顺序进行清偿：

1)支付基金财产清算费用；
2)缴纳基金所欠税款；
3)清偿基金债务；
4)根据基金合同终止日金鹰中证500份额净值、金鹰中证500A份额与金鹰中证500B份额各自的基金份额参考净值分别计算金鹰中证 500、金鹰中证500A与金鹰中证500B三类份额各自的应计分配比例，在此基础上，在金鹰中证 500份额、金鹰中证500A份额与金鹰中证500B份额各自类别内，按照基金份额持有人实际持有上述各类别基金份额占该类别份额总额的比例进行分配。基金财产未按前款1)-3)项规定清偿前，不得分配给基金份额持有人。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准，在本基金的金鹰中证500A份额与金鹰中证500B份额终止运作后，如果本基金进行基金财产清算，则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占基金份额总额的比例进行分配。

二十四、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

(一)资料寄送服务

1、账户确认书

根据客户的需要，为客户寄送开放式基金账户确认书。

2、对账单

基金投资人对账单包括季度对帐单和年度对账单。其中，季度对账单在每季结束后的20个工作日内向有交易的持有人以书面或电子文件形式寄送；年度对账单在每年度结束后25个工作日内对所有持有人以书面或电子文件形式寄送。

如投资人需要更改寄送方式或寄送频率，请致电本公司客服中心或登陆公司网站。

3、其他相关的信息资料

介绍公司最新动态、投资运作、新产品、国内外金融市场动态和投资机会等。

(二)基金间转换服务

基金管理人在本基金合同生效后的适当时候将为投资人办理基金间的转换业务，具体业务办理时间、业务规则及转换费率在基金转换公告中列明。

(三)定期投资计划

在技术条件成熟时，基金管理人将利用直销网点或代销网点为投资人提供定期投资的服务。通过定期投资计划，投资人可以通过固定的渠道，定期申购基金份额。该定期投资计划的有关规则另行公告。

(四)网络在线服务

通过本基金管理人网站的留言板和客户服务信箱，投资人可以实现在线咨询、投诉、建议和寻求各种帮助。

基金管理人网站提供了基金公告、投资资讯、理财刊物、基金常识等各种信息，投资人可以根据各自的使用习惯非常方便的自行查阅或信息定制。

基金管理人网站将为投资人提供基金账户查询、交易明细查询、对账单寄送方式或频率设置、修改查询密码等服务。

公司网址：http://www.gefund.com.cn

电子信箱：csmail@gefund.com.cn

(五)信息定制服务

在技术条件成熟时，基金管理人还可为基金投资人提供通过基金管理人网站、客户服务中心提交信息定制申请，基金管理人通过手机短讯、E-MAIL定期为客户发送所定制的信息，内容包括：每笔交易确认查询、每月账户余额与损益查询、最近季度的基金投资组合、分红提示、公司最新公告、新产品信息披露、基金净值查询等。

(六)客户服务中心（CALL-CENTER）电话服务

呼叫中心自动语音系统提供7×24小时交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息查询。

呼叫中心人工座席每个交易日9：00-17：00为投资人提供服务，投资人可以通过该热线获得业务咨询，信息查询，服务投诉，信息定制，资料修改等专项服务。

客服电话：4006135888

传真：020-83283445

(七)投诉受理

投资人可以拨打金鹰基金管理有限公司客户服务中心电话或以书信、电子邮件等方式，对基金管理人和销售网点提所供的服务进行投诉。

对于工作日期间受理的投诉，以"及时回复"为处理原则，对于不能及时回复的投诉，基金管理人承诺在2个工作日之内对投资人的投诉做出回复。对于非工作日提出的投诉，基金管理人将在顺延的工作日当日进行回复。

(八)网上开户与交易服务

在技术条件成熟时，金鹰基金及其合作机构将为投资人提供方便快捷的网上在线开户交易服务。

二十五、其它应披露事项

《基金合同》如有未尽事宜，由基金合同当事人各方按有关法律法规协商解决。

二十六、招募说明书的存放及查阅方式

基金招募说明书、定期报告、临时报告与公告等文本存放在基金管理人、基金托管人和销售机构的办公场所和营业场所，在办公时间内可供免费查阅。投资人也可以直接登录基金管理人的网站进行查阅。投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。对投资人按此种方式所获得的文件及其复印件，基金管理人和基金托管人应保证与所公告的内容完全一致。

金鹰基金管理有限公司

二〇一二年四月二十三日