



# 金鹰中证 500 指数分级证券投资基金 更新的招募说明书摘要

2015 年第 1 号

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

## 【重要提示】

金鹰中证500指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）根据2012年2月27日中国证券监督管理委员会《关于核准金鹰中证500指数分级证券投资基金募集的批复》（证监许可【2012】247号）和2012年4月9日《关于金鹰中证500指数分级证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函[2012]217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2012年6月5日备案确认（基金部函[2012]458号）后正式生效。

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读招募说明书及其摘要。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

基金管理人保证本招募说明书及其摘要的内容真实、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。

投资有风险，投资者投资本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。本基金的金鹰中证 500 指数基金份额，其预期收益与风险较高，一般而言，其预期收益与风险高于混合型、债券型与货币市场基金份额。从金鹰中证 500 指数基金（场内）份额当中分离出来的金鹰中证 500A 份额，其风险收益特性为低风险、预期收益稳定，但在本基金资产出现极端损失的情况下，金鹰中证 500A 仍可能面临无法取得约定收益乃至本金受损的风险；金鹰中证 500B 份额的风险收益特性为风险较高、预期收益较高；由于本基金的资产及收益将按照约定收益优先分配给金鹰中证 500A 的份额持有人，在本基金资产出现损失的情况下，则金鹰中证 500B 份额将首先面临本金损失。

投资人申购本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。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。



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 2015 年 6 月 5 日，有关财务数据截止日为 2015 年 3 月 31 日，净值表现截止日为 2015 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

法定代表人：凌富华

成立日期：2002 年 12 月 25 日

联系电话：020-83282855

联系人：潘晓毅

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
广州证券股份有限公司	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

凌富华先生，董事，经济学学士、会计师，历任苏州航空工业部长风机械总厂财务处会计、广州大同精密机械有限公司会计部经理，广西北海国际信托投资公司所属城市信用社、营业部、信贷部经理助理，香港大同机械企业有限公司驻国内企业会计主任，广东省联谊信诚贸易有限公司财务部经理，长城证券有限责任公司广州营业部财务经理、总部财务中心综合部经理、广州营业部拟任总经理，广州恒运企业集团股份有限公司财务部副经理、财务部经理兼任财务负责人、财务总监兼任财务负责人，广州证券有限责任公司财务总监兼任财务负责人。现任广州证券股份有限公司副总裁兼任财务总监、财务负责人。 经公司第五届董



事会第五次会议决议通过，并经中国证券监督管理委员会证监许可[2014]1401号核准，自 2015年1月起，担任金鹰基金管理有限公司董事长。

刘岩先生，董事，经济学硕士，历任中国光大银行总行投行业务部业务主管，中国光大银行总行财富管理中心业务副经理，广州证券有限责任公司资产管理总部总经理等职。经公司第四届董事会第三十九次会议审议通过，并报经中国证监会核准，自2014年8月至今，担任金鹰基金管理有限公司总经理。现兼任深圳前海金鹰资产管理有限公司董事长。

王毅先生，董事，工商管理硕士、经济师，历任广州证券有限责任公司营业部经理、营业部总经理助理、营业部副总经理，办公室副主任（主持全面工作）、合规总监、董事会秘书。现任广州证券股份有限公司副总裁兼任董事会秘书、首席风险官、合规总监。

程宁女士，董事，注册会计师、注册税务师，历任广州白云山制药总厂财务科科员、广州白云山宝得药厂财务科副科长，兼任广州白云山兽药厂财务科科长、广州白云山制药股份有限公司经营部结算科科长、结算中心会计出纳科科长、财务部副部长、监事会成员兼监事会秘书、广州白云山企业集团有限公司资财处代理处长、处长、广州医药集团财务部副部长、财务部部长。现任广州医药集团副总经理、财务总监、财务部部长，广州白云山医药集团股份有限公司董事，广药白云山香港有限公司董事会召集人。

王静女士，董事，企业管理硕士。曾任美的集团股份有限公司资本运营项目助理，资产重组经理，现任美的集团股份有限公司资产重组高级专员。

温婉容女士，董事，商科毕业。曾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。

吴晓球先生，独立董事，国民经济管理学博士。曾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。

刘国常先生，独立董事，管理学（会计学）博士、教授、博士生导师，曾在郑州航空工业管理学院、暨南大学管理学院任教。现任广东财经大学会计学院教授，兼任暨南大学管理学院博士生导师、广东省审计学会副会长、广州市审计学会副会长等。

谢石松先生，独立董事，法学博士、教授，历任广州中山大学法学院讲师、副教授，现



任中山大学法学院教授，国际法研究所所长。兼任武汉大学法学院、西北政法大学兼职教授，中国国际私法学会副会长；中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员及专家咨询委员会委员，华南国际经济贸易仲裁委员会、上海国际经济贸易仲裁委员会仲裁员，上海、广州、长沙、深圳、厦门、珠海、佛山、肇庆、惠州等仲裁委员会仲裁员等。

陈家雄先生，监事，硕士研究生，历任东莞证券资产管理部投资经理、广州证券资产管理部产品总监，现任金鹰基金管理有限公司产品研发部副总监。

姜慧斌先生，监事，管理学硕士。曾任宇龙计算机通信科技（深圳）有限公司人力资源部组织发展经理，现任金鹰基金管理有限公司综合管理部总监助理。

曾巧女士，监事，管理学学士。曾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。

## 2、公司高级管理人员

刘岩先生，总经理，经济学硕士，历任中国光大银行总行投行业务部业务主管，中国光大银行总行财富管理中心业务副经理，广州证券有限责任公司资产管理总部总经理等职。经公司第四届董事会第三十九次会议审议通过，并报经中国证监会核准，2014 年 8 月 7 日起担任公司总经理。现兼任深圳前海金鹰资产管理有限公司董事长。

李云亮先生，副总经理，硕士研究生，先后于重庆理工大学、中国证监会重庆监管局任职，历任西南证券股份有限公司证券资管部总经理等职。经公司第五届董事会第四次会议审议通过，并已按规定报中国证券投资基金业协会备案，于 2014 年 12 月 25 日起任公司副总经理。

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

何晓春先生，产业经济学博士，16 年金融行业从业经验，曾任世纪证券有限责任公司江西分公司筹办组负责人等职，2011 年 4 月加入金鹰基金管理有限公司，现任公司权益投资部总监、现任公司权益投资部总监、本基金、金鹰稳健成长股票型证券投资基金、金鹰行业优势股票型证券投资基金、金鹰民族新兴灵活配置混合型证券投资基金、金鹰产业整合灵



活配置混合型证券投资基金基金经理。

#### 4、投资决策委员会成员

本基金采取集体投资决策制度，投资决策委员会成员有：

刘岩先生，投资决策委员会主席，总经理；

何晓春先生，投资决策委员会委员，权益投资部总监，基金经理；

王喆先生，投资决策委员会委员，权益投资部副总监，基金经理；

杨刚先生，投资决策委员会委员，研究部总监，基金经理；

于利强先生，投资决策委员会委员，研究部副总监，基金经理；

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交通银行股份有限公司，基本情况如下：

名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

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

邮政编码：200120

注册时间：1987年3月30日

注册资本：742.62亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25号

联系人：裴学敏

电话：021-95559

## 三、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：凌富华

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：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

联系人：曹榕

电话：021-58781234

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

(2) 名称：中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

联系人：张静

电话：010-67596219

客服电话：95533（全国）

网址：www.ccb.com

(3) 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：洪崎

联系人：董云巍





电话：010-57092615

客服电话：95568（全国）

网址：www.cmbc.com.cn

(4) 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

(5) 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

(6) 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：王俭

电话：010-66107900

客服电话：95588（全国）

网址：www.icbc.com.cn

(7) 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



(8) 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

(9) 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

(10) 名称：广发银行股份有限公司

注册（办公）地址：广州市越秀区东风东路713号

法定代表人：董建岳

联系人：王妍

联系电话：010-65169561

客服电话：95508

公司网站：www.cgbchina.com.cn

(11) 名称：广州证券股份有限公司

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：邱三发

联系人：林洁茹

联系电话：020-88836999

客服电话：020-961303

网址：www.gzs.com.cn

(12) 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：北京市朝阳区门内大街 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

(13) 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 楼联系人：吴筱菊

电话：021-38676666-6161

客服电话：95521（全国）

网址：www.gtja.com

(14) 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：陈有安

联系人：田薇

电话：010-66568430

客服电话：4008888888

网址：www.chinastock.com.cn

(15) 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：李笑鸣

电话：021-23219000

客服电话：95533（全国）、4008888001

网址：www.htsec.com

(16) 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

客户服务电话：95575（全国）

网址：www.gf.com.cn

(17)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

(18)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

联系人：范雪玲

电话：0755-82023431

客服电话：4006008008

网址：www.cjis.cn

(19)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：谢永林

联系人：郑舒丽

电话：0755-22626391

客服电话：4008816168

网址：www.stock.pingan.com

(20)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：蔡咏

联系人：李蔡

电话：0551-2272101

客服电话：95578（全国）

网址：www.gyzq.com.cn

(21)名称：财通证券有限责任公司



注册（办公）地址：浙江省杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心

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](http://www.ctsec.com)

(22)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](http://www.wlzq.com.cn)

(23)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：范力

联系人：方晓丹

电话：0512-65581136

客服电话：0512-96288

网址：[www.dwzq.com.cn](http://www.dwzq.com.cn)

(24)名称：长江证券股份有限公司

注册（办公）地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：杨泽柱

联系人：李良

电话：027-65799999

客服电话：95579、4008-888-999

网址：[www.95579.com](http://www.95579.com)

(25)名称：齐鲁证券有限公司

注册（办公）地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李玮

联系人：王霖



电话：0531-68889157

客服电话：95538（全国）

网址：www.qlzq.com.cn

(26)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：姚志勇

联系人：徐欣

电话：0510-82831662

客服电话：4008885288、0510-82588168

网址：www.glsc.com.cn

(27)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：丁学东

联系人：黄峻敏

电话：0755-83196491

客服电话：010-65051166

网址：www.cicc.com.cn

(28)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

(29)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：400-6666-888

网址：www.cgws.com

(30)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：姜味军

联系人：张婷

电话：0755-83199599-8246

客服电话：0755-83199599

网址：www.cscoc.com.cn

(31)名称：华安证券有限责任公司

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

(32)名称：天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 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：林爽

电话：010-66045608

客服电话：010-66045678

网址：www.txsec.com

(33)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

电话：010-88086830

客服电话：010-88086830

网址：www.rxzq.com.cn

(34)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

电话：021-50122086

客服电话：021-38929908、400-820-9898

网址：www.cnhbstock.com

(35)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

(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：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：何春梅

联系人：牛孟宇

电话：0755-83709350

客服电话：95563

网址：www.ghzq.com.cn

(38)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

法定代表人：黄金琳

联系人：张腾

电话：0591-87383623

客服电话：0591-96326

网址：www.gfhfzq.com.cn





(39)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

(40)名称：申万宏源证券股份有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层（邮编：200031）

法定代表人：李梅

联系人：曹晔

电话：021-33389888

客服电话：95523 或 4008895523

网址：www.swhysc.com

(41)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

(42)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

电话：0755-82545707

客服电话：40018-40028

网址：www.wkzq.com.cn

(43)名称：国盛证券有限责任公司

注册（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：曾小普

联系人：徐美云

电话：0791-6285337

客服电话：0791-6272572

网址：www.gsstock.com

(44)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

(45)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

(46)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：蔡一兵

联系人：郭蕾

电话：0731-84403319

客服电话：0731-84403350

网址：www.cfzq.com

(47)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

(48)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

(49)名称：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

电话：0755-83025022

客服电话：4008-888-228

网址：www.jyzq.cn

(50)东海证券有限责任公司

注册（办公）地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18-19 号楼

法定代表人：朱科敏

联系人：霍晓飞

电话：0519-88157761

客服电话：400-888-8588、0519-88166222（常州地区）、021-52574550（上海地区）、  
0379-64902266（洛阳地区）

网址：www.longone.com.cn

(51)九州证券有限公司

注册地址：青海省西宁市城中区西大街 11 号

办公地址：深圳市福田区民田路新华保险大厦 18 楼

法定代表人：曲国辉

联系人：何翌



电话：0755-33331188

客服电话：4006-5432-18

网址：[www.tyzq.com.cn](http://www.tyzq.com.cn)

(52)中山证券有限责任公司

注册及办公地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层

法定代表人：黄扬录

业务联系人：罗艺琳

联系电话：0755- 82570586

客服电话：4001-022-011

网址：[www.zszq.com](http://www.zszq.com)

(53)名称：中国民族证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼

办公地址：北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观 A 座40F-43F

法定代表人：赵大建

联系电话：010-59355900

客服电话：4008895618

网址：[www.e5618.com](http://www.e5618.com)

(54)名称：东北证券股份有限公司

注册地址：长春市自由大路1138号

办公地址：长春市自由大路1138号

法定代表人：杨树财

联系电话：0431-85096517

客服电话：95360/4006-000686

网址：[www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

(55)名称：联讯证券股份有限公司

注册地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼

办公地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼

法定代表人：徐刚

联系电话：021-33606736



客服电话：95564/4006135888

网址：[www.lxzq.com.cn](http://www.lxzq.com.cn)

(56)名称：德邦证券股份有限公司

注册地址：上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼

办公地址：上海市福山路500号城建国际中心26楼

法定代表人：姚文平

联系电话：021-68761616

客服电话：95353

网址：[www.tebon.com.cn](http://www.tebon.com.cn)

(57)名称：宏信证券有限责任公司

注册地址：四川省成都市人民南路二段18号川信大厦10楼

办公地址：四川省成都市人民南路二段18号川信大厦10楼

法定代表人：吴玉明

联系电话：028-86199041

客服电话：4008-366-366

网址：[www.hx818.com](http://www.hx818.com)

(58)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：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn)

(59)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：[www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

(60)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：周旻旻

电话：0751-28829790

客服电话：4000-766-123、0571-28829123

网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

(61)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：[www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

(62)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](http://www.noah-fund.com)

(63)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：李二钢

电话：010-85188234

客服电话：400-888-6661



网址：[www.myfund.com](http://www.myfund.com)

(64)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：<http://licaike.hexun.com>

(65)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：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

(66)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/](http://www.chtfund.com/)

(67)名称：浙江同花顺基金销售有限公司

注册（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：林顺平

联系人：杨翼

电话：4008-773-772

客服电话：0571-88911818

网址：[www.5ifund.cn](http://www.5ifund.cn)

(68)名称：北京钱景财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008 室



办公地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008 室

法定代表人：赵荣春

联系电话：010-57418829

客服电话：400-678-5095

网址：www.niuji.net

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：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

法定代表人：周明

电话：（010）58598839

传真：（010）58598907

联系人：朱立元

#### （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





#### 四、基金的名称

本基金名称	金鹰中证 500 指数分级证券投资基金	
本基金简称	金鹰中证 500 指数分级	
本基金主代码	162107	
下属分级基金的基金简称	金鹰中证 500 指数分级 A	金鹰中证 500 指数分级 B
下属分级基金的交易代码	150088	150089

#### 五、基金的类型与运作方式

本基金类型：股票型证券投资基金

本基金的运作方式为契约型开放式

#### 六、基金的投资目标

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。

#### 七、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%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

#### 八、投资策略

##### 1、股票投资策略

###### （1）股票投资组合的构建

以中证 500 指数成分股在其指数中的基准权重为基础，在综合考察指数成分股的行业



构成与市值占比、各行业成分股权重的构成与分散程度、成分股流动性与贝塔值等因素的基础上，采用重点抽样与分层抽样相结合的策略以构建指数化投资组合；若抽样组合内的股票停牌或出现流动性不足等情形时，本基金将根据变化了的新情况，对于抽样组合进行再调整。

在建仓期内，本基金将在综合考量宏观经济与资本市场的运行状况、本基金跟踪偏离度与跟踪误差控制的目标范围，灵活动态地把握指数跟踪的节奏。

## （2）股票投资组合的调整

### 1) 定期调整

当中证 500 指数成分股定期调整时，本基金将根据抽样跟踪策略对指数化投资组合进行相应调整；为避免在成分股调整日集中抛售与集中买入而带来过高的冲击成本，本基金可根据标的指数成分股的选择方法，审慎研判预期将被剔除的成分股、预期将入选的成分股，并据此提前对指数化投资组合逐步调整。

### 2) 不定期调整

A、因分红、增发、配股等而导致成分股在指数中的权重改变时，本基金将根据抽样跟踪策略，在密切监测跟踪误差、跟踪偏离度的前提下，对抽样组合进行相应的调整，以期降低冲击成本。

B、根据本基金的申购、赎回情况，对指数化投资组合进行适当的调整，以期在有效跟踪标的指数的同时，降低冲击成本与交易成本。

C、本基金采用跟踪误差、跟踪偏离度（基金份额净值增长率与业绩比较基准增长率的绝对值）作为评价指数跟踪效果的指标，将密切监测过去 30 个交易日的日均跟踪误差、跟踪偏离度，若跟踪误差、跟踪偏离度较大，本基金将选取合理的措施以调整投资组合，可供选择的措施包括但不限于：调整被动投资的比例；增加抽样组合当中成分股的数目；缩小抽样组合行业构成与标的指数行业构成之间的偏离等。

## 2、债券投资策略

本基金债券投资的目的是：在保持基金资产的流动性以应对日常的申购赎回前提下，提升基金资产的使用效率，提高基金资产的投资收益。故而，本基金配置固定收益类资产的原则是：安全性与流动性优先，兼顾收益性。

在满足安全性与流动性要求的前提下，通过对国际经济环境与国内宏观经济运行状况的综合考量，审慎研判债券市场风险收益特征的变化趋势，采取自上而下的策略构造组合，重点选取到期日在一年以内的国债、央行票据、政策性金融债等进行配置。



### 3、一级市场申购策略

为提高本基金资金使用效率同时兼顾流动性，本基金还可积极参与一级市场股票、债券的发行，以求突破二级市场建仓时的流动性限制与冲击；同时，还可能获取一级市场与二级市场间的价差，扩大盈利空间。

### 4、权证投资策略

本基金或将因为指数成分股进行增发、配售以及投资分离交易的可转换公司债券等原因而被动获得权证，或者在进行套利交易、避险交易以及权证价值严重低估等情形下投资权证。

本基金进行权证投资时，将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上，结合股价波动率等参数，运用数量化期权定价模型，确定其合理内在价值，从而构建套利交易、避险交易组合以及合同许可投资比例范围内的价值显著低估的权证组合。

### 5、其它创新或者衍生产品的投资策略

本基金将根据公募基金的特点和要求，结合创新或者衍生产品的特征，在进行充分风险控制 and 充分遵守法律法规的前提下，制定合适的投资策略进行该类产品的投资。

## 九、业绩比较基准

本基金业绩比较基准为中证500指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更适于作为本基金业绩比较基准的指数时，本基金可以在上报中国证监会备案后变更业绩比较基准，并及时公告。

## 十、风险收益特征

本基金为被动跟踪指数的指数型证券投资基金，属于证券投资基金当中收益、风险较高的品种。一般情形下，其风险和预期收益高于混合型、债券型、货币市场基金。

就金鹰中证500基金场内份额分拆而成的两级基金份额而言，金鹰中证500A份额具有低风险、预期收益相对稳定的特征；金鹰中证500B份额具有高风险、高预期收益的特征。

## 十一、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。

本基金的托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于2015年7月14日复



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3月31日，本报告中所列财务数据未经审计。

#### 1、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	32,248,931.95	83.15
	其中：股票	32,248,931.95	83.15
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	4,338,265.99	11.19
7	其他资产	2,194,883.99	5.66
8	合计	38,782,081.93	100.00

#### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合机构

##### （1）指数投资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	523,695.35	1.47
B	采矿业	970,000.76	2.72
C	制造业	18,140,938.61	50.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	944,515.56	2.65



E	建筑业	1,001,905.65	2.81
F	批发和零售业	2,159,209.73	6.06
G	交通运输、仓储和邮政业	1,299,018.74	3.65
H	住宿和餐饮业	48,892.00	0.14
I	信息传输、软件和信息技术 服务业	2,041,044.50	5.73
J	金融业	751,024.84	2.11
K	房地产业	2,608,819.52	7.33
L	租赁和商务服务业	562,555.64	1.58
M	科学研究和技术服务业	162,169.68	0.46
N	水利、环境和公共设施管理 业	208,878.45	0.59
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	402,726.31	1.13
S	综合	423,330.18	1.19
	合计	32,248,725.52	90.58

## (2) 积极投资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	-	-
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	206.43	0.00
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	-	-
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	206.43	0.00

### 3、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### (1) 期末指数投资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	601099	太平洋	21,800	301,494.00	0.85
2	300059	东方财富	5,880	244,549.20	0.69
3	600219	南山铝业	20,600	222,892.00	0.63



4	300253	卫宁软件	1,100	179,410.00	0.50
5	600601	方正科技	19,610	172,764.10	0.49
6	002405	四维图新	4,159	169,687.20	0.48
7	002183	怡亚通	5,313	167,465.76	0.47
8	600881	亚泰集团	16,900	164,437.00	0.46
9	600410	华胜天成	5,770	162,714.00	0.46
10	600645	中源协和	2,456	162,169.68	0.46

## (2) 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	600858	银座股份	21	206.43	0.00
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末仅持有一只积极投资股票

## 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

## 5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

## 6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

## 7、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

本基金报告期内未投资贵金属。

## 8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细



本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货的持仓。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本报告期无投资国债期货。

11、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) 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	8,543.23
2	应收证券清算款	2,166,512.73
3	应收股利	-
4	应收利息	3,350.41
5	应收申购款	16,477.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,194,883.99

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 期末投资股票中存在流通受限情况的说明

1) 期末指数投资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	占基金	流通受限情
----	------	------	----------	-----	-------





			允价值	资产净 值比例 (%)	况说明
1	300059	东方财富	244,549.20	0.69	重大事项
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

## 2) 期末积极投资前五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	占基金 资产净 值比例 (%)	流通受限情 况说明
1	600858	银座股份	206.43	0.00	重大事项
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

## (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。

## 十二、基金的业绩

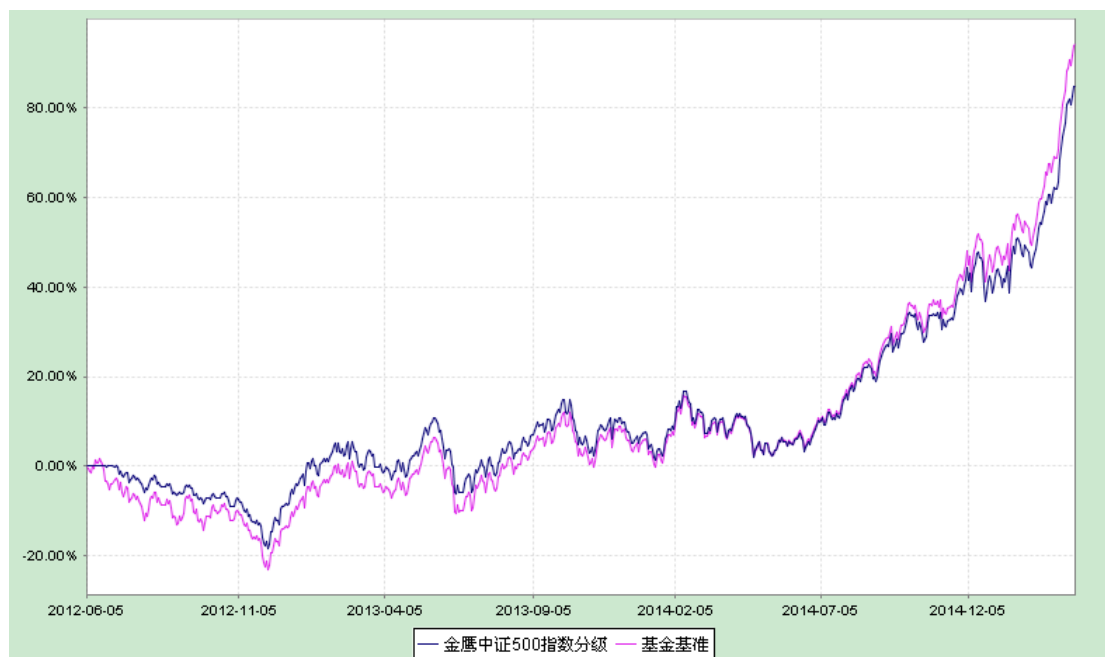
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效日为2012年6月5日，基金合同生效以来（截至2015年3月31日）的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示：

金鹰中证 500 指数分级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	净值增长率①	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
2012.6.5-2012.12.31	-3.93%	0.89%	-9.02%	1.35%	5.09%	-0.46%
2013.1.1-2013.12.31	11.65%	1.34%	16.14%	1.37%	-4.49%	-0.03%
2014.1.1-2014.12.31	30.44%	1.14%	36.88%	1.18%	-6.44%	-0.04%
2015.1.1-2015.3.31	32.06%	1.28%	34.22%	1.28%	-2.16%	0.00%
2012.6.5-2015.3.31	84.77%	1.19%	94.12%	1.30%	-9.35%	-0.11%

金鹰中证 500 指数分级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（2012 年 6 月 5 日至 2015 年 3 月 31 日）





注：1、本基金于 2012 年 6 月 5 日成立。

2、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%。

### 十三、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）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。

##### 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

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：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

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：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

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：

$H = E \times 0.02\% / \text{当年天数}$  (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

$$H = \max (E \times 0.02\% / \text{当年天数}, 548)$$

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。

本章第（一）条第1款之第（4）至（11）项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

在符合相关法律法规和履行了必备的程序的条件下，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。

## （二）与基金销售有关的费用

### 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
场外申购费率	$A < 50$	1.2%
	$50 \leq A < 100$	0.8%
	$100 \leq A < 500$	0.4%
	$A \geq 500$	每笔 1000 元
场内申购费率	深圳证券交易所会员单位应按照场外申购费率设定投资者的场内申购费率。	

注：上表中，A 为投资者申购金额。

### 2、赎回费率

本基金的场外赎回费率不高于 0.5%，随基金份额持有期限的增加而递减；本基金的场内

赎回费率为固定赎回费率 0.5%，不按份额持有时间分段设置赎回费率，具体赎回费率如下表所示：

	持有期（计为 T）	赎回费率
场外赎回费率	T < 1 年	0.5%
	1 年 ≤ T < 2 年	0.3%
	T ≥ 2 年	0%
场内赎回费率	0.5%	

注：1 年指 365 天。

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本基金合同规定范围内调低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 日前在至少一家中国证监会指定媒体和基金管理人网站上刊登公告。

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，按相关监管部门要求履行相关手续后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和基金赎回费率。

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采用低于柜台费率的申购费率。

### 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、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家指定媒体公告。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项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

#### 十四、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1月9日刊登的《金鹰中证500指数分级证券投资基金更新的招募说明书》进行了更新，主要更新的内容如下：

- （一）在“三、基金管理人”部分，更新了本基金基金经理的介绍等；
- （二）在“四、基金托管人”部分，更新了基金托管人的有关资料信息；
- （三）在“五、相关服务机构”部分，对机构与人员的信息按照最新变动情况进行了更新；
- （四）在“十三、基金的投资”部分，增加了本基金最近一期投资组合报告的内容；
- （五）在“十四、基金的业绩”部分，增加了基金合同生效以来的投资业绩；
- （六）在“二十六、其他应披露事项”部分，更新了本基金在本报告期内公开披露的信息内容。

金鹰基金管理有限公司

2015年7月17日