

# 大成蓝筹稳健证券投资基金

## 更新的招募说明书

### 2008年第2期

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

二〇〇九年一月

### 重要提示

大成蓝筹稳健证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会证监基金字【2004】36号文核准募集，基金合同于2004年06月03日正式生效。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会审核同意，但中国证监会对本基金募集的核准，均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。

投资人申购本基金时应认真阅读本招募说明书。

投资有风险，过往业绩并不预示其未来表现。

本招募说明书更新已经本基金托管人复核。本招募说明书（更新）所载内容截止日为2008年12月03日，有关财务数据和基金净值表现截止日为2008年09月30日，所列财务数据未经审计。

## 目 录

一、绪 言 .....	1
二、释 义 .....	1
三、基金管理人 .....	3
四、基金托管人 .....	14
五、相关服务机构 .....	19
六、基金合同的生效 .....	35
七、基金的申购与赎回 .....	36
八、基金的转换 .....	40
九、基金投资 .....	42
十、基金业绩 .....	49
十一、基金财产 .....	50
十二、基金资产估值 .....	51
十三、基金收益与分配 .....	54
十四、基金费用与税收 .....	55
十五、基金的会计与审计 .....	58
十六、基金的信息披露 .....	59
十七、风险揭示 .....	61
十八、基金的终止和清算 .....	62
十九、基金合同内容摘要 .....	64
二十、基金托管协议内容摘要 .....	73
二十一、基金份额持有人服务 .....	77
二十二、其他应披露的事项 .....	79
二十三、对招募说明书更新部分的说明 .....	81
二十四、招募说明书存放及查阅方式 .....	81
二十五、备查文件 .....	81

## 一、绪 言

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据《大成蓝筹稳健证券投资基金基金合同》编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。投资人取得依基金合同所发行的基金份额，即成为基金份额持有人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务；基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅《大成蓝筹稳健证券投资基金基金合同》。

## 二、释 义

在本招募说明书中除非文义另有所指，下列词语具有以下含义：

基金或本基金	指大成蓝筹稳健证券投资基金
基金代码	指大成蓝筹稳健证券投资基金的基金代码为：090003
基金合同	指《大成蓝筹稳健证券投资基金基金合同》
招募说明书或本招募说明书	指《大成蓝筹稳健证券投资基金招募说明书》
托管协议	指《大成蓝筹稳健证券投资基金托管协议》
中国证监会	指中国证券监督管理委员会
中国银监会	指中国银行业监督管理委员会
《基金法》	指《中华人民共和国证券投资基金法》
《信托法》	指《中华人民共和国信托法》
《运作办法》	指《证券投资基金运作管理办法》
《销售办法》	指《证券投资基金销售管理办法》
《信息披露办法》	指《证券投资基金信息披露管理办法》
《试点办法》	指《开放式证券投资基金试点办法》
基金合同当事人	指受基金合同约束，根据本基金合同享有权利并承担义务的基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

基金管理人	指大成基金管理有限公司
基金托管人	指中国银行股份有限公司
基金份额持有人	指本基金份额的购买者或持有者
基金代销机构	指接受基金管理人委托代为办理本基金销售业务的具有基金代销业务资格的机构
基金注册登记机构	指大成基金管理有限公司
基金投资人	指现有的和潜在的开放式基金投资人
个人投资人	指合法持有现时有效的中华人民共和国居民身份证、军官证、士兵证、警官证的中国居民
机构投资人	指在中国境内合法注册登记或经相关政府部门批准设立的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织以及中国证监会批准的合格境外机构投资人
基金合同生效日	指自招募说明书公告之日起三个月内，在基金净认购额超过人民币 2 亿元，且认购户数达到或超过 100 户的条件下，基金管理人依据有关法律法规宣告基金合同生效的日期
存续期限	指基金合同生效并存续的期间
开放日	指开放式基金销售网点正常工作日，投资人可以办理基金交易业务
营业时间	指开放式基金销售网点正常工作日的对外营业起止时间
T 日	指申购、赎回或其他基金交易的申请日
认购	指在募集期内购买基金份额的行为
申购	指基金投资人根据基金销售网点规定的手续，向基金管理人申请购买基金份额的行为
赎回	指基金投资人根据基金销售网点规定的手续，向基金管理人申请卖出基金份额的行为
基金转换	指开放式基金份额持有人将其持有的部分或全部基金份额转换为同一基金管理人管理的另一只开放式基金的份额的行为
转托管	指基金份额持有人申请将其在某一销售机构交易账户持有的基金份额全部或部分转出并转入另一销售机构交易账户的行为
基金收益	指基金投资所得债券利息、红利、股息、买卖证券差价、银行存款利息以及其他收益
基金财产总值	指基金所购买的各类证券价值、银行存款本息和基金应收的

	基金申购款以及其他投资所形成的价值总和
基金资产净值	指基金财产总值减去基金负债、按照法律、法规、规章的有关规定可以在基金资产中扣除的费用后的价值。
基金份额净值	指计算日基金资产净值总额除以计算日基金份额总数后的价值
基金资产估值	指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程
更新的招募说明书	指本基金合同生效后每 6 个月公告一次的有关基金简介、基金投资组合公告、基金经营业绩、重要变更事项和其他按法律规定应披露事项的说明
基金份额持有人服务	指基金管理人承诺为基金份额持有人提供的一系列服务
基金销售网点	指基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点
指定媒体	指中国证监会指定的用以进行信息披露的报纸和互联网网站，包括但不限于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、上海证券交易所网站、深圳证券交易所网站（及本基金管理人的网站和基金托管人的网站

### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

本基金管理人大成基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]10 号文批准发起设立，概况介绍如下：

住 所：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层

法定代表人：张树忠（相关工商变更登记手续尚在办理中，下同）

成立日：1999 年 04 月 12 日

注册资本：贰亿元人民币

股权结构：中泰信托投资有限责任公司（持股 48%）、中国银河投资管理有限责任公司（持股 25%）、光大证券股份有限公司（持股 25%）、广东证券股份有限公司（持股 2%）。

电话：0755-83183388

传真：0755-83199588

联系人：肖冰

大成基金管理有限公司设有股东会、董事会、监事会，下设十一个部门，分别是投资部、交易部、金融工程部、规划发展部、委托投资部、市场部、监察稽核部、信息技术部、基金运营部、国际业务

部和综合管理部；此外，还设立了投资决策委员会和风险控制委员会。

公司拥有一支充满活力的高素质、高学历、具备丰富市场经验的专业队伍，所有人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。公司以“诚信、稳健、创新、服务”为经营理念，坚持“诚实信用、勤勉尽责”的企业精神，致力于开拓基金及证券市场业务，力求为投资人获得更大投资回报。

## （二）证券投资基金管理情况

截止2008年12月3日，本基金管理人共管理3只封闭式证券投资基金：基金景宏、基金景福、大成优选股票型证券投资基金及12只开放式证券投资基金：大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成货币市场证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、大成财富管理2020生命周期证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成强化收益债券型证券投资基金、大成策略回报股票型证券投资基金。

## （三）主要人员情况

### 1、公司高级管理人员

#### 董事会：

张树忠先生，董事长，经济学博士。1989年7月—1993年2月，任中央财经大学财政系讲师；1993年2月—1997年3月，任华夏证券股份有限公司投资银行总部总经理、研究发展部总经理；1997年3月—2003年7月，任光大证券股份有限公司总裁助理兼北方总部总经理、资产管理总监；2003年7月—2004年6月，任光大保德信基金管理公司董事、副总经理；2004年6月—2006年12月，任大通证券股份有限公司副总经理；2007年1月—2008年1月，任大通证券股份有限公司总经理；2008年1月—2008年4月，任职中国人保资产管理股份有限公司；2008年4月起任中国人保资产管理股份有限公司副总裁、党委委员；2008年11月起同时担任大成基金管理有限公司董事长。

王颢先生，董事总经理，国际工商管理专业博士。2000年12月—2002年9月，任招商证券股份有限公司深圳管理总部副总经理、机构管理部副总经理；2002年9月加入大成基金管理有限公司，历任助理总经理、副总经理；2008年11月起担任大成基金管理有限公司总经理。

王长林先生，董事，研究生，高级经济师。曾任中国农业银行天津分行计划处副处长、信息中心副总经理，中国长城信托投资公司计划财务部总经理。现任中国银河投资管理有限公司办公室主任。

曾北川先生，董事，博士。1989年8月—1992年6月，任建设部中国城乡建设发展总公司项目经理；1992年6月—1994年3月，任中国建设银行总行房地产信贷部房地产信贷项目经理；1994年4月—1998年5月，任国家开发银行国际金融局信贷一处信贷项目经理、国家开发银行国际金融局综合计划处副处长；1998年5月—2001年10月，任华夏银行北京管理部副总经理、华夏银行北京管理

部副总经理（主持工作）；2001年10月—2006年10月，任华夏银行总行营业部常务副总经理（党组副书记）、华夏银行总行稽核部总经理（监事会监事、审计委员会委员）；2006年10月—2008年4月，任中国人寿保险股份有限公司市场拓展部总经理；2008年4月，任人保金控投资有限公司筹备组成员；2008年7月起任中国华闻投资控股有限公司总裁、党委书记。

杨赤忠先生，董事，大学本科。历任深圳蓝天基金管理公司投资与研究部经理；长盛基金管理有限公司研究部副总监、基金经理；大成基金管理有限公司研究总监；光大证券证券投资部总经理。现任光大证券助理总裁。

蔺春林先生，独立董事，大学本科。1970—1971年，解放军信阳坦克师锻炼；1971—1987年，任兵器部5107、5137厂生产会计员、财务处长；1987年—1998年，任湖北省财政厅中央企业处副处长、财政部驻湖北省专员助理；1998年—2005年，任财政部驻江西专员办专员助理、副专员、专员、党组书记；2005年8月，任中央纪委、中组部金融巡视组组长；2007年1月退休。

于绪刚先生，独立董事，法学博士，环太平洋律师协会会员、全国律协金融证券委员会委员、华中科技大学兼职教授及研究生导师、北京工商大学客座教授、华北电力大学客座教授。1990年—1995年，任河北省保定市中级人民法院助理审判员；1995年—1998年，北京大学法学硕士学习；1999年，香港大学法律学院访问学者、香港法律教育信托基金访问学者；1999年—2001年，北京大学法学博士学习；2001年起任大成律师事务所律师、高级合伙人、管委会委员。

万曾炜先生，独立董事，经济学博士，研究员，曾任上海市政府发展研究中心处长，上海市浦东新区综合规划土地局党组书记、局长，浦东新区发展计划局党组书记，上海浦东发展集团和上海浦东投资建设有限公司筹建负责人和法人代表，现任上海市公积金管理中心党委书记、主任，上海市政府特聘决策咨询专家。

刘大为先生，独立董事，国家开发银行总会计师，高级经济师，享受政府特殊津贴专家。中国人民银行研究生部硕士生指导老师，首都经济贸易大学兼职教授，清华大学中国经济研究中心高级研究员。先后在北京市人民政府研究室（副处长、处长），北京市第一商业局（副局长），中国建设银行信托投资公司（总经理），中国投资银行（行长），国家开发银行（总会计师）工作。

#### 监事会：

胡学光先生，监事长，硕士，高级经济师，广东省高级经济师评审委员会委员。曾在湖北金融高等专科学校任教，广州金融高等专科学校任金融系副主任；1992年—2003年4月，在广东证券股份有限公司先后任“广证基金”、“广证受益”经理、部门总经理、总裁助理、副总裁，兼任中山大学岭南学院兼职教授、中天证券研究院副院长，广东证券博士后科研工作站指导导师；2003年5月至2008年8月任大成基金管理有限公司董事长。



宁加岭先生，监事，大学本科。1983年2月—1987年6月，任财政部人教司副处长、处长；1987年6月—1994年6月，任财政部行政司副司长、司长；1994年6月—1999年6月，任财政部德宝实业总公司总经理、法人代表；1999年6月起，任职于财政部离退休老干部局。

黄建农先生，监事，大学本科。曾任中国银河证券有限责任公司上海江苏北路营业部总经理，中国银河证券有限责任公司资产管理总部副总经理，总经理，中国银河投资管理公司投资管理部总经理。现任中国银河投资管理公司上海投资部董事总经理。

其他高级管理人员：

刘彩晖女士，副总经理，管理学硕士。1999年—2002年，历任江南信托投资有限公司投资银行部副总经理、总经理；2002年—2006年，历任江南证券有限公司总裁助理、投资银行部总经理、机构管理部总经理，期间还任江南宏富基金管理公司筹备组副组长；2006年1月—7月任深圳中航集团公司人力资源部副总经理；2006年8月—2008年5月，任大成基金管理有限公司助理总经理；2008年5月起任大成基金管理有限公司副总经理。

杜鹏女士，督察长，研究生学历。1992年—1994年，历任原中国银行陕西省信托咨询公司证券部驻上交所上市代表、上海业务部负责人；1994年—1998年，历任广东省南方金融服务总公司投资基金管理部证券投资部副经理、广东华侨信托投资公司证券总部资产管理部经理；1998年9月参与大成基金管理有限公司的筹建；1999年3月起，任大成基金管理有限公司督察长兼监察稽核部总监。

## 2、基金经理

### (1) 现任基金经理

施永辉先生，大成蓝筹稳健证券投资基金经理，理学硕士，12年证券从业经验。曾任中科院资源环境信息中心担任助理研究员，甘肃证券资产管理部研究员，招商证券研发中心高级分析师、总经理助理。2003年加盟大成基金管理有限公司，历任公司研究部高级研究员、投资部副总监、大成精选增值混合型证券投资基金经理助理。自2006年01月21日起至今担任本基金经理。

### (2) 历任基金经理

历任基金经理姓名	管理本基金时间
王加英	2004年06月03日—2006年01月20日

## 3、公司投资决策委员会

公司投资决策委员会由9名成员组成，设主任委员1名，其他委员8名。名单如下：

刘明，投资总监，大成优选股票型证券投资基金基金经理，投资决策委员会主任委员；杨建华，投资部执行总监，负责公司股票投资业务，大成景阳领先股票型证券投资基金基金经理，投资决策委员会委员；陈尚前，投资部执行总监，负责公司固定收益证券投资业务，大成债券投资基金、大成强

化收益债券型证券投资基金基金经理，投资决策委员会委员；邓韶勇，交易部总监，投资决策委员会委员；姚榕，投资部研究副总监，投资决策委员会委员；施永辉，大成蓝筹稳健证券投资基金基金经理，投资决策委员会委员；杨丹，金融工程部总监助理，大成沪深300指数证券投资基金基金经理、景福证券投资基金基金经理，投资决策委员会委员；王立，大成货币市场证券投资基金基金经理，投资决策委员会委员；孙蓓琳，资深研究员，投资决策委员会委员。

上述人员之间不存在亲属关系。

#### （四）基金管理人的职责

按照《基金法》，基金管理人必须履行以下职责：

- 1、依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构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；
- 2、办理基金备案手续；
- 3、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；
- 4、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；
- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制中期和年度基金报告；
- 7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、召集基金份额持有人大会；
- 10、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；
- 11、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；
- 12、国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

#### （五）基金管理人承诺

1、基金管理人承诺严格遵守《证券法》，并建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生；

2、基金管理人承诺严格遵守《基金法》、《运作办法》，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止以下《基金法》、《运作办法》禁止的行为发生：

- （1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- （2）不公平地对待其管理的不同基金财产；
- （3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- （4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

(5) 依照法律、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

(1) 越权或违规经营；

(2) 违反基金合同或托管协议；

(3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益；

(4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；

(5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；

(6) 玩忽职守、滥用职权；

(7) 泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

(8) 除按本基金管理公司制度进行基金投资外，直接或间接进行其他股票交易；

(9) 协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；

(10) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；

(11) 故意损害基金投资人及其他同业机构、人员的合法权益；

(12) 以不正当手段谋求业务发展；

(13) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；

(14) 信息披露不真实，有误导、欺诈成分；

(15) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

#### 4、基金经理承诺

(1) 依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

(2) 不利用职务之便为自己及其代理人、代表人、受雇人或任何第三人谋取利益；

(3) 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

(4) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

#### (六) 基金管理人的内部控制制度

本基金管理人为加强内部控制，促进公司诚信、合法、有效经营，保障基金份额持有人利益，维护公司及公司股东的合法权益，依据《中华人民共和国证券法》、《证券投资基金公司管理办法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》等法律法规，并结合公司实际情况，制定《大成基金管理有限公司内部控制大纲》。

公司内部控制是指公司为防范和化解风险，保证经营运作符合公司的发展规划，在充分考虑内外

部环境的基础上，通过建立组织机制、运用管理方法、实施操作程序与控制措施而形成的系统。公司建立科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系，制定科学完善的内部控制制度。

公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等部分组成。

公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任，公司管理层对内部控制制度的有效执行承担责任。

#### 1、公司内部控制的总体目标

(1) 保证公司经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念。

(2) 防范和化解经营风险，提高经营管理效益，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，实现公司的持续、稳定、健康发展。

(3) 确保基金、公司财务和其他信息真实、准确、完整、及时。

#### 2、公司内部控制遵循以下原则

(1) 健全性原则。内部控制涵盖公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并包括决策、执行、监督、反馈等各个环节。

(2) 有效性原则。通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行。

(3) 独立性原则。公司各机构、部门和岗位职责的设置保持相对独立，公司基金财产、自有资产与其他资产的运作相互分离。

(4) 相互制约原则。公司设置的各部门、各岗位权责分明、相互制衡。

(5) 成本效益原则。公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

#### 3、公司制定内部控制制度遵循以下原则

(1) 合法合规性原则。公司内控制度符合国家法律、法规、规章和各项规定。

(2) 全面性原则。内部控制制度涵盖公司经营管理的各个环节，不得留有制度上的空白或漏洞。

(3) 审慎性原则。制定内部控制制度以审慎经营、防范和化解风险为出发点。

(4) 适时性原则。随着有关法律法规的调整和公司经营战略、经营方针、经营理念等内外部环境的变化进行及时的修改或完善内部控制制度。

#### 4、内部控制的基本要素

内部控制的基本要素包括控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通和内部监控。

(1) 控制环境构成公司内部控制的基础，控制环境包括经营理念和内控文化、公司治理结构、组织结构、员工道德素质等内容。

(2) 公司管理层牢固树立内控优先和风险管理理念, 培养全体员工的风险防范意识, 营造一个浓厚的内控文化氛围, 保证全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度, 使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个环节。

(3) 健全公司法人治理结构, 充分发挥独立董事和监事会的监督职能, 禁止不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生, 保护投资人利益和公司合法权益。

(4) 公司的组织结构体现职责明确、相互制约的原则, 各部门有明确的授权分工, 操作相互独立。公司建立决策科学、运营规范、管理高效的运行机制, 包括民主、透明的决策程序和管理议事规则, 高效、严谨的业务执行系统, 以及健全、有效的内部监督和反馈系统。

(5) 依据公司自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的内控防线:

①各岗位职责明确, 有详细的岗位说明书和业务流程, 各岗位人员在上岗前均应知悉并以书面方式承诺遵守, 在授权范围内承担责任。

②建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度, 相关部门和岗位之间相互监督制衡。

③公司督察长和内部监察稽核部门独立于其他部门, 对内部控制制度的执行情况实行严格的检查和反馈。

(6) 建立有效的人力资源管理制度, 健全激励约束机制, 确保公司各级人员具备与其岗位要求相适应的职业操守和专业胜任能力。

(7) 建立科学严密的风险评估体系, 对公司内外部风险进行识别、评估和分析, 及时防范和化解风险。

(8) 建立严谨、有效的授权管理制度, 授权控制贯穿于公司经营活动的始终。

①确保股东会、董事会、监事会和管理层充分了解和履行各自的职权, 建立健全公司授权标准和程序, 保证授权制度的贯彻执行。

②公司各业务部门、分支机构和各级人员在规定授权范围内行使相应的职责。

③公司重大业务的授权采取书面形式, 明确授权书的授权内容和时效。

④公司适当授权, 建立授权评价和反馈机制, 包括已获授权的部门和人员的反馈和评价, 对已不适用的授权及时修改或取消授权。

(9) 建立完善的资产分离制度, 公司资产与基金财产、不同基金的资产之间和其他委托资产, 实行独立运作, 分别核算。

(10) 建立科学、严格的岗位分离制度, 明确划分各岗位职责, 投资和交易、交易和清算、基金会计和公司会计等重要岗位不得有人员重叠。重要业务部门和岗位进行物理隔离。

(11) 制订切实有效的应急应变措施, 建立危机处理机制和程序。

(12) 维护信息沟通渠道的畅通, 建立清晰的报告系统。

(13) 建立有效的内部监控制度，设置督察长和独立的监察稽核部门，对公司内部控制制度的执行情况进行持续的监督，保证内部控制制度落实。公司定期评价内部控制的有效性，并根据市场环境、新的金融工具、新的技术应用和新的法律法规等情况进行适时改进。

#### 5、内部控制的主要内容

(1) 公司自觉遵守国家有关法律法规，按照投资管理业务的性质和特点严格制定管理规章、操作流程和岗位手册，明确揭示不同业务可能存在的风险点并采取控制措施。

(2) 研究业务控制主要包括：

- ①研究工作保持独立、客观。
- ②建立严密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法。
- ③建立投资对象备选库制度，根据基金合同要求，在充分研究的基础上建立和维护备选库。
- ④建立研究与投资的业务交流制度，保持通畅的交流渠道。
- ⑤建立研究报告质量评价体系。

(3) 投资决策业务控制主要包括：

- ①严格遵守法律法规的有关规定，符合基金合同所规定的投资目标、投资范围、投资策略、投资组合和投资限制等要求。
- ②健全投资决策授权制度，明确界定投资权限，严格遵守投资限制，防止越权决策。
- ③投资决策有充分的投资依据，重要投资有详细的研究报告和风险分析支持，并有决策记录。
- ④建立投资风险评估与管理制度，在设定的风险权限额度内进行投资决策。
- ⑤建立科学的投资管理业绩评价体系，包括投资组合情况、是否符合基金产品特征和决策程序、基金绩效归属分析等内容。

(4) 基金交易业务控制主要包括：

- ①基金交易实行集中交易制度，基金经理不得直接向交易员下达投资指令或者直接进行交易。
- ②建立交易监测系统、预警系统和交易反馈系统，完善相关的安全设施。
- ③交易管理部门审核投资指令，确认其合法、合规与完整后方可执行，如出现指令违法违规或者其他异常情况，应当及时报告相应部门与人员。
- ④公司执行公平的交易分配制度，确保不同投资人的利益能够得到公平对待。
- ⑤建立完善的交易记录制度，及时核对并存档保管每日投资组合列表等。
- ⑥建立科学的交易绩效评价体系。
- ⑦根据内部控制的原则，制定场外交易、网下申购等特殊交易的流程和规则。

(5) 建立严格有效的制度，防止不正当关联交易损害基金份额持有人利益。基金投资涉及关联交易的，在相关投资研究报告中特别说明，并报公司风险控制委员会审议批准。

(6) 公司在审慎经营和合法规范的基础上力求金融创新。在充分论证的前提下周密考虑金融新品种或业务的法律性质、操作程序、经济后果等，严格控制金融新品种、新业务的法律风险和运行风险。

(7) 建立和完善客户服务标准、销售渠道管理、广告宣传行为规范，建立广告宣传、销售行为法律审查制度，制定销售人员准则，严格奖惩措施。

(8) 制定详细的登记过户工作流程，建立登记过户电脑系统、数据定期核对、备份制度，建立客户资料的保密保管制度。

(9) 公司按照法律、法规和中国证监会有关规定，建立完善的信息披露制度，保证公开披露的信息真实、准确、完整、及时。

(10) 公司配备专人负责信息披露工作，进行信息的组织、审核和发布。

(11) 加强对公司及基金信息披露的检查和评价，对存在的问题及时提出改进办法，对出现的失误提出处理意见，并追究相关人员的责任。

(12) 掌握内幕信息的人员在信息公开披露前不得泄露其内容。

(13) 根据国家法律法规的要求，遵循安全性、实用性、可操作性原则，严格制定信息系统的管理制度。

信息技术系统的设计开发符合国家、金融行业软件工程标准的要求，编写完整的技术资料；在实现业务电子化时，设置保密系统和相应控制机制，并保证计算机系统的可稽性，信息技术系统投入运行前，经过业务、运营、监察稽核等部门的联合验收。

(14) 通过严格的授权制度、岗位责任制度、门禁制度、内外网分离制度等管理措施，确保系统安全运行。

(15) 计算机机房、设备、网络等硬件要求符合有关标准，设备运行和维护整个过程实施明确的责任管理，严格划分业务操作、技术维护等方面的职责。

(16) 公司软件的使用充分考虑到软件的安全性、可靠性、稳定性和可扩展性，具备身份验证、访问控制、故障恢复、安全保护、分权制约等功能。信息技术系统设计、软件开发等技术人员不得介入实际的业务操作。用户使用的密码口令定期更换，不得向他人透露。数据库和操作系统的密码口令分别由不同人员保管。

(17) 对信息数据实行严格的管理，保证信息数据的安全、真实和完整，并能及时、准确地传递到会计等各职能部门；严格计算机交易数据的授权修改程序，并坚持电子信息数据的定期查验制。建立电子信息数据的即时保存和备份制度，重要数据异地备份并且长期保存。

(18) 信息技术系统定期稽核检查，完善业务数据保管等安全措施，进行排除故障、灾难恢复的演习，确保系统可靠、稳定、安全地运行。

(19) 依据《中华人民共和国会计法》、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《企业财务通则》等国家有关法律、法规制订基金会计制度、公司财务制度、会计工作操作流程和会计岗位工作手册，并针对各个风险控制点建立严密的会计系统控制。

(20) 明确职责划分，在岗位分工的基础上明确各会计岗位职责，禁止需要相互监督的岗位由一人独自操作全过程。

(21) 以基金为会计核算主体，独立建账、独立核算，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。基金会计核算与公司会计核算相互独立。

(22) 采取适当的会计控制措施，以确保会计核算系统的正常运转。

①建立凭证制度，通过凭证设计、登录、传递、归档等一系列凭证管理制度，确保正确记载经济业务，明确经济责任。

②建立账务组织和账务处理体系，正确设置会计账簿，有效控制会计记账程序。

③建立复核制度，通过会计复核和业务复核防止会计差错的产生。

(23) 采取合理的估值方法和科学的估值程序，公允反映基金所投资的有价证券在估值时点的价值。

(24) 规范基金清算交割工作，在授权范围内，及时准确地完成基金清算，确保基金财产的安全。

(25) 建立严格的成本控制和业绩考核制度，强化会计的事前、事中和事后监督。

(26) 制订完善的会计档案保管和财务交接制度，财会部门妥善保管密押、业务用章、支票等重要凭据和会计档案，严格会计资料的调阅手续，防止会计数据的毁损、散失和泄密。

(27) 严格制定财务收支审批制度和费用报销运作办法，自觉遵守国家财税制度和财经纪律。

(28) 公司设立督察长，对董事会负责，经董事会聘任，报中国证监会核准。根据公司监察稽核工作的需要和董事会授权，督察长可以列席公司相关会议，调阅公司相关档案，就内部控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能。督察长定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况，董事会对督察长的报告进行审议。

(29) 公司设立监察稽核部门，对公司管理层负责，开展监察稽核工作，公司保证监察稽核部门的独立性和权威性。

(30) 明确监察稽核部门及内部各岗位的具体职责，配备充足的监察稽核人员，严格监察稽核人员的专业任职条件，严格监察稽核的操作程序和组织纪律。

(31) 强化内部检查制度，通过定期或不定期检查内部控制制度的执行情况，确保公司各项经营管理活动的有效运行。

(32) 公司董事会和管理层重视和支持监察稽核工作，对违反法律、法规和公司内部控制制度的，追究有关部门和人员的责任。



## 6、基金管理人关于内部控制制度声明书

- (1) 本基金管理公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确。
- (2) 本基金管理公司承诺根据市场变化和公司业务发展不断完善内部控制制度。

## 四、基金托管人

### (一) 基金托管人的基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

变更注册登记日期：2004年08月26日

注册资本：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元

法定代表人：肖钢

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管及投资者服务部总经理：董杰

托管部门联系人：宁敏

电话：(010) 66594977

传真：(010) 66594942

发展概况：

中国银行业务涵盖商业银行、投资银行和保险三大领域，其中，商业银行业务是中国银行的传统主营业务，包括公司金融业务、个人金融业务及金融市场业务。中国银行提供的公司金融业务包括存款业务、贷款业务、国际结算及贸易融资业务，以及银行汇票、本票、支票、汇兑、银行承兑汇票、委托收款、托收承付、集中支付、支票圈存及票据托管等其他公司金融业务；个人金融业务包括储蓄存款业务、个人贷款业务、个人中间业务、“中银理财”服务、私人银行业务和银行卡业务等；金融市场业务主要包括本外币金融工具的自营与代客业务、本外币各类证券或指数投资业务、债务资本市场业务、代客理财和资产管理业务、金融代理及托管业务等。

中国银行在国内同业中率先引进国际管理技术人才和经营理念，不断向国际化一流大银行的目标迈进，截至2007年末底，中国银行境内外机构共有10,834家，其中在中国内地拥有37家一级分行、直属分行，拥有283家二级分行及9,824家分支机构；在境外有689家分行、子公司及代表处，是中国国际化程度最高的银行。

2007年，中国银行营业收入快速增长，风险管理水平不断提高，资产质量明显改善，实现税后利润620.17亿元人民币，较上年增加139.59亿元人民币，增幅29.05%，其中，股东应享税后利润562.29亿元人民币，较上年增加136.05亿元人民币，增幅31.92%；截止2007年末，中国银行资本充足率为13.34%，核心资本充足率为10.67%；中国银行不良贷款率为3.12%，较2006年末下降0.92个百分点。

多年来中国银行围绕客户需求所做的不懈努力，得到了来自业界、客户和权威第三方的广泛认可。在与国际同业和国内同业的激烈竞争中，凭借雄厚的实力和优良的服务，中国银行脱颖而出，成为北京2008年奥运会唯一的银行合作伙伴；自1990年以来，中国银行一直荣登《财富》500强排行榜；2004至2007年，中国银行连续被《环球金融》杂志评为“中国最佳贸易融资银行”和“中国最佳外汇银行”；2007年，中国银行在《银行家》杂志“世界1000家大银行”中排名第9位；2007年中国银行被《金融亚洲》评为“亚洲最佳公司（最佳管理、最佳公司治理、最佳股利政策）”和“中国最佳外汇交易银行”；2007年中国银行被《亚洲货币》杂志和《贸易融资》杂志分别评为“中国最佳现金管理银行”和“中国最佳贸易融资银行”；在“和讯财经风云榜”中，中国银行被评为“中国银行业杰出服务奖”、“中国银行业理财产品测评最具投资价值奖”；2007年中国银行再次荣获“优信咨询（Universum）”评选的“最理想雇主奖”。

## （二）主要人员情况

肖钢先生，自2004年08月起任中国银行股份有限公司董事长、党委书记。自2003年03月起任中国银行董事长、党委书记、行长，自1996年10月起任中国人民银行行长助理，期间曾兼任中国人民银行计划资金司司长、货币政策司司长、广东省分行行长及国家外汇管理局广东省分局局长。1989年10月至1996年10月，历任中国人民银行政策研究室副主任、主任、中国外汇交易中心总裁、计划资金司司长等职。肖先生出生于1958年08月，1981年毕业于湖南财经学院，1996年获得中国人民大学法学硕士学位。

李礼辉先生，自2004年08月起担任中国银行股份有限公司副董事长、党委副书记、行长。2002年09月至2004年08月担任海南省副省长。1994年7月至2002年09月担任中国工商银行副行长。1988年至1994年07月历任中国工商银行国际业务部总经理、新加坡代表处首席代表、福建省分行副行长等职。李先生出生于1952年05月，1977年毕业于厦门大学经济系财政金融专业，1999年获得北京大学光华管理学院金融学专业博士研究生学历和经济学博士学位。

王永利先生，自2006年08月起担任中国银行股份有限公司副行长。自2003年11月至2006年08月任中国银行行长助理，1997年04月至2003年11月历任中国银行财务部、资产负债管理部副总经理、总经理、福建省分行常务副行长及行长，以及河北省分行行长等职。王先生出生于1964年

04月，1987年毕业于中国人民大学，2005年获得厦门大学博士学位。

董杰先生，自2007年11月27日起担任中国银行股份有限公司托管及投资者服务部总经理。自2005年09月起任中国银行天津市分行副行长、党委委员，1983年07月至2005年09月历任中国银行深圳市分行沙头角支行行长、深圳市分行信贷经营处处长、公司业务处处长、深圳市分行行长助理、党委委员等职。董先生出生于1962年11月，获得西南财经大学博士学位。

### （三）基金托管部门的设置及员工情况

中国银行总行于1998年设立基金托管部，为进一步树立以投资者为中心的服务理念，根据不断丰富和发展的托管对象和托管服务种类，中国银行于2005年03月23日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部，下设覆盖销售、市场、运营、风险与合规管理、信息技术、行政管理等各层面的多个团队，现有员工90余人；另外，在上海市分行、深圳市分行设有托管业务团队。

中国银行托管及投资者服务部现有员工90余人，其中硕士学历以上人员21人，具有一年以上海外工作和学习经历的人员有10余人。

### （四）证券投资基金托管情况

截止到2008年6月末，中国银行已托管景宏、同盛、华夏行业精选、同智优势成长、易方达平稳增长、易方达策略成长、易方达策略成长二号、易方达积极成长、易方达货币、易方达月月收益、易方达深证100交易型开放式指数、嘉实服务增值、嘉实成长收益、嘉实理财通系列（含嘉实稳健、嘉实增长、嘉实债券）、嘉实货币、嘉实沪深300指数、嘉实超短债、嘉实主题精选、银华优势企业、银华优质增长股票型、海富通收益增长、海富通货币、海富通股票、海富通精选2号、万家180指数、金鹰成份股优选、华夏回报、华夏回报二号、华夏大盘精选、景顺长城景系列（含景顺长城动力平衡、景顺长城货币、景顺长城优选股票）、景顺长城鼎益股票型、泰信天天收益、泰信优质生活、招商先锋、大成蓝筹稳健、大成财富管理2020、大成优选、泰达荷银行业精选、国泰沪深300指数、国泰金鹏蓝筹价值、友邦华泰盛世中国、友邦华泰积极成长、南方高增长、工银瑞信核心价值股票型、华宝兴业动力组合、华宝兴业先进成长股票型、国海富兰克林潜力组合、银河竞争优势成长、国投瑞银稳定增利债券型、嘉实研究精选股票、长盛创新先锋灵活配置、国泰金鹿保本二期、易方达中小盘股票型等57只证券投资基金，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币市场型、指数型、行业型、创新型等多种类型的基金和理财品种，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

### （五）基金托管人的内部控制制度

#### 1、内部控制目标

中国银行努力构建严密内部控制体系，以保证各项业务持续健康发展。中国银行内控建设的总目

标是：以完善的内部控制组织体系为保障，以体现制衡原则、健全有效的制度为基础，以精细化的过程为着眼点，以激励约束机制和问责制为引导，以信息技术手段为依托，大力培育合规文化，努力构建全面系统、动态、主动和可证实的内部控制体系。

为实现上述目标，中国银行从明确职责入手，完善内部控制组织体系建设；从制度建设入手，夯实内部控制基础；从细节入手，实现精细化的过程控制；从完善激励约束机制和问责制入手，引导内部控制目标的实现；从加强信息技术手段入手，提高内部控制水平和质量；从加强教育培训入手，促进合规文化的形成。

## 2、内部控制组织结构

中国银行股份有限公司自 2004 年 08 月 26 日成立以来，按照国家有关法律法规制定了新的公司章程，形成了由股东大会、董事会、监事会和高级管理层构建的现代股份公司治理架构。

(1) 董事会负责制订总体风险偏好、审阅及批准本行的风险管理目标及策略。董事会下设风险政策委员会，并成立了稽核委员会。

风险政策委员会主要职责包括评估和监督本行风险管理政策及内部控制政策的实施、监督已确立的风险领域敞口、监控和评估本行风险偏好、审核本行法律与合规事务程序的有效性和监督其实施，以及审查及批准超出授予本行行长信贷审批权限的信贷决定。总行风险管理部是风险政策委员会的秘书机构，风险管理部拟订风险管理策略及工作计划，并牵头拟定及管理风险管理政策及管理风险管理政策及程序。

中国银行历来重视内部稽核职能，中国银行的内部稽核是内部独立客观的监督与评价活动，对本行风险管理和内部控制的适当性和有效性进行审查与评估，负责跟进被稽核发现的问题及监督整改行动。2005 年 11 月，董事会及稽核委员会采纳了内部稽核章程，进一步明确内部稽核职能独立于业务部门，并由董事会的稽核委员会领导，在董事会授权下，稽核委员会负责提名总稽核及评估其表现、审查及核准内部稽核政策、内部稽核组织架构、年度内部稽核计划及预算，以及审查内部稽核职能的有效性。中国银行已于境内一级分行及主要海外分行与子公司设立内部稽核部门，各家境内一级分行内部稽核工作负责人均由总行委任及考核，向总行的内部稽核部门及分行行长报告。中国银行建立了问责制，明确界定了内部稽核部门及稽核人员的责任，相关的内部稽核部门或人员的工作表现被纳入年度绩效考核。

(2) 中国银行股份有限公司高级管理层负有整体管理责任，管理本行风险的各个方面，包括风险管理策略、措施和信贷政策，并批准风险管理的内部规则、措施及程序。高级管理层下设内部控制委员会、资产负债管理委员会、资产处置委员会和反洗钱工作委员会。

内部控制委员会负责监督全行内部控制体系的总体运行，决定内部控制基本制度，评估内部控制

体系的有效性，以及识别内部控制体系存在的不足和缺陷，督导改进措施的落实，审阅及批准本行主要内部控制政策及相关实施计划，制订本行有关操作风险识别、评估、监测、控制、计量等管理制度和报告制度，并不时聘用内部和外部专家评估内部控制的有效性和提供改进建议。法律与合规部是内部控制委员会的秘书机构，该部负责管理法律风险、合规风险，并牵头协调内部控制管理。

资产负债管理委员会监督本行整体资产和负债的管理，以及根据风险政策委员会所采用的一般风险管理政策，制订有关管理政策。资产负债管理部是资产负债管理委员会的秘书机构，该部按照资产负债管理委员会制订的政策，管理本行流动性，预测本行流动性的需求和风险，并对内重新分配资金以满足流动性管理的需要。

资产处置委员会审核有关处置不良资产的战略及政策，负责审批处置、清收及收回金额超出境内一级分行及海外分行的授权限额的不良贷款的建议。授信执行部是资产处置委员会的秘书机构。

反洗钱工作委员会负责反洗钱及打击恐怖主义融资事宜，法律与合规部是反洗钱工作委员会的秘书机构。

(3) 托管及投资者服务部总经理对托管业务的风险控制负第一责任。部门内部设有专门的风险控制小组,作为部内风险管理与内部控制的审议和决策机构，负责审议决定托管及投资者服务部风险管理战略、基本原则、风险管理目标和重大政策措施，检查和监督风险管理战略、方针和政策的执行情况。针对托管业务的特点，托管及投资者服务部内部设立高级合规官和风险与合规管理团队，具体开展部门内部内控及风险管理的相关工作。

### 3、内部控制制度及措施

中国银行开办各类基金托管业务均获得相应的授权，并在辖内实行业务授权管理和从业人员核准资格管理。中国银行自 1998 年开办托管业务以来严格按照相关法律法规的规定以及监管部门的监管要求，以控制和防范基金托管业务风险为主线，制定并逐步完善了包括托管业务授权管理制度、业务操作规程、员工职业道德规范、保密守则等在内的各项业务管理制度，将风险控制落实到每个工作环节；在敏感部位建立了安全保密区和隔离墙，安装了录音监听系统，以保证基金信息的安全；建立了有效核对和监控制度、应急制度和稽查制度，保证托管基金资产与银行自有资产以及各类托管资产的相互独立和资产的安全；制定了内部信息管理制度，严格遵循基金信息披露规定和要求，及时准确地披露相关信息。

### 4、其他事项

最近一年内，基金托管人基金托管业务部门及其高级管理人员无重大违法违规行为，未受到中国证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。

### (六) 托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、《证券投资基金会计核算办法》、基金合同的相关规定，托管人就基金的投资范围、投资组合比例、投资限制、基金管理人报酬和基金托管人托管费的计提比例和支付方法、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配等事项，对基金管理人进行业务监督、复核。基金托管人在履行上述职责过程中，如发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

## 五、相关服务机构

### （一）销售机构及联系人

#### 1、直销机构：大成基金管理有限公司

住 所：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层

办公地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层

法定代表人：张树忠

电话：0755-83183388

传真：0755-83199588

联系人：杨春明

公司网址：[www.dcfund.com.cn](http://www.dcfund.com.cn)

全国统一客户服务号码：400-888-5558（免固话长途费）

大成基金管理有限公司现分别在北京、深圳、上海设有投资理财中心：

#### （1）大成基金管理有限公司北京投资理财中心

办公地址：北京市朝阳区朝阳门外大街16号中国人寿大厦1201室（邮编：100020）

电话：010-85252345/46

传真：010-85252272/73

联系人：廖红军、李宁

#### （2）大成基金管理有限公司深圳投资理财中心

办公地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层（邮编：518040）

电话：0755-83195090/5236

传真：0755-83195091

联系人：梁靖、瞿宗怡

(3) 大成基金管理有限公司上海投资理财中心

办公地址：上海市广东路689号海通证券大厦19楼（邮编：200001）

电话：021-63513925/26

传真：021-63513928

联系人：徐龄、朱君

## 2、代销机构

(1) 中国农业银行

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：项俊波

客服电话：95599

联系人：蒋浩

电话：010-85109219

传真：010-85109219

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

(2) 中国银行股份有限公司

注册地址：北京西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：肖钢

客服电话：95566

传真：010-66593777

电话：010-66596688

(3) 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 号长安兴融中心 1 号楼

法定代表人：郭树清

联系人：王琳

电话：010-67596084

传真：010-66275654

客服电话：95533

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

(4) 中国工商银行股份有限公司

注册地址：中国北京复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

客服电话：95588

联系人：田耕

电话：010-66107900

传真：010-66108013

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

(5) 深圳市平安银行股份有限公司

注册地址：中国深圳市深南中路 1099 号

法定代表人：黄立哲

电话：0755-25859591

传真：0755-25878304

联系人：霍兆龙

客户服务热线：0755-961202、4006699999

公司网站：[www.18ebank.com](http://www.18ebank.com)

(6) 深圳发展银行股份有限公司

办公地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人：法兰克纽曼 (Frank N.Newman)

客服电话：95501

联系人：周勤

电话：0755-82088888-8811

传真：0755-82080714

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

(7) 交通银行股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

客服电话：95559

联系人：曹榕

电话：021-58781234



传真：021-58408842

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

(8) 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行股份有限公司大厦

法定代表人：秦晓

客服电话：95555

联系人：刘薇

电话：0755-83195915

传真：0755-83195061

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

(9) 中国光大银行

注册地址：北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦

法定代表人：唐双宁

客服电话：95595

联系人：李伟

电话：010-68560675

传真：010-68560661

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

(10) 中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区正义路 4 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：董文标

客服电话：95568

联系人：董云巍

电话：010-58351666-8155

传真：010-83914283

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

(11) 上海浦东发展银行股份有限公司

办公地址：上海市北京东路 689 号 17 楼

法定代表人：吉晓辉

联系人：倪苏云

客服热线：95528

电话：021-61618888

传真：021-63602431

网址：www.spdb.com.cn

（12）兴业银行股份有限公司

办公地址：福州市五一中路元洪大厦 25 层

法定代表人：高建平

电话：021-62677777

传真：021-62569070

联系人：潘玲

客户服务电话：95561

网址：www.cib.com.cn

（13）广东发展银行股份有限公司

注册地址：广州市农林下路 83 号

法定代表人：李若虹

客服电话：95508

电话：020-87310888

网址：www.gdb.com.cn

（14）东方证券股份有限公司

住所：上海市中山南路 318 号新源广场 2 号楼 21-29 楼

法定代表人：王益民

客户电话：95503

联系人：吴宇

电话：021-63325888

传真：021-63327888

网址：www.dfzq.com.cn

（15）长江证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

联系人：李良

联系电话：021-63219781

客服电话：4008-888-999

委托电话：4008-888-318

传真：027-85481900

网址：www.cjsc.com.cn

（16）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

通讯地址：上海浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦

法定代表人：祝幼一

客服电话：400-8888-666

联系人：芮敏祺

电话：021-62580818-213

传真：021-62583439

网址：www.gtja.com

（17）中信建投证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

通讯地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：张佑君

客服电话：400-8888-108

联系人：魏明

电话：010-85130579

网址：www.csc108.com

（18）国信证券有限责任公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26

法定代表人：何如

客服电话：800-810-8868

联系人：林建闽

电话：0755-82130833-2181

传真：0755-82133302

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

(19) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人：宫少林

客服电话：4008888111、95565

联系人：黄健

电话：0755-82943511

传真：0755-83734343

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

(20) 广发证券股份有限公司

注册地址：广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心 26 楼 2611 室

法定代表人：王志伟

客服电话：020—87555888 转各营业网点

联系人：肖中梅

电话：020-87555888-875

传真：020-87557985

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

(21) 中国银河证券股份有限公司

通讯地址：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：肖时庆

客服电话：4008-888-888

联系人：李洋

联系电话：010-66568047

传真：010-66568536

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

(22) 联合证券有限责任公司

办公地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、24、25 层

法定代表人：马韶明

客服电话：400-8888-555

联系人：盛宗凌

电话：0755-82492000

传真：0755-82492962

网址：www.lhzq.com

（23）申银万国证券股份有限公司

通讯地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：丁国荣

客服电话：021-962505

联系人：曹晔

电话：021-54033888

传真：021-54038844

网址：www.sw2000.com.cn

（24）海通证券股份有限公司

通讯地址：上海市淮海中路 98 号

法定代表人：王开国

客服电话：021-962503、400-888-8001

联系人：金芸

电话：021-23219278 021-53594566-4125

传真：021-63602722

网址：www.htsec.com

（25）中信证券股份有限公司

办公地址：北京朝阳区新源南路 6 号京城大厦

法定代表人：王东明

客服电话：010-84588888 各地营业部咨询电话

联系人：陈忠

电话：010-84683893

传真：010-84865560

网址：www.cs.ecitic.com

（26）安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 2222 号安联大厦 34 层、28 层 A02 单元

法定代表人：牛冠兴

客服电话：4008001001

联系人：张茜萍

电话：0755-82558335

传真：0755-82558335

网址：www.axzq.com.cn

（27）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：徐浩明

客服电话：10108998

联系人：刘晨

电话：021-68816000

传真：021-68815009

网址：www.ebscn.com

（28）华林证券有限责任公司

办公地址：珠海市拱北夏湾华平路 96 号二层 202-203 房

法定代表人：段文清

客服电话：0750—3160388 各地营业部客户服务电话

联系人：杨玲

电话：0755-82707855

传真：0755-82707850

网址：www.chinalions.com

（29）中信万通证券有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 室）

办公地址：青岛市东海西路 28 号

法定代表人：史洁民

客服电话：0532-96577

联系人：丁韶燕

电话：0532-85022026

传真：0532-85022026

网址：www.zxwt.com.cn

## (30) 东海证券有限责任公司

注册地址：常州延陵西路 59 号常信大厦 18、19 楼

办公地址：上海市浦东区东方路 989 号中达广场 17 楼

法定代表人：朱科敏

客服电话：0519-88166222、0379-64902266、021—52574550

联系人：李涛

电话：021-50586660

传真：021-50586660-8880

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

## (31) 江南证券有限责任公司

注册地址：南昌市抚河北路 291 号

办公地址：南昌市抚河北路 291 号六楼

法定代表人：姚江涛

客服电话：0791-6768763

联系人：余雅娜

电话：0791-6768763

传真：0791-6789414

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

## (32) 中信金通证券有限责任公司

注册地址：杭州市中河南路 11 号万凯庭院商务楼 A 座

办公地址：杭州市中河南路 11 号万凯庭院商务楼 A 座

法定代表人：刘军

电话：0571-96598

传真：0571-85783771

联系人：王勤

联系电话：0571-85783715

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

## (33) 广州证券有限责任公司

注册地址：广州市先烈中路 69 号主楼五楼

办公地址：广州市先烈中路 69 号东山广场主楼五楼

法定代表人：吴志明

客服电话：020-961303

联系人：江欣

联系电话：020-87320991

传真：020-87325036

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

（34）平安证券有限责任公司

办公地址：深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦三楼

法定代表人：陈敬达

客服电话：95511

联系人：袁月

电话：0755-22627802

传真：0755-83433794

网址：[www.pa18.com](http://www.pa18.com)

（35）华泰证券有限责任公司

地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

客服电话：4008-888-168、95597

联系人：李金龙、张小波

电话：025-84457777-950、248

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

（36）湘财证券股份有限公司

住所：长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼

办公地址：上海陆家嘴环路 958 号华能联合大厦 5 层

法定代表人：陈学荣

客服电话：400-888-1551

联系人：钟康莺

电话：021-68634518

传真：021-68865680

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



## (37) 国元证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市寿春路 179 号

公司办公地址：安徽省合肥市寿春路 179 号（邮政编码：230001）

法定代表人：凤良志

客服电话：400-888-8777、0551—95888

联系人：程维

电话：0551-2634400

传真：0551-2645709

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

## (38) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市西藏中路 336 号

办公地址：上海市西藏中路 336 号

法定代表人：蒋元真

客服电话：021-962518

联系人：谢秀峰

电话：021-51539888

传真：021-65081063

网址：[www.962518.com](http://www.962518.com)

## (39) 华安证券有限责任公司

住所：安徽省合肥市长江中路 357 号

法定代表人：李工

客服电话：0551-5161671

联系人：甘霖

电话：0551-5161671

传真：0551-5161672

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

## (40) 兴业证券股份有限公司

住所：福建省福州市湖东路 99 号标力大厦

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号中国保险大厦 18 楼

法定代表人：兰荣

电话：021-68419974

传真：021-68419867

联系人：杨盛芳

网址：www.xyzq.com.cn

客服电话：400888123

（41）财通证券经纪有限责任公司

注册地址：杭州市解放路 111 号金钱大厦

办公地址：杭州市解放路 111 号金钱大厦

法定代表人：沈继宁

联系人：乔骏

电话：0571-87925129

传真：0571-87925129

网址：www.ctsec.com

客户服务电话：0571-96336

（42）信泰证券有限责任公司

办公地址：江苏省南京市长江路 88 号国信大厦 18、19 楼（邮政编码：210005）

法定代表人：钱凯法

客服电话：400-8888-918

联系人：舒萌菲

电话：025-84784765

传真：025-84784830

网址：www.thope.com

（43）浙商证券有限责任公司

地址：浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6-7 楼

法定代表人：吴承根

联系人：吴颖

电话：0571-87901963

传真：0571-87902081

网址：www.stocke.com

（44）渤海证券有限责任公司

注册地址:天津市经济技术开发区第一大街 29 号

办公地址:天津市河西区宾水道 3 号

法定代表人:张志军

客服电话: 4006515988

联系人:王兆权

电话:022-28451861

传真:022-28451892

客服电话: 28455588

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

(45) 山西证券有限责任公司

注册地址: 山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人: 侯巍

客服电话: 400-666-1618

联系人: 张治国

电话: 0351-8686703

传真: 0351-8686619

网址: [www.i618.com.cn](http://www.i618.com.cn)

(46) 上海农村商业银行股份有限公司

注册地址: 上海市浦东新区浦东大道 981 号

法定代表人: 李秀仑

电话: 021-62126969

传真: 021-62521689

联系人: 吴海平, 翁敏芬

客服电话: 021-962999

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

(47) 方正证券有限责任公司

注册地址: 湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

办公地址: 湖南省长沙市建湘路 479 号

法定代表人: 雷杰

客服电话: 0571-95571、0731-95571、13258915782

电话: 0731-2882340 0571-87782047

传真: 0731-2882332

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

(48) 东莞证券有限责任公司

办公地址: 东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼

法定代表人: 游锦辉

客服电话: 0769-961130

联系人: 张建平

电话: 0769-22119426

传真: 0769-22119423

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

(49) 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: 矫正中

联系人: 潘锴

电话: 85096709

客户服务电话: 0431-96688-0 0431-85096733

网址: [www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

(50) 国海证券有限责任公司

注册地址: 广西南宁市滨湖路46号

办公地址: 广西南宁市滨湖路46号

客服电话: 400-888-8100 (全国)、96100 (广西)

法定代表人: 张雅锋

电话: 0771-5539262

传真: 0771-5539033

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

(51) 恒泰证券有限责任公司

注册地址: 内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号

法人代表: 刘汝军

客户服务电话：0471-4961259

联系人：常向东

电话：0471-4913998

传真：0471-4930707

网址：www.cnht.com.cn

(52)瑞银证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层

办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层

法定代表人：刘弘

电话：010-59226788

传真：010-59226840

联系人：谢亚凡

客户服务电话：400-887-8827

网址：www.ubssecurities.com

(53)宏源证券股份有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市建设路2号

办公地址：北京市海淀区西直门北大街甲43号金运大厦B座6层

法定代表人：汤世生

联系人：李茂俊

电话：010-62294608-6240

传真：010-62296854

客户服务电话：010-62294600

网址：www.hysec.com

(54)长城证券有限责任公司

注册地址：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

传真：0755-83516199

客户服务热线：0755-33680000、400 6666 888

网址：[www.cc168.com.cn](http://www.cc168.com.cn)

(二) 注册登记机构

名称：大成基金管理有限公司

住所：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层

办公地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层

法定代表人：张树忠

电话：0755-83183388

传真：0755-83195239

联系人：范瑛

(三) 律师事务所和经办律师

律师事务所名称：通力律师事务所

注册地址：上海市浦东南路528号上海证券大厦南塔21楼

办公地址：上海市浦东南路528号上海证券大厦南塔21楼

经办律师：秦悦民、傅轶

电话：021-68818100

传真：021-68816880

(四) 会计师事务所和经办注册会计师

会计师事务所名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦1604-1608室

办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

法人代表：杨绍信

经办注册会计师：薛竞、金毅

电话：(021) 61238888

传真：(021) 61238800

联系人：金毅

## 六、基金合同的生效

(一) 基金合同的生效

根据相关法规和《大成蓝筹稳健证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金合同已于2004年06月03日正式生效，自本基金合同生效之日起，本基金管理人大成基金管理有限公司正式开始管理本基

金。

### （二）基金存续期内基金份额持有人数量和资金量的限制

本基金合同生效后的存续期间内，有效基金份额持有人数量连续20个工作日达不到100人，或连续20个工作日基金财产净值低于5000万元人民币，基金管理人应及时向中国证监会报告，说明出现上述情况的原因及解决方案。若有效基金份额持有人数量连续60个工作日达不到100人，或连续60个工作日基金财产净值低于人民币5000万元，基金管理人可宣布本基金终止。

### （三）基金类型及存续期限

基金类型：契约型

基金运作方式：开放式

基金存续期限：不定期

## 七、基金的申购与赎回

### （一）申购、赎回场所

本基金基金合同生效后，基金的申购和赎回将通过本基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点及网站进行。此外，投资人可通过本基金管理人的网站办理申购与赎回业务。同时，在国内的电子支付与结算和其他相关技术成熟时，根据基金管理人最新公告，投资人可通过本基金管理人或者基金销售代理人指定的其他形式进行申购与赎回。

### （二）申购、赎回开放日及时间

本基金已于2004年6月7日起开始办理日常申购业务，于2004年7月15日起办理日常赎回业务。

本基金申购、赎回的开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易日。具体业务办理时间为上海证券交易所和深圳证券交易所的交易时间。若出现新的证券市场或交易所交易时间更改或其它情况，基金管理人可视情况对营业时间进行相应的调整，并报中国证监会备案。

投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

### （三）申购与赎回的原则

- 1、“未知价”原则，即基金申购与赎回以受理申请当日的基金份额净值为基准进行交易；
- 2、“金额申购、份额赎回”原则，即基金申购以金额申请，基金赎回以基金份额数申请；
- 3、基金份额持有人在赎回基金份额时，基金管理人按先进先出的原则，对该持有人账户在该销售机构托管的基金份额进行处理，即先确认的份额先赎回，后确认的份额后赎回；
- 4、当日的申购与赎回申请可以在当日交易结束时间（目前定为 15:00）前撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销；

5、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前两日内予以公告。

#### （四）申购与赎回的程序

##### （1）申请方式

基金投资人必须按照基金销售网点规定的手续，在工作日的交易时间段内向基金销售网点提出申购或赎回申请。

投资人在提交申购申请时，须按销售机构规定的方式备足申购资金；提交赎回申请时，账户中必须有足够的基金份额余额。

##### （2）申购与赎回的注册登记

投资人申购基金成功后，注册登记机构在 T+1 个工作日为投资人办理增加权益的登记手续，投资人自 T+2 个工作日起有权赎回该部分基金。投资人赎回基金成功后，注册登记机构在 T+1 个工作日为投资人办理扣除权益的登记手续。

基金管理人可以在法律法规、基金合同允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前两日内在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

##### （3）申购与赎回的确认与通知

投资人可于 T+2 个工作日以后（含 T+2 工作日）到直销或代销网点取得 T 日交易申请成交确认单，或凭基金账户号和查询密码通过大成客户服务中心、电子商务中心查询交易确认结果，若交易未成功或数据不符，投资人可与为其办理手续的投资顾问或网点人员联系并进行核实。

##### （4）申购与赎回款项支付的方式与时间

申购采用全额缴款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，申购款项本金将退回投资者账户，由此产生的利息等损失由投资者自行承担。

投资者赎回申请成功后，基金托管人按有关规定将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法按本基金合同有关规定处理。

#### （五）申购与赎回的数额约定

投资人按金额申购基金，最低申购金额为 100 元。基金申购份额计量单位为份基金份额，采用四舍五入法保留两位小数，由此引起的差额计入基金财产。

投资人赎回时按份额赎回基金，基金份额持有人可申请将其持有的部分或全部基金份额赎回。赎回金额计量单位为人民币元，采用四舍五入法保留两位小数，由此引起的差额计入基金财产。

基金管理人可根据市场情况调整申购与赎回的有关数额限制，调整结果必须在前两日内在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。



## （六）申购份额与赎回支付金额的计算方式

### 1、基金申购份额的计算：

（1）若投资人选择前端收费模式，则申购金额包括申购费用和净申购金额，计算公式如下：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日基金单位净值}$$

（2）若投资人选择后端收费模式，则在申购本基金时先不用支付申购费，而在赎回时支付，并且持有本基金年限越长，申购费率越低，直至为零。

基金申购份额和后端申购费用的计算公式为：

$$\text{申购份数} = \text{申购金额} / \text{申购日基金份额净值}$$

$$\text{后端申购费用} = \text{赎回份额} \times \text{申购申请日的基金份额净值} \times \text{该部分份额对应的后端申购费率。}$$

### 2、基金赎回金额的计算：

本基金的净赎回金额前端收费模式为赎回金额扣减赎回费用；后端收费模式为赎回金额扣减后端申购费用和赎回费用，计算公式如下：

$$\text{赎回金额} = \text{赎回份数} \times \text{申请日基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{前端收费模式净赎回金额} = \text{赎回金额} - \text{赎回费用}$$

$$\text{后端收费模式净赎回金额} = \text{赎回金额} - \text{后端申购费用} - \text{赎回费用}$$

3、申请日（T日）的基金份额净值在当天证券交易所收市后计算，并在下一交易日（T+1日）公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算和公告。

基金份额净值的计算公式为：

$$\text{基金份额净值} = \text{基金资产净值} / \text{发行在外的基金份额总份数。}$$

## （七）拒绝或暂停申购、赎回的情形及处理方式

1、除非出现如下情形，基金管理人不得拒绝或暂停接受基金投资人的申购申请：

（1）不可抗力的原因导致基金无法正常工作；

（2）证券交易场所在交易时间非正常停市；

（3）基金财产规模过大，使相应的基金管理人无法找到合适的投资品种，或可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益；

（4）当基金管理人认为某笔申购会有损于现有基金份额持有人利益；

（5）法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退划给投资人。

基金管理人拒绝或暂停接受申购的方式包括：

(1) 根据有关法律、法规、中国证监会的规定、本基金合同及基金管理人的业务规则，拒绝接受、暂停接受某笔或某数笔申购申请；

(2) 拒绝接受、暂停接受某个或某数个工作日的全部申购申请；

(3) 按比例拒绝接受、暂停接受某个或某数个工作日的申购申请。

2、除下列情形外，基金管理人不得拒绝接受或暂停接受投资人的赎回申请：

(1) 不可抗力的原因导致基金无法正常工作；

(2) 证券交易场所交易时间非正常停市；

(3) 因市场剧烈波动或其他原因而出现连续巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；

(4) 法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应在当日立即向中国证监会备案。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能支付时，将按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分由基金管理人按照相应的处理办法在后续开放日予以兑付。

3、发生基金合同或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人认为有正当理由认为需要暂停接受基金申购、赎回申请的，应当报经中国证监会批准。

4、基金暂停申购、赎回，基金管理人应及时在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上公告。暂停期间结束、基金重新开放时，基金管理人应当公告最新的基金份额净值。

如果发生暂停的时间为1日，基金管理人应于重新开放日或者前两日内在至少一种指定信息披露媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告并公告最新的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过1日但少于两周，暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应于前两日内在至少一种指定信息披露媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最新的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应于前两日内在至少一种指定信息披露媒体连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最新的基金份额净值。

(八) 巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

单个开放日基金净赎回申请超过上一日基金总份额数的10%时，为巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定接受全额赎回或部分延期

赎回。

(1) 接受全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资人的赎回申请有困难，或认为兑付投资人的赎回申请进行的资产变现可能使基金份额净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；未受理部分除投资人在提交赎回申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权并将以该下一个开放日的基金份额净值为基准计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。

当发生巨额赎回并部分延期赎回时，基金管理人应立即向中国证监会备案并在两日内在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告，并说明有关处理方法。

本基金连续两个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过正常支付时间20个工作日，并应当在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

## 八、基金的转换

### (一) 定义

基金转换是指开放式基金份额持有人将其持有的部分或全部基金份额转换为同一基金管理人管理的另一只开放式基金的份额。

### (二) 适用范围

1、基金转换业务目前限于本基金管理公司管理的由本基金管理公司担任注册登记机构的开放式证券投资基金（详见本基金管理公司基金开通转换业务公告）。

2、基金转换业务适用于已开通转换业务基金的所有基金份额持有人，包括个人投资人和机构投资者。

3、投资人只能在前端收费模式下的基金间进行基金转换。

4、基金管理人在不损害基金份额持有人合法权益的情况下可以更改上述适用范围，但最迟应于开始实施日前2日内在至少一种中国证监会指定媒体上公告。

### (三) 业务规则

#### 1、基金转换的原则

(1) 采用“未知价”和“已知价（确定价）”相结合的原则，即转换入大成货币市场基金以一元人

人民币的确定价为基准转换基金份额；转换入非大成货币市场基金转换价格按受理申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

(2) “份额申请”原则，即投资人的基金转换申请必须以份额为单位提出；

(3) “定向转换”原则，即投资人必须指明基金转换的方向，明确指出转出基金和转入基金的名

称；

(4) “视同赎回”原则，即基金转换申请转出的基金份额应作为赎回申请纳入转出基金当日赎回申请总量的汇总计算中，当发生巨额赎回时，对基金转换申请的处理方法与赎回申请相同；

(5) 基金管理人在不损害基金份额持有人合法权益的情况下可以更改上述原则，但最迟应于新规则开始实施日前两日内在至少一种中国证监会指定媒体上公告。

## 2、基金转换费用

(1) 每笔基金转换视为转出基金的一笔基金赎回和转入基金的一笔基金申购。基金转换费用由转出基金赎回费用及基金申购补差费用两部分构成。

(2) 转入基金时，从申购费用低的基金向申购费用高的基金转换时，每次收取申购补差费用；从申购费用高的基金向申购费用低的基金转换时，不收取申购补差费用。转入基金的申购补差费用按照转换金额对应的转出基金与转入基金的申购费率差额进行补差。

(3) 转出基金时，如涉及的转出基金有赎回费用，收取该基金的赎回费用。收取的赎回费用25%归入基金资产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

(4) 投资人可以发起多次基金转换业务，基金转换费用按每笔申请单独计算。

(5) 基金管理人可以根据市场情况在不违背有关法律、法规和基金合同的规定之前提下，调整上述收费方式和费率水平，但最迟应于新收费办法开始实施日前2日内在至少一种中国证监会指定媒体上公告。

## 3、基金转换的计算公式

$$A = [B \times C \times (1 - D) / (1 + G) + F] / E$$

其中，A为转入的基金份额； B为转出的基金份额； C为转换申请当日转出基金的基金份额净值； D为转出基金的对应赎回费率， G为对应的申购补差费率； E为转换申请当日转入基金的基金份额净值； F为基金账户内货币市场基金全部份额转出时，结转的账户当前累计未付正收益（仅限转出基金为货币市场基金）。

具体份额以注册登记机构的记录为准。转入份额的计算结果四舍五入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。

## 4、基金转换的注册登记

投资人T日申请基金转换成功后，注册登记机构将在T+1日为投资人办理减少转出基金份额、增

加转入基金份额的权益登记手续，投资人自T+2日起有权赎回转入部分的基金份额。

#### 5、基金转换的限制

(1) 每次基金转换申请的份额不得低于100份基金份额。

(2) 基金转换业务的开放日及办理时间同申购赎回业务，基金转换所涉及的两只基金，如果其中任何一只基金处在封闭期、暂停赎回期、非开放日或基金管理人公告不能办理转换业务的日期，基金转换业务不予确认。

(3) 投资人通过销售机构认购或申购的基金份额不能与该销售机构未代理销售的开放式基金产品办理基金转换业务。

#### 6、声明

基金管理人有权根据市场情况在不违背有关法律、法规和基金合同的规定之前提下，对上述基金转换的业务规则进行调整，但最迟应于调整生效前两日内在至少一种指定媒体上公告。

#### (四) 暂停基金转换的情形及处理

出现下列情况之一时，基金管理人可以暂停接受基金份额持有人的基金转换申请：

- 1、不可抗力的原因导致基金无法正常运转；
- 2、证券交易所在交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- 3、因市场剧烈波动或其他原因而出现连续巨额赎回，基金管理人认为有必要暂停接受该基金份额的转出申请；
- 4、基金管理人认为某基金继续接受基金份额转入可能对现有基金份额持有人的利益产生不利影响；
- 5、法律、法规、规章规定的其他情形或其他在基金合同、招募说明书已载明并获中国证监会批准的特殊情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应立即向中国证监会备案并于规定期限内至少一种中国证监会指定媒体上刊登暂停公告。重新开放基金转换时，基金管理人应于前两日内在至少一种中国证监会指定媒体上连续刊登重新开放基金转换的公告。

## 九、基金投资

### (一) 投资目标

通过精选符合本基金投资理念、流动性良好的证券，在控制非系统风险的前提下获取投资收益，同时辅助运用一系列数量分析方法，有效控制系统性风险，实现基金财产的中长期稳定增值。

### (二) 投资范围

本基金的股票投资主要投资于上证180指数成分股、深证100指数成分股以及未来可能入选成分股

的股票，并适度投资于新股申购、股票增发申购等。债券投资以国债投资为主，并适度投资于国内依法公开发行、上市的金融债、企业（公司）债（包括可转债）等债券及中国证监会允许投资的其他金融工具。

本基金投资股票比例为基金资产净值的30%~95%，投资债券比例为基金资产净值的0%~65%，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%。法律法规另有规定时从其规定。

### （三）投资理念

1、随着改革开放和现代化进程的推进，中国已经并将继续涌现一批治理结构良好、经营管理能力突出、信息透明、具备核心竞争力、盈利持续稳定增长的蓝筹上市公司，为长期价值投资提供了可能。

2、在充分研究的基础上，通过对上述公司的证券进行精选和长期投资，同时运用数量分析方法有效控制系统性风险，在承担风险较低的情况下分享中国经济快速增长的成果，为持有人增加财富。

### （四）投资决策

#### 1、决策依据

本基金管理人将主要依据下述因素决定基金资产配置和具体证券的买卖：

- （1）国家有关法律、法规和基金合同的有关规定；
- （2）国家宏观经济环境及其对债券市场的影响；
- （3）国家货币政策、财政政策以及证券市场政策；
- （4）发债公司财务状况、行业处境、经济 and 市场需求状况及其当前市场价格；
- （5）货币市场、资本市场资金供求状况及未来走势。

#### 2、投资流程

- （1）投资部提出市场策略研究报告和宏观经济、类属资产或行业、公司分析报告。

投资部研究员在广泛参考和利用公司外部的研究成果，尤其是研究实力雄厚的证券经营机构提供的研究报告，拜访国家有关部委，了解国家宏观经济政策、财政政策、货币政策，经过筛选、归纳和整理，定期或不定期地撰写市场策略研究报告和宏观经济、行业、上市公司分析报告，定期出具类属资产配置报告。债券投资方面，国债及金融债的选择采取以利率研究为核心的分析方式，由投资部宏观研究员对宏观经济形势、利率走势等进行分析，并向基金经理提交研究报告。公司债和企业债的选择采取以利率研究和发行人偿债能力研究为核心的分析方式，由投资部公司研究员在宏观研究、利率研究的基础上，结合对发行人经营及财务状况的调研，提出投资价值分析报告。

投资部向投资决策委员会和基金经理提供研究报告，作为其投资决策依据。

- （2）金融工程部提出基金资产配置及调整建议，基金经理制定资产配置方案

金融工程部数量分析师根据数量分析模型的结果，提出基金资产配置建议和组合调整建议，撰写

数量分析报告，提交投资决策委员会和基金经理。基金经理根据金融工程部的数量分析报告和投资部报告制定资产配置方案。

(3) 投资决策委员会决议确定基金资产分配比例

投资决策委员会根据金融工程部和基金经理提供的市场策略研究报告、宏观研究报告、数量分析报告和资产配置方案，决议确定基金总体投资计划。

(4) 基金经理制定具体的投资策略和投资组合方案

基金经理根据投资决策委员会确定的基金总体投资计划，参考投资部的宏观、行业及上市公司分析报告、市场分析报告，制定股票、债券和现金资产的投资比例，同时确定行业或类属资产的配置计划，构造投资组合方案。

(5) 基金投资组合经投资决策委员会审核后，由基金经理向集中交易室下达具体交易指令。

(6) 风险控制委员会提出风险控制建议

风险控制委员会根据市场变化对基金投资组合进行风险评估，并提出风险防范措施。监察稽核部对计划的执行过程进行日常监督，投资计划执行完毕，基金经理负责向投资决策委员会提出总结报告。

(7) 本基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据市场环境变化和实际需要调整上述投资流程。

### 3、初始建仓期

在基金募集完毕并宣告基金合同生效后，本基金管理人将在六个月内完成建仓。

#### (五) 投资策略

##### 1、资产配置策略

本基金利用修正的恒定比例投资组合保险策略（CPPI）来动态调基金中股票、债券和现金的配置比例。其中，股票投资部分的80%投资于上证180指数成分股和深证100指数成分股。

利用CPPI来动态调整基金资产配置，需要动态确定一些相关的参数：无风险利率、初始股票仓位、风险乘数、修正调整幅度等。一般来说，无风险率采用平均隔夜资金拆借成本。初始股票仓位取决于建仓初期宏观经济环境、市场状况和资金供求情况以及未来的市场预期。因此，我们将深入分析、研究宏观经济环境、市场特征、资金供求状况以及对市场未来做合理预期，在此基础上谨慎做出投资期初的资产配置决策，构建投资期初的股票仓位。而风险乘数则是通过对市场的收益、风险特征所做的数量化分析以及对投资人的风险容忍程度的深入调查后确定的，一般介于2—5之间。

##### 2、行业配置策略

本基金的行业配置采取较为积极的策略，以投资基准的行业权重为基础，以行业研究及比较分析为核心，通过适时增大或降低相应行业的投资权重，使整体投资表现跟上或超越投资基准。基金管理人将根据国家产业政策、行业周期和景气状况、行业发展前景预期、市场行业轮换情况等因素，综合

判断行业投资价值，适当加大对处于产业复苏周期、被市场低估、行业景气指数上升、发展前景良好的行业的投资。具体根据基金管理人投资部的行业投资价值评估系统进行。

### 3、个股选择策略

个股选择策略采用蓝筹成分股优选策略，运用“价值—势头”选股方法，优选出被市场低估并有良好市场表现，处于价值回归阶段的天相280指数成分股投资，并采用积极的资产管理方式，以期获得资本的稳健增值。

选股程序：

#### (1) 确定现有成分股和可能进入的股票

以上证180指数和深证100指数成分股作为基础备选股票库；再根据上证180指数和深证100指数编制原则，选出未来可能进入上证180指数或深证100指数成分股并符合本基金投资理念的股票，加入基础备选股票库；

#### (2) 价值选股：

- 蓝筹公司主要挑选标准：
  - 公司治理结构良好，行为规范，信息透明，注重公众股东利益和投资人关系
  - 主营业务鲜明并具有一定的竞争力
  - 经营管理能力和市场竞争能力在行业中具有明显优势
  - 具备长期持续稳定成长性，预期至少未来两年的主营业务收入和利润增长率高于 GDP 增长率
  - 财务状况良好，具备较好的抗风险能力
- 由基金管理人内设的研究部公司分析人员根据上述蓝筹公司挑选标准，采用自下而上方式逐个筛选，形成基本面合规备选股票库。
- 将基本面合规备选股票库按 P/B 从小到大排序（删除业绩为负的股票），选取前 70% 的股票作备选，产生投资备选股票库。

#### (3) 势头选股：

将备选股票按如下公式计算势头，按势头从大到小排序，并参考排序结果形成最终股票组合。

$$\text{Momentum} = \frac{(R_s - R_i)}{\sigma_{s-i}} \times Tr$$

其中： $R_s$  为股票最近三个月的收益率，

$R_i$  为股票所在行业最近三个月的收益率，

$\sigma_{s-i}$  为股票收益率与其对应行业收益率之差的月标准差，



$Tr$  为股票交易活跃度，表示为股票最近5个交易日平均换手率除以最近30个交易日平均换手率。

#### 4、债券投资策略

本基金的债券投资采用完全积极的投资策略，采用利率预测、久期管理、收益率曲线移动策略、相对价值评估、收益率利差策略、套利交易策略以及利用正逆回购进行杠杆操作等积极的投资策略，力求获得超过债券市场的收益。

#### （六）业绩比较基准

天相投资顾问有限公司编制的天相280指数作为股票投资部分的基准，采用中信国债指数作为债券投资部分的基准。本基金的业绩比较基准如下：

70%×天相280指数+30%×中信国债指数

#### （七）风险收益特征

本基金属于较低风险证券投资基金，适于能承受一定风险，追求当期收益和长期资本增值的基金投资人投资。本基金采用大成风险管理系统和基金绩效评估系统，该系统可以完成市场风险管理、压力测试、多因子风险分析、流动性风险控制等多项风险管理功能。

#### （八）投资组合

本基金下投资组合须符合以下规定：

- 1、基金持有一家上市公司的股票，不超过基金资产净值的10%；
- 2、本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，不超过该证券的10%；
- 3、中国证监会规定的其他比例限制；
- 4、法律法规或监管部门对上述比例另有规定时从其规定。

由于本基金规模或市场的变化导致基金投资组合超过上述约定的比例，基金管理人应在合理期限内进行调整，以达到上述比例标准。

#### （九）投资限制

本基金禁止从事下列行为：

- 1、投资于其他基金；
- 2、以本基金的名义使用不属于本基金名下的资金买卖证券；
- 3、将基金财产用于非法抵押、担保、资金拆借或者贷款；
- 4、以基金财产进行房地产投资；
- 5、从事可能使基金财产承担无限责任的投资；
- 6、将基金财产投资于与基金托管人或基金管理人有利害关系的公司所发行的证券；
- 7、内幕交易、操纵市场、通过关联交易损害基金份额持有人的利益；
- 8、配合管理人的发起人及其他任何机构的证券投资业务；

9、故意维持或抬高管理人的发起人及其他任何机构所承销股票的价格；

10、中国证监会禁止从事的其他行为。

(十) 基金管理人代表基金行使股东权利的原则及方法

基金管理人将按照国家有关规定代表本基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益。基金管理人代表基金行使股东或债权人权利时应遵守以下原则：

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司或发债公司的经营管理；
- 2、有利于基金财产的安全与增值，有利于保护基金份额持有人的合法权益。

(十一) 基金投资组合报告

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，保证本报告所载内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2008年12月31日复核了本基金投资组合报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2008年09月30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

项目	金额（元）	占基金资产总值比例
股票	6,877,545,632.38	60.33%
债券	4,172,493,000.00	36.60%
权证	0.00	0.00%
资产支持证券	0.00	0.00%
银行存款和清算备付金合计	279,129,409.77	2.45%
其他资产	70,128,505.12	0.62%
合计	11,399,296,547.27	100.00%

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	公允价值（元）	占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	60,090,204.00	0.54%
B 采掘业	848,447,273.43	7.59%
C 制造业	3,296,993,703.43	29.52%
C0 食品、饮料	930,202,398.09	8.33%
C1 纺织、服装、皮毛	14,300,750.75	0.13%
C2 木材、家具	0.00	0.00%
C3 造纸、印刷	1,296,960.73	0.01%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	799,532,588.16	7.16%
C5 电子	88,968,870.00	0.80%
C6 金属、非金属	514,001,683.12	4.60%
C7 机械、设备、仪表	489,116,908.93	4.38%
C8 医药、生物制品	426,213,243.65	3.81%

C99 其他制造业	33,360,300.00	0.30%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	614,726,673.87	5.50%
E 建筑业	0.00	0.00%
F 交通运输、仓储业	292,592,550.86	2.62%
G 信息技术业	2,400,000.00	0.02%
H 批发和零售贸易	205,690,597.55	1.84%
I 金融、保险业	1,448,490,271.76	12.96%
J 房地产业	64,983,773.48	0.58%
K 社会服务业	43,130,584.00	0.39%
L 传播与文化产业	0.00	0.00%
M 综合类	0.00	0.00%
合计	6,877,545,632.38	61.55%

## 3、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	600900	长江电力	65,496,911	600,606,673.87	5.38%
2	600583	海油工程	22,536,067	355,619,137.26	3.18%
3	000568	泸州老窖	12,973,425	337,309,050.00	3.02%
4	000792	盐湖钾肥	4,700,000	317,485,000.00	2.84%
5	600596	新安股份	9,440,000	310,764,800.00	2.78%
6	600519	贵州茅台	2,071,081	273,154,873.09	2.44%
7	601318	中国平安	8,099,951	269,485,369.77	2.41%
8	000157	中联重科	18,206,286	267,814,467.06	2.40%
9	600030	中信证券	10,599,950	262,454,762.00	2.35%
10	600036	招商银行	14,328,053	252,460,293.86	2.26%

## 4、报告期末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 债	0.00	0.00%
2	金 融 债	913,744,000.00	8.18%
3	央行票据	3,258,749,000.00	29.17%
4	企 业 债	0.00	0.00%
5	可 转 债	0.00	0.00%
6	其 他	0.00	0.00%
	合 计	4,172,493,000.00	37.35%

## 5、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明细

序号	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例
1	08 进出 08	913,744,000.00	8.18%
2	08 央行票据 79	793,360,000.00	7.10%
3	08 央行票据 25	529,045,000.00	4.73%
4	07 央行票据 133	288,750,000.00	2.58%
5	08 央行票据 07	288,660,000.00	2.58%

## 6、报告期间本基金投资权证明细

(1) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权证证明细

无。

(2) 报告期内权证投资情况

权证代码	权证名称	期初数量(份)	期间买入数量(份)	期间买入成本(元)	期间卖出数量(份)	权证卖出收入(元)	期末数量(份)	备注
580024	宝钢CWB1	4,882,880	0	0.00	4,882,880	8,930,641.80	0	被动持有
031007	东阿EJC1	0	2,502,925	0.00	2,502,925	43,162,279.49	0	被动持有

7、报告期末资产支持证券公允价值占基金净资产的比例以及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明细

无。

8、投资组合报告附注

(1) 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

(2) 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

(3) 基金的其他资产构成

序号	其他资产	金额(元)
1	存出保证金	5,397,638.54
2	应收证券清算款	0.00
3	应收利息	62,700,786.30
4	应收申购款	1,129,540.46
5	应收股利	900,539.82
	合计	70,128,505.12

(4) 报告期末基金持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

(5) 本报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金情况

无。

(6) 由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## 十、基金业绩

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，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

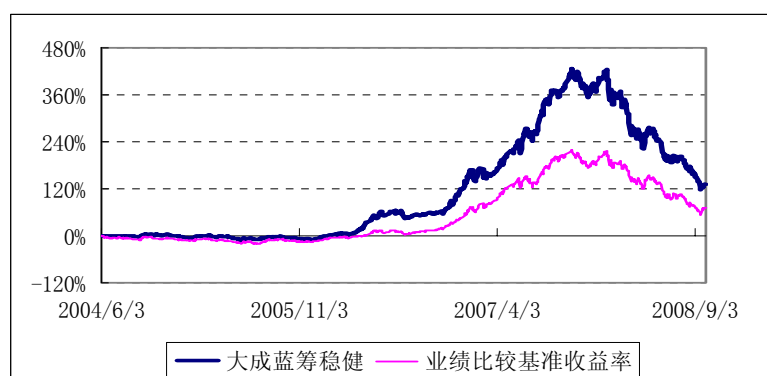
(一) 自本基金合同生效日(2004年06月03日)至2008年9月30日以来完整会计年度的基金份额净值增长率以及与同期业绩比较基准收益率的比较：：

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
2004.06.03-2004.12.31	-1.65%	0.71%	-11.78%	0.96%	10.13%	-0.25%
2005.01.01-2005.12.31	-2.34%	0.93%	-1.68%	0.94%	-0.66%	-0.01%
2006.01.01-2006.12.31	129.02%	1.43%	65.34%	1.00%	63.67%	0.42%
2007.01.01-2007.12.31	127.40%	1.95%	105.10%	1.63%	22.3%	0.32%
2008.01.01-2008.09.30	-53.58%	2.25%	-42.72%	2.13%	-10.86%	0.12%
2004.06.03-2008.09.30	132.18%	1.60%	70.61%	1.43%	61.57%	0.17%

(二) 自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动的比较

### 大成蓝筹稳健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

(2004年6月3日至2008年9月30日)



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期。依据本基金2005年8月31日《关于调整大成蓝筹稳健证券投资基金资产配置比例的公告》，本基金投资股票比例为基金资产净值的30%~95%，投资债券比例为基金资产净值的0%~65%，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%，法律法规另有规定时从其规定。截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

## 十一、基金财产

### (一) 基金财产总值

基金财产总值包括基金所拥有的各类有价证券、银行存款本息、应收基金申购款及其他投资所形成的价值总和。

### (二) 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债、按照法律、法规、规章的有关规定可以在基金资产中扣除的费用后的价值。

### (三) 基金资产的账户

本基金根据相关法律法规、规范性文件开立基金专用银行存款账户以及证券账户，与基金管理人和基金托管人自有的资产账户以及其他基金资产账户独立。

#### （四）基金资产的处分

1、本基金财产独立于基金管理人及基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。

2、基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归基金财产。

3、基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算范围。

4、基金财产的债权不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销；不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 十二、基金资产估值

### （一）估值目的

基金资产的估值目的是客观、准确的反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值，并为基金份额提供计价依据。

### （二）估值日

本基金合同生效后，每个交易日对基金财产进行估值。

### （三）估值对象

基金所持有的金融资产和金融负债。

### （四）估值原则

1. 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，应采用市价确定公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，可采用最近交易市价确定公允价值。

2. 对存在活跃市场的投资品种，如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值存在较大影响，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

3. 当投资品种不再存在活跃市场，且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值存在较大影响，可采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。

### （五）估值方法

#### 1、股票估值方法

### (1) 上市流通股票的估值

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，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

### (2) 未上市股票的估值

送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。

### (3) 有明确锁定期股票的估值

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，按交易所上市的同一股票的收盘价估值；非公开发行且处于明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

## 2、固定收益证券的估值方法

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘净价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(2) 证券交易所市场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（自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息）得到的净价进行估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按有交易的最近交易日所采用的净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(3) 未上市债券采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。

(4) 在银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

(5) 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，按成本进行后续计量。

(6) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

## 3、权证估值方法

#### （1）配股权证的估值

因持有股票而享有的配股权，类同权证处理方式的，采用估值技术进行估值。

#### （2）认沽 / 认购权证的估值

从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的认沽 / 认购权证按估值日的收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。未上市交易的认沽 / 认购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的情况下，按成本估值；因持有股票而享有的配股权，停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

#### 4、其他资产的估值方法

其他资产按照国家有关规定或行业约定进行估值。

5、在任何情况下，基金管理人采用上述 1—4 项规定的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，如果基金管理人有着充足的理由认为按上述方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素的基础上与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

6、国家有最新规定的，按其规定进行估值。

#### （六）估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金资产净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核；基金托管人复核无误后签字返回给基金管理人。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

#### （七）估值错误的处理

基金份额净值的计算采用四舍五入方法保留到小数点后四位。当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后四位以内发生差错时，视为基金资产估值错误。

“基金管理人和基金托管人将采取必要、适当合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。”

因基金份额净值计算错误给投资人造成损失的，基金管理人应当承担赔偿责任。赔偿原则如下：

- 1、赔偿仅限于因差错而导致的基金份额持有人的直接损失；
- 2、基金管理人代表基金份额持有人保留要求返还不当得利的权利；



3、基金管理人负责赔偿在单次交易时给单一当事人造成的 10 元人民币以上的损失；

#### （八）暂停估值的情形

- 1、基金投资涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、中国证监会认定的其他情形。

#### （九）特殊情形的处理

1、基金管理人按本部分第（四）条有关估值方法规定的第 5 款进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

2、由于其他不可抗力原因，或由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

### 十三、基金收益与分配

#### （一）基金收益的构成

基金收益包括：基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券差价、银行存款利息以及其他收入。

#### （二）基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按照国家有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

#### （三）基金收益分配原则

1、本基金收益分配方式采用现金方式。基金份额持有人事先可选择将现金收益按权益登记日除息后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。如果基金份额持有人事先未作出选择的，默认为现金方式；

- 2、每一基金份额享有同等分配权；
- 3、基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；
- 4、基金收益分配后每基金份额净值不能低于面值；
- 5、如果基金当期出现亏损，则不进行收益分配；
- 6、基金收益分配的比例不低于基金净收益的 90%；
- 7、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至少一次；年度分配在基金会计年度结束后 4 个月内完成。

法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### （四）基金收益分配方案

基金收益分配方案中载明基金收益的范围、基金净收益、基金收益分配对象、分配原则、分配时

间、分配数额及比例、分配方式及有关手续费等内容。

(五) 基金收益分配方案的确定与公告

基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人核实后确定，在报中国证监会备案后两日内由基金管理人公告。

(六) 收益分配中发生的费用

1、基金份额持有人选择将现金红利进行再投资时，免收再投资的费用。

2、基金份额持有人选择现金分红方式时，收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担；如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，注册登记机构自动将该基金份额持有人的现金红利按权益登记日当日除息后的基金份额净值转为基金份额。

## 十四、基金费用与税收

(一) 与基金运作有关的费用

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) 基金的证券交易费用；
- (4) 基金合同生效后的基金信息披露费用；
- (5) 基金份额持有人大会费用；
- (6) 基金合同生效后的会计师费和律师费；
- (7) 按照国家有关规定可以列入的其他费用。

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

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 1.5% 年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起两日内从基金资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

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.25% 年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

(3) 上述第 1 款第 3 项至第 7 项费用由基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。

### 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、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、申购费用

申购费用是基金销售和服务过程中发生费用，由基金份额持有人承担，按交易金额的一定比例收取，不列入基金财产。

(1) 投资人既可以选择申购时交纳申购费用，也可以选择赎回时交纳申购费用。投资人若选择申购时交纳称为前端申购费，投资人若选择在赎回时交纳则称为后端申购费。

(2) 投资人选择交纳前端申购费时，按照申购金额采用比例费率，具体如下表所示：

申购金额 M	费率
M < 50 万	1.5%
50 万 ≤ M < 200 万	1.0%
200 万 ≤ M < 500 万	0.6%
M ≥ 500 万	1000 元/笔

计算公式如下：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日基金单位净值}$$

(3) 投资人选择后端申购费时，基金申购份额的计算公式为：

$$\text{申购份数} = \text{申购金额} / \text{申购日基金份额净值}$$

交纳的后端申购费按照持有时间采用比例费率，并随持有时间递减，具体计算公式如下：

$$\text{后端申购费用} = \text{赎回份额} \times \text{申购申请日的基金份额净值} \times \text{该部分份额对应的后端申购费率}$$

后端申购费率具体如下表所示：

基金 费率 持有年限	大成蓝筹稳健证券投资基金
T<1 年	2.0%
1≤T<2 年	1.5%
2≤T<3 年	1.0%
3≤T<5 年	0.5%
T≥5	0

## 2、赎回费用

本基金的赎回费用按持有期递减，最高不超过赎回总金额的 0.50%；

赎回费用用于支付相关手续费后余额归入基金财产，赎回费归入基金财产的比例不得低于赎回费总额的百分之二十五；具体费率如下：

持有期	赎回费率
T<365	0.5%
T≥365	0.25%

基金的净赎回金额为赎回金额扣减赎回费用和其他相关费用后的余额，计算公式如下：

赎回金额=赎回份数×申请日基金份额净值

赎回费用=赎回金额×赎回费率

净赎回金额= 赎回金额－赎回费用－后端申购费用

3、基金管理人可根据市场情况，在不违背有关法律、法规和基金合同规定的情况下调整本基金的申购和赎回费率，调整结果将于前两日内在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

4、基金管理人可在不违背法律法规规定的情形下，根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以对促销活动范围内的投资人调低基金的费率。

## 5、基金转换费用

(1) 每个基金份额持有人自首次购买大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成财富管理2020生命周期证券投资基金的基金份额获得确认之日起每一年内可免费转换两次；本基金与大成货币市场证券投资基金之间的转换适用大成货币市场证券投资基金转换的有关费用规定；

(2) 每个基金份额持有人每年转换基金超过两次以上的, 从第三次起每次转换需交纳一定的基金转换费用, 基金转换费以转出基金份额总金额为计算基础, 转换费率为0.25%, 全部作为基金注册登记费和其他相关手续费; 本基金与大成货币市场证券投资基金之间的转换适用大成货币市场证券投资基金转换的有关费用规定;

(3) 基金管理人可以根据市场情况在不违背有关法律、法规和基金合同的规定之前提下, 调整上述收费方式和费率水平, 但最迟应于新收费办法开始实施日前两日内在至少一种中国证监会指定媒体上公告。

### (三) 基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体, 应按国家税收法律、法规履行其纳税义务。

按照国家现行税收法律、法规规定, 个人投资人投资本基金所获增值部分免税, 机构投资人投资本基金所获增值部分应按相关规定缴纳企业所得税。

## 十五、基金的会计与审计

### (一) 基金会计政策

- 1、基金的会计年度为公历每年01月01日至12月31日。
- 2、基金核算以人民币为记账本位币, 以人民币元为记账单位。
- 3、会计制度按国家有关的会计制度执行。
- 4、本基金独立建账、独立核算。
- 5、本基金会计责任人为基金管理人, 基金管理人也可以委托具有证券相关资格的独立的会计师事务所担任基金会计, 但该会计师事务所不能同时从事本基金的审计业务。

### (二) 基金审计

- 1、基金管理人聘请普华永道中天会计师事务所有限公司及其注册会计师对基金年度财务报表进行审计。普华永道中天会计师事务所有限公司及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立, 并具有从事证券相关业务资格。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师, 须事先征得基金管理人和基金托管人同意, 并报中国证监会备案。
- 3、基金管理人(或基金托管人)认为有充足理由更换会计师事务所, 须经基金托管人(或基金管理人)同意, 并报中国证监会备案后可以更换。更换会计师事务所在两日内公告。

## 十六、基金的信息披露

本基金的信息披露按照《基金法》、《信息披露办法》及其实施准则、基金合同及其他有关规定办理。本基金的信息披露事项将通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）和基金管理人、基金托管人的互联网网站（以下简称“网站”）等媒介披露。

### （一）基金募集信息披露

本基金管理人已按照《基金法》、《信息披露办法》编制并公告了基金招募说明书等相关文本：

1、本基金管理人已于2004年04月22日公告了《大成蓝筹稳健证券投资基金招募说明书》及基金合同摘要，并于当日登载在指定报刊和网站上。

2、本基金管理人已于2004年04月22日公告了《大成蓝筹稳健证券投资基金发行公告》，并于当日登载在指定报刊和网站上。

3、本基金的基金管理人、基金托管人已将基金合同、基金托管协议登载在网站上。

4、本基金管理人已于2004年06月04日公告了《大成蓝筹稳健证券投资基金成立公告》，并于基金合同生效的次日登载在指定报刊和网站上。

5、本基金管理人已于2007年01月13日公告了《大成蓝筹稳健证券投资基金更新的招募说明书（2006年第2号）》、《大成蓝筹稳健证券投资基金更新的招募说明书摘要（2006年第2号）》，并于当日登载在指定报刊或网站上。

6、其他更新招募说明书请见有关公告。

### （二）基金运作信息披露

本基金定期报告包括年度报告、半年度报告、季度报告、基金净值公告及更新的招募说明书，由基金管理人和基金托管人按照《基金法》、《信息披露办法》及相关法律、法规的规定和中国证监会颁布的有关证券投资基金信息披露内容与格式的相关文件进行编制并公告，同时报中国证监会备案。

1、年度报告：基金年度报告经注册会计师审计后在基金会计年度结束后的90日内公告。

2、半年度报告：基金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。

3、季度报告：基金季度报告应当在每个季度结束之日起15个工作日内公告。

4、基金净值公告：每开放日公布前一开放日的基金份额净值。

5、更新的招募说明书：更新的招募说明书由基金管理人编制并公告。本基金合同生效后，于每6个月结束后45日内公告更新的招募说明书，并在公告时间15日前报中国证监会审核。

### （三）基金临时信息披露

基金在运作过程中发生如下可能对基金份额持有人权益产生重大影响的事项时，基金管理人须按

照法律法规及中国证监会的有关规定及时报告并公告：

- 1、基金份额持有人大会的召开；
- 2、提前终止基金合同；
- 3、延长基金合同期限；
- 4、转换基金运作方式；
- 5、更换基金管理人、基金托管人；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- 8、基金募集期延长；
- 9、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；
- 10、基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十；
- 11、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；
- 12、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
- 13、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- 14、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；
- 15、重大关联交易事项；
- 16、基金收益分配事项；
- 17、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 18、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；
- 19、基金改聘会计师事务所；
- 20、变更基金份额发售机构；
- 21、基金更换注册登记机构；
- 22、开放式基金开始办理申购、赎回；
- 23、开放式基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- 24、开放式基金发生巨额赎回并延期支付；
- 25、开放式基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- 26、开放式基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 27、中国证监会规定的其他事项。

（四）信息披露文件的存放与查阅

本基金招募说明书或更新的招募说明书、年度报告、半年报告、基金投资组合公告、临时公告等文本存放在基金管理人、基金托管人和基金代销机构的主要办公场所或网站，投资人可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。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。

## 十七、风险揭示

### （一）市场风险

本基金主要投资于证券市场，而证券市场价格受政治、经济、投资心理和交易制度等各种因素的影响会产生波动，从而对本基金财产产生潜在风险，导致基金收益水平发生波动。市场风险的主要存在以下几种：

#### 1、政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家宏观经济政策的变化对证券市场产生一定影响，从而导致市场价格波动，影响基金收益而产生的风险。

#### 2、经济周期风险

证券市场是国民经济的晴雨表，而经济运行则具有周期性的特点。随宏观经济运行的周期性变化，基金所投资于国债与上市公司股票的收益水平也会随之变化，从而产生风险。

#### 3、利率风险

金融市场利率的变化直接影响着国债的价格和收益率，进而影响金融债、企业债的价格和收益率，同时影响债券利息的再投资。同时，金融市场利率的变化也影响到证券市场资金供求关系，并在一定程度上影响上市公司的盈利水平。上述变化将直接影响本基金的收益。

#### 4、上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等都会导致公司盈利发生变化。如果基金所投资的成长型公司经营不善，成长性不足，导致股票价格下跌或股息、红利减少；如果基金所投资的价值型公司基本情况继续恶化，或者没有出现预计的价值回归，其股票价格可能下跌，或股息、红利减少，给基金的投资带来风险。

#### 5、购买力风险

基金收益的一部分将通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而使购买力下降，从而使基金的实际投资收益下降。

#### 6、国际竞争风险

随着中国市场开放程度的提高，上市公司的发展必然要受到国际市场同类技术或同类产品公司的强有力竞争，部分上市公司有可能不能适用新的行业形势而业绩下滑。尤其是中国加入 WTO 以后，中国境内公司将面临前所未有的市场竞争，上市公司在这些因素的影响下将存在更大不确定性。

### （二）管理风险



1、在基金管理运作过程中，基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有以及对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平；

2、基金管理人和基金托管人的管理手段和管理技术等因素的变化也会影响基金收益水平。

### （三）流动性风险

本基金类型为契约型开放式，基金规模将随着基金投资人对基金份额的申购和赎回而不断波动，若由于基金投资人的连续大量赎回，导致基金管理人的现金支付出现困难，或被迫在不适当的价格大量抛售债券股票，使基金财产净值受到不利影响，从而产生流动性风险。

### （四）产品特有风险

#### 1、CPPI 投资策略风险

本基金根据理论分析和实证研究的结果，采用修正的 CPPI 策略进行资产配置。但 CPPI 投资策略的有效性是建立在一系列假定条件基础上的，如参与主体可以无限度融入资金的假定，市场具有足够流动性的假定等，这些假定目前我国证券市场并不完全具备。另外，CPPI 投资策略在中国市场还是新生事物，实际效果尚未得到实践检验。所有这些因素都可能给基金的投资收益产生不利影响。

#### 2、价值投机风险

本基金坚持价值投资理念，主要投资于上证 180 和深证 100 指数成分股等蓝筹绩优股票。自 2002 年底以来，价值投资理念受到了市场的追捧，上证 180 指数和深证 100 指数的涨幅明显超过大盘，部分大盘蓝筹股票涨幅超过 100%，媒体惊呼蓝筹时代来临。这一方面说明蓝筹绩优股票受到了市场广大投资人的青睐和追捧，价值投资有一个很好的市场前景，另一方面也反映了市场中可能存在的一种趋势：对某些绩优股票的过度追捧，最后使价值投资演变成价值投机，给基金投资带来风险。

### （六）其他风险

- 1、因技术因素而产生的风险，如电脑系统不可靠产生的风险；
- 2、因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；
- 3、因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈等行为产生的风险；
- 4、对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；
- 5、因业务竞争压力可能产生的风险；
- 6、其他风险。

## 十八、基金的终止和清算

### （一）基金的终止

有下列情形之一的，本基金经中国证监会批准后终止：

- 1、存续期间内，基金份额持有人数量连续 60 个工作日达不到 100 人，或连续 60 个工作日基金资产净值低于人民币 5000 万元，基金管理人宣布本基金终止；
- 2、基金经基金份额持有人大会表决终止；
- 3、因重大违法、违规行为，基金被中国证监会责令终止；

4、基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任本基金的管理人，而无其他适当的基金管理机构承接其权利及义务；

5、基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任本基金的托管人，而无其他适当的基金托管机构承接其权利及义务；

6、由于投资方向变更引起的基金合并、撤销；

7、法律法规或中国证监会允许的其他情况。

基金终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金进行清算。

## （二）基金的清算

### 1、基金清算小组

（1）自发生导致基金终止情形之日起 30 个工作日内合同生效基金清算小组，基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算，在基金清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应依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）基金清算小组成员由基金管理人、基金托管人、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。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

### 2、清算程序

（1）基金终止后，由基金清算小组统一接管基金财产；

（2）基金清算小组对基金财产进行清理和确认；

（3）对基金财产进行评估和变现；

（4）将基金清算结果报告中国证监会；

（5）公布基金清算公告；

（6）对清算后的剩余基金财产进行分配。

### 3、清算费用

清算费用是指基金清算小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小组优先从基金财产中支付。

### 4、基金剩余资产的分配

基金清算后的全部剩余资产扣除基金清算费用后如有余额，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

### 5、基金清算的公告

基金终止并报中国证监会核准后 2 日内由基金清算小组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金清算结果由基金清算小组于中国证监会批准后两日内公告。

### 6、清算账册及文件的保存

基金清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 十九、基金合同内容摘要

### （一）基金份额持有人的权利和义务

#### 1、基金份额持有人的权利

- ①出席或委派代表出席基金份额持有人大会，行使表决权；
- ②取得基金收益；
- ③监督基金经营情况，依照规定的程序和方式获取基金业务及财务状况的资料；
- ④申购、赎回基金单位；
- ⑤取得基金清算后的剩余资产；
- ⑥因基金管理人、基金托管人、销售机构、注册登记机构的错误导致基金份额持有人利益受损的情况下索取赔偿；
- ⑦提请基金管理人、基金托管人或基金注册登记机构履行按本基金合同规定应尽的义务；
- ⑧按照基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；
- ⑨法律、法规和基金合同规定的其他权利；
- ⑩依据其持有的基金单位享有并行使权利，每份基金单位具有同等的合法权益。

#### 2、基金份额持有人的义务

- ①遵守基金合同；
- ②交纳基金认购、申购款项及规定的费用；
- ③承担基金亏损或者终止的有限责任；
- ④不从事任何有损基金及其他基金份额持有人利益的活动；
- ⑤法律、法规和基金合同规定的其他义务。

### （二）基金管理人的权利和义务

#### 1、基金管理人的权利

根据《运作办法》、基金合同和其他有关法规，基金管理人享有如下权利：

- ①自本基金合同生效之日起，根据法律、法规和基金合同的规定管理和运作基金财产；
- ②获得基金管理人报酬；
- ③销售基金单位，办理其他基金交易业务；
- ④选择、更换基金代销机构，对基金代销机构的相关行为进行监督和处理。如认为基金代销机构违反基金合同、《基金销售代理协议》及国家法律、法规的有关规定，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人的利益；
- ⑤依照《运作办法》及其他有关规定，代表基金行使因基金投资而获得的任何权利；
- ⑥在事先征得基金托管人书面同意的前提下，基金管理人可以授权有关人员代表基金管理人履行基金合同项下的任何义务或责任；
- ⑦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法律、法规的有关规定，应呈报中国证监会和中国人民银行，并采取必要措施保护基金投资人的利益。除非法律法规、基金合同及《托

管协议》规定，否则基金管理人对于基金托管人的行为不承担任何责任；

⑧法律、法规和基金合同规定的其他权利。

## 2、基金管理人的义务

根据《运作办法》、基金合同和其他有关法规，基金管理人负有如下义务：

- (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作基金财产；
- (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单位的认购、申购和赎回业务或委托其他机构代理该项业务；
- (4) 配备足够的专业人员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管理人的资产相互独立，保证不同基金在资产运作、财务管理等方面相互独立；
- (6) 除依据《运作办法》、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) 接受基金托管人的监督；
- (8) 按规定计算并公告基金财产净值及单位基金财产净值；
- (9) 严格按照《运作办法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- (10) 保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等。除《运作办法》、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；
- (11) 开放式基金合同生效后的存续期间内，其有效持有人数量连续 20 个工作日达不到 100 人，或者连续 20 个工作日最低基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当及时向中国证监会报告，说明出现上述情况的原因以及解决方案；
- (12) 依据本基金合同决定基金收益分配方案，并按规定向基金份额持有人分配基金收益；
- (13) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- (14) 不谋求对上市公司的控股和直接管理；
- (15) 依据《运作办法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会；
- (16) 保存基金的会计账册、报表、记录 15 年以上；
- (17) 确保向基金投资人提供的各项文件或资料在规定时间内发出；并且保证投资人能够按照招募说明书公告的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并得到有关资料的复印件；
- (18) 参加基金清算小组，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并通知基金托管人；
- (20) 因过错导致基金财产的损失，应承担赔偿责任，采取适当、合理的方式向基金份额持有人进行赔偿；该过错责任不因其退任而免除；
- (21) 因估值错误导致基金份额持有人的损失，应承担赔偿责任，该过错责任不因其退任而免除；

(22) 监督基金托管人按基金合同的规定履行自己的义务，因基金托管人的过错造成基金财产损失时，应为基金持有人向基金托管人追偿；

(23) 法律、法规和基金合同规定的其他义务。

(三) 基金托管人的权利和义务

#### 1、基金托管人的权利

根据《运作办法》、基金合同及其他有关法规，基金托管人享有如下权利：

①根据法律、法规和基金合同的规定保管基金财产，监督本基金的投资运作；

②依据基金合同约定获得基金托管费用；

③监督基金管理人，如认为基金管理人违反了基金合同及国家有关法律法规，应呈报中国证监会和中国人民银行，并采取必要措施保护基金投资人的利益。除非法律法规、基金合同及《托管协议》规定，否则，基金托管人对基金管理人的行为不承担任何责任；

④在事先通知基金管理人前提下，基金托管人可以授权有关人员代表基金托管人履行基金合同项下的任何义务或责任；

⑤有权对基金管理人的违法、违规投资指令不予执行，并向中国证监会报告；

⑥监督基金注册登记机构的基金注册及过户登记服务；

⑦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

根据《运作办法》、基金合同及其他有关法规，基金托管人负有如下义务：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金财产；

(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托管人的资产以及不同的基金财产相互独立；对不同的基金分别设置账户，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《运作办法》、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) 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) 以基金的名义设立证券账户、银行账户等基金财产账户，负责基金投资于证券的清算交割，执行基金管理人的投资指令，负责办理基金名下的资金往来；

(7) 保守基金商业秘密。除《运作办法》、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；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和单位基金资产净值；

(9) 采取适当、合理的措施，使基金单位的认购、申购、赎回等事项符合基金合同等有关法律

文件的规定；

(10) 采取适当、合理的措施，使基金管理人用以计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合法律、法规、基金合同或其他法律文件的规定；

(11) 采取适当、合理的措施，使基金投资和融资的条件符合法律、法规、基金合同或其他法律文件的规定；

(12) 按规定出具基金业绩和基金托管情况的报告，并呈报中国证监会和中国人民银行；

(13) 负责基金认购、申购和赎回业务的资金保管和清算；

(14) 在定期报告内出具托管人意见，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；

(15) 按有关规定，保存基金的会计账册、报表和记录等 15 年以上；

(16) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(17) 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；

(18) 参加基金清算小组，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，应及时报告中国证监会和中国人民银行，并通知基金管理人；

(20) 因过错导致基金财产的损失，应承担赔偿责任，该过错责任不因其退任而免除；

(21) 监督基金管理人按基金合同的规定履行自己的义务，因基金管理人的过错造成基金财产损失时，应为基金持有人向基金管理人追偿；

(22) 法律、法规和基金合同规定的其他义务。

(四) 基金份额持有人大会

#### 1、召开事由

(1) 有以下情形之一的，应召开基金份额持有人大会：

①修改基金合同(基金合同中约定可由基金管理人和基金托管人协商后修改而无需召开基金份额持有人大会的情形除外)；

②更换基金管理人；

③更换基金托管人；

④提前终止基金合同；

⑤与其他基金合并；

⑥代表基金总份额 10% 以上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；

⑦基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

⑧转换基金运作方式；

⑨提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；

⑩法律、法规及中国证监会规定的其他情形。

(2) 有以下情形之一的，经基金合同约定可由基金管理人和基金托管人协商后修改，无需召开基金份额持有人大会：

- ①调低基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- ②在基金合同约定的范围内变更本基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
- ③因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- ④对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- ⑤对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按照法律法规或基金合同规定不需要召开基金份额持有人大会的其他情形。

## 2、召集方式

(1) 在正常情况下，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十日内决定是否召集，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六十日内召开；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) 代表基金份额百分之十以上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十日内决定是否召集，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六十日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额百分之十以上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十日内决定是否召集，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六十日内召开。

(4) 基金管理人和基金托管人都不召集基金份额持有人大会的，代表基金份额 10% 以上的基金份额持有人有权自行召集。基金份额持有人自行召集基金份额持有人大会的，应当至少提前三十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。

## 3、通知

召开基金份额持有人大会，召集人应当至少提前 30 天，在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告通知。基金份额持有人大会通知至少应载明以下内容：

- (1) 会议召开的时间、地点和会议方式；
- (2) 会议拟审议的主要事项、议事程序；
- (3) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- (4) 代理投票授权委托书送达时间和地点；

- (5) 会议的表决方式;
- (6) 会务常设联系人姓名、电话;
- (7) 与会者需要准备或履行的文件和手续;
- (8) 召集人认为需要通知的其他事项。

采取通讯方式开会并进行表决的情况下,会议通知应报中国证监会备案,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、书面表决意见的寄交和收取方式等。

#### 4、会议召开方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会与通讯方式开会。

会议的召开方式由召集人确定,但更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

基金份额持有人大会应当有代表在权益登记日基金总份额 50% 以上的基金份额持有人参加方可召开。

##### (1) 现场开会。

现场开会并符合下列条件时,可以进行基金份额持有人大会议程:

①由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席,基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席;

②本人出席会议者应持有本基金份额凭证、受托出席会议者应出具委托人持有本基金份额的凭证及委托人的授权委托书应符合法律、法规、本基金合同和会议通知的规定。

③经核对,汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示,有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50%。

##### (2) 通讯方式开会

通讯方式开会应以书面方式进行表决。符合以下条件的通讯开会有效:

①召集人应按本基金合同规定公告会议通知,在两个工作日内在指定媒体上连续公布相关提示性公告;

②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基金份额持有人的书面表决意见;

③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代理人提交的持有本基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有本基金份额的凭证及委托人的授权委托书应符合法律、法规、本基金合同和会议通知的规定;

④本人直接出具书面意见或授权他人代表出具意见的,基金份额持有人所持有的基金份额在基金权益登记日基金总份额的 50% 以上。

(3) 不论现场开会或通讯方式开会,若该次会议不符合本基金合同规定的开会条件,则该次会议不得审议会议通知中的各项议题,但召集人可以按照本基金合同规定的方式和程序,对于同一议题



再次召集基金份额持有人大会；再次开会日期的提前通知期限为 30 天，但确定有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人资格的权益登记日不发生变化；再次召开的基金份额持有人大会需满足上述现场开会或通讯方式开会的各项条件方为有效。

## 5、议事内容与程序

### （1）议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如修改基金合同、提前终止基金合同、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、转换基金运作方式、提高基金管理人或基金托管人报酬以及召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%以上基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前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。

大会召集人在会议通知公告前应当按照以下原则对提案进行审核：

①关联性：提案涉及事项与本基金有直接关系，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。

②程序性：大会召集人可以对提案涉及的程序性问题作出决定。如将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，召集人可就程序性问题提请基金份额持有人大会作出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议的提案，以及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的，时间间隔不少于 6 个月。

对于召集人未列入会议通知并公告的提案，该提案的提案人可在本次基金份额持有人大会后按本基金合同的规定自行召集基金份额持有人大会。

### （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下列第（七）款规定的程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，律师见证并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人未能主持大会的情况下，由基金托管人授权出席会议的代表主持；如果基金管理人和基金托管人均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人以所代表的基金份额 50%以上多数选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。

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、住处地址、持有或者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

在通讯方式开会的情况下，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二天统计全部有效表决，在公证机构监督下形成决议。

## 6、表决

(1) 基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权，基金份额持有人可以委托代理人出席基金份额持有人大会并行使表决权。

(2) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

### ①一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人所持表决权的 50% 以上通过方为有效；除下列 (2) 所规定的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。

### ②特别决议

特别决议须经参加大会的基金份额持有人所持表决权的 2/3 以上通过方可作出。更换基金管理人或者基金托管人、提前终止基金合同、转换基金运作方式必须以特别决议通过方为有效。

(3) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

(4) 采取通讯方式进行表决时，符合会议通知规定的书面表决意见为有效表决。除非在计票时有充分的相反证据证明，否则符合法律法规、基金合同和会议通知的书面表决意见为有效表决；表决意见模糊不清或相互矛盾的为无效表决，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。

(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不得就未经公告的事项进行表决。

## 7、计票

### (1) 现场开会

①如大会由基金管理人或基金托管人召集，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中选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中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

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

③如果会议主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果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者基金份额持有人的代理人对会议主持人宣布的表决结果有异议，有权在宣布表决结果后立即要求重新清点；重新清点以一次为限，会议主持人应当于重新清点后当场公布重新清点结果。

④计票过程应由公证机关予以公证。

### (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的监督下进行计票，并由公证机关对计票过程予以公证。

## 8、生效与公告

基金份额持有人大会表决通过的事项，召集人应当自通过之日起五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。

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。

基金份额持有人大会决议自生效之日起两日内在至少一种中国证监会指定的报刊上公告。

#### （五）基金合同的修改和终止

##### 1、基金合同的修改

（1）本基金合同的修改应经基金合同各方当事人的同意，但本合同另有规定的除外；

（2）基金合同修改的内容应经基金份额持有人大会决议通过，但本合同另有规定的除外；

（3）基金合同的修改应报中国证监会批准，并自批准之日起生效。

如因相应的法律法规发生变动并属本基金合同必须遵照进行修改的情形或基金合同的修改事项对基金份额持有人的利益无实质性不利影响的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案。

##### 2、基金合同的终止

###### （1）基金的终止

出现本基金合同规定的基金终止的情形之一时，经中国证监会批准可以终止基金。

###### （2）基金合同的终止

基金终止后，应依据法律、法规和本基金合同的规定对基金进行清算。中国证监会对清算结果批准并予以公告之日起，本基金合同终止。

#### （六）违约责任及争议的解决方式

##### 1、违约责任

（1）由于本基金合同当事人的过错，造成基金合同不能履行或不能完全履行的，由有过错的一方承担违约责任；如属基金合同两方或多方当事人的过错，根据实际情况，由双方或多方承担各自应负的违约责任。但是发生下列情况，当事人可以免责：

①因管理人及基金托管人按照中国证监会的规定或当时有效的法律、法规或规章的作为或不作为而造成的损失；

②在没有欺诈或过错的情况下，因基金管理人由于按照本基金合同规定的投资原则而履行或不履行其投资义务而造成的损失。

（2）本基金合同当事人违反本合同的，应向其他各方当事人支付违约金，如果由于违约已给其他方造成的直接经济损失超过违约金的，还应就超过部分进行赔偿。

（3）基金合同能够继续履行的，应当继续履行。

##### 2、争议的处理

本基金合同当事人发生纠纷时，可以通过协商或调解解决。基金合同当事人不愿通过协商、调解解决或协商、调解不成的，可向基金托管人所在地有管辖权的人民法院起诉。

#### （七）基金合同的存放及查阅方式

本基金的基金合同存放在基金管理人和基金托管人的营业场所，基金投资人可免费查阅，也可按

工本费购买本基金合同印制件或复印件；如涉及争议事项需协商、仲裁或诉讼的，应以基金合同正本为凭。

## 二十、基金托管协议内容摘要

### （一）托管协议当事人

本基金托管协议当事人为：

基金管理人：大成基金管理有限公司

住 所：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层

法定代表人：张树忠

成立日：1999 年 04 月 12 日

注册资本：贰亿元人民币

基金托管人：中国银行

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：肖 钢

企业类型：股份有限公司

注册资本：人民币壹仟捌佰陆拾叁亿玖仟零叁拾伍万贰仟肆佰玖拾柒元捌角叁分

存续期间：持续经营

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

### （二）基金托管人与基金管理人之间的业务监督、核查

#### 1、基金托管人对基金管理人的业务监督、核查

根据《试点办法》、基金合同和有关证券法规的规定，托管人应对基金管理人就基金财产的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、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、基金的申购与赎回、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

（1）基金托管人发现基金管理人违反《试点办法》、基金合同和有关法律、法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人违反基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

（2）基金托管人发现基金管理人的指令违反《试点办法》、基金合同和有关法律、法规规定的行为，可以拒绝执行，并通知基金管理人，向中国证监会报告。

（3）基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。按照规定监督基金管理人的投资运作。

(4) 如基金托管人认为基金管理人的作为或不作为违反了法律法规、基金合同或本托管协议,基金托管人应呈报中国证监会和其他监管部门,有权利并有义务行使法律法规、基金合同或本托管协议规定的基金托管人的任何及所有权利和救济措施,以保护基金财产的安全和基金投资人的利益,包括但不限于就更换基金管理人事宜召集基金份额持有人大会、代表基金对因基金管理人的过错造成的基金财产的损失向基金管理人索赔。

## 2、基金管理人就基金托管人的业务监督、核查

根据《试点办法》、基金合同及其他有关规定,基金管理人就基金托管人是否及时执行基金管理人的指令、是否将基金财产和自有资产分账管理、是否擅自动用基金财产、是否按时将分配给基金份额持有人的收益划入分红派息账户等事项,对基金托管人进行监督和核查。

(1) 基金管理人定期对基金托管人保管的基金财产进行核查。基金管理人发现基金托管人未对基金财产实行分账管理、擅自挪用基金财产、因基金托管人的过错导致基金财产灭失、减损、或处于危险状态的,基金管理人应立即以书面的方式要求基金托管人予以纠正和采取必要的补救措施。基金管理人有权要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

(2) 基金管理人发现基金托管人的行为违反《试点办法》、基金合同和有关法律、法规的规定,应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正,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。

(3) 如基金管理人认为基金托管人的作为或不作为违反了法律法规、基金合同或本托管协议,基金管理人应呈报中国证监会和其他监管部门,有权利并有义务行使法律法规、基金合同或本托管协议规定的基金管理人的任何及所有权利和救济措施,以保护基金财产的安全和基金投资人的利益,包括但不限于就更换基金托管人事宜召集基金份额持有人大会、代表基金对因基金托管人的过错造成的基金财产的损失向基金托管人索赔。

## 3、基金管理人和基金托管人有义务配合和协助对方依照本协议对基金业务执行监督、核查。

基金管理人或基金托管人无正当理由,拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权,或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督,情节严重或经监督方提出警告仍不改正的,监督方应报告中国证监会。

### (三) 基金财产的保管

#### 1、基金财产保管的原则

(1) 基金财产的保管责任,由基金托管人承担。基金托管人将遵守《信托法》、《基金法》、《试点办法》、基金合同及其他有关规定,为基金份额持有人的最大利益处理基金事务。基金托管人保证恪尽职守,依照诚实信用、勤勉尽责的原则,谨慎、有效的持有并保管基金财产。

(2) 基金托管人应当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;建立健全内部风险监控制度,对负责基金财产托管的部门和人员的行为进行事先控制和事后监督,防范和减少风险。

(3) 基金托管人应当购置并保持对于基金财产的托管所必要的设备和设施（包括硬件和软件），并对设备和设施进行维修、维护和更换，以保持设备和设施的正常运行。

(4) 除依据《信托法》、《试点办法》、本基金合同及其他有关规定外，不为自己及任何第三人谋取利益，基金托管人违反此义务，利用基金财产为自己及任何第三方谋取利益，所得利益归于该基金财产；基金托管人不得将基金财产转为其固有财产，不得将固有资产与基金财产进行交易，或将不同基金财产进行相互交易；违背此款规定的，将承担相应的责任，包括但不限于恢复相关基金财产的原状、承担赔偿责任。

(5) 基金托管人必须将基金财产与自有资产严格分开，将基金财产与其托管的其他基金财产严格分开；基金托管人应当为基金设立独立的账户，建立独立的账簿，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面具有实质的独立性。

(6) 除依据《信托法》、《试点办法》、本基金合同及其他有关规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产；

(7) 基金托管人应安全、完整地保管基金财产；未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。

## 2、基金合同生效时募集资金的验证

基金设立募集期满或基金管理人宣布停止募集时，基金管理人应将设立募集的资金存入其指定的相应验资专户；由基金管理人聘请具有从事相关业务资格的会计师事务所对基金进行验资，并分别出具验资报告，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。

## 3、基金的银行账户的开设和管理

(1) 基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

(2) 基金托管人以本基金的名义在其营业机构开设本基金的银行账户。本基金的银行预留印鉴，由基金托管人保管和使用。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、收取申购款，均需通过本基金的银行账户进行。

(3) 本基金银行账户的开立和使用，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本基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用基金的任何银行账户进行本基金业务以外的活动。

(4) 基金银行账户的管理应符合《中华人民共和国票据法》、《银行账户管理办法》、《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。

## 4、基金证券账户和资金账户的开设和管理

(1) 基金托管人应当代表本基金，以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设证券账户。

(2) 本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

人不得出借和未经另一方同意擅自转让本基金的任何证券账户；亦不得使用本基金的任何证券账户进行本基金业务以外的活动。

(3) 基金托管人以自身法人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，用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的全部基金在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

(4) 基金证券账户和资金账户的开设和管理可以根据当时市场的通行做法办理，而不同于上述关于账户开设、使用的规定。

(5) 在本托管协议订立日之后，本基金被允许从事其他投资品种的投资业务的，涉及相关账户的开设、使用的，若无相关规定，则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

#### 5、国债托管专户的开设和管理

(1) 基金合同生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管账户，并代表基金进行债券和资金的清算。在上述手续办理完毕之后，由基金托管人负责向银行监管部门进行报备。

(2) 基金管理人和基金托管人同时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、基金财产投资的有关实物证券的保管

实物证券由基金托管人存放于托管银行的保管库，但要与非本基金的其他实物证券分开保管；也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司的代保管库。保管凭证由基金托管人持有。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。

#### 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。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时，应保证基金一方持有两份以上的正本，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。

#### (四) 基金资产净值的计算和复核

##### 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。基金单位资产净值是指计算日基金资产净值除以计算日该基金单位总数后的价值。

##### 2、基金资产净值的复核

基金管理人应每工作日对基金资产估值。估值原则应符合基金合同、《证券投资基金会计核算办法》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单位资产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结束后计算得出当日的基金单位资产净值，并在盖章后以加密传真方式发送给基金托管人。基金托管人应在收到上述传真后马上对净值计算结果进行复核，并在盖章后以加密传真方式将复核结果传送给基金管理人；如果基金托管人的复核结果与

基金管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，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，基金托管人有权将相关情况报中国证监会备案。

#### （五）基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册，包括基金设立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、每月最后一个交易日的基金份额持有人名册，均由基金管理人和托管人负责分别保管，基金管理人应及时向基金托管人提供相关信息。

#### （六）适用法律与争议解决

1、本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

2、基金/基金管理人、基金/基金托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可通过友好协商解决，但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，根据提交仲裁时该会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。除提交仲裁的争议之外，各方当事人仍应履行本协议的其他规定。争议处理期间，双方当事人应恪守基金/基金管理人和基金/基金托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和托管协议规定的义务，维护各基金份额持有人的合法权益。

#### （七）托管协议的修改和终止

1、本协议双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，报中国证监会批准后生效。

2、发生以下情况，本托管协议终止：

- （1）基金或基金合同终止；
- （2）本基金更换基金托管人；
- （3）基金更换基金管理人；
- （4）发生《基金法》、《试点办法》或其他法律法规规定的终止事项。

（注：本部分“基金托管协议内容摘要”摘自 2004 年 4 月签署的《大成蓝筹稳健证券投资基金托管协议》）

## 二十一、基金份额持有人服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务，并将根据基金份额持有人的需要和市场的变化增加、修改这些服务项目。

#### （一）服务内容：

##### 1、持有人注册登记服务

基金管理人委托注册登记机构为基金份额持有人提供注册登记服务。基金注册登记机构配备安



全、完善的电脑系统及通讯系统，准确、及时地为基金投资人办理基金账户、基金份额的登记、管理、托管与转托管，股东名册的管理，权益分配时红利的登记、派发，基金交易份额的清算过户和基金交易资金的交收等服务。

## 2、红利再投资服务

若基金份额持有人选择红利再投资形式进行基金收益分配，该持有人当期分配所得基金收益将按红利发放日的基金份额净值自动转基金份额，且不收取任何申购费用。

## 3、定期定额投资计划

基金管理人已开通部分代销网点为投资人提供定期定额投资的服务。通过定期定额投资计划，投资人可以通过固定的渠道，定期定额申购基金份额，该定期申购计划不受最低申购金额的限制，以另行公告为准。

## 4、持有人专项理财服务

基金管理人通过四个平台为基金份额持有人提供专项理财服务，包括满意理财热线、大成绿色通道、基金E点通和财富俱乐部。

### (1) 满意理财热线

为基金份额持有人提供专业化的人工服务和7×24小时自助语音查询服务。基金份额持有人可在工作时间选择人工查询、咨询、信息定制、投诉建议服务，也可选择大成基金客服热线自助语音系统查询基金净值、账户情况、公司介绍等服务。

### (2) 大成绿色通道

为基金份额持有人定期邮寄对账单服务。每季度结束后20个工作日内，基金管理人将向在最近一季度内发生交易的基金份额持有人邮寄该持有人最近一季基金交易对账单，记录该持有人最近一季所有申购、赎回、非交易过户等交易发生的时间、金额、数量、价格以及当前账户的余额等。每年度结束后30个工作日内，基金管理人将向所有基金份额持有人寄送账户状况对账单。“大成绿色通道”同时提供理财期刊定期送阅服务。基金管理人定期出版“大成理财”等专业理财刊物供基金份额持有人订阅。

### (3) 基金E点通

为基金份额持有人开通了短信服务定制平台、电子对账单及电子刊物订阅平台、网站留言互动平台和网上交易平台等。通过先进的网络通讯技术，为基金份额持有人提供高效安全的基金交易服务、及时迅捷的基金信息和理财服务。

### (4) 财富俱乐部

是为基金份额持有人中的高端客户专门设立的服务体系，将为优质客户提供专项的个性化服务。

## （二）联系方式

1、大成公司客服热线：021-53599588-#

全国统一客户服务号码：400-888-5558（免固话长途费）

2、大成公司网址：www.dcfund.com.cn

3、大成投资理财中心电话：

深圳：0755-83195090/83195236      北京：010-85252345/46

上海：021-63513925/26

## 二十二、其他应披露的事项

（一）本基金管理人、基金托管人的托管业务部门目前无重大诉讼事项。

（二）最近3年本基金管理人、基金托管人的托管业务部门及高级管理人员没有受到任何处罚。

（三）2008年6月4日至2008年12月03日的公告：

1、2008年6月11日《大成基金管理有限公司增加湘财证券为基金代销机构的公告》。

2、2008年6月13日《大成基金管理有限公司关于旗下基金申购步步高A股的公告》。

3、2008年6月17日《大成基金管理有限公司旗下部分基金通过中国银行股份有限公司开办定期定额投资及网上银行交易费率优惠的公告》。

4、2008年7月9日《大成基金管理有限公司关于在民生银行开通基金“定期定额投资计划”的公告》。

5、2008年7月12日《大成蓝筹稳健证券投资基金更新的招募说明书》、《大成蓝筹稳健证券投资基金更新的招募说明书摘要》。

6、2008年7月18日《大成蓝筹稳健证券投资基金2008年第二季度报告》。

7、2008年7月22日《大成基金管理有限公司增加广东发展银行股份有限公司为代销机构的公告》。

8、2008年8月1日《大成基金管理有限公司关于在民生银行开通基金“定期定额投资计划”的公告》。

9、2008年8月25日《大成蓝筹稳健证券投资基金2008年半年度报告》。

10、2008年8月27日《大成基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金申购费率的公告》。

11、2008年8月29日《大成基金管理有限公司关于调整中国农业银行借记卡网上直销申购费率的公告》。

12、2008年9月16日《大成基金管理有限公司关于调整旗下基金持有长期停牌股票估值方法的

公告》。

13、2008年9月17日《大成基金管理有限公司关于旗下基金估值方法调整后的净值变动情况公告》。

14、2008年9月24日《大成基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金基金转换业务规则的公告》。

15、2008年9月25日《大成基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金基金转换业务规则的更正公告》。

16、2008年10月13日《大成基金管理有限公司关于旗下部分基金在光大证券开展基金转换业务的公告》。

17、2008年10月24日《大成基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金通过中国农业银行办理基金转换业务的公告》、《大成蓝筹稳健证券投资基金2008年第三季度报告》。

18、2008年10月27日《关于上海浦东发展银行开通大成基金管理有限公司旗下部分基金定期定额投资业务的公告》。

19、2008年10月30日《大成基金管理有限公司关于增加方正证券有限责任公司为基金代销机构的公告》。

20、2008年10月31日《大成基金管理有限公司关于旗下基金参加上海浦东发展银行基金定投申购优惠活动的公告》、《大成基金管理有限公司关于增加长城证券有限责任公司为基金代销机构的公告》。

21、2008年11月7日《大成基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金通过交通银行股份有限公司办理基金转换业务的公告》、《大成基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金通过中国建设银行办理基金转换业务的公告》。

22、2008年11月13日《大成基金管理有限公司关于增加恒泰证券股份有限公司为基金代销机构的公告》、《大成基金管理有限公司关于增加宏源证券股份有限公司为基金代销机构的公告》。

23、2008年11月20日《大成基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票复牌后估值方法的提示性公告》。

24、2008年12月3日《大成基金管理有限公司关于增加瑞银证券有限责任公司为基金代销机构的公告》。

(四) 招募说明书或以前的更新的招募说明书与本次更新的招募说明书内容若有不一致之处,以本次更新的招募说明书为准。

### 二十三、对招募说明书更新部分的说明

本更新的招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《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》及其他有关法律法规的要求，对2008年7月12日公布的《大成蓝筹稳健证券投资基金更新的招募说明书（2008年1号）》进行了更新，并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新，主要更新的内容如下：

1. 根据最新资料，更新了“三、基金管理人”部分。
2. 根据最新资料，更新了“四、基金托管人”部分。
3. 根据最新资料，更新了“五、相关服务机构”部分。
4. 根据最新资料，更新了“七、基金的申购与赎回”部分。
5. 根据最新资料，更新了“八、基金转换”部分。
6. 根据最新数据，更新了“九、基金的投资”部分。
7. 根据最新数据，更新了“十、基金的业绩”部分。
8. 根据最新资料，更新了“十二、基金财产估值”部分。
9. 根据最新公告，更新了“十四、基金费用与税收”部分。
10. 根据最新公告，更新了“二十、基金托管协议内容摘要”部分。
11. 根据最新公告，更新了“二十二、其他应披露的事项”。

### 二十四、招募说明书存放及查阅方式

本基金的招募说明书存放在本基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构的办公场所，投资人可在办公时间免费查阅，也可按工本费购买本招募说明书的复印件。如涉及争议事项需协商、仲裁或诉讼的，应以招募说明书正本为凭。

### 二十五、备查文件

本基金的相关备查文件存放在本基金管理人、基金托管人的办公场所，投资人可在办公时间免费查阅。如涉及争议事项需协商、仲裁或诉讼的，应以各项备查文件的正本为凭。

- 1、中国证监会核准大成蓝筹稳健证券投资基金募集的文件；
- 2、《大成蓝筹稳健证券投资基金基金合同》；
- 3、《大成蓝筹稳健证券投资基金托管协议》；
- 4、《大成蓝筹稳健证券投资基金招募说明书》；

- 4、《大成基金管理有限公司开放式基金注册登记业务规则》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照。

大成基金管理有限公司

2009年1月16日