

**大成沪深 300 指数证券投资基金  
更新的招募说明书  
2009 年第 1 期**

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

二〇〇九年五月

## 重要提示

大成沪深300指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会证监基金字【2006】24号文核准募集，基金合同于2006年4月6日正式生效。

本基金管理人保证更新的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、勤勉尽责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。

投资有风险，投资者申购本基金时应认真阅读本更新的招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本更新的招募说明书已经本基金托管人复核。所载内容截止日为2009年4月6日，有关财务数据和净值表现截止日为2009年3月31日，本报告中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	5
四、基金托管人	18
五、相关服务机构	21
六、基金合同的生效	39
七、基金的申购与赎回	39
八、基金投资	47
九、基金业绩	55
十、基金的融资	56
十一、基金财产	57
十二、基金财产估值	57
十三、基金收益与分配	63
十四、基金费用与税收	64
十五、基金的会计与审计	68
十六、基金的信息披露	68
十七、风险揭示	72
十八、基金的终止和清算	75
十九、基金合同内容摘要	76
二十、基金托管协议内容摘要	89
二十一、基金份额持有人服务	95
二十二、其他应披露的事项	97
二十三、对招募说明书更新部分的说明	99
二十四、招募说明书存放及查阅方式	99
二十五、备查文件	99

## 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《大成沪深 300 指数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。投资者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《运作管理办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露管理办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售管理办法》）、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务；基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅《大成沪深 300 指数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	指大成沪深 300 指数证券投资基金
基金合同	指《大成沪深 300 指数证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何修改和补充
招募说明书	指《大成沪深 300 指数证券投资基金招募说明书》
托管协议或本托管协议	指《大成沪深 300 指数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
银行业监管机构	指中国银监会和/或中国人民银行等国家监督管理机关
监管机构(关)或相关	指中国证监会和/或中国银监会和/或中国人民银行等国家监督管理机关

监管机构（关）	
上交所或上证所	指上海证券交易所
深交所	指深圳证券交易所
交易所或证券交易所	指上海证券交易所和/或深圳证券交易所等
交易所业务规则	指上海证券交易所、深圳证券交易所及其附属机构所发布的相关业务规则、操作指引或其他相关规定，有时也可指中国证券登记结算有限责任公司所发布的相关业务规则、操作指引等规定
交易所开放式基金《业务规则》	指交易所制定的关于开放式基金各种相关业务的业务规则、操作指引及其他相关规定，包括但不限于 2005 年 7 月 13 日深圳证券交易所、2005 年 7 月 14 日上海证券交易所分别发布并于发布之日起施行的《深圳证券交易所开放式基金申购赎回业务实施细则》和《上海证券交易所开放式基金认购、申购、赎回业务办理规则》及相应修改和补充
法律法规	指中华人民共和国现时有效并公布实施的法律、行政法规、行政规章、部门规章、司法解释及规范性文件、地方法规、地方规章及规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充
《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》
《运作管理办法》	指《证券投资基金运作管理办法》
《销售管理办法》	指《证券投资基金销售管理办法》
《信息披露管理办法》	指《证券投资基金信息披露管理办法》
基金合同当事人	指受基金合同约定，根据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	指中国农业银行股份有限公司
个人投资者	指依据中华人民共和国有关法律、法规及其他有关规定可以投资于证券投资基金的自然人
机构投资者	指依据中华人民共和国有关法律、法规及其他有关规定在境内注册登记或经政府有关部门批准设立的可以投资于证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体及其他组织
合格境外机构投资者	指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规的规定，可投资于中国境内证券的中国境外的机构投资者
投资者	指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者等的总称
注册登记业务	指本基金的登记、存管、过户、清算和交收等业务，具体内容包括份额持有人基金账户管理、基金份额注册登记、清算、基金交易确认、发放

	红利、建立并保管基金份额持有人名册等
注册登记机构	指办理本基金注册登记业务的机构，本基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司
注册登记系统	指注册登记机构的开放式基金登记结算系统
注册登记业务规则	指注册登记机构制定的开放式基金注册登记业务规则
直销机构	指大成基金管理有限公司
销售代理人或代销机构	指符合中国证监会和/或其他相关监管机构有关规定并与基金管理人签订销售服务代理协议，代为办理本基金的认购、申购、赎回和其他基金业务的机构，场内代销机构还可以是具有开放式基金代销资格的交易所会员单位
销售机构	指直销机构和代销机构
会员单位	指由中国证监会核准的具有开放式基金代销资格，经相关交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的相关交易所会员单位
场内交易系统	指上海证券交易所和/或深圳证券交易所用于开放式基金认购、申购、赎回等业务的交易系统
场外	指销售机构不通过交易所场内交易系统而通过自身的柜台或其他交易系统进行基金份额认购、申购和赎回等业务的场所
场内	指交易所会员单位作为代销机构通过交易所场内交易系统进行基金份额认购、申购和赎回等业务的场所
销售场所	指场外销售场所和场内销售场所，分别简称场外和场内
基金合同生效日	指募集期结束后本基金达到法定的基金备案条件，基金管理人依据有关法律法规向中国证监会办理基金备案手续后，中国证监会书面确认之日
基金合同终止日	指基金合同规定的合同终止事由出现后，按照基金合同规定的程序终止基金合同的日期
基金存续期	指基金合同生效日至基金合同终止日的不定期期限
募集期	指自基金份额发售之日起不超过 3 个月
认购	指在本基金募集期内，投资者申请购买本基金基金份额的行为
申购	指在基金合同生效后，投资者申请购买本基金基金份额的行为
赎回	指在基金合同生效后，基金份额持有人按规定的条件和程序，向基金管理人申请卖出本基金基金份额的行为
基金转换	指基金份额持有人按照基金合同或届时有效的业务规则将其持有的任一开放式基金的部分或全部基金份额转换为同一基金管理人管理的其他开放式基金基金份额的行为
转托管	指基金份额持有人按照基金合同或届时有效的业务规则将其持有的部分

	或全部本基金份额在场内不同会员单位（营业部）之间进行转托管（转指定）、在场外不同销售机构之间进行转托管以及在场内和场外之间进行跨市场转托管的行为
定期定额投资计划	指投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式
基金账户	指注册登记机构为基金投资者开立的记录其持有的由该注册登记机构办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户
交易账户	指销售机构为基金投资者开立的记录其持有的由该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务的基金份额余额及其变动情况的账户
工作日	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日
开放日	指为投资者办理基金申购、赎回等基金业务的工作日
日/月	指公历日/月
T 日	指销售机构在规定时间受理申购、赎回、基金转换或其他基金交易的申请日
T+n 日	指自 T 日起后的第 n 个工作日（不包括 T 日）
元	指人民币元
基金收益	指基金投资所得股票红利、股息、债券利息、票据投资收益、买卖证券价差、银行存款利息以及其他合法收益
基金财产总值或基金资产总值	指基金所拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收的申购款及其他资产的价值总和
基金财产净值或基金资产净值	指基金财产总值扣除负债后的净资产值
基金资产估值或基金财产估值	指计算评估基金财产和负债的价值，以确定基金财产净值的过程
基金份额净值或基金单位净值	指计算日基金财产净值除以计算日发行在外的基金份额总数所得到的基金份额净值
前端收费模式或 A 类收费模式（适用于 A 类基金份额）	指 A 类基金份额的收费模式。即在认（申）购本基金时直接交纳认（申）购费，再以扣除认（申）购费后的净额作为认（申）购金额的收费模式。投资者在本基金中，每笔认（申）购只能选择 A 类基金份额或者 B 类基金份额收费模式的任一种
后端收费模式或 B 类收费模式（适用于 B	指 B 类基金份额的收费模式。即在认（申）购时不交纳认（申）购费，以

类基金份额)	认(申)购总额直接作为认(申)购金额,但赎回时交纳认(申)购费的收费模式 投资者在本基金中,每笔认(申)购只能选择 A 类基金份额或者 B 类基金份额收费模式的任一种
A 类份额、A 类基金份额或 A 类基金单位	指选择本基金前端收费模式对应的基金份额
B 类份额、B 类基金份额或 B 类基金单位	指选择本基金后端收费模式对应的基金份额
更新的招募说明书或公开说明书	指基金合同生效后每 6 个月结束之日起 45 日内公告的有关基金概要、基金投资组合、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等的对招募说明书进行更新的说明书
指定媒体	指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体
不可抗力	指本合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在基金合同由基金托管人、基金管理人签署之后发生的,使基金合同当事人无法全部履行或无法部分履行基金合同的任何事件,包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易等

### 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是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 4 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(持股比例48%)、中国银河投资管理有限公司(持股比例25%)、光大证券股份有限公司(持股比例25%)、广东证券股份有



限公司（持股比例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，下设十五个部门，分别是股票投资部、固定收益部、委托投资部、研究部、交易管理部、金融工程部、客户服务部、市场部、总经理办公室、人力资源部、综合财务部、基金运营部、监察稽核部和国际业务部；此外，还设立了投资决策委员会、投资风险控制委员会和战略规划委员会。

公司以“稳健、高效”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，以稳健灵活的投资策略和注重绩优、高成长的投资组合，力求为投资者获得更大投资回报。公司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。

## （二）证券投资基金管理情况

截至 2009 年 4 月 6 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、大成创新成长股票型证券投资基金、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和大成策略回报股票型证券投资基金等。

## （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、中组部金融巡视组局长；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

杨丹先生，基金经理，理学硕士，8 年证券从业经验。2001 年加入大成基金管理有限公司，先后任职于基金经理部、研究部、金融工程部，长期从事指数化投资及金融工程研究工作。2006 年 5 月起担任大成沪深 300 指数证券投资基金基金经理，2008 年 8 月 23 日起兼任景福证券投资基金基金经理。

### (2) 历任基金经理

历任基金经理姓名	管理本基金时间
施永辉	2006 年 4 月 6 日—2006 年 5 月 26 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，股票投资部总监，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，固定收益部总监，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；曹雄飞，研究总监，大成精选增值混合型证券投资基金基金经理，投资决策委员会委员；邓韶勇，交易管理部总监，投资决策委员会委员；姚璐，研究部副总监，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，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。

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》、《运作管理办法》，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止以下《基金法》、《运作管理办法》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) 除按本公司制度、法律法规进行基金等投资外，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) 故意损害基金投资者及其他同业机构、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》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《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，维护内部控制制度的有效执行。

(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，公司基金资产、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，保护投资者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，公司资产与基金资产、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，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，确保不同投资者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。

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创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核性，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度。

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，确保基金资产的安全。

(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) 本公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确。
- (2) 本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) 基金托管人情况

#### 1. 基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市海淀区西三环北路 100 号金玉大厦

法定代表人：项俊波

成立时间：2009 年 1 月 15 日

注册资本：2600 亿元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-68424199

联系人：李芳菲

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。2009 年 1 月 15 日,中国农业银行股份有限公司正式成立,承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡,成为国内网点最多、业务辐射范围最广,服务领域最广,服务对象最多,业务功能齐全的大型国有商业银行之一。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行,中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念,坚持审慎稳健经营、可持续发展,立足县域和城市两大市场,实施差异化竞争策略,着力打造“伴你成长”服务品牌,依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品,致力为广大客户提供优质的金融服务,与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行,经验丰富,服务优质,业绩突出,2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计,并获得无保留意见的 SAS70 审计报告,表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全

有效性的全面认可。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2004 年 9 月更名为托管业务部，内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司。股份公司于 2009 年 1 月 15 日依法成立。股份公司自成立之日起，将完整承继中国农业银行的资产、负债和所有业务，并将继续从事原经营范围和业务许可文件上批准/核准的业务。中国农业银行已有的营业机构、商标、互联网域名和咨询服务电话等保持不变，由股份公司继续使用，各项业务照常进行。客户毋需因改制而办理任何变更手续。

## 2. 主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工 93 名，其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家 10 余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

## 3. 基金托管业务经营情况

截止 2008 年 12 月 31 日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 63 只，包括基金裕阳、基金裕隆、基金汉盛、基金景福、基金天华、基金鸿阳、基金丰和、基金久嘉、富国动态平衡开放式基金、长盛成长价值开放式基金、宝盈鸿利收益开放式基金、大成价值增长开放式基金、大成债券开放式基金、银河稳健开放式基金、银河收益开放式基金、长盛债券开放式基金、长信利息收益开放式基金、长盛动态精选开放式基金、景顺长城内需增长开放式基金、万家增强收益债券型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式基金、富国天瑞强势开放式基金、鹏华货币市场基金、国联分红增利开放式基金、国泰货币市场基金、新世纪优选分红证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达荷银货币市场基金、交银施罗德货币市场基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金（LOF）、信诚四季红混合型证券投资基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金、富国天时货币市场基金、益民货币市场基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心精选股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票型证券投资基金、景顺长城内需增

长贰号股票型证券投资基金、长盛中证 100 指数证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、泰达荷银首选企业股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金、国泰金牛创新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、益民创新优势混合型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、华夏复兴基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、新世纪优选成长股票型证券投资基金、金元比联成长动力灵活配置混合型证券投资基金、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金。

## （二）基金托管人的内部控制制度

### 1. 内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

### 2. 内部控制组织结构

风险与内控管理委员会直接负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。托管业务部专门设置了风险管理处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

### 3. 内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理实行严格的复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

## （三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作管理办法》、基金合同、托管协议

规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统，每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作，并通过基金资金账户，基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时，基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处

- 理：
1. 电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题，电话提示基金管理人；
  2. 书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题，以书面方式对基金管理人进行提示；
  3. 书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

## 五、相关服务机构

### （一）销售机构及联系人

#### 1. 直销机构：

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：0755-83199588

联系人：杨春明

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

大成基金客户服务热线：021-53599588，400-888-5558（免长途固话费）

大成基金管理有限公司现分别在深圳、北京、上海设有投资理财中心：

#### （1）大成基金深圳投资理财中心

地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层

联系人：梁靖、瞿宗怡

电话：0755-83195090，83195236

传真：0755-83195091



(2) 大成基金北京投资理财中心

地址：北京市朝阳区朝阳门外大街16号中国人寿大厦1201室

联系人：廖红军、李宁

电话：010-85252345/46

传真：010-85252273/2274/2275

(3) 大成基金上海投资理财中心

地址：上海市广东路689号海通证券大厦19层

联系人：徐舫、朱君

电话：021-63513925/26

传真：021-63513928

## 2. 场外代销机构

(1) 中国农业银行股份有限公司

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：010-66594946

电话：010-66594977

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

(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

（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

（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

（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

（7）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

（8）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

（9）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

（10）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)

(11) 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)

(12) 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)

(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](http://www.gdb.com.cn)

(14) 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)

(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](http://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](http://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](http://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：4008881111、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 239 号 2 楼

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

注册地址：上海市淮海中路 98 号

法定代表人：王开国

客服电话：95553、400-888-8001

联系人：金芸

电话：021-23219000

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](http://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](http://www.axzq.com.cn)

(27) 光大证券股份有限公司

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：徐浩明

客服电话：4008888788;10108998

联系人：刘晨、李芳芳

电话：021-22169081

传真：021-22169134

网址：[www.ebscn.com](http://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](http://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

(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

(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

（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

（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

（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](http://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](http://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](http://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

（45）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

（46）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

(47) 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

(48) 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

联系人：覃清芳

电话：0771-5539262

传真：0771-5539033

网址：www.ghzq.com.cn

(49) 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

(50) 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](http://www.ubssecurities.com)

(51) 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：韩梅

电话：010-62294608-6957

传真：010-62296854

客户服务电话：010-62294600

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

(52) 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

长城证券网站：[www.cc168.com.cn](http://www.cc168.com.cn)

(53) 国都证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区中心区金田路 4028 号荣超经贸中心 26 层 11、12

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

法定代表人：王少华

联系人：黄静

客户服务电话：800-810-8809

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

(54) 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

（55）世纪证券有限责任公司

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 楼

法定代表人：段强

客服电话：0755-83199511

联系人：刘军辉

电话：0755-83199511

传真：0755-83199545

网址：www.csc.com.cn

电子邮箱：liujh@csc.com.cn;

（56）中银国际证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39F

法定代表人：平岳

联系人：张静

电话：021-68604866-8309

网址：www.bocichina.com.cn

（57）齐鲁证券有限公司

办公地址：山东省济南市经十路 128 号

法定代表人：李玮

联系人：傅咏梅

电话：0531-82024184、0531-82024147

传真：0531-82024197

网址：www.qlzq.com.cn

### 3. 场内代销机构

场内代销机构是指具有开放式基金代销资格，经上海证券交易所和本基金管理



人认可的，可通过上海证券交易所场内“上证基金通”办理开放式基金的申购与赎回业务的会员单位，详见上海证券交易所网站（[www.sse.com.cn](http://www.sse.com.cn)）。

本基金管理人可以根据相关法律法规要求，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

注册地址：北京市西城区金融大街27号投资广场23层

办公地址：北京市西城区金融大街27号投资广场23层

法定代表人：陈耀先

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

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

公司名称：安永华明会计师事务所

注册地址：北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层

办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层

法定代表人：葛明

经办注册会计师：张小东，樊淑华

电话：010-58153000

传真：010-85188298

联系人：涂珮施

## 六、基金合同的生效

### （一）基金合同的生效

根据相关法规和《大成沪深 300 指数证券投资基金基金合同》的有关规定，基金合同已于 2006 年 4 月 6 日正式生效，自基金合同生效之日起，本基金管理人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

本基金基金合同生效后，连续20个工作日基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会，说明出现上述情况的原因及解决方案；法律法规另有规定的，按其规定办理。

### （三）基金类别及存续期限

基金类别：股票型指数基金

基金运作方式：契约型开放式

基金存续期限：不定期

## 七、基金的申购与赎回

### （一）申购与赎回办理的场

基金合同生效后，投资者可通过场外和场内两种方式办理本基金的申购与赎回等基金销售业务。

#### 1. 场外申购与赎回的方式及场所

采用场外方式时，投资者可以通过基金管理人的直销网点、代销机构的代销网点及其他合法方式办理本基金的申购与赎回业务。

#### 2. 场内申购与赎回的方式及场所

采用场内方式时，投资者可以通过具有开放式基金代销资格的交易所会员单位的场内开放式基金销售系统办理本基金的申购与赎回等业务。

3. 投资者应当按照销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的合法方式办理本基金的申购与赎回等业务。

本基金管理人可以根据实际情况增减基金销售机构、销售网点或销售交易平台，并予以公告。

### （二）申购与赎回办理的时间

### 1. 申购、赎回的开放日及开放时间

本基金为投资者办理申购与赎回等基金业务的时间即开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所等的交易日。各销售机构的具体办理时间详见招募说明书、最新的更新的招募说明书或销售机构发布的其他公告。

若出现新的证券交易市场或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日进行相应的调整，报中国证监会备案，并由基金管理人最迟于实施前 2 日内在至少一种中国证监会指定媒体上公告。

### 2. 申购的开始时间

本基金已于 2006 年 4 月 24 日正式开始办理基金场外申购业务，已于 2006 年 4 月 26 日正式开始办理基金场内申购业务。具体业务办理时间在申购开始公告中列明。

### 3. 赎回的开始时间

本基金已于 2006 年 4 月 24 日正式开始办理基金场外赎回业务，已于 2006 年 4 月 26 日正式开始办理基金场内赎回业务。具体业务办理时间在赎回开始公告中列明。

## （三）申购与赎回的原则

1. “未知价”原则，即基金的申购与赎回价格以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. “金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3. 当日的申购与赎回申请可以在当日交易结束时间前按照基金管理人规定的条件撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销；

4. 基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回。投资者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、赎回价格为下一办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格；

5. 基金管理人可以根据基金运作的实际情况，在不损害基金份额持有人实质利益的情况下调整上述原则，但最迟应在新的原则实施前 2 日内在至少一种中国证监会指定媒体上予以公告。

## （四）申购与赎回的数额限制

### 1. 申购金额的限制

（1）基金投资者场外申购本基金的最低申购金额为 1000 元。

（2）基金投资者场内申购本基金的最低申购金额为 1000 元，同时每笔申购金额必须是 100 的整数倍，并且每笔申购最大不超过 99,999,900 元。

## 2. 赎回份额的限制

投资者场内赎回时，可申请将其持有的部分或全部基金份额赎回，并且每笔赎回最大不超过 99,999,999 份基金份额。

3. 本基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下，可根据市场情况调整申购与赎回的有关数额限制，报中国证监会备案，调整结果于 2 日内在至少一种中国证监会指定的报刊上公告。

## （五）申购与赎回的程序

### 1. 申购与赎回申请的提出

基金投资者须按销售机构规定的手续，在开放日的业务办理时间提出申购或赎回等业务的申请。

投资者申购本基金，须按销售机构规定的方式全额交付申购款项，投资者提交赎回申请时，其在销售机构（网点）必须有足够的基金份额余额。

### 2. 申购与赎回申请的确认

投资者 T 日提交的申购、赎回申请，注册登记机构在 T+1 日对该交易申请的有效性进行确认，在 T+2 日后（包括该日）投资者可向销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申购与赎回的成交情况。

### 3. 申购与赎回申请的款项支付

申购采用全额交款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功；申购不成功或无效，款项将退回投资者账户。

投资者 T 日赎回申请成交后，基金管理人按规定向投资者支付赎回款项，赎回款项最迟于 T+7 日内从基金托管账户划出，经销售机构划往投资者银行账户。在发生巨额赎回或延期支付时，款项的支付办法按基金合同有关规定处理。

4. 投资者申购、赎回的详细程序或手续，以到时开放申购和（或）赎回的相关公告为准。

## （六）申购费用、赎回费用

### 1. 申购费用

投资者申购本基金时只能从 A 类和 B 类两种收费模式中选择一个。投资者申购本基金采用全额缴款的申购方式。关于基金收费模式的分类与基金份额的分类，请参见本招募说明书“基金费用与税收”章节。

若选择 A 类收费方式（前端收费模式），则申购费率最高不超过 1.2%。申购费

用系投资者申购基金时直接交纳的销售费用，用于基金的市场推广、销售、注册登记、客户服务等各项费用，不列入基金财产。

若选择 B 类收费方式（后端收费模式），在申购时无须交纳申购费用，投资者以其全部申购金额申购本基金，但需在赎回时交纳申购费用。

## 2. 赎回费用

投资者赎回本基金须缴纳赎回费；本基金赎回费率最高不超过 0.5%。具体收费模式参见本基金招募说明书“基金费用与税收”章节。

3. 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。

## （七）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）A 类基金份额（前端收费模式）

净申购金额=申购金额 / (1+申购费率)

申购费用=申购金额 - 净申购金额

申购份额=净申购金额 / T 日基金份额净值

#### （2）B 类基金份额（后端收费模式）

申购份额=申购金额 / 申购日基金份额净值

（3）说明：投资者以同样的金额申购本基金时，选择 B 类收费模式得到的申购份额将比选择 A 类收费模式多，但需在赎回时交纳申购费。

### 2. 基金净赎回金额的计算：

#### （1）A 类基金份额（采用前端收费模式）

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

#### （2）B 类基金份额（采用后端收费模式）

如果投资者在认购时选择 B 类基金份额，则净赎回金额的计算方法如下：

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

后端认购费用=赎回份数×基金份额面值×后端认购费率

净赎回金额=赎回金额－赎回费用－后端认购费用

其中，基金份额面值为 1.00 元。

如果投资者在申购时选择 B 类基金份额，则净赎回金额的计算方法如下：

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

后端申购费用 = 赎回份数 × 申购日基金份额净值 × 后端申购费率

净赎回金额 = 赎回金额 - 赎回费用 - 后端申购费用

### 3. 基金份额净值的计算：

申请日（T 日）的基金份额净值在当天交易所收市后计算，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。

### 4. 申购份额、余额的处理方式：

场外申购时，申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用（若有）后，以申请当日的基金份额净值为基准计算，四舍五入法保留两位小数，由此引起的差额计入基金财产。

场内申购时，申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用（若有）后，以申请当日的基金份额净值为基准计算，保留到整数位，剩余部分折回金额返回投资者。

上述原则对 A 类基金份额和 B 类基金份额均适用。

### 5. 赎回金额的处理方式：

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额以当日基金份额净值为基准计算，并扣除相应的费用，计算结果四舍五入法保留两位小数，由此引起的差额计入基金财产。

## （八）申购与赎回的注册登记

投资者申购基金成功后，注册登记机构在 T+1 日为投资者办理增加权益的登记手续，投资者自 T+2 日起有权赎回该部分基金。

投资者赎回基金成功后，注册登记机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益的登记手续。

基金管理人或注册登记机构等可以在法律法规允许的范围内，对上述注册登记业务规则进行调整，并最迟于开始实施前 2 日内在至少一种中国证监会指定媒体上公告。

## （九）基金转换

### 1. 定义

基金转换是指基金份额持有人按照基金合同或基金管理人届时有效的业务规则将其持有的任一开放式基金的部分或全部基金份额转换为同一基金管理人管理的其他开放式基金的基金份额的行为。

## 2. 适用范围

(1) 基金转换业务限于本基金管理人管理的开放式基金。

(2) 基金转换业务适用于持有本基金管理人管理的开放式基金的所有基金份额持有人，包括个人投资者、机构投资者及合格境外机构投资者等。

## 3. 办理时间及场所

(1) 基金合同生效后，在确定基金转换开始时间后，基金管理人最迟于开放转换日前2日内在至少一种中国证监会指定媒体上公告。

(2) 投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金转换。

## 4. 业务规则

基金转换的业务规则及费率详见本基金开放基金转换业务公告或其他刊登在指定媒体上的公告。

### (十) 巨额赎回的认定及处理方式

#### 1. 巨额赎回的认定

单个开放日基金的净赎回申请份额（赎回申请总数与基金转换申请转出份额总数之和扣除申购申请总数及基金转换申请转入份额总数的余额）超过上一日基金总份额的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) 全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资者的全部赎回申请时，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者的赎回申请有困难，或认为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金财产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，对其余赎回申请予以延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个基金份额持有人申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该单个基金份额持有人当日办理的赎回份额；当日赎回

申请中未被受理部分，除投资者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，自动延迟至下一开放日办理。依照上述规定转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权，并将按该下一个开放日赎回申请总量确定赎回份额及以下一个开放日的基金份额净值为准计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

开放式基金发生巨额赎回并延期办理的，基金管理人应当在3个交易日内通过采用邮寄、传真、网站或者在至少一种中国证监会指定媒体上予以公告的方式通知基金份额持有人，说明有关处理方法。

本基金连续两个开放日以上（含两个开放日）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，但延期期限不得超过20个工作日，并应当在至少一种中国证监会指定媒体上予以公告。

#### （十一）拒绝或暂停申购、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形及处理

1. 在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受基金投资者的申购申请：

（1）不可抗力的原因导致基金无法正常运作；

（2）证券交易所在交易时间临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金财产净值；

（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）法律、法规规定、中国证监会认定或交易所等相关机构认为必要的其他可暂停申购情形；

（5）基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购。

如果投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退划给投资者。

发生上述（1）到（4）项暂停申购情形时，基金管理人应当在至少一种中国证监会指定媒体上刊登暂停申购公告。

2. 基金管理人拒绝或暂停接受申购的方式：

（1）根据有关法律、法规、中国证监会的规定、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；

（4）本基金拒绝或暂停接受申购时，与本基金相关的基金转换也暂停；若恢复



接受申购，除非另有公告或约定，相应的基金转换也恢复。

3. 在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项：

(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，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赎回申请或转出申请；

(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，可支付部分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，未支付的部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以兑付。

同时在出现上述第(3)款的情形时，对已接受的赎回申请可延期支付赎回款项，最长不超过正常支付时间20个工作日，并在中国证监会指定的一种媒体上予以公告。投资者在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。

在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理。

#### 4. 基金暂停或重新开放基金申购、赎回的公告

某日或某段时间内，基金暂停全部所有的申购、赎回申请或者按比例暂停全部所有的申购、赎回申请，基金管理人应及时在至少一种中国证监会指定媒体上予以公告。暂停期间结束、基金重新开放时，基金管理人应当及时公告最新的基金份额净值，并恢复业务的办理。

如果发生暂停的时间为一日，基金管理人应于重新开放日在至少一种中国证监会指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公告最近一个工作日的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过一日但少于两周，暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前2日内在至少一种中国证监会指定媒体上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近一个工作日的基金份额净值。

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，基金管理人最迟应提前2日内在

至少一种中国证监会指定媒体上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近一个工作日的基金份额净值。

### （十二）定期定额投资计划

定期定额投资计划是指投资者通过基金管理人指定的销售机构申请，约定每期扣款时间、扣款金额和扣款方式，由指定的销售机构于每期约定扣款日在投资者指定银行账户内自动完成扣款和基金申购申请的一种长期投资方式。

本基金管理人现已开通部分代销网点为投资者提供定期定额投资服务。具体业务规则，详见基金管理人公告及代销机构的规定。

### （十三）基金份额的转托管

本基金份额持有人可将其持有的部分或全部基金份额在场内不同会员单位（营业部）之间进行转托管（转指定）、在场外不同销售机构之间进行转托管以及在场内系统和场外系统之间进行跨市场转托管。

在本基金开放申购、赎回后，投资者可以申请办理上述业务；但存在质押、冻结基金份额或其他特殊情形，可能影响份额持有人权益时，其申请不予受理。

本基金转托管的具体业务按照注册登记机构或基金管理人等相关机构的相关规定办理。

### （十四）基金份额的非交易过户

1. 非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资者基金账户转移到另一投资者基金账户的行为，本基金非交易过户的具体业务按照注册登记机构的相关规定办理。

#### 2. 其他特殊交易业务

在相关法律法规允许的条件下，基金管理人可以办理除上述业务以外的其他特殊交易业务。

## 八、基金投资

### （一）投资目标

通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，实现指数投资偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。

### （二）投资理念

本基金以拟合、跟踪沪深 300 指数为原则，进行被动式指数化长期投资，力求获得该指数所代表的中国证券市场的平均收益率，为投资者提供一个投资沪深 300 指数的有效投资工具，以使投资者可以分享中国经济中长期增长的稳定收益。

### （三）投资范围

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括沪深 300 指数成份股、备选成份股、新股（如一级市场初次发行或增发）等，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金财产净值的 5%。本基金还可以投资于法律法规及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。待金融衍生产品推出后，本基金可以依照法律法规或监管机构的规定运用金融衍生产品进行风险管理。

本基金跟踪标的指数的投资组合资产原则上不低于基金财产净值的 90%。除非法律法规另有规定，本基金的股票投资比例可以提高到基金财产净值的 100%。

### （四）标的指数

本基金的标的指数是沪深 300 指数。

如果沪深 300 指数被停止编制及发布，或沪深 300 指数由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致沪深 300 指数不宜继续作为标的指数，本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则变更本基金的标的指数；并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数。

本基金由于上述原因变更标的指数，需经基金份额持有人大会决议通过，在报中国证监会核准后，应于正式实施变更前 2 日内在至少一种中国证监会指定的媒体上予以公告。

### （五）投资策略

本基金采用被动式指数投资策略。原则上，股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合、复制标的指数，并原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况（如股权分置改革等）导致流动性不足时，或因其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并辅之以金融衍生产品投资管理等，最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。

## 1. 决策依据

- (1) 有关法律、法规、基金合同和标的指数等的相关规定；
- (2) 经济运行态势和证券市场走势。

## 2. 投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理团队制。投资决策委员会负责制定基金投资方面的整体投资计划与投资原则；决定有关指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策；基金经理根据投资决策委员会的决策，负责投资组合的构建、调整和日常管理等工作。

## 3. 投资程序

(1) 金融工程部运用风险监测模型以及各种风险监控指标，结合公司内外研究报告,对市场预期风险和指数化投资组合风险进行风险测算与归因分析，依此提出研究分析报告。

(2) 投资决策委员会依据金融工程部等部门提供的研究报告，定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议，决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议，进行基金投资管理的日常决策。

(3) 根据标的指数，结合研究报告，基金经理原则上依据指数成份股的权重构建组合。在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下,基金经理将采取适当的方法,以降低交易成本、控制投资风险。

(4) 交易管理部根据基金经理下达的交易指令制定交易策略，完成具体证券品种的交易。

(5) 金融工程部等部门根据市场变化定期和不定期对基金进行投资绩效评估,并提供相关绩效评估报告。监察稽核部对投资计划的执行进行日常监督和实时风险控制。

(6) 基金经理跟踪标的指数变动,结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况、金融工程部和监察稽核部的绩效评估报告和对各种风险的监控和评估结果，对投资组合进行监控和调整,密切跟踪标的指数。

(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程序，并予以公告。

## 4. 金融衍生产品投资管理

本基金若投资金融衍生产品，则其目的主要包括：对冲某些成份股的特殊突发风

险和某些特殊情况下的流动性风险，以及适当利用金融衍生产品组合的持有收益覆盖一定的基金固定费用，最终使得基金收益率尽可能地贴近所跟踪标的指数的收益率。

本基金投资金融衍生产品的投资策略主要包括：主要采用市场公认的多种期权定价模型对权证进行定价，作为权证投资的价值基准；根据权证对应公司基本面的研究估值，结合权证理论价值进行权证的趋势投资；利用权证衍生工具的特性，基金通过权证与证券的组合投资，来达到改善组合风险收益特征的目的，包括但不限于杠杆交易策略、看跌保护组合策略、保护组合成本策略、获利保护策略、买入跨式投资策略。

## （六）投资组合管理

### 1. 投资组合的建立

基金管理人主要按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

本基金跟踪标的指数的投资组合资产原则上不低于基金财产净值的 90%。除非法律法规另有规定，本基金的股票投资比例可以提高到基金财产净值的 100%。

如因标的指数成份股调整、股票停牌限制、股票流动性不足、基金申购或赎回等各种基金管理人之外的因素，致使基金无法依指数权重购买某成份股、投资不符合前述规定比例时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整。

本基金依照法律法规的规定及基金合同的约定进行指数化投资。本基金对指数的拟合与复制，在投资股票数量上可能与指数成份股数量有较小偏离，但应保证投资组合收益率与指数高度相关，并寻求跟踪误差和偏离度的最小化。

### 2. 投资组合的管理

基金管理人通过定期分析成份股公司行为信息、标的指数变化、申购赎回情况等因素，利用数量化分析模型，制定并将投资组合调整到目标组合的最优方案，最大限度地降低跟踪误差，以实现基金的投资目标。

### 3. 投资组合调整

本基金为指数型基金，基金所构建的指数化投资组合原则上将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发因素等变化，对基金投资组合进行实时调整，以保证基金净值增长率与基准指数收益率之间的高度正相关和跟踪误差最小化。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本

合同的约定。

### （1）定期调整

本基金所构建的指数化投资组合将根据所跟踪的标的指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。

### （2）不定期调整

#### ① 与指数相关的调整

根据指数编制规则，当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重新调整时，本基金将根据标的指数在股权变动公告日次日发布的临时调整决定及其需调整的权重比例，进行相应调整。

#### ② 限制性调整

根据法律法规中针对基金投资比例的相关规定，当基金投资组合中按标的指数权重投资的股票资产比例或个股比例超过规定限制时，本基金将对其进行实时的被动性卖出调整，并相应地对其他资产类别或个股进行微调，以保证基金合法规范运行。

#### ③ 根据申购和赎回情况调整

本基金将根据申购和赎回情况对股票投资组合进行调整，以保证基金正常运行，从而有效跟踪标的指数；

#### ④ 其他调整

针对我国证券市场新股发行制度的特点，本基金将参与一级市场新股认购，由此得到的非成份股将在其规定持有期之后的一定时间以内卖出。

对个别成份股，若其存在严重的流动性困难、或者财务风险较大、或者面临重大的不利的司法诉讼、或者有充分而合理的理由认为其被市场操纵等情形时，本基金可以不投资该成份股，而用备选股、甚至现金来代替，也可以选择与其行业相近、定价特征类似或者收益率相关性较高的其他股票来代替，即采用“用其他股票或金融衍生产品等来进行暂时替代”的方法加以应对，并按照如下程序构造替代组合：

A、选择跟踪标的指数中与被替代股票处于同一细分行业内的股票作为备选库；

B、根据被替代股票需要的替代时间长度来确定备选库中股票交易数据考察区间的长度；

C、利用选定考察区间的备选股票的交易数据，采用一定的“冲击成本模型”计算每个备选股票的冲击成本参数；

D、用考查期内备选股票为基础组合，以组合在考察期内与被替代股票的日收益

率序列的相关系数最大化为优化目标，同时考虑到组合交易过程的交易成本、冲击成本的影响，利用 Matlab 的优化函数进行优化，优化结果为组合中各股票的权重。

这样得出的优化组合能较好的代表被替代股票的收益率波动情况的组合。

#### 4. 投资绩效评估

在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

#### （七）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数。

如果沪深 300 指数被停止编制及发布，或沪深 300 指数由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致沪深 300 指数不宜继续作为业绩比较基准，本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则，变更本基金的业绩比较基准。

本基金由于上述原因变更业绩比较基准，基金管理人需报中国证监会核准后，应于正式实施变更前 2 日内在至少一种中国证监会指定的媒体上予以公告。

#### （八）风险收益特征

本基金为指数基金，是风险中等、获得证券市场平均收益率的产品。

#### （九）投资限制

基金财产不得用于下列投资或者活动：

1. 承销证券；
2. 向他人贷款或者提供担保；
3. 从事承担无限责任的投资；
4. 买卖其他基金份额，但是法律法规或监管机关另有规定的除外；
5. 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
6. 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
7. 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
8. 依照法律、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使前述 1 至 8 项规定被修改或取消，则本基金可相应地对该项规定进行修改或取消，该项规定之修改或取消，无须召开基金份额持有人大会，但应报证券监管机关批准或备案。

对于因上述 5—6 项情形导致无法投资的沪深 300 指数成份股，基金管理人将在严格控制跟踪误差的前提下，将结合使用其他合理方法进行适当替代。

#### (十) 基金管理人代表基金行使所投资证券项下权利的原则及方法

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。基金管理人在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（截至2009年3月31日）

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据基金合同规定，于 2009 年 4 月 23 日复核了本报告中的财务指标、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2009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	4,816,442,144.34	93.61
	其中：股票	4,816,442,144.34	93.61
2	固定收益投资	-	0.00
	其中：债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
3	金融衍生品投资	-	0.00
4	买入返售金融资产	-	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
5	银行存款和结算备付金合计	294,794,332.20	5.73
6	其他资产	34,078,464.24	0.66
7	合计	5,145,314,940.78	100.00

##### 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合



## (1) 指数投资部分

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	25,396,305.45	0.50
B	采掘业	506,849,545.81	9.94
C	制造业	1,306,000,713.45	25.62
C0	食品、饮料	188,391,711.45	3.70
C1	纺织、服装、皮毛	28,691,378.69	0.56
C2	木材、家具	2,505,708.18	0.05
C3	造纸、印刷	16,584,419.80	0.33
C4	石油、化学、塑胶、塑料	136,114,937.05	2.67
C5	电子	22,729,522.91	0.45
C6	金属、非金属	441,918,924.32	8.67
C7	机械、设备、仪表	353,292,215.73	6.93
C8	医药、生物制品	93,342,935.96	1.83
C99	其他制造业	22,428,959.36	0.44
D	电力、煤气及水的生产和供应业	216,130,867.72	4.24
E	建筑业	122,513,937.35	2.40
F	交通运输、仓储业	299,348,706.17	5.87
G	信息技术业	156,185,429.14	3.06
H	批发和零售贸易	150,303,829.17	2.95
I	金融、保险业	1,508,576,869.91	29.60
J	房地产业	305,230,170.31	5.99
K	社会服务业	74,815,756.71	1.47
L	传播与文化产业	14,511,616.47	0.28
M	综合类	130,578,396.68	2.56
	合计	4,816,442,144.34	94.50

## (2) 积极投资部分

本基金期末未持有积极投资部分股票。

## 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五名股票明细

## (1) 指数投资部分

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	600036	招商银行	11,633,823	185,326,800.39	3.64
2	600030	中信证券	6,405,314	163,143,347.58	3.20
3	601318	中国平安	3,938,491	154,034,383.01	3.02
4	601328	交通银行	21,466,701	138,030,887.43	2.71
5	600016	民生银行	25,971,659	131,936,027.72	2.59

## (2) 积极投资部分

本基金期末未持有积极投资部分股票。

#### 4. 报告期末按券种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 6. 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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. 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。

#### 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、处罚的情形。

(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	名称	金额（元）
1	存出保证金	750,000.00
2	应收证券清算款	24,756,410.01
3	应收股利	-
4	应收利息	52,548.29
5	应收申购款	8,519,505.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	34,078,464.24

#### (4) 报告期末基金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) 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### (6) 由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## 九、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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

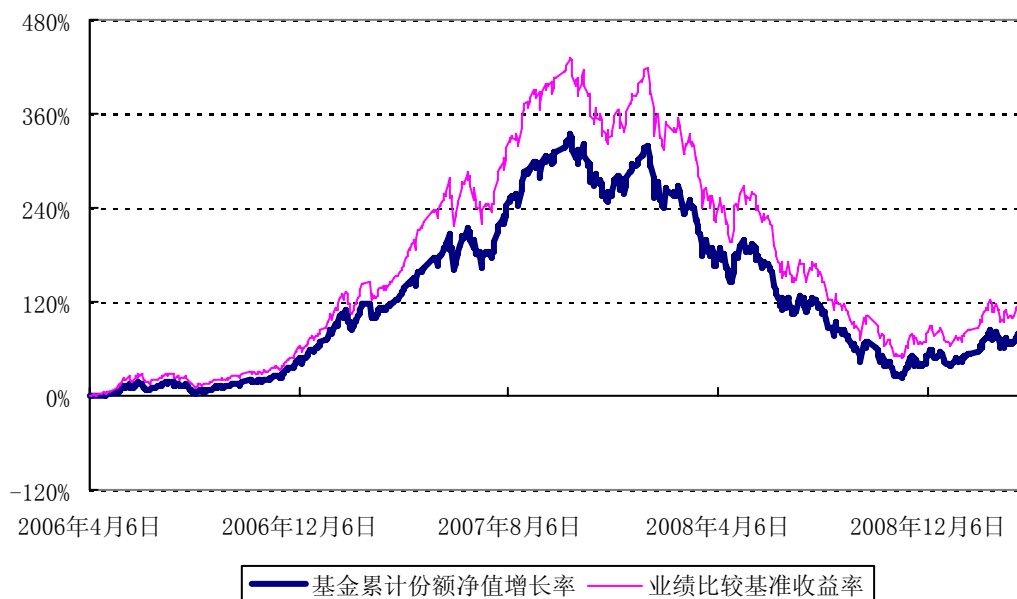
(一) 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较：

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
2006.04.06-2006.12.31	68.66%	1.41%	85.01%	1.52%	-16.35%	-0.11%
2007.01.01-2007.12.31	133.11%	2.18%	161.57%	2.30%	-28.46%	-0.12%
2008.01.01-2008.12.31	-64.77%	2.90%	-65.95%	3.05%	1.18%	-0.15%
过去三个月	35.42%	2.23%	37.96%	2.33%	-2.54%	-0.10%
自基金合同生效起至今	87.57%	2.33%	127.31%	2.45%	-39.74%	-0.12%

(二) 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

大成沪深 300 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  
(2006 年 4 月 6 日至 2009 年 3 月 31 日)

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



注：按《基金合同》规定，本基金的初始建仓期为6个月。截至报告日，本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二条之（六）投资组合中规定的各项比例。

## 十、基金的融资

本基金可以按照国家有关规定进行融资。

## 十一、基金财产

### （一）基金财产总值

基金财产包括基金所拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收的申购款及其他资产等的价值总和。

### （二）基金财产净值

基金财产净值是指基金财产总值扣除负债后的净资产值。

### （三）基金财产的账户

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、基金托管人、基金代销机构和基金注册登记机构的固有财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### （四）基金财产的保管与处分

1. 本基金财产应独立于基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构的资产，并由基金托管人保管。

2. 基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构以其自有的财产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。

3. 基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运作或者其他情形而取得的财产和收益，归入基金财产。

4. 除依据《基金法》、《运作管理办法》、基金合同及其他有关规定处分外，本基金财产不得被处分。

## 十二、基金财产估值

### （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

本基金的估值日为相关的证券交易场所的正常营业日。

### （三）估值对象

基金依法拥有的各类有价证券，以及应收应付款等项目。

### （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）上市流通股按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

#### （2）未上市股票的估值：

1) 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公允价值的情况下，按成本价估值；

2) 送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所上市的同一股票的市价进行估值；

3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日在证券交易所上市的同一股票的市价进行估值；

4) 非公开发行的且在发行时明确一定期限锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

（3）在任何情况下，基金管理人如采用本项第（1）—（2）小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第（1）—（2）小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(4) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## 2. 债券估值方法：

(1) 在证券交易所市场挂牌交易实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；估值日没有交易，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

(2) 在证券交易所市场挂牌交易未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

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

(4) 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。

(5) 在全国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。

(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；

(7) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)－(6)小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第(1)－(6)小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(8) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## 3. 权证估值办法：

(1) 基金持有的权证，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；估值日没有交易，且最近交易日

后经济环境未发生重大变化的，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。

(2) 首次发行未上市的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(3) 因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

(4) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)－(3)项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为本项第(1)－(3)项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(5) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

4. 其他有价证券等资产按国家有关规定进行估值。

#### (六) 估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金财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送给基金托管人，基金托管人按法律法规、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) 估值错误的处理方法

1. 当基金财产的估值导致基金份额净值小数点后四位内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。

基金管理人、基金托管人和注册登记机构应采取必要、适当、合理的措施确保基金财产估值的准确性和及时性。当发生估值错误时，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。

#### 2. 差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或代理销售机构、或投资者自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该过错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”承担赔偿责任并给予赔偿。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平无法预见、无法避免、无法抗拒，则属于不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资者的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

### 3. 差错处理原则

(1) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已发生的差错，给当事人造成损失的由差错责任方承担；若差错责任方已经积极协调，并且有协调义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

(2) 差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

(3) 因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责，如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求支付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分的不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和基金托管人之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿。

(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、基金合同或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿



由此发生的费用和遭受的损失。

(7) 由于证券交易所或登记结算公司发送的数据错误以及不可抗力因素，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而造成的基金财产估值错误，基金管理人、基金托管人可以免于承担赔偿责任。基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

(8) 按法律法规和监管机构规定的其他原则处理差错。

#### 4. 差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方。

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估。

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失。

(4) 根据差错处理方法，需要修改基金注册登记机构的交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认。

(5) 基金管理人及基金托管人基金资产净值计算错误偏差达到或超过基金资产净值 0.25% 时，基金管理人应当及时通知基金托管人并报中国证监会；错误偏差达到基金资产净值 0.5% 时，基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案。

#### (八) 暂停估值的情形

1. 本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、基金托管人无法准确评估基金财产价值时；
3. 中国证监会认定的其他情形。

#### (九) 特殊情形的处理

由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，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，由此造成的基金财产估值错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

基金管理人或基金托管人按股票估值方法的第(3)项、债券估值方法的第(7)项或权证估值方法的第(4)项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误

处理。

#### （十）基金份额净值的确认

基金份额净值的计算，精确到 0.0001 元，小数点后第五位采用四舍五入方法，法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### 十三、基金收益与分配

#### （一）基金收益的构成

基金收益包括：

1. 基金投资所得红利、股息、债券利息收入、票据投资收益；
2. 买卖证券差价收入；
3. 银行存款利息收入；
4. 其他合法收益。

因运用基金财产带来的成本或费用的节约计入基金收益。

#### （二）基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按照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. 基金收益分配应当采用现金方式。

基金份额持有人可以事先选择将所获分配的现金收益，按照基金合同有关基金份额申购的约定转为基金份额；基金份额持有人事先未做出选择的，基金管理人应当支付现金；本基金默认的分红方式为现金分红。

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. 基金当期出现亏损，则可不进行收益分配。
5. 基金收益分配后每基金份额净值不能低于面值。
6. 在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年不超过 6 次，成立不满 3 个月，收益可不分配。
7. 基金年度收益分配比例不低于基金年度已实现收益的 50%。
8. 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

在不影响投资者实质性利益的情况下，基金管理人可酌情调整以上基金收益分

配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，基金管理人应于实施更改前 2 日内在至少一种中国证监会指定报刊上刊登公告。

#### （四）收益分配方案的确定与公告

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。

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，基金管理人应在实施日前 2 日内在至少一种中国证监会指定媒体上予以公告，并在公开披露日报中国证监会备案。

#### （五）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于本基金时，可免收再投资的申购等费用。

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。

### 十四、基金费用与税收

#### （一）与基金运作有关的费用

##### 1. 与基金运作相关费用列示

- （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）基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费；
- （7）按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

##### 2. 与基金运作相关费用计提方法、计提标准和支付方式

###### （1）基金管理人的管理费

本基金的基金管理费按基金财产净值的 0.75% 年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金财产净值的 0.75% 年费率计提。计算方法如：

$$H = E \times 0.75\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金财产净值

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 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

## （2）基金托管人的基金托管费

本基金的基金托管费按基金财产净值的 0.15% 年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金财产净值的 0.15% 年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金财产净值

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 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

（3）本条第 1 款第 3 至第 8 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。

基金合同生效前的相关费用，包括但不限于律师费、会计师费、验资费、信息披露费用等不得从基金财产中列支，其他具体不得列入基金费用的项目依据相关法律法规执行。

## （二）与基金销售等相关费用

本基金分为 A 类和 B 类两种收费模式，对应 A 类和 B 类两种不同的份额。

A 类收费模式，即前端收费模式，指在本基金中，选择在认（申）购本基金时直接交纳认（申）购费，再以扣除认（申）购费后的净额作为认（申）购金额的收费模式。

B 类收费模式，即后端收费模式，指在本基金中，选择在认（申）购时不交纳认（申）购费，以认（申）购总额直接作为认（申）购金额，但在赎回时交纳认（申）

购费的收费模式。

本基金因不同的收费模式而有两类基金份额：A 类基金份额和 B 类基金份额。A 类基金份额是选择 A 类收费方式（前端收费模式）的基金份额；B 类基金份额是选择 B 类收费方式（后端收费模式）的基金份额。

本基金将来若增加新的收费模式，对应地，可能会增加新的基金份额种类，并可能需计算其新基金份额类别的基金份额净值。

此分类对募集期的认购行为和基金合同生效后的申购行为，均同样适用。

投资者在认（申）购本基金时，每笔认（申）购只能选择 A 类或 B 类之一。

#### 1. 基金申购（基金合同生效后购买本基金）

投资者申购本基金时只能从 A 类和 B 类两种收费模式中选择一个。投资者申购本基金采用全额缴款的申购方式。

##### (1) A 类收费模式：前端收费模式

A 类：前端收费模式	申购金额 M	前端申购费率
	M < 50 万元	1.2%
	50 ≤ M < 200 万元	1.0%
	200 ≤ M < 500 万元	0.5%
	M ≥ 500 万元	每笔 1000 元

前端申购费用的计算方法如下：

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购费用在基金申购时从申购金额中扣除，不列入基金财产。基金申购费用用于市场推广、销售、注册登记、客户服务等各项费用。

##### (2) B 类收费模式：后端收费模式

B 类：后端收费方式	持有期限 T	后端申购费率
	T < 1 年	1.2%
	1 年 ≤ T < 2 年	0.8%
	2 年 ≤ T < 3 年	0.4%
	T ≥ 3 年	0

采用 B 类收费模式，投资者在申购时无须支付申购费用，但是赎回时需交纳申

购费用。后端申购费用的计算方法如下：

后端申购费用 = 赎回份数 × 申购日基金份额净值 × 后端申购费率

## 2. 基金赎回（对 A 类基金份额和 B 类基金份额均适用）

本基金赎回费用由基金赎回人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。

本基金的赎回费率按持有期（T）递减，最高不超过总的赎回金额的 0.5%，持有期超过 2 年赎回费率则为 0。

赎回费率表如下：

赎回费率	持有期 T	适用的赎回费率
	T < 1 年	0.5%
	1 ≤ T < 2 年	0.15%
	T ≥ 2 年	0%

注：1 年按照 365 天计算，2 年按照 730 天计算，其余同。

赎回费用的计算方法如下：

赎回费用 = 赎回金额 × 赎回费率

本基金赎回费在扣除手续费后，余额不得低于赎回费总额的 25%，并应当归入基金财产。

## 3. 基金转换

本基金转换费用详见本基金开放转换业务公告、最新的更新的招募说明书或其他刊登在指定媒体上的公告。

### （三）费率调整

基金管理人和基金托管人可根据实际情况分别调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。调高基金管理费率和基金托管费率，原则上须召开基金份额持有人大会审议，除非法律法规另有规定、或基金合同另有约定、或获得监管机关的豁免等。

基金管理人等可根据市场情况在不违背有关法律法规之规定和基金合同之约定的情况下调整本基金的认购费率、申购费率、赎回费率等。调低前述相关费率，或在不增加整体费率水平的情况下改变收费模式，无须召开基金份额持有人大会。

若将来法律法规或监管机构许可本基金或本类型的基金采取持续性销售服务模式，则本基金可以依法引入持续性销售服务费收费模式；若引入该类收费模式，并没有增加现有投资者的费用负担，则无须召开基金份额持有人大会，法律法规或监管机关另有规定的除外。

基金管理人或其授权或认可的机构，在不违背相关法律法规之规定和基金合同

之约定的情况下，有权仅对场外或者仅对场内的费率结构进行调整。

费率的调整，最迟在调整生效前 2 日内在至少一种中国证监会指定媒体上公告。

#### （四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，应按国家法律、法规履行其纳税义务。

### 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 1 月 1 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. 会计核算制度按照国家有关会计核算制度执行。

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从业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。

6. 基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表。

7. 基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

#### （二）基金审计

1. 本基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券从业资格的会计师事务所（或有限公司）及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。

2. 会计师事务所（或有限公司）更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人和基金托管人的同意，并报监管机关备案。

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，并报监管机关备案后可以更换。更换会计师事务所（或有限公司）最迟于更换前 2 日内在至少一种中国证监会指定媒体上公告。

### 十六、基金的信息披露

本基金的信息披露按照《基金法》、《运作管理办法》、《信息披露管理办法》及

其实施准则、基金合同及其他有关规定办理。

本基金信息披露义务人应当按照法律、行政法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律、行政法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。

本基金的信息披露义务人应当在中国证监会规定的时间内，将应予以披露的基金信息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，并保证投资者能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

### （一）基金募集信息披露

1. 基金管理人按照《基金法》、《信息披露管理办法》编制基金招募说明书，基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人在本基金份额发售前 3 天将基金招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应当同时将基金合同、基金托管协议登载在网站上。

2. 基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

3. 基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。

4. 基金合同生效后，基金管理人应当在每 6 个月结束之日起 45 日内，编制更新的招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人应当在公告的十五日前向中国证监会报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

### （二）基金运作信息披露

基金管理人和基金托管人应当按照《基金法》、《信息披露管理办法》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基金运作信息，同时报中国证监会备案。

#### 1. 定期报告

（1）年度报告：基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。



(2) 半年度报告：基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定报刊上。

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

(4) 基金合同生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。基金定期报告应当在公开披露的第二个工作日，分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本和书面报告两种方式。

(5) 法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

## 2. 基金净值公告：

基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金财产净值和基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金财产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金财产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

若本基金因收费模式差异等原因而有多个基金份额净值的，应分别计算和公告。

### (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，基金管理人等信息披露义务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. 终止基金合同；
3. 转换基金运作方式；
4. 更换基金管理人、基金托管人；
5. 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
6. 基金管理人股东及其出资比例发生变更；

7. 基金募集期延长;
8. 基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动;
9. 基金管理人的董事在一年内变更超过 50%;
10. 基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过 30%;
11. 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼;
12. 基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查;
13. 基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚,基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚;
14. 重大关联交易事项;
15. 基金收益分配事项;
16. 管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更;
17. 基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%;
18. 基金改聘会计师事务所;
19. 变更基金份额发售机构;
20. 基金更换注册登记机构;
21. 开放式基金开始办理申购、赎回;
22. 开放式基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更;
23. 开放式基金发生巨额赎回并延期支付;
24. 开放式基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请;
25. 开放式基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回;
26. 中国证监会规定的其他事项。

#### (四) 澄清公告

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

#### (五) 信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度,指定专人负责管理信

信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则的规定；特定基金信息披露事项和特殊基金品种的信息披露，应当符合中国证监会相关编报规则的规定。

基金托管人应当按照相关法律、行政法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，对基金管理人编制的基金财产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择披露信息的报刊。

基金管理人、基金托管人除依法在指定报刊和网站上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒体披露信息，但是其他公共媒体不得早于指定报刊和网站披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到基金合同终止后10年。

#### （六）信息披露文件的存放与查阅

本基金招募说明书、基金合同、定期报告公告后应当分别置于基金管理人、基金托管人、基金销售机构的办公场所和基金进行场内交易的交易所，供公众查阅、复制。

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，从而对本基金投资产生潜在风险，导致基金收益水平发生波动。

#### 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者对基金份额的申购和赎回而不断波动，若由于基金投资者的连续大量赎回，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）本基金有关指数投资风险

##### 1. 标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

标的指数并不能完全代表整个股票市场。标的指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

##### 2. 标的指数波动的风险

标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

##### 3. 基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离：

（1）由于标的指数调整成份股或变更编制方法，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度与跟踪误差。

（2）由于标的指数成份股发生配股、增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差。

（3）成份股派发现金红利、新股市值配售收益将导致基金收益率超过标的指数收益率，产生正的跟踪偏离度。

（4）由于成份股停牌、摘牌或流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生跟踪偏离度和跟踪误差。

（5）由于基金投资过程中的证券交易成本，以及基金管理费和托管费的存在，使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差。

（6）在本基金指数化投资过程中，基金管理人的管理能力，例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对标的指数的跟踪程度。

（7）其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同；因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大；因基金申购与赎回带来的现金变动。

因指数发布机构指数编制错误等，由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

##### 4. 标的指数变更的风险

尽管可能性很小，但根据基金合同规定，如出现变更标的指数的情形，本基金

将变更标的指数。基于原标的指数的投资政策将会改变，投资组合将随之调整，基金的收益风险特征将与新的标的指数保持一致，投资者须承担此项调整带来的风险与成本。

#### （五）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、欺诈等行为产生的潜在风险；
4. 对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的潜在风险；
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）基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

- （1）基金合同经基金份额持有人大会表决终止的；
- （2）基金管理人职责终止，而在 6 个月内没有新基金管理人承接其原有职责的；
- （3）基金托管人职责终止，而 6 个月内没有新基金托管人承接其原有职责的；
- （4）基金合同规定的其他情况或中国证监会规定的其他情况。

### （二）基金财产的清算

#### 1. 基金财产清算组

（1）基金财产清算组：自出现基金合同终止事由之日起 30 个工作日内成立基金财产清算组，基金管理人组织基金财产清算组并在中国证监会的监督下进行基金财产清算。

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

（3）基金财产清算组职责：基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法以自己的名义进行必要的民事活动。

#### 2. 清算程序

- (1) 基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (2) 基金财产清算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) 公布基金财产清算公告；
- (5) 对基金财产进行分配；
- (6) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (7) 将基金财产清算报告报中国证监会备案并公告。

### 3. 清算费用

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

### 4. 基金财产清算剩余资产的分配

基金财产清算后的全部剩余财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. 基金财产清算的公告

基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告；基金财产清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。

### 6. 清算账册及文件的保存

基金财产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

每份基金份额具有同等的合法权益。

根据《基金法》、《运作管理办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

- (1) 按本基金合同的规定分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法转让或申请赎回其持有的基金份额；

(4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会;

(5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会,对基金份额持有人大会审议事项行使表决权;

(6) 监督基金管理人的投资运作;

(7) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料;

(8) 对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼;

(9) 法律法规、本基金合同以及依据本基金合同制定的其他法律文件规定的其他权利。

## 2. 基金份额持有人的义务

根据《基金法》、《运作管理办法》及其他有关规定,基金份额持有人的义务包括但不限于:

(1) 遵守基金合同;

(2) 缴纳基金认购、申购款项,承担基金合同规定的费用;

(3) 以其对基金的投资额为限承担基金亏损或者终止的有限责任;

(4) 不从事任何有损本基金及其他基金份额持有人合法利益的活动;

(5) 返还在基金交易过程中因任何原因,自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利;

(6) 执行生效的基金份额持有人大会的决定;

(7) 法律法规及本基金合同以及依据本基金合同制定的其他法律文件规定的其他权利。

## (二) 基金管理人权利及义务

### 1. 基金管理人的权利

根据《基金法》、《运作管理办法》及其他有关规定,基金管理人的权利包括但不限于:

(1) 自基金合同生效之日起,基金管理人依照法律法规和基金合同独立管理基金财产;

(2) 根据法律法规和本基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式,获得基金管理费,收取认购费、申购费、基金赎回手续费及其他经批准或公告的合理费用以及法律法规规定的其他费用;



- (3) 依照有关规定代表基金行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- (4) 根据法律法规和本基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金募集、认购、申购、赎回、转托管、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；
- (5) 根据法律法规合本基金合同规定销售基金份额；
- (6) 依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；
- (7) 在基金托管人更换时，提名新任基金托管人；
- (8) 依据法律法规合本基金合同监督基金托管人，如认为基金托管人违反了本基金合同或国家有关法律规定，并对基金财产或基金份额持有人利益造成损失的，应呈报中国证监会和中国银监会，以及采取其他必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；
- (9) 选择、委托、更换基金代销机构，对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；
- (10) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；
- (11) 依照法律法规及中国证监会的规定，为了基金份额持有人的利益为基金进行融资；
- (12) 依据本基金合同的规定，决定基金收益的分配方案；
- (13) 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；
- (14) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- (15) 增加或减少交易模式；
- (16) 法律法规、本基金合同以及依据本基金合同制订的其他法律文件所规定的其他权利。

## 2. 基金管理人的义务

根据《基金法》、《运作管理办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

- (1) 依法募集基金，办理基金备案手续；
- (2) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
- (3) 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；

(4) 配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购和赎回业务或委托其他机构代理该项业务；

(5) 配备足够的专业人员和相应的技术设施进行基金的注册登记或委托其他机构代理该项业务；

(6) 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财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

(7) 除依据《基金法》、本基金合同及其他有关规定外，不得利用基金财产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；

(8) 依法接受基金托管人的监督；

(9) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合本基金合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金财产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；

(10) 严格按照《基金法》、本基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

(11) 保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、本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；

(12) 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；

(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《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

(17) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(18) 确保需要向基金份额持有人提供的各项文件或资料在规定时间内发出；保证投资者能够按照基金合同约定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并得到有关资料的复印件；

(19) 组织并参加基金财产清算组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和

分配；

(20) 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；

(21) 因违反本基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其过错责任不因其退任而免除；

(22) 因基金托管人违反本基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(23) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(24) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(25) 不从事任何有损于本基金及其他基金当事人利益的活动；

(26) 编制中期和年度基金报告；

(27) 法律法规、本基金合同以及依据本基金合同制订的其他法律文件所规定的其他义务。

### (三) 基金托管人的权利和义务

#### 1. 基金托管人的权利

根据《基金法》、《运作管理办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

(1) 依照本基金合同的约定获得基金托管费；

(2) 监督本基金的投资运作，如基金托管人发现基金管理人的投资指令违反基金合同或有关法律法规规定的，应拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告；

(3) 自本基金合同生效之日起，依法律法规和本基金合同的规定保管基金财产；

(4) 依据法律法规和本基金合同的规定监督基金管理人，如认为基金管理人违反了法律法规或本基金合同规定对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会，以及采取其他必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；

(5) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(6) 依照法律法规及本基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；

(7) 法律法规、基金合同以及依据本基金合同制定的其他法律文件所规定的其

他权利。

## 2. 基金托管人的义务

根据《基金法》、《运作管理办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则，安全保管基金财产；

(2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

(3) 建立健全内部控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有资产以及不同的基金财产相互独立；对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《基金法》、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；

(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) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照本基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(7) 保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金财产净值、基金份额净值及基金份额申购、赎回价格；

(9) 采取适当、合理的措施，使基金份额的认购、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基金合同等法律文件的规定；

(11) 采取适当、合理的措施，使基金投资和融资的条件符合基金合同等法律文件的规定；

(12) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(13) 对基金财务会计报告、中期和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照本基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行本基金合同规定的行为，还应说明基金托管人是否采取了适当的措施；

(14) 按规定保存有关基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料，保存基金的会计账册、报表和记录等15 年以上；

(15) 建立并保存基金份额持有人名册；

(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) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

(19) 按照规定监督基金管理人的投资运作；

(20) 参加基金财产清算组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

(22) 基金管理人因违反本基金合同造成基金财产损失时，基金托管人应为基金向基金管理人追偿；

(23) 因违反本基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(24) 不从事任何有损本基金及基金其他当事人利益的活动；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会决议；

(26) 法律法规、本基金合同和依据本基金合同制定的其他法律文件所规定的其他义务。

#### (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 修改或终止基金合同，但基金合同另有约定或法律法规另有规定的除外；

② 转换基金运作方式；

③ 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

④ 更换基金管理人；

⑤ 更换基金托管人；

⑥ 与其他基金合并；

- 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 变更基金类别；
- ⑨ 变更基金投资目标、范围或策略；
- ⑩ 变更基金份额持有人大会程序；
- (11) 法律、法规及中国证监会规定的其他情形。

若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使前述①至⑩项规定被修改或取消，则本基金可相应地对该项规定进行修改或取消，该项规定之修改或取消，无须召开基金份额持有人大会，但应报证券监管机关批准或备案。

(2) 有以下情形之一的，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、基金托管人等相关服务机构的报酬标准；
- ② 在不违背相关法律法规和本基金合同相关约定的情况下，变更本基金的申购费率、赎回费率等，或变更其收费模式；
- ③ 因法律法规发生变动而确有必要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实质性变化；
- 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 按照法律法规之规定或本基金合同相关约定或经监管机关认可而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) 基金份额持有人大会的召集人（以下简称“召集人”）负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

(2) 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。

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

(4) 代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基

金托管人。

基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额10%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10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开。

(5) 代表基金份额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，基金管理人、基金托管人都不召集的，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30日向中国证监会备案。

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

(1) 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媒体上公告通知，会议通知应报中国证监会备案。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 确定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。

(2) 采取通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见的寄交和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容。

(3) 如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人；如召集人为基金

托管人，则应另行书面通知基金管理人；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人。

#### 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。

现场开会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，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席；通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。会议的召开方式由召集人确定，但决定基金管理人更换或基金托管人的更换、转换基金运作方式和终止基金合同事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

##### (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代理投票授权委托书符合法律法规、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%（含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代理投票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。

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（含50%）。

#### 5. 议事内容与程序



## （1）议事内容及提案权

① 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。

② 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

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

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解释和说明。

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。

## （2）议事程序

### ① 现场开会

在现场开会的方式下，基金份额持有人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，由基金托管人授权其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（不含50%）多数选举产生一名基金份额持有人或其代理人作为该次基金份额持有人大会的主持人。

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第7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，并形成大会决议。

### ② 通讯方式开会

在通讯开会的情况下，公告会议通知时应当同时公布提案，在所通知的表决截止日期后2个工作日内统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

## 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（含50%）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（含2/3）通过方可做出。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3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（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，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5日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起2个工作日内在至少一种中国证监会指定媒体上公告。

生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人和基金托管人均有法律约束力。

## （五）基金合同的变更和终止

### 1. 基金合同的变更

（1）本基金合同的变更应经基金管理人和基金托管人同意。

（2）变更基金合同应经基金份额持有人大会决议通过并报中国证监会批准，自批准之日起生效。但如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行变更的情形，或者基金合同的变更不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化，或者基金合同的变更对基金份额持有人利益无实质性不利影响，按照法律法规之规定或本基金合同的相关约定或经监管机关认可而不需要召开基金份额持有人大会的其他情形，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变更后公布，并报中国证监会备案。

（3）除非法律法规另有规定或本基金合同另有约定，以下基金合同变更事项需召开基金份额持有人大会：

- ① 终止基金合同；
- ② 转换基金运作方式；
- ③ 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- ④ 更换基金管理人、基金托管人；
- ⑤ 基金合同约定的其他事项。

## 2. 基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

- (1) 基金合同经基金份额持有人大会表决终止的；
- (2) 基金管理人职责终止，而在6个月内没有新基金管理人承接其原有职责的；
- (3) 基金托管人职责终止，而6个月内没有新基金托管人承接其原有职责的；
- (4) 法律法规及基金合同规定的其他情况或监管机关规定的其他情况。

### (六) 争议解决方式

1. 本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

2. 本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可首先通过友好协商解决。自一方书面要求协商解决争议之日起60日内如果争议未能以协商方式解决，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届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

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

### (七) 基金合同存放地及投资者取得基金合同的方式

基金合同可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构办公场所和基金进行场内交易的交易所查阅；投资者也可复印本基金合同等法律文件，但若有歧义，则应以本基金合同等法律文件的正本为准。

## 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

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

## （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《基金法》、《运作管理办法》、《销售管理办法》、《基金合同》和有关证券法规的规定，基金托管人应对基金管理人就基金财产的投资对象、基金财产的投资组合比例、基金财产的核算、基金财产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金的申购、赎回和基金转换等业务、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《基金法》、《运作管理办法》、《销售管理办法》、《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投资指令违反《基金法》、《运作管理办法》、《销售管理办法》、《基金合同》和有关法律、法规规定，应拒绝执行，立即通知基金管理人；并及时向中国证监会报告。

（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。

（4）基金托管人有权利并有义务行使法律法规、《基金合同》或本托管协议赋予、给予、规定基金托管人应有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合同当事人的利益。基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，基金托管人应为基金向基金管理人追偿。

### 2. 基金管理人对于基金托管人的业务监督、核查

根据《基金法》、《运作管理办法》、《销售管理办法》、《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、或因基金托管人的其他

原因而导致基金财产有所灭失、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《基金法》、《运作管理办法》、《销售管理办法》、《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，基金管理人应呈报相关监管机构，有权利并有义务行使法律法规、《基金合同》或本托管协议赋予、给予、规定的基金管理人应有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合同当事人的利益。基金托管人因违反基金合同造成基金财产损失时，基金管理人应为基金向基金托管人追偿。

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《基金法》、《信托法》、《运作管理办法》、《销售管理办法》、《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；建立健全内部风险控制制度，对负责基金财产托管的部门和人员的行为进行事先预防和事后监督，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》、《基金法》、《运作管理办法》、《销售管理办法》、本《基金合同》及其他有关规定外, 基金托管人不得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, 其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, 应承担相应的责任, 包括但不限于恢复相关基金财产的原状、承担赔偿责任等。

(5) 基金托管人保证其托管的基金财产与基金托管人自有资产以及不同的基金财产相互独立; 对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。

(6) 除依据《信托法》、《基金法》、《运作管理办法》、《销售管理办法》、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; 未经基金管理人的合法指令, 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

基金募集期限届满, 具备基金备案条件, 基金管理人应将募集的全部资金及其在募集期产生的利息存入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, 并出具书面验资报告, 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. 基金的银行存款账户的开设和管理

(1) 基金托管人应负责本基金的银行存款账户的开设和管理。

(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存款账户。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) 本基金银行存款账户的开立和使用, 限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行存款账户; 亦不得使用基金的任何银行存款账户进行与本基金相关业务无关的活动。

(4) 基金银行存款账户的管理应符合《中华人民共和国票据法》、《人民币银行

存款账户管理办法》、《现金管理暂行条例》、《中国人民银行利率管理规定》、《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. 基金证券账户和结算备付金账户的开设和管理

(1) 基金托管人应当代表本基金，以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开设专门的证券账户。

(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与本基金相关业务无关的活动。

(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相关基金在交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。

(4) 基金证券账户和基金托管人结算备付金账户的开设和管理可以根据当时市场的通行做法办理或变更，而限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，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、使用的规定或相关法律法规、业务规则之规定办理。

#### 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由基金托管人、基金管理人共同保管。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）基金财产净值计算与复核**

（1）基金财产净值是指基金财产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金财产净值总额除以计算日该基金发行在外的基金份额总份数后的数值。

（2）基金管理人应每工作日对基金财产估值。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财产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日结束后计算得出当日的基金份额净值，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等，均由基金管理人和基金托管人负责并分别保管，彼此应及时向对方提供相关信息。

基金管理人授权其他合格机构担任注册登记机构时，可委托该注册登记机构承担基金份额持有人名册的持续保管义务。注册登记机构对基金份额持有人名册的保管，按国家法律法规及证券监督管理部门的要求执行。

#### **（六）争议解决方式**

基金管理人、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管理人和基金托管人职责，继续忠实、勤

勉、尽责地履行《基金合同》和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）托管协议的修改与终止

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。修改后的新协议如需报有关机关批准或备案，在办理完毕相关的批准或备案手续后生效。

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）本基金更换基金管理人；

（4）发生《基金法》、《运作管理办法》、《销售管理办法》或其他法律法规规定的终止事项。

## 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、及时地为基金投资者办理基金账户、基金份额的登记、管理、托管与转托管，基金份额持有人名册的管理，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

定期定额投资计划是指投资者通过基金管理人指定的销售机构申请，约定每期扣款时间、扣款金额和扣款方式，由指定的销售机构于每期约定扣款日在投资者指定银行账户内自动完成扣款和基金申购申请的一种长期投资方式。

本基金管理人现已开通部分代销网点为投资者提供定期定额投资服务。具体业务规则，详见基金管理人公告及代销机构的规定。

#### 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。

“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自助语音查询服务。基金份额持有人可在本管理人办公时间选择人工查询、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。

“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份额持有人最近一季度基金交易对账单，记录该份额持有人最近一季度内所有申购、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。

“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。

“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

大成基金客户服务热线	021-53599588
	400-888-5558（免长途固话费）
大成基金深圳理财中心	联系人：梁靖、瞿宗怡
	电话：0755-83195090，83195236
	传真：0755-83195091
大成基金北京理财中心	联系人：廖红军、李宁
	电话：010-85252345/46
	传真：010-85252272/73/75

大成基金上海理财中心	联系人：徐舫、朱君
	电话：021-63513925/26
	传真：021-63513928
大成基金公司网址	www.dcfund.com.cn
大成基金客户服务电子信箱	service@dcfund.com.cn

## 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）大成沪深 300 基金 2008 年 10 月 7 日至 2009 年 4 月 6 日发布的公告：

1. 2008 年 10 月 24 日《2008 年第三季度报告》。

2. 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代销机构的公告》。

3. 2008 年 10 月 31 日《大成基金管理有限公司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增加长城证券有限责任公司为基金代销机构的公告》。

4. 2008 年 11 月 6 日《大成基金管理有限公司关于公司副总经理变动的公告》。

5. 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》。

6. 2008 年 11 月 19 日《大成沪深 300 指数证券投资基金更新的招募说明书》、《大成沪深 300 指数证券投资基金更新的招募说明书摘要》。

7. 2008 年 11 月 20 日《大成基金管理有限公司旗下基金持有的停牌股票复牌后估值方法的公告》。

8. 2008 年 11 月 24 日《大成基金管理有限公司关于变更公司董事长和公司总经理的公告》。

9. 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》。

10. 2008 年 12 月 11 日《大成基金管理有限公司关于增加国都证券有限责任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中国国际金融有限公司为基金代销机构的公告》。

11. 2008 年 12 月 17 日《大成基金管理有限公司关于直销交易系统升级的提示性公告》。

12. 2008 年 12 月 18 日《大成基金管理有限公司关于增加宁波银行股份有限公司为基金代销机构并开通基金定投及转换业务的公告》、《大成基金管理有限公司关于在长城证券有限责任公司开通基金定期定额投资业务的公告》。

13. 2008 年 12 月 30 日《大成基金管理有限公司参与中国建设银行基金定投申购费率优惠活动的公告》。

14. 2008 年 12 月 31 日《大成基金管理有限公司旗下开放式基金关于延长中国工商银行基金定投申购费率优惠活动的公告》、《大成基金管理有限公司关于调整中国建设银行借记卡网上直销申购费率的公告》。

15. 2009 年 1 月 9 日《大成基金管理有限公司关于在深圳发展银行开通基金定期定额投资计划的公告》。

16. 2009 年 1 月 14 日《大成基金管理有限公司关于在上海浦东发展银行开展网上基金申购费率优惠活动的公告》。

17. 2009 年 1 月 15 日《大成基金管理有限公司旗下部分基金参与中国光大银行基金定投申购费率优惠活动的公告》。

18. 2009 年 1 月 22 日《2008 年第四季度报告》、《大成基金管理有限公司关于增加中国银行股份有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告》。

19. 2009 年 2 月 4 日《大成基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告》。

20. 2009 年 3 月 5 日《大成基金管理有限公司关于旗下基金基金托管人名称变更的公告》。

21. 2009 年 3 月 23 日《大成基金管理有限公司关于与民生银行合作开通开放式基金网上直销业务的公告》。

22. 2009 年 3 月 31 日《2008 年年度报告》、《2008 年年度报告摘要》。

(四)《招募说明书》与本更新的招募说明书内容若有不一致之处，以本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 11 月 19 日公布的《大成沪深 300 指数证券投资基金更新的招募说明书》(2008 年第二期)进行了补充和更新,主要修改内容如下:

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. 根据最新数据,更新了“八、基金的投资”部分。
5. 根据最新数据,更新了“九、基金的业绩”部分。
6. 根据最新公告,更新了“二十二、其他应披露的事项”。
7. 根据最新情况,更新了“二十三、招募说明书更新部分的说明”。

## 二十四、招募说明书存放及查阅方式

本招募说明书和基金合同存放在基金管理人、基金托管人、销售机构等的办公场所和基金进行场内交易的交易所,并刊登在基金管理人、基金托管人等的网站上。

投资者可在办公时间免费查阅本基金的招募说明书和基金合同,也可复印本招募说明书和基金合同等,但若有歧义,则应以本基金招募说明书和基金合同等的正本为准。

## 二十五、备查文件

1. 中国证监会核准大成沪深300指数证券投资基金募集的文件
2. 大成沪深300指数证券投资基金基金合同
3. 中国证券登记结算有限公司开放式基金注册登记业务规则
4. 大成沪深300指数证券投资基金托管协议
5. 大成沪深300指数证券投资基金登记结算服务协议
6. 法律意见书

7. 基金管理人业务资格批件、营业执照
8. 基金托管人业务资格批件和营业执照
9. 中国证监会要求的其他文件

大成基金管理有限公司

2009年5月4日