

**大成景恒保本混合型证券投资基金  
更新招募说明书  
(第二个保本运作期)  
(2016年第1期)**

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

二〇一六年七月

## 重要提示

大成景恒保本混合型证券投资基金经中国证监会2012年4月27日证监许可【2012】567号文核准募集，本基金的基金合同于2012年6月15日正式生效。

根据《大成景恒保本混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）和《大成景恒保本混合型证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金的第一个保本周期为三年，自《基金合同》生效之日起至三个公历年后对应日止，如该对应日为非工作日，保本周期到期日顺延至下一个工作日。本基金的第一个保本周期到期日为2015年6月15日（星期一），鉴于本基金管理人已与深圳市高新投集团有限公司（以下简称“高新投”）就本基金第二个保本周期的保本事宜达成一致，由高新投为本基金进入第二个保本周期的运作提供保本保证，并签订了《保证合同》，本基金符合《基金合同》规定的保本基金存续的条件，本基金将转入下一保本周期。现经本基金管理人大成基金管理有限公司与本基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，本基金第一个保本周期到期后将转入第二个保本周期，同时对《大成景恒保本混合型证券投资基金基金合同》部分表述进行了修订更新，本次基金合同修订的内容自2015年6月16日起生效。

基金管理人保证本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，并不表明中国证监会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。

本基金为保本基金，但是投资者投资于保本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，在出现保证风险或不可抗力风险等极端情况下保本基金仍然存在本金损失的风险。投资者购买基金份额的行为视为同意《大成景恒保本混合型证券投资基金保证合同》的约定。

基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资有风险，投资者申购基金时，请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同。

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

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2016年6月15日（其中人员变动信息以公告日为准），有关财务数据和净值表现截止日为2016年3月31日（财务数据未经审计）。

## 目 录

重 要 提 示.....	1
第一部分 绪 言.....	3
第二部分 释 义.....	3
第三部分 基金管理人.....	9
第四部分 基金托管人.....	22
第五部分 相关服务机构.....	22
第六部分 基金的存续.....	46
第七部分 基金份额的申购、赎回与转换.....	46
第八部分、基金的转换、转托管、定期定额投资计划、非交易过户、冻结与质押.....	56
第九部分 基金的保本.....	57
第十部分 基金保本的保证.....	59
第十一部分 保本周期到期.....	63
第十二部分 基金的投资.....	68
第十三部分 基金业绩.....	85
第十四部分 基金的财产.....	86
第十五部分 基金资产估值.....	87
第十六部分 基金的费用与税收.....	91
第十七部分 基金收益与分配.....	93
第十八部分 基金的会计与审计.....	94
第十九部分 基金的信息披露.....	95
第二十部分 风险揭示.....	98
第二十二部分 基金合同的变更、终止与基金财产清算.....	100
第二十三部分 基金合同内容摘要.....	103
第二十四部分 基金托管协议内容摘要.....	126
第二十五部分 对基金份额持有人的服务.....	138
第二十六部分 其他应披露的事项.....	139
第二十七部分 对招募说明书更新部分的说明.....	140
第二十六部分 招募说明书的存放及查阅方式.....	141
第二十七部分 备查文件.....	141

## 第一部分 绪 言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、其他有关规定及《大成景恒保本混合型证券投资基金基金合同》（以下简称基金合同）编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。本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《大成景恒保本混合型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。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，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《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务；基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅《大成景恒保本混合型证券投资基金基金合同》。

## 第二部分 释 义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语具有如下含义：

基金或本基金：	指大成景恒保本混合型证券投资基金；
基金合同：	指《大成景恒保本混合型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充；
招募说明书或本招募说明书：	指《大成景恒保本混合型证券投资基金招募说明书》及其定期更新；
发售公告：	指《大成景恒保本混合型证券投资基金基金份额发售公告》
托管协议	指《大成景恒保本混合型证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充；
保证合同	指基金管理人与担保人签署的《大成景恒保本混合型证券投资基金保证合同》；

- 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 2012 年 12 月 28 日经第十一届全国人民代表大会常务委  
员会第三十次次会议通过，自 2013 年 6 月 1 日起实施的  
《中华人民共和国证券投资基金法》及不时做出的修订；
- 《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的  
《证券投资基金销售管理办法》及不时做出的修订；
- 《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的  
《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不  
时做出的修订；
- 《信息披露办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布并于 2004 年 7 月 1 日实  
施的《证券投资基金信息披露管理办法》及不时作出的修订；
- 元：指人民币元；
- 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；
- 担保人：指依据《中华人民共和国担保法》为本基金提供担保的担保  
人。就本基金第二个保本周期而言，指深圳市高新投集团有  
限公司（以下简称“高新投”）；
- 注册登记业务：指本基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资  
者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、  
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  
为大成基金管理有限公司；
- 投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法  
规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者；
- 个人投资者：指依据中华人民共和国有关法律法规可以投资于证券投资基  
金的自然人；
- 机构投资者：指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有  
效存续并依法可以投资于证券投资基金的企业法人、事业法  
人、社会团体或其他组织；
- 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办  
法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资  
基金的中国境外的机构投资者；

基金份额持有人大会：	指按照基金合同第九部分之规定召集、召开并由基金份额持有人或其合法的代理人进行表决的会议；
基金合同生效日：	指募集结束，基金募集的基金份额总额、募集金额和基金份额持有人人数符合相关法律法规和基金合同规定的，基金管理人依据《基金法》向中国证监会办理备案手续后，中国证监会的书面确认之日；
存续期：	指基金合同生效至终止之间的不定期期限；
保本周期	指本基金的保本期限。本基金的保本周期每三年为一个周期。自本基金公告的保本期起始日起至3年后对应日止，如该对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日。基金管理人将在保本周期到期前公告的到期处理规则中确定下一个保本周期的起始时间。基金合同中若无特别所指，保本周期即为当期保本周期；
保本周期起始日	保本周期起始日为前一个保本周期到期后过渡期折算日的次日，具体以基金管理人届时公告为准；
保本周期到期日	保本周期届满的最后一日，如该对应日为非工作日，则顺延至下一工作日。基金合同中若无特别所指即为当期保本周期届满日；
持有到期	基金份额持有人在当期保本周期内一直持有其过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期的基金份额直到当期保本周期到期日的行为；
持有到期的基金份额	基金份额持有人在当期保本周期内一直持有其过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期直到当期保本周期到期日的基金份额；
过渡期	前一保本周期结束之后（不含当期保本周期到期日）至下一保本周期开始之前不超过30个自然日的一段期间，具体日期由基金管理人在到期处理规则中确定；
过渡期申购	投资人在过渡期的限定期限内申购本基金份额的行为。在过渡期内，投资者转换转入本基金基金份额，视同为过渡期申购；
转入下一保本周期	在符合保本基金存续条件下，基金份额持有人在下一保本周期继续持有经过基金份额折算后的本基金基金份额的行为；
折算日	前一保本周期结束之后，下一保本周期开始日的前一工作日，即过渡期最后一个工作日。基金合同中若无特别所指，折算

	日即为当期保本周期开始日的前一工作日；
基金份额折算	在折算日，在基金份额持有人持有的基金份额所代表的资产净值总额保持不变的前提下，变更登记为基金份额净值为 1.00 元的基金份额，基金份额数按折算比例相应调整；
过渡期申购保本金额	基金份额持有人在过渡期申购并持有到期的基金份额在过渡期折算日所代表的资产净值及过渡期申购费用之和；
从上一保本周期转入当期保本周期基金份额的保本金额	基金份额持有人将其上一保本周期届满时持有的基金份额转入当期保本周期并持有到期部分在过渡期折算日所代表的基金资产净值；
保本金额	过渡期申购保本金额或从上一保本周期转入当期保本周期基金份额的保本金额；
持有到期的基金份额的可赎回金额	根据基金保本周期到期日基金份额净值计算的可赎回金额，即基金份额持有人持有到期的基金份额与保本周期到期日基金份额净值的乘积；
保本赔付差额	持有到期的基金份额的可赎回金额加上相应基金份额在当期保本周期内的累计分红款项之和低于保本金额的差额部分；
保本	在保本周期到期日，如基金份额持有人持有到期的基金份额的可赎回金额加上其持有到期的基金份额在当期保本周期内的累计分红款项之和低于其保本金额的，基金管理人或保本义务人应补足该差额，并在保本周期到期日后 20 个工作日（含第 20 个工作日）内将该差额支付给基金份额持有人；
保证	第二个保本周期，担保人为本基金保本提供的不可撤销的连带责任保证，保证范围为基金份额持有人过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额的可赎回金额加上其过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额的累计分红款项之和低于其过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期保本金额的差额部分，保证期间为基金保本周期到期日起六个月；本基金第二个保本周期后各保本周期涉及的基金保本的保障事宜，由基金管理人与担保人或保本义务人届时签订的保证合同或风险买断合同决定，并由基金管理人在当期保本周期开始前公告；
保本基金存续条件	本基金保本周期届满时，符合法律法规有关担保人或保本义务人资质要求、并经基金管理人和基金托管人认可的担保人

	或保本义务人同意为本基金下一保本周期提供保本保障，并与本基金管理人签订保证合同或风险买断合同，同时本基金满足法律法规规定及基金合同约定的基金存续要求；
保本周期到期后基金的存续形式	保本周期届满时，若符合保本基金存续条件，本基金继续存续；否则，本基金变更为非保本的股票型基金，基金名称相应变更为“大成景恒稳健增长股票型证券投资基金”。如果本基金不符合法律法规和基金合同对基金的存续要求，则本基金将按照基金合同的相关规定终止；
保本周期到期选择	基金份额持有人在保本周期到期后，选择赎回本基金基金份额、将本基金基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额、转入下一保本周期、或继续持有变更后基金的基金份额的行为；
定期定额投资计划	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投资者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；
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；
申购：	指在基金合同生效后的存续期间，投资者申请购买本基金基金份额的行为（在过渡期内，投资者转换转入本基金基金份额，视同为过渡期申购）；
赎回：	指在基金合同生效后的存续期间，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求基金管理人购回本基金基金份额的行为；
基金转换：	指基金份额持有人按基金管理人规定的条件，申请将其持有的基金管理人管理的某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金的基金份额的行为；
转托管：	指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作；
指令：	指基金管理人在运用基金财产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令；
巨额赎回：	指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日基金总份额的 10% 的情形；
代销机构：	指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基



	金代销业务资格并接受基金管理人委托，代为办理基金申购、赎回和其他基金业务的机构；
销售机构：	指基金管理人及本基金代销机构；
基金销售网点：	指基金管理人的直销中心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刊和互联网网站或其它媒体；
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：	指销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理申购、赎回、转换及转托管等业务而引起的基金份额的变动及结余情况的账户；
开放日：	指为投资者办理基金份额申购、赎回等业务的工作日；
T 日：	指销售机构在规定时间受理投资者申购、赎回或其他业务申请的开放日；
T+n 日：	指 T 日后（不包括 T 日）第 n 个工作日，n 指自然数；
业务规则	指《大成基金管理有限公司开放式基金注册登记业务规则》；
基金收益：	指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约；
基金资产总值：	指基金持有的各类有价证券、银行存款本息、应收款项及其他资产的价值总和；
基金资产净值：	指基金资产总值减去基金负债后的价值；
基金份额净值	指以计算日基金资产净值除以计算日基金份额余额所得的单位基金份额的价值；
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；
法律法规：	指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、地方法规、地方规章、部门规章及其他规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充；
不可抗力：	指本合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件。



### 第三部分 基金管理人

#### （一）基金管理人概况

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

成立日期：1999 年 4 月 12 日

注册资本：贰亿元人民币

股权结构：公司股东为中泰信托有限责任公司（持股比例 50%）、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%）三家公司。

法定代表人：刘卓

电话：0755-83183388

传真：0755-83199588

联系人：肖剑

#### （二）主要人员情况

##### 1. 公司高级管理人员

###### 董事会：

刘卓先生，董事长，工学学士。曾任职于共青团哈尔滨市委、哈尔滨银行股份有限公司、中泰信托有限责任公司；2007 年 6 月，任哈尔滨银行股份有限公司执行董事；2008 年 8 月，任哈尔滨银行股份有限公司董事会秘书；2012 年 4 月，任哈尔滨银行股份有限公司副董事长；2012 年 11 月至今，任中泰信托有限责任公司监事会主席。2014 年 12 月 15 日起任大成基金管理有限公司董事长。

靳天鹏先生，副董事长，国际法学硕士。1991 年 7 月至 1993 年 2 月，任职于共青团河南省委；1993 年 3 月至 12 月，任职于深圳市国际经济与法律咨询公司；1994 年 1 月至 6 月，任职于深圳市蛇口律师事务所；1994 年 7 月至 1997 年 4 月，任职于蛇口招商港务股份有限公司；1997 年 5 月至 2015 年 1 月，先后任光大证券有限责任公司南方总部研究部研究员，南方总部机构管理部副总经理，光大证券股份有限公司债券业务部总经理助理，资产管理总部投资部副总经理（主持工作），法律合规部副总经理，零售交易业务总部副总经理。

罗登攀先生，董事、总经理，耶鲁大学经济学博士。具注册金融分析师(CFA)、金融风险管理师(FRM)资格。曾任毕马威(KPMG)法律诉讼部资深咨询师、金融部资深咨询师，以及SLCG证券诉讼和咨询公司合伙人；2009年至2012年，任中国证券监督管理委员会规划委专家顾问委员，机构部创新处负责人，兼任国家“千人计划”专家；2013年2月至2014年10月，任中信并购基金管理有限公司董事总经理，执委会委员。2014年11月26日起任大成基金管理有限公司总经理。2015年3月起兼任大成国际资产管理有限公司董事长。2015年10月起兼任大成国际资产管理有限公司董事总经理。

周雄先生，董事，金融学博士，北京大学光华管理学院高级管理人员工商管理硕士(EMBA)。1987年8月至1993年4月，任厦门大学财经系教师；1993年4月至1996年8月，任华夏证券有限公司厦门分公司经理；1996年8月至1999年2月，任人民日报社事业发展局企业管理处副处长；1999年2月至今任职于中泰信托有限责任公司，历任副总裁、总裁，现任中泰信托有限责任公司董事、总裁。

孙学林先生，董事，博士研究生在读。具注册会计师、注册资产评估师资格。现任中国银河投资管理有限公司投资二部董事总经理、投资决策委员会委员。2012年6月起，兼任镇江银河创业投资有限公司总经理、投资决策委员会委员。

黄隽女士，独立董事，经济学博士。现任中国人民大学经济学院教授、博士生导师，中国人民大学经济学院院长助理，中国人民大学艺术品金融研究所副所长。

叶林先生，独立董事，法学博士。现任中国人民大学法学院教授、民商法教研室主任，博士研究生导师、国家社会科学重点基地中国民商事法律科学研究中心兼职教授。

吉敏女士，独立董事，金融学博士，现任东北财经大学讲师，教研室主任，东北财经大学金融学国家级教学团队成员，东北财经大学开发金融研究中心助理研究员，主要从事金融业产业组织结构、银行业竞争方面的研究。参与两项国家自然科学基金、三项国家社科基金、三项教育部人文社会科学一般项目、多项省级创新团队项目，并负责撰写项目总结报告，在国内财经类期刊发表多篇学术论文。

金李先生，独立董事，博士。现任英国牛津大学商学院终身教职正教授(博士生导师)和北京大学光华管理学院讲席教授(博士生导师)，金融系联合系主任，院长助理，北京大学国家金融研究中心主任。曾在美国哈佛大学商学院任教十多年，并兼任哈佛大学费正清东亚研究中心执行理事。

监事会：

陈希先生，监事长，中国人民大学经济学专业研究生，高级经济师。2006年被亚洲风

险与危机管理协会授予“企业风险管理师”资格。2007年起任中国银河投资管理有限公司董事、常务副总裁（至2012年7月）、党委委员；2010年7月起，兼任吉林省国家生物产业创业投资有限责任公司董事长兼总经理、吉林省国家汽车电子产业创业投资有限责任公司董事，2012年6月起，兼任镇江银河创业投资有限公司董事长；2012年7月起至今，任中国银河投资管理有限公司总裁。

蒋卫强先生，职工监事，经济学硕士。1997年7月至1998年10月任杭州益和电脑公司开发部软件工程师。1998年10月至1999年8月任杭州新利信息技术有限公司电子商务部高级程序员。1999年8月加入大成基金管理有限公司，历任信息技术部系统开发员、金融工程部高级工程师、监察稽核部总监助理、信息技术部副总监、风险管理部副总监，现任风险管理部总监。

吴萍女士，职工监事，文学学士。1991年至1992年任中国农业银行深圳分行国际业务部会计。1993年至1998年任日本三和银行深圳分行单证部、信贷部主任。1999年至2009年任普华永道会计师事务所深圳分所审计部经理、高级经理。2010年6月加入大成基金管理有限公司，历任计划财务部高级会计师、总监助理，现任计划财务部副总监。

其他高级管理人员：

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。2009年3月—2015年7月兼任大成国际资产管理有限公司董事。

肖剑先生，副总经理，公共管理硕士。曾任深圳市南山区委（政府）办公室副主任，深圳市广聚能源股份有限公司副总经理兼广聚投资控股公司执行董事、总经理，深圳市人民政府国有资产监督管理委员会副处长、处长。2015年1月加入大成基金管理有限公司，任公司副总经理。

温智敏先生，副总经理，哈佛大学法学博士。2000至2002年就职于Hunton & Williams美国及国际律师事务所，2002至2006年任中银国际投行业务副总裁，2006至2009年任香港三山投资公司董事总经理，2009至2014年任标准银行亚洲有限公司董事总经理兼中国投行业务主管。2015年4月加入大成基金管理有限公司，出任首席战略官，2015年8月起任公司副总经理。

周立新先生，副总经理，大学本科学历。曾任新疆精河县党委办公室机要员、新疆精

河县团委副书记、新疆精河县人民政府体改委副主任、新疆精河县八家户农场党委书记、新疆博尔塔拉蒙古自治州团委副书记及少工委主任、江苏省铁路发展股份有限公司办公室主任、江苏省铁路发展股份有限公司控股企业及江苏省铁路实业集团有限公司控股企业负责人、中国华闻投资控股有限公司燃气战略管理部项目经理。2005年1月加入大成基金管理有限公司，历任客户服务中心总监助理、市场部副总经理、上海分公司副总经理、客户服务部总监兼上海分公司总经理、公司助理总经理，2015年8月起任公司副总经理。

## 2、基金经理

### (1) 现任基金经理

赵世宏先生，经济学硕士，5年证券从业经历。2011年3月至2012年9月任中银基金管理有限公司研究员。2012年9月至2015年9月任易方达基金管理有限公司研究员、基金经理助理。2015年9月加入大成基金管理有限公司，任职于固定收益总部。自2016年3月26日起担任大成景丰债券型证券投资基金（LOF）、大成景恒保本混合型证券投资基金、大成景利混合型证券投资基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金和大成强化收益定期开放债券型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国

### (2) 历任基金经理

历任基金经理姓名	任期起始日	任期结束日
朱文辉	2012年6月15日	2013年11月8日
王磊	2013年7月17日	2016年3月25日

## 3、公司投资决策委员会（固定收益）

公司固定收益投资决策委员会由3名成员组成，设固定收益投资决策委员会主席1名，其他委员2名。名单如下：

罗登攀，总经理，固定收益投资决策委员会主席；张翼，固定收益总部总监，固定收益投资决策委员会委员；王立，基金经理，固定收益总部副总监兼公募投资部总监，固定收益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》、《运作办法》及其他有关规定，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. 办理基金备案登记手续;
3. 自基金合同生效之日起,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产;
4. 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;
5. 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,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;
6. 除依据《基金法》、《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. 接受基金托管人依法进行的监督;
8. 采取适当合理的措施使计算基金份额申购、赎回价格的方法符合基金合同等法律文件的规定,按规定计算并公告基金份额净值,确定基金份额申购、赎回价格;
9. 严格按照《基金法》、《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。除法律法规、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;
11. 按基金合同规定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;
12. 不谋求对上市公司的控制和直接经营管理;
13. 依据《基金法》、《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;
14. 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
15. 编制中期和年度基金报告;
16. 保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上;
17. 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;
18. 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;
19. 因违反《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他法律法规,导致基金财产损失或损害基金份额持有人合法权益的,应承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;
20. 按照法律法规和基金合同的规定受理申购和赎回申请,及时、足额支付赎回款项;
21. 确保向基金投资者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

照基金合同规定的时间和方式，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；

22. 不从事任何有损基金及本基金其他当事人利益的活动；

23. 负责为基金聘请注册会计师和律师；

24. 由于基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

25. 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；

26. 法律法规及基金合同规定的其他职责。

#### 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) 将基金管理人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) 法律法规和中国证监会禁止的其他行为。

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) 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) 法律法规和中国证监会禁止的其他行为。

4. 本基金管理人将根据基金合同的规定，按照本招募说明书列明的投资目标、策略及限制等全权处理本基金的投资。

5. 本基金管理人不得从事违反《基金法》的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，保证基金财产不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，但国务院另有规定的除外；
- (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) 依照法律法规规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

## 六、基金经理的承诺

- 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被代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；
- 3. 不违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，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. 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

## 七、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《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营成本，提高经济效益，以合理的成本控制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订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。

4) 风险管理部主要负责对投资组合的市场风险、流动性风险和信用风险等进行风险测量，并提出风险调整的建议；对投资业绩进行评价，包括整体表现分析、业绩构成分析及业绩短期和长期持续性检验；对将要展开的新业务和创新性产品的投资做全面的风险评估，提出风险预警等工作。

(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订或取消授权。

(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,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订程序，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管理办法, 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的声明

(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。

## 第四部分 基金托管人

### （一）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

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：田国立

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

### （二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

### （三）证券投资基金托管情况

截至2016年06月30日，中国银行已托管475只证券投资基金，其中境内基金444只，QDII基金31只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，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。

### （四）托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风



风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007年起，中国银行连续聘请外部会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2016年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

#### （五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人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，及时通知基金管理人，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，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

## 第五部分 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：刘卓

电话：0755-83183388

传真：0755-83199588

联系人：王为开

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

大成基金客户服务热线：400-888-5558（免长途固话费）

#### （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

电话：0755-22223523、0755-22223555、0755-22223556

联系人：肖成卫、白小雪

传真：0755-83195235/83195245/83195232

邮编：518040

## 2. 代销机构

### (1) 中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

客服电话：95588

联系人：陶仲伟

电话：010-66107900

传真：010-66107914

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

### (2) 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：周慕冰

客服电话：95599

电话：010-85109219

传真：010-85109219

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

### (3) 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：田国立

客服电话：95566

联系人：王娟

电话：010-66594909

传真：010-66594942

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

### (4) 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：王洪章

联系人：王嘉朔

电话：：010—66275654

传真：010-66275654

客服电话：95533

网址：www.ccb.com

（5）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：牛锡明

客服电话：95559

联系人：曹榕

电话：021-58781234

传真：021-58408483

网址：www.bankcomm.com

（6）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

法定代表人：李建红

客服电话：95555

联系人：邓炯鹏

电话：0755-83077278

传真：0755-83195049

网址：www.cmbchina.com

（7）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：胡平西

客服电话：021-962999、400-696-2999

电话：021-38576666

传真：021-50105124

联系人：施传荣

网址：www.shrcb.com

(8) 北京农村商业银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区阜成门内大街 410 号

法定代表人：王金山

联系人：董汇

联系电话：010-85605588

传真：010-66506163

客服电话：96198

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

(9) 青岛银行股份有限公司

地址：青岛市市南区香港中路 68 号华普大厦

法定代表人：张广鸿

联系人：滕克、李佳程

联系电话：0532-68629926

客服电话：96588（青岛）、400-66-96588（全国）

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

(10) 浙商银行股份有限公司

注册地址：杭州市庆春路 288 号

法定代表人：沈仁康

联系人：唐燕

客户服务热线：95105665

电话：0571-87659056

传真：0571-87659188

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

(11) 东莞银行股份有限公司

注册地址：东莞市运河东一路 193 号

法定代表人：卢国锋

联系人：陈幸

电话：0769-22119061

传真：0769-22117730

客服电话：96228

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

(12) 江苏银行股份有限公司

地址：南京市洪武北路 55 号

法定代表人：夏平

联系人：田春慧

客户服务电话：96098、400-86-96098

电话：025-58587018

传真：025-58588164

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

(13) 洛阳银行股份有限公司

注册地址：洛阳市洛龙区开元大道 256 号

办公地址：洛阳市洛龙区开元大道 256 号

客服电话：0379-96699

法定代表人：王建甫

联系人：胡艳丽

电话：0379-65921977

传真：0379-65921851

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

(14) 大连银行股份有限公司

注册地址：大连市中山区中山路 88 号天安国际大厦 49 楼

法定代表人：陈占维

客服电话：4006640099

联系人：：李格格

电话：：0411-82356627

传真：0411-82311420

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

(15) 哈尔滨银行股份有限公司

住所：哈尔滨市道里区尚志大街 160 号

办公地址：哈尔滨市道里区尚志大街 160 号

法人：郭志文

联系人：遇玺

联系电话：0451-86779018

传真：0451-86779007

客服电话：95537

公司网址：www.hrbb.com.cn

（16）国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：杨德红

客服电话：95521

联系人：芮敏祺、朱雅崑

联系电话：021-38676666

传真：021-38670161

网址：www.gtja.com

（17）中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

法定代表人：王常青

客服电话：4008888108

联系人：权唐

电话：010-85130577

传真：010-65182261

网址：www.csc108.com

（18）国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦六层

法定代表人：何如

客服电话：95536

联系人：周杨

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

网址：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：95565

联系人：黄婵君

电话：0755-82960167

传真：0755-82943636

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：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场

5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼

法定代表人：孙树明

客服电话：95575

联系人：黄岚

电话：020-87555888

传真：020-87555305

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

(21) 中信证券股份有限公司

注册地址：深圳市深南路 7088 号招商银行大厦

法定代表人：王东明

客服电话：010-84588888

联系人：顾凌

电话：010-60838696

传真：010-84865560

网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

(22) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安

客服电话：4008-888-888

联系人：宋明

联系电话：010-66568450

传真：010-66568990

网址：www.chinastock.com.cn

（23）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：李笑鸣

电话：021-23219000

传真：021-63602722

网址：www.htsec.com

（24）申万宏源证券股份有限公司

通讯地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 40 层

法定代表人：陈亮

客服电话：95523、4008895523

联系人：曹晔

电话：021-54033888

传真：021-54038844

网址：www.sywg.com

（25）兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

法定代表人：兰荣

客户服务电话：95562

联系人：夏中苏

电话：0591-38281963

传真：0591-38507538

网址：www.xyzq.com.cn

（26）长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦



法定代表人：杨泽柱

客户服务热线：95579、4008-888-999

联系人：奚博宇

电话：027-65799999

传真：027-85481900

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

(27) 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

法定代表人：牛冠兴

客服电话：4008 001 001

联系人：陈剑虹

电话：0755-82825551

传真：0755-82558355

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

(28) 西南证券股份有限公司

地址：重庆市渝中区临江支路 2 号合景国际大厦 A 幢

法定代表人：余维佳

客服电话：4008096096

联系人：张煜

联系电话：023-63786633

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

(29) 民生证券股份有限公司

地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座

法定代表人：余政

客服电话：4006198888

联系人：赵明

联系电话：010-85127622

联系传真：010-85127917

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

(30) 渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

法定代表人：王春峰

联系人：蔡霆

电话：022-28451991

传真：022-28451892

客服电话：4006515988

网址：ww.ewww.com.cn

(31) 中信证券（山东）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：杨宝林

客服电话：0532-96577

联系人：吴忠超

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

网址：www.zxwt.com.cn

(32) 信达证券股份有限公司

地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

客户服务电话：4008008899

联系人：唐静

联系电话：010-63081000

传真：010-63080978

公司网址：www.cindasc.com

(33) 东方证券股份有限公司

地址：上海市中山南路 318 号新源广场 2 号楼 22-29 楼

法定代表人：潘鑫军

客户电话：95503

联系人：胡月茹

电话：021-63325888

传真：021-63326173

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

(34) 方正证券股份有限公司

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

法定代表人：雷杰

客服电话：95571

联系人：徐锦福

电话：010-57398062

传真：010-57398058

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

(35) 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：杨光裕

客户服务热线：0755-33680000、400-6666-888

联系人：高峰

电话：0755-83516094

传真：0755-83516199

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

(36) 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：薛峰

客服电话：400-888-8788、95525

联系人：刘晨

电话：021-22169999

传真：021-22169134

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

(37) 广州证券股份有限公司

注册地址：广州市先烈中路 69 号东山广场主楼十七楼

法定代表人：邱三发

客服电话：95396

联系人：林洁茹

联系电话：020-87322668

传真：020-87325036

网址：www.gzs.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

法定代表人：龚德雄

客服电话：021-962518、4008918918

联系人：许曼华

电话：021-53519888

传真：021-63608830

网址：www.962518.com

（39）平安证券有限责任公司

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

法定代表人：谢永林

客服电话：95511 转 8

联系人：吴琼

电话：0755-22626391

传真：0755-82400862

网址：www.pingan.com

（40）财富证券有限责任公司

办公地址：湖南长沙芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 层

法人代表：蔡一兵

客户服务热线：0731-84403333、400-88-35316

联系人：郭磊

传真：0731-84403439

网址：www.cfzq.com

（41）东莞证券有限责任公司

注册地址：东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

法定代表人：张运勇

客服电话：0769-961130

联系人：梁健伟

电话：0769-22119341

传真：0769-22116999

网址：www.dgzq.com.cn

（42）中原证券股份有限公司

地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号

法定代表人：菅明军

客服电话：0371-967218、4008139666

联系人：程月艳、范春艳

联系电话：0371—69099882

联系传真：0371-65585665

网址：www.ccnew.com

（43）国都证券有限责任公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人：常喆

客户服务电话：400-818-8118

联系人：黄静

电话：010-84183333

传真：010-84183311-3389

网址：www.guodu.com

（44）国盛证券有限责任公司

注册地址：江西省南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦

办公地址：江西省南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦 4 楼

法定代表人：曾小普

联系人：周欣玲

电话：0791-86281305

传真：0791-6282293

网址：www.gsstock.com

（45）中泰证券股份有限公司

办公地址：山东省济南市经十路 20518 号

法定代表人：李玮

客户服务电话：95538

联系人：吴阳

电话：0531-81283938

传真：0531-81283900

网址：www.qlzq.com.cn

（46）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：姜昧军

客服电话：0755-83199599

联系人：袁媛

电话：0755-83199511

传真：0755-83199545

网址：www.csc.com.cn

（47）第一创业证券股份有限公司

地址：深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25F

法人代表：刘学民

电话：4008881888

网址：www.firstcapital.com.cn

（48）中航证券有限公司

注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

办公地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

法人代表：王宜四

客户服务热线：4008866567

联系人：戴蕾

电话：0791-86768681

传真：0791-86770178

网址：www.avicsec.com

（49）中国国际金融有限公司

注册地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京市建国门外大街甲 6 号 SK 大厦

法定代表人：丁学东

联系人：杨涵宇

电话：010-65051166

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

(50) 华鑫证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01 (b) 单元

办公地址：上海市肇嘉浜路 750 号

法定代表人：俞洋

联系人：陈敏

网站：[www.cfsc.com.cn](http://www.cfsc.com.cn)

客户服务电话：021-32109999、029-68918888、4001099918

(51) 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

法定代表人：程宜荪

电话：010-58328373

传真：010-58328748

联系人：冯爽

客户服务电话：400-887-8827

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

(52) 中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层

法定代表人：高涛

联系人：刘毅

客户电话：400 600 8008

电话：0755-82023442

传真：0755-82026539

网址：[www.china-invs.cn](http://www.china-invs.cn)

(53) 中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层

法定代表人：黄扬录

联系人：罗艺琳

联系电话：0755-82570586

客服电话：400-1022-011

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

(54) 联讯证券股份有限公司

注册地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼

法人代表：徐刚

联系人：郭晴

联系电话：0752-2119391

客户服务电话：95564

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

(55) 江海证券有限公司

办公地址：哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法人代表：孙名扬

电话：0451-85863726

客服热线：4006662288

联系人：周俊

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

(56) 国金证券股份有限公司

注册地址：成都市东城根上街 95 号

客户服务电话：4006600109

联系人：刘婧漪

电话：028-86690057

传真：028-86690126

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

(57) 中国民族证券有限责任公司



注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 40 层-43 层

法人代表：赵大建

联系人：李微

客户服务电话：400-889-5618

网址：www.e5618.com

（58）华宝证券有限责任公司

地址：上海市浦东新区环球金融中心 57 楼

法定代表人：陈林

客户服务电话：400-820-9898

联系人：刘闻川

电话：021-68778075

传真：021-68868117

网址：www.cnhbstock.com

（59）爱建证券有限责任公司

地址：上海市南京西路 758 号 23 楼

法定代表人：郭林

客服电话：021-63340678

联系人：陈敏

电话：021-32229888

传真：021-62878783

网址：www.ajzq.com

（60）华融证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 8 号

法定代表人：祝献忠

联系人：李慧灵

联系电话：010-58315221

传真：010-58568062

客户服务电话：010-58568118 、 400-898-9999

网址：www.hrsec.com.cn

（61）天风证券股份有限公司

注册地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼

法定代表人:余磊

联系人:翟璟

联系电话:(027) 87618882、(028) 86711410

传真:(027) 87618863

公司网站:www.tfzq.com

(62) 天相投资顾问有限公司

注册地址:北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

法定代表人:林义相

客服电话:010-66045678

联系人:尹伶

传真:010-66045527

网址:www.txsec.com

(63) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006 号

法定代表人:杨懿

办公地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006 号

联系人:张燕

联系电话:010-58325388\*1588

网站:www.new-rand.cn

客户服务电话:400-166-1188

(64) 和讯信息科技有限公司

注册地址:北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人:王莉

联系人:刘洋

联系电话:021-20835785

传真:021-20835879

客户服务电话:400-920-0022

网址:http://licaike.hexun.com

(65) 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

法定代表人：汪静波

办公地址：上海市杨浦区昆明路 508 号北美广场 B 座 12 楼

联系人：徐诚

联系电话：021-38509639

网站：www.noah-fund.com

客户服务电话：400-821-5399

（66）深圳众禄基金销售有限公司

办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

电话：0755-33227950

传真：0755-82080798

网址：www.zlfund.cn

客服电话：4006-788-887

（67）上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼

法人代表：其实

联系人：潘世友

电话：021-54509998

传真：021-64383798

客户服务电话：400-1818-188

网址：www.1234567.com.cn

（68）杭州数米基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街文一西路 1218 号 1 栋 202 室

法人代表：陈柏青

联系人：徐映绯

电话：021-60897840

传真：0571-26698533

客户服务电话：4000-766-123

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

(69) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：杭州市西湖区文二西路1号元茂大厦903室

办公地址：浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼

法人代表：凌顺平

联系人：林海明

电话：0571-88911818-8580

传真：0571-88911818-8002

客户服务电话：4008-773-772

网站地址：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

(70) 北京钱景财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街6号中关村金融大厦（丹棱soho）1008

法定代表人：赵荣春

联系人：魏争

网站：[www.qianjing.com](http://www.qianjing.com)

客户服务电话：400-893-6885

(71) 泰诚财富基金销售（大连）有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中华园3号

法定代表人：林卓

联系人：张晓辉

电话：0411-88891212

传真：0411-84396536

客服电话：400-6411-999

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

(72) 上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路765号602-115室

法定代表人：陈继武

客服电话：4000178000

联系人：葛佳蕊

电话：021-63333319

传真：021-63332523

网址：www.lingxianfund.com

(73) 武汉市伯嘉基金销售有限公司

注册地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城（一期）第 7 栋 23 层 1 号、4 号

法定代表人：陶捷

联系人：杨帆

电话：027-87006003/87006009

网站：www.buyfunds.cn

公司传真：027-87006010

客户服务电话：400-027-9899

(74) 上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

法定代表人：郭坚

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

联系人：宁博宇

网站：www.lufunds.com

客户服务电话：4008219031

(75) 珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

法定代表人：肖雯

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203

联系人：黄敏嫦

网站：www.yingmi.cn

客户服务电话：020-89629066

(76) 奕丰金融服务（深圳）有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座 1115 室，1116 室及 1307 室

法定代表人： TAN YIK KUAN

联系人： 叶健

电话： 0755-89460507

传真： 0755-21674453

客户服务电话： 400-684-0500

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

(77) 深圳市金斧子投资咨询有限公司

注册地址： 深圳市南山区智慧广场第 A 栋 11 层 1101-1102

办公地址： 深圳市南山区科苑路 18 号东方科技大厦 18 楼

法定代表人： 陈姚坚

联系人： 张烨

电话： 0755-84034499

传真： 0755-84034477

客服电话： 400-950-0888

网址： <http://www.jfzinv.com>

(78) 北京蕙次方资产管理有限公司

注册地址： 北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

法定代表人： 钟斐斐

客服电话： 010-61840688

联系人： 袁永娇

电话： 010-61840688

传真： 010-61840699

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

(79) 徽商期货有限责任公司

注册地址： 合肥市芜湖路 258 号

法人代表人： 吴国华

联系人： 蔡芳

传真： 0551-62862801

客服电话： 4008878707

网址： <http://www.hsqh.net>

## 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 26 层

法定代表人：刘卓

电话：0755-83183388

传真：0755-83195229

联系人：范瑛

### （三）担保人

名称：深圳市高新投集团有限公司

住所：深圳市深南大道 7028 号时代科技大厦 22 层、23 层

办公地址：深圳市深南大道 7028 号时代科技大厦 22 层、23 层

法定代表人：陶军

电话：0755-82852588

传真：0755-82852555

联系人：史玉洁

### （四）律师事务所和经办律师

名称：北京市金杜律师事务所

注册地址：北京市朝阳区东三环中路 7 号财富中心写字楼 A 座 40 层

办公地址：北京市朝阳区东三环中路 7 号财富中心写字楼 A 座 40 层

负责人：王玲

电话：0755-22163333

传真：0755-22163390

经办律师：靳庆军、冯艾

联系人：冯艾

### （五）会计师事务所和经办注册会计师

名称：安永华明会计师事务所

住所：北京市东城区东长安街1 号东方广场安永大楼17层 01-12室

办公地址：北京市东城区东长安街1 号东方广场安永大楼17层01-12室

执行事务合伙人：吴港平

电话：（010）58153000、（0755）25028288

传真：（010）85188298、（0755）25026188

签章注册会计师：昌华、高鹤

联系人：昌华

## 第六部分 基金的存续

### （一）基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额

基金合同生效后，连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续六十个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

### （二）基金类型及存续期限

基金类型：保本混合型基金

基金运作方式：契约型开放式

基金存续期限：不定期

## 第七部分 基金份额的申购、赎回与转换

### （一）申购与赎回的场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书、基金份额发售公告或其他公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并予以公告。投资者可以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的申购与赎回。

### （二）申购与赎回办理的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

本基金的开放日为基金管理人公告开始办理申购、赎回业务后，上海证券交易所、深圳证券交易所同时开放交易的正常交易日，开放时间为上海证券交易所、深圳证券交易所交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公



告暂停申购、赎回时除外。具体业务办理时间以销售机构公布的时间为准。

若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整并公告。

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、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，视为下一个开放日的申请，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。

## 2、申购与赎回的开始日及业务办理时间

本基金已于 2015 年 7 月 2 日恢复日常申购、赎回、转换及定投业务。

### （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基金份额净值为基准进行计算；

2、基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、基金份额持有人在赎回基金份额时，基金管理人按后进先出的原则。即对该基金份额持有人在销售机构所持有的基金份额进行处理时，认、申购确认日期在前的基金份额后赎回，认、申购确认日期在后的基金份额先赎回，以确定所适用的赎回费率及适用保本条款的基金份额；

4、当日的申购与赎回申请可以在当日业务办理时间结束前撤销，在当日的业务办理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，但应在新的原则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

### （四）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内提出申购或赎回的申请。

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

基金管理人应以交易时间结束前受理申购或赎回申请的当日作为申购或赎回申请日（T 日），正常情况下，本基金注册登记机构在 T+1 日对基金投资者申购、赎回申请的有效

性进行确认。投资者在 T+2 日后（包括该日）可到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，依法对上述申购和赎回申请的确认时间进行调整，并必须在调整实施日前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案。

基金发售机构申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表发售机构确实接收到申购、赎回申请。申购、赎回的确认以基金注册登记机构或基金管理公司的确认结果为准。

### 3、申购与赎回申请的款项支付

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

投资者赎回申请成功后，基金管理人应通过注册登记机构按规定向投资者支付赎回款项，赎回款项在自受理基金投资者有效赎回申请之日起不超过 7 个工作日内划往投资者银行账户。在发生巨额赎回以及保本周期到期赎回的情形时，赎回款项的支付办法按基金合同和有关法律法规规定处理。

#### （五）申购与赎回的数额限制

1、本基金申购和赎回的数额限制由基金管理人确定并在招募说明书中列示。

2、基金管理人可根据市场情况，合理调整对申购金额和赎回份额的数量限制，基金管理人进行前述调整必须按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

#### （六）申购份额与赎回金额的计算方式

1、申购份额的计算方式：申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除申购费用后，以申请当日基金份额净值为基准计算，各计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后 2 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。

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中，

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

申购份数=净申购金额/T 日基金份额净值

2、赎回金额的计算方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以申请当日基金份额净值的金额，净赎回金额为赎回金额扣除赎回费用的金额，各计算结果均按照四舍五入方法，保留小数点后 2 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。

本基金的净赎回金额为赎回金额扣减赎回费用。其中，

赎回金额=赎回份数×T 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

保本周期到期日的赎回，按本基金保本周期到期条款执行。

#### （七）申购和赎回的费用及其用途

1、本基金申购费率最高不超过申购金额的 5%，赎回费率最高不超过赎回金额的 5%。

2、本基金申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定并在招募说明书中载明。

3、本基金的申购费用由申购人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，其中不低于 25%的部分归入基金财产（具体比例见招募说明书），其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

4、基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率和赎回费率。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

5、基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行相关手续并与相关代销机构协商一致后基金管理人可以适当调低基金申购费率、赎回费率和转换费率等。

6、保本周期到期后，本基金依据基金合同的有关约定可变更为“大成景恒稳健增长股票型证券投资基金”，或者转入下一保本周期。如变更为“大成景恒稳健增长股票型证券投资基金”，申购费率最高不超过 5%，赎回费率最高不超过 5%，具体以届时公告为准。

#### （八）申购与赎回的注册登记

1、投资者 T 日申购基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者增加权益并办理注册登记手续，投资者自 T+2 日起有权赎回该部分基金份额。

2、投资者 T 日赎回基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者扣除权益并办理相应的注册登记手续。

3、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并在开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

#### （九）巨额赎回的认定及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

单个开放日中，本基金的基金份额净赎回申请（赎回申请总份额扣除申购总份额后的余额）与净转出申请（转出申请总份额扣除转入申请总份额后的余额）之和超过上一日基金总份额的 10%，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资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，确定该基金份额持有人当日受理的赎回份额；未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，延迟至下一开放日办理，赎回价格为下一个开放日的价格。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权，以此类推，直到全部赎回为止。

（3）当发生巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或招募说明书规定的其他方式，在 3 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒体予以上公告。

（4）暂停接受和延缓支付：本基金连续 2 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，但延缓期限不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒体上公告。

#### （十）拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

- （1）因不可抗力导致基金管理人无法受理投资者的申购申请；
- （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）发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；

(4) 基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他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的情形；

(5) 保本周期到期前 6 个月内，基金管理人根据基金实际运作情况认为有必要暂停申购；

(6) 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；

(7) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时，申购款项将全额退回投资者账户。发生上述 (1) 到 (5) 项暂停申购情形，且基金管理人决定暂停接受申购申请时，应当依法公告。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并依法公告。

2、在以下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请：

(1) 因不可抗力导致基金管理人无法支付赎回款项；

(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 2 个或 2 个以上开放日巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；

(4) 发生基金合同规定的暂停基金资产估值的情况；

(5) 发生基金合同第十五部分“保本周期到期”中约定的情况，即基金管理人可在保本周期到期前 30 个工作日内视情况暂停本基金的日常赎回业务（含转换转出业务）；

(6) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停赎回或者延缓支付赎回款项的，基金管理人应当在当日向中国证监会备案，并及时公告。已接受的赎回申请，基金管理人应当足额支付；如暂时不能足额支付，应当按单个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受的赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分在后续开放日予以支付。

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并依法公告。

3、暂停基金的申购、赎回，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

4、暂停申购或赎回期间结束，基金重新开放时，基金管理人应依法公告并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。

(1) 如果发生暂停的时间为一天，基金管理人将于重新开放日，在指定媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公告最近一个开放日的基金份额净值；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

(2) 如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人将依照《信息披露办法》的有关规定在指定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近一个开放日的基金份额净值；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

(3) 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；当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定在指定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近一个开放日的基金份额净值。

#### (十一) 过渡期申购

1、基金管理人应在当期保本周期到期前公告处理规则，允许投资人在下一保本周期开始前的过渡期限定期限内申请购买本基金基金份额，投资人在上述期限内申请购买本基金基金份额的行为称为“过渡期申购”。在过渡期内，投资者转换转入本基金基金份额，视同为过渡期申购。投资人在过渡期的限定期限内申购本基金的，按其申购的基金份额在下一保本周期开始前的折算日所代表的资产净值和过渡期申购的费用确认下一保本周期的保本金额并适用下一保本周期的保本条款。

2、基金管理人在当期保本周期到期前，将根据担保人提供的下一保本周期担保额度确定并公告下一保本周期的担保规模上限，规模控制的具体方案详见当期保本周期到期前公告的处理规则。

#### (十二) 转入第二保本周期相关规则

鉴于本基金管理人已与深圳市高新投集团有限公司（以下简称“高新投”）就本基金第二个保本周期的保本事宜达成一致，由高新投为本基金进入第二个保本周期的运作提供保本保证，并签订了《保证合同》，本基金符合《基金合同》规定的保本基金存续的条件，本基金将转入第二个保本周期。为保证本基金第一个保本周期到期操作和转入第二个保本周期相关工作的顺利进行，现将本基金第一个保本周期到期操作规则及转入第二个保本周期的相关规则公告如下：

##### 一、第一个保本运作期到期操作及转入第二个保本周期的总体时间安排

本基金第一个保本周期到期后的过渡期为2015年6月15日（含）至2015年6月23日（含）。其中2015年6月15日（含）至2015年6月19日（含）为保本周期到期期间。2015年6月23日

为过渡期申购日。2015年6月23日为基金份额折算日，折算后基金份额净值调整为1.00元。基金份额折算日的下一个工作日为第二个保本周期的起始日，保本周期三年，第二个保本周期自2015年6月24日起至3个公历年后对应日止，如果该对应日为非工作日，则保本周期到期日顺延至下一个工作日。

## 二、到期操作的规则

### （一）到期操作的形式

1、在本基金的保本周期到期期间，基金份额持有人可以将持有的部分基金份额或全部基金份额做出如下选择：

（1）在到期期间内赎回持有到期的基金份额；

（2）在到期期间内将持有到期的基金份额转换为基金管理人管理的、已公告开放转换转入的其他基金；

（3）将持有的基金份额转入下一保本周期。

2、基金份额持有人应将其持有的部分基金份额或全部基金份额选择上述三种处理方式之一。

3、保本周期到期后，如基金份额持有人没有作出到期选择，本基金转入第二个保本周期，则基金份额持有人默认方式为转入第二个保本周期，基金份额持有人进行到期操作的截止日期为到本基金的到期期间的最后一个工作日。

### （十三）、第二个保本周期的保本和担保

本基金第二个保本周期的起始日为2015年6月24日，保本周期为3年，保本周期自第二个保本周期的起始日至3个公历年后对应日止。如果该对应日为非工作日，保本周期到期日顺延至下一个工作日。

#### （一）保本

在保本周期到期日，如基金份额持有人过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额的可赎回金额加上其过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额在当期保本周期内的累计分红款项之和低于其过渡期申购保本金额、或从上一保本周期转入当期保本周期的基金份额的保本金额，则基金管理人应补足该差额（即保本赔付差额），并在保本周期到期日后二十个工作日内（含第二十个工作日，下同）将该差额支付给基金份额持有人，担保人对此提供不可撤销的连带责任保证。

过渡期申购保本金额 = 基金持有人过渡期申购并持有到期的基金份额的投资金额，即基金份额持有人在过渡期内进行申购（含转换转入）并持有到期的基金份额在折算日所代

表的资产净值及过渡期申购费用之和。

从上一保本周期转入当期保本周期的基金份额的保本金额 = 基金份额持有人将其上一保本周期持有的基金份额转入当期保本周期并持有到期的，其基金份额在折算日所代表的资产净值。

## （二）适用保本条款的情形

1、基金份额持有人过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额；

2、对于过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的份额，基金份额持有人无论选择赎回、转换到基金管理人管理的其他基金、本基金转入下一保本周期或是转型为“大成景恒稳健增长股票型证券投资基金”，在当期保本周期都同样适用保本条款。

## （三）不适用保本条款的情形

1、在保本周期到期日，按基金份额持有人过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上其过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额在当期保本周期内的累计分红款项之和计算的总金额不低于其过渡期申购保本金额、或从上一保本周期转入当期保本周期的基金份额的保本金额；

2、基金份额持有人过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期，但在基金当期保本周期到期日前（不包括该日）赎回或转换出的基金份额；

3、基金份额持有人在保本周期内申购或转换转入的基金份额；

4、在保本周期内发生本合同规定的基金合同终止或与其他基金合并的情形；

5、在保本周期到期日之后（不包括该日）基金份额发生的任何形式的净值减少；

6、在保本周期内，基金更换基金管理人的，但担保人或保本义务人书面同意继续承担其相关保本保障责任的除外；

7、因不可抗力的原因导致基金投资亏损，或因不可抗力事件直接导致基金管理人无法按约定履行全部或部分义务或延迟履行义务的，或基金合同规定的其他情形基金管理人免于履行保本义务的。

## （四）基金保本的保证

1、担保人的保证范围

本基金第二个保本周期由深圳市高新投集团有限公司提供不可撤销的连带责任保证。



担保人承担保证责任的金额即保证范围为：对基金份额持有人过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额的保证范围为保本赔付差额，即在保本周期到期日基金份额持有人过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额的可赎回金额与相应基金份额的累计分红金额之和低于过渡期申购保本金额、或从上一保本周期转入当期保本周期的基金份额的保本金额的差额部分。

## 2、保证期间

保证期间为本基金第二个保本周期到期日起六个月。

## 3、除外责任

下列任一情形发生时，担保人不承担保证责任：

1、在保本周期到期日，按基金份额持有人过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额与保本周期到期日基金份额净值的乘积加上其过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额累计分红款项之和计算的总金额不低于保本金额的；

2、基金份额持有人过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期，但在基金保本周期到期日前（不包括该日）赎回或转换出本基金的基金份额；

3、基金份额持有人在本保本周期内申购或转换转入的基金份额；

4、在保本周期内发生基金合同规定的基金合同终止的情形；

5、在保本周期内发生本基金与其他基金合并或更换基金管理人的情形，且担保人不同意继续承担保证责任；

6、在保本周期到期日之后（不包括该日），基金份额发生的任何形式的净值减少；

7、因不可抗力的原因导致基金投资亏损，或因不可抗力事件直接导致基金管理人无法按约定履行全部或部分义务或延迟履行义务的，或基金合同规定的其他情形基金管理人免于履行保本义务的；

8、未经担保人书面同意修改基金合同条款，可能加重担保人保证责任的，但根据法律法规要求进行修改的除外。

## （十四）第二个保本周期的赎回费率

自第二个保本周期起，本基金的赎回费率调整为：

持有基金时间（T）	赎回费率
T<7 天	1.5%
7 天≤T<30 天	0.75%

30 天 $\leq$ T<6 个月	0.5 %
6 个月 $\leq$ T<1 年	0.1%
1 年 $\leq$ T<2 年	0.05%
T $\geq$ 2 年	0%
注：1 年指 365 天	

本基金对持续持有基金份额少于 30 日的投资人收取的赎回费，将全额计入基金财产；对持续持有基金份额长于 30 日但少于 3 个月的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 75% 计入基金财产；对持续持有基金份额长于 3 个月但少于 6 个月的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 50% 计入基金财产；对持续持有基金份额长于 6 个月的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 25% 归入基金财产。未计入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

本基金进入第二个保本周期后，基金份额持有人的持有期连续计算，基金份额持有期以注册登记机构记录为准。

#### （十五）重要提示

1、本次到期期间，本基金开放赎回和转出业务，但不开通申购和转入业务；过渡期申购期间，本基金开放申购和转入业务，但不开放赎回和转出业务。

2、保本周期到期操作期间，选择到期操作的基金份额持有人将自行承担保本到期日（不含当日）至实际操作日的基金份额净值波动风险。

3、自本基金第二个保本周期开始后，本基金管理人将暂停本基金的日常申购和赎回业务，其中赎回业务的暂停期限最长不超过 3 个月，具体恢复赎回的日期由基金管理人根据基金实际运作情况决定并在开始日前依照《信息披露办法》的有关规定在至少一家指定媒体上公告。

4、基金管理人可以在不违背法律法规规定和基金合同约定的情形下对已在本公司直销中心办理账户认证手续并通过本公司直销中心申购基金的养老金账户进行申购费率优惠。养老金账户，包括养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金，包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，本公司将依据规定将其纳入养老金账户范围。养老金账户申购费率优惠的详细实施情况，请见基金管理人发布的相关业务公告。

## 第八部分、基金的转换、转托管、定期定额投资计划、非交易过户、冻结与质押

### （一）基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定，在条件成熟的情况下提供本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换服务。基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告。

### （二）转托管

基金份额持有人可以办理其基金份额在不同销售机构的转托管手续，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。转托管在转出方进行申报，基金份额转托管一次完成。投资者于 T 日转托管基金份额成功后，转托管份额于 T+1 日到达转入方网点，投资者可于 T+2 日起赎回该部分基金份额。

### （三）定期定额投资计划

基金管理人可以为投资者办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。

### （四）基金的非交易过户

基金注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中：

“继承”指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；

“捐赠”仅指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；

“司法强制执行”是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。

办理非交易过户业务必须提供基金注册登记机构规定的相关资料，申请人按基金注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。

### （五）基金的冻结与解冻

基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金账户或基金份额的冻结与解冻。基金账户或基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益（包括现金分红和红利再投资）一并冻结。

### （六）基金的质押

如相关法律法规允许基金管理人办理基金份额的质押业务或其他基金业务，基金管理人将制定和实施相应的业务规则。

## 第九部分 基金的保本

### （一）保本

本基金第二个保本周期及以后各保本周期到期日，如基金份额持有人过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额的可赎回金额加上其过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额在当期保本周期内的累计分红款项之和低于其过渡期申购保本金额、或从上一保本周期转入当期保本周期的基金份额的保本金额，由当期有效的基金合同、保证合同或风险买断合同约定的基金管理人或保本义务人将该差额支付给基金份额持有人。基金份额持有人在保本周期内申购、转换转入，或在当期保本周期到期日前赎回或转换转出的基金份额不适用本条款。

过渡期申购保本金额 = 基金持有人过渡期申购并持有到期的基金份额的投资金额，即基金份额持有人在过渡期内进行申购（含转换转入）并持有到期的基金份额在折算日所代表的资产净值及过渡期申购费用之和。

从上一保本周期转入当期保本周期的基金份额的保本金额 = 基金份额持有人将其上一保本周期持有的基金份额转入当期保本周期并持有到期的，其基金份额在折算日所代表的资产净值。

对于基金持有人多次申购、赎回的情况，以后进先出的原则确定持有到期的基金份额。

### （二）保本周期

三年。本基金第二个保本周期及以后的各保本周期自基金管理人公告的保本周期起始日起至三个公历年后对应日止，如该对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日。基金管理人将在保本周期到期前公告的到期处理规则中确定下一个保本周期的起始日。

### （三）适用保本条款的情形

1、基金份额持有人过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额；

2、对于过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的份额，基金份额持有人无论选择赎回、转换到基金管理人管理的其他基金、本基金转入下一保本周期或是转型为“大成景恒稳健增长股票型证券投资基金”，在当期保本周期都同样适用保本条款。

#### （四）不适用保本条款的情形

1、在保本周期到期日，按基金份额持有人过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上其或过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额在当期保本周期内的累计分红款项之和计算的总金额不低于其或过渡期申购保本金额、或从上一保本周期转入当期保本周期的基金份额的保本金额；

2、基金份额持有人过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期，但在基金当期保本周期到期日前（不包括该日）赎回或转换出的基金份额；

3、基金份额持有人在保本周期内申购或转换转入的基金份额；

4、在保本周期内发生本合同规定的基金合同终止或与其他基金合并的情形；

5、在保本周期到期日之后（不包括该日）基金份额发生的任何形式的净值减少；

6、在保本周期内，基金更换基金管理人的，但担保人或保本义务人书面同意继续承担其相关保本保障责任的除外；

7、因不可抗力的原因导致基金投资亏损，或因不可抗力事件直接导致基金管理人无法按约定履行全部或部分义务或延迟履行义务的，或基金合同规定的其他情形基金管理人免于履行保本义务的。

## 第十部分 基金保本的保证

（一）为确保履行保本条款，保障基金份额持有人利益，本基金的第二个保本周期由深圳市高新投集团有限公司作为担保人。本节以下内容为本基金第二个保本周期基金保本的保证的相关约定，之后保本周期相关内容详见届时公告及相关保证合同或风险买断合同。

### 1、担保人的基本情况

名称：深圳市高新投集团有限公司

住所：深圳市深南大道 7028 号时代科技大厦 22 层、23 层

办公地址：深圳市深南大道 7028 号时代科技大厦 22 层、23 层

法定代表人：陶军

成立日期：1994 年 12 月 29 日

组织形式：有限责任公司

注册资本：22 亿元人民币

经营范围：从事担保业务；投资开发，信息咨询；贷款担保；自有物业租赁。

深圳市高新投集团有限公司成立于1994年12月，是国内最早设立的专业担保机构之一。集团注册资本22亿元人民币，股东为深圳市投资控股有限公司、深圳市财政金融服务中心、深圳市远致投资有限公司和深圳市中小企业服务中心，核心业务：保证担保、融资担保、创业投资；最近三年未受过重大处罚；财务状况良好，最近三年连续盈利。

## 2、担保人资产与对外承担保证或偿付责任的情况

截至2014年12月31日，深圳市高新投集团有限公司的总资产规模为48.5亿元人民币，其中保本基金资产规模为16.53亿元人民币。

（二）担保人与基金管理人签署保证合同。保证合同的具体内容见本合同附件：《大成景恒保本混合型证券投资基金基金保证合同》，担保人的保证责任以保证合同为准。基金管理人应当保证基金合同中相关内容的约定与保证合同的约定相符。

本基金保本由担保人提供不可撤销的连带责任保证；对基金份额持有人过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额的保证范围为保本赔付差额，即在保本周期到期日基金份额持有人过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额的可赎回金额与相应基金份额的累计分红金额之和低于过渡期申购保本金额、或从上一保本周期转入当期保本周期的基金份额的保本金额的差额部分。

保证期间为：基金保本周期到期日起 6 个月止。

担保人承担保证责任的总金额最高不超过按第二个保本周期开始前的折算日确认的基金份额所计算的过渡期申购保本金额、或从上一保本周期转入当期保本周期的基金份额的保本金额。

（三）保本周期内，担保人出现足以影响其履行保证合同项下保证责任能力情形的，应在该情形发生之日起 3 个工作日内通知基金管理人以及基金托管人。基金管理人在接到通知之日起 3 个工作日内应将上述情况报告中国证监会并提出处理办法，并在接到通知之日起 3 个工作日内在指定媒体上公告上述情形。当确定担保人已丧失履行保证合同项下保证责任能力或宣告破产的情况下，基金管理人应召集基金份额持有人大会。

(四) 保本周期内更换担保人必须经基金份额持有人大会决议通过，并且担保人的更换必须符合基金份额持有人的利益。更换担保人的，原担保人承担的所有与本基金保证责任相关的权利义务由继任的担保人承担。在新的担保人接任之前，原担保人应继续承担保证责任。

(五) 基金管理人代表基金向担保人通知履行保证责任，并办理相关的手续(包括但不限于：向担保人发送《履行保证责任通知书》以及代收相关款项等)。如果保本周期到期日基金份额持有人过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额的可赎回金额与相应基金份额的累计分红金额之和低于过渡期申购保本金额、或从上一保本周期转入当期保本周期的基金份额的保本金额（差额部分即为“保本赔付差额”），且基金管理人无法全额履行保本义务的，基金管理人应按本合同的约定在保本周期到期日后5个工作日内，向担保人发出书面《履行保证责任通知书》。担保人应在收到基金管理人发出的《履行保证责任通知书》后的5个工作日内，将需代偿的金额划入基金管理人指定的本基金在基金托管人处开立的托管账户中，由基金管理人将保本赔付差额支付给基金份额持有人。

担保人将代偿金额全额划入基金管理人指定的本基金在基金托管人处开立的托管账户中后即全部履行了保证责任，担保人无须对基金份额持有人逐一进行清偿。代偿款的分配与支付由基金管理人负责，担保人对此不承担责任。如保本周期到期后10个工作日内相应款项仍未到账，基金管理人应当履行催付职责。基金管理人及担保人未履行《基金合同》及《保证合同》中约定的保本义务及保证责任的，自保本周期到期后第21个工作日起，基金份额持有人可以根据《基金合同》第二十八部分“争议的处理”约定，直接向基金管理人或担保人请求解决保本赔付差额支付事宜，但基金份额持有人直接向担保人追偿的，仅得在保证期间内提出。

(六) 基金管理人有权要求担保人按照本合同及保证合同的约定履行保证责任。除本部分第四条所指的“更换担保人的，原担保人承担的所有与本基金保证责任相关的权利义务由继任的担保人承担”及本部分第六条约定的情形外，担保人不得免除保证责任。

下列任一情形发生时，担保人不承担保证责任：

1、在保本周期到期日，按基金份额持有人过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额与保本周期到期日基金份额净值的乘积加上其过渡期申购、

或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额累计分红款项之和计算的总金额不低于保本金额的；

2、基金份额持有人过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期，但在基金保本周期到期日前（不包括该日）赎回或转换出本基金的基金份额；

3、基金份额持有人在本保本周期内申购或转换转入的基金份额；

4、在保本周期内发生基金合同规定的基金合同终止的情形；

5、在保本周期内发生本基金与其他基金合并或更换基金管理人的情形，且担保人不同意继续承担保证责任；

6、在保本周期到期日之后（不包括该日），基金份额发生的任何形式的净值减少；

7、因不可抗力的原因导致基金投资亏损，或因不可抗力事件直接导致基金管理人无法按约定履行全部或部分义务或延迟履行义务的，或基金合同规定的其他情形基金管理人免于履行保本义务的；

8、未经担保人书面同意修改基金合同条款，可能加重担保人保证责任的，但根据法律法规要求进行修改的除外。

（七）保本周期届满时，基金管理人认可的机构继续为本基金的保本提供不可撤销的连带责任保证或者承诺提供保本，同时本基金满足法律法规和基金合同规定的基金存续要求的，本基金将转入下一保本周期；若本基金保本周期内的担保人承诺继续对下一保本周期提供保证的，该担保人应与基金管理人另行签署保证合同。否则，本基金变更为非保本的股票型基金，基金名称相应变更为“大成景恒稳健增长股票型证券投资基金”，担保人不再为该股票型基金承担保证责任。

（八）保证费用由基金管理人按基金资产净值 0.18% 的年费率从基金管理费收入中列支，按月支付。

担保费计算方式：每日担保费=前一日基金资产净值×0.18%÷当年实际天数



担保费计算期间自《基金合同》生效之日起，至担保人解除保证责任之日或保本周期到期日较早者止，起始日及终止日均应计入期间。

担保费从基金管理人收取的本基金管理费中列支，按公式每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。基金管理人应于每月收到基金管理费之后的五个工作日内向担保人支付担保费。

#### （九）追偿权、追偿程序和还款方式

1、担保人履行了保证责任后，即有权要求基金管理人归还担保人为履行保证责任支付的全部款项（包括但不限于担保人按《履行保证责任通知书》所载金额支付的实际代偿款项、基金份额持有人直接向担保人要求代偿的金额、基金份额持有人通过召开基金份额持有人大会向担保人要求代偿的金额及担保人为履行保证责任支付的其他金额，前述款项重叠部分不重复计算）和自支付之日起的利息以及担保人的其他费用和损失，包括但不限于担保人为代偿追偿产生的律师费、调查取证费、诉讼费、保全费、评估费、拍卖费、公证费、差旅费、抵押物或质押物的处置费等。

2、基金管理人应自担保人履行保证责任之日起一个月内，向担保人提交担保人认可的还款计划，在还款计划中载明还款时间、还款方式，并按担保人认可的还款计划归还担保人为履行保证责任支付的全部款项和自支付之日起的利息以及担保人的其他费用和损失。基金管理人未能按本条约定提交担保人认可的还款计划，或未按还款计划履行还款义务的，担保人有权要求基金管理人立即支付上述款项及其他费用，并赔偿给担保人造成的损失。

上述保证合同的全文详见基金合同的附件。基金份额持有人购买基金份额的行为视为同意和接受上述保证合同的主要内容及保证合同的约定。

在本基金第一个保本周期结束后，基金管理人将根据第一个保本周期结束后各保本周期的保本保障机制、保证人或保本义务人情况和届时签署的保证合同或风险买断合同，披露各保本周期的保证合同或风险买断合同的主要内容及全文。保证人或保本义务人承诺继续对下一个保本周期提供担保或担任保本义务人的，与基金管理人另行签署保证合同或风险买断合同。基金份额持有人购买基金份额的行为视为同意和接受届时按基金合同约定披露的有效保证合同或风险买断合同的约定。

(十) 基金管理人应在指定媒体上公告双方签署的保证合同。

(十一) 保证合同项下的任何权利、利益和收益均不得转让。

## 第十一部分 保本周期到期

### (一) 保本周期到期后基金的存续形式

保本周期届满时，在符合法律法规有关担保人、或保本义务人资质要求、并经基金管理人和基金托管人认可的担保人、或保本义务人同意为下一个保本周期提供保本保障，与本基金管理人签订保证合同或风险买断合同，同时本基金满足法律法规和本合同规定的基金存续要求的情况下，本基金继续存续并进入下一保本周期，下一保本周期的具体起讫日期以本基金管理人届时公告为准。

如保本周期到期后，本基金未能符合上述保本基金存续条件，则本基金将按基金合同的约定，变更为“大成景恒稳健增长股票型证券投资基金”。同时，基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等相关内容也将根据基金合同的相关约定作相应修改。上述变更无须经基金份额持有人大会决议，在基金管理人与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后，提前在临时公告或《大成景恒稳健增长股票型证券投资基金招募说明书》中予以说明。

如果本基金不符合法律法规和基金合同对基金的存续要求，则本基金将根据基金合同的约定终止。

### (二) 保本周期到期的处理规则

1、到期期间是指基金管理人在保本周期到期日前公告指定的一个期间。如本基金转入下一保本周期，则到期期间为基金管理人公告指定的过渡期内的一个期限，加上保本周期到期日在内的一段期间，该期间为五个工作日（自保本周期到期日开始计算）；如本基金变更为“大成景恒稳健增长股票型证券投资基金”，则到期期间为保本周期到期日。

本基金保本周期到期前，基金管理人将提前公告到期期间的具体起止时间，并提示基金份额持有人在此期间内作出到期选择。

2、在基金管理人指定的到期期间内，基金份额持有人可以做出如下选择：

- (1) 在到期期间内赎回持有到期的基金份额；
- (2) 在到期期间内将持有到期的基金份额转换为基金管理人管理的、已公告开放转换转入的其他基金；
- (3) 本基金符合保本基金存续条件，将持有的基金份额根据届时基金管理人的公告转入下一保本周期；
- (4) 本基金不符合保本基金存续条件，继续持有变更后的“大成景恒稳健增长股票型证券投资基金”的基金份额。

3、基金份额持有人可将其持有的所有基金份额选择上述四种处理方式之一，也可以部分选择赎回、转换转出、转入下一保本周期或继续持有变更后基金的基金份额。

4、无论持有人采取何种方式作出到期选择，均无需就其过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额在到期期间的赎回和转换支付赎回费用和转换费用（包括转出基金的赎回费用和转入基金的申购费补差，下同）等交易费用。转换为基金管理人管理的其他基金或转为“大成景恒稳健增长股票型证券投资基金”后的其他费用，适用其所转入基金的费用、费率体系。

5、若基金份额持有人未在到期期间内作出到期选择且本基金符合保本基金存续条件，则基金管理人将默认基金份额持有人继续持有本基金基金份额；若基金份额持有人未在到期期间内作出到期选择且本基金不符合保本基金存续条件，则基金管理人将默认基金份额持有人选择了继续持有变更后的“大成景恒稳健增长股票型证券投资基金”的基金份额。

6、在到期期间内（除保本周期到期日），基金份额持有人将所持有的基金份额进行赎回或转换转出时，将自行承担保本周期到期日后（不含保本周期到期日）至赎回或转换出的实际操作日（含该日）的基金份额净值波动的风险。

### （三）保本周期到期的公告

1、保本周期届满时，在符合保本基金存续条件下，本基金将继续存续。基金管理人应依照相关法律法规的规定就本基金继续存续、到期赎回或转换的到期期间以及为下一保本周期开放申购的期限等的相关事宜进行公告。

2、保本周期届满时，在不符合保本基金存续条件下，本基金将变更为“大成景恒稳健增长股票型证券投资基金”，基金管理人将在临时公告或“大成景恒稳健增长股票型证券

投资基金”的招募说明书中公告相关规则。

3、在保本周期到期前，基金管理人还将进行提示性公告。

#### （四）保本周期到期的保本条款

1、过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额持有人，无论选择赎回、转换到基金管理人管理的其他基金、还是转入下一保本周期或继续持有变更后的“大成景恒稳健增长股票型证券投资基金”的基金份额，其过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额都适用保本条款。

2、本基金第二个保本周期及以后的各保本周期，若基金份额持有人选择赎回持有到期的基金份额，持有到期的基金份额的可赎回金额加上相应的基金份额在当期保本周期内的累计分红款项低于其保本金额，基金管理人将赎回当日基金份额对应的资产净值总额支付给投资者，并由当期有效的基金合同、保证合同或风险买断合同约定的基金管理人或保本义务人补足持有到期的基金份额的保本赔付差额。

3、本基金第二个保本周期及以后的各保本周期，若基金份额持有人选择在持有到期后进行基金转换，而持有到期的基金份额的可赎回金额加上相应的基金份额在当期保本周期内的累计分红款项低于其保本金额，基金管理人将转换当日基金份额对应的资产净值总额作为转出金额，并由当期有效的基金合同、保证合同或风险买断合同约定的基金管理人或保本义务人补足持有到期的基金份额的保本赔付差额。

4、本基金第二个保本周期及以后的各保本周期，若基金份额持有人在持有到期后选择继续持有进入下一保本周期的基金份额，而持有到期的基金份额的可赎回金额加上相应的基金份额在当期保本周期内的累计分红款项低于其保本金额，基金管理人将折算日基金份额对应的资产净值总额作为转入下一保本周期的转入金额，并由当期有效的基金合同、保证合同或风险买断合同约定的基金管理人或保本义务人补足持有到期的基金份额的保本赔付差额。

5、本基金第二个保本周期及以后的各保本周期，若基金份额持有人在持有到期后选择继续持有变更后的“大成景恒稳健增长股票型证券投资基金”的基金份额，而持有到期的基金份额的可赎回金额加上相应的基金份额在当期保本周期内的累计分红款项低于其保本金额，基金管理人将持有到期的基金份额的可赎回金额作为转入变更后的“大成景恒稳健增长股票型证券投资基金”的转入金额，并由当期有效的基金合同、保证合同或风险买断合同约定的基金管理人或保本义务人补足持有到期的基金份额的保本赔付差额。

## （五）保本周期到期的赔付

### 1、第二个保本周期到期的赔付

（1）在发生保本赔付的情况下，基金管理人在保本周期到期日后 20 个工作日内向基金份额持有人履行保本赔付差额的支付义务；基金管理人不能全额履行保本赔付差额支付义务的，基金管理人应于保本周期到期日后 5 个工作日内向担保人发出书面《履行保证责任通知书》。担保人应在收到基金管理人发出的《履行保证责任通知书》后的 5 个工作日内，将需代偿的金额划入基金管理人指定的本基金在基金托管人处开立的托管账户中。

（2）基金管理人应及时查收资金是否到账。如保本周期到期后 10 个工作日内相应款项仍未到账，基金管理人应当履行催付职责。资金到账后，基金管理人应按照《基金合同》的约定进行分配和支付。

（3）发生赔付的具体操作细则由基金管理人提前公告。

2、本基金第二个保本周期后各保本周期到期的赔付事宜，由基金管理人届时进行公告。

## （六）转入下一保本周期的处理规则

1、过渡期是指当期保本周期结束后（不含当期保本周期到期日）至下一保本周期起始日之前不超过 30 个自然日的一段期间，具体日期由基金管理人在当期保本周期到期前公告的到期处理规则中确定。

### 2、过渡期运作的相关规定

（1）在过渡期内，除暂时无法变现的基金财产外，基金管理人应使基金财产保持为现金形式，基金管理人和基金托管人在过渡期内免收基金管理费和基金托管费，过渡期内的基金收益归基金份额持有人所有。

（2）基金管理人将依照基金合同第二十部分“基金资产的估值”，在过渡期内对本基金进行每日估值并公告。

（3）基金管理人应在当期保本周期到期前公告处理规则，允许投资人在过渡期的限定期限内申请购买本基金基金份额，投资人在上述期限内申请购买本基金基金份额的行为称为“过渡期申购”。在过渡期内，投资者转换转入本基金基金份额，视同为过渡期申购。在此限定期限内，投资人可按申购当日基金份额净值计算申购份额，适用的申购费率以届时公布的更新的招募说明书为准。

基金管理人将根据担保人或保本义务人提供的下一保本周期保证额度或保本偿付额度确定并公告本基金过渡期申购规模上限以及规模控制的办法。

(4) 折算日为本基金第一个保本周期后各保本周期起始日的前一工作日（即过渡期最后一个工作日）。折算日时，基金管理人将对基金份额持有人所持有的基金份额，以折算日的基金份额净值为基础，在其持有的基金份额所代表的资产净值总额保持不变的前提下，变更登记为基金份额净值为 1.00 元的基金份额，基金份额数按折算比例相应调整。

3、自折算日的下一个工作日开始，本基金转入下一保本周期。基金管理人以过渡期申购、或从上一保本周期转入的基金份额在折算日所代表的资产净值，确定为本基金转入下一保本周期时的基金资产。

4、对于过渡期申购、或从上一保本周期转入的基金份额，分别按其在折算日所代表的资产净值及过渡期申购的费用之和、或折算日所代表的资产净值，确认下一保本周期的保本金额并适用下一保本周期的保本条款。

5、对于过渡期申购或从上一保本周期转入的基金份额，投资人将自行承担过渡期申购或从上一保本周期转入实际工作日至折算日（含该日）的基金份额净值波动的风险。

(七) 转为变更后的“大成景恒稳健增长股票型证券投资基金”的资产的形成

保本周期届满时，若本基金依据基金合同的约定转为变更后的“大成景恒稳健增长股票型证券投资基金”：

1、在保本周期到期日，基金管理人以保本周期到期日的基金份额净值与基金份额的乘积，确定为本基金变更为“大成景恒稳健增长股票型证券投资基金”的基金资产。

2、变更后的“大成景恒稳健增长股票型证券投资基金”申购的具体操作办法由基金管理人提前公告。

## 第十二部分 基金的投资

### 一、保本周期的投资

#### 1、投资目标

本基金通过运用组合保险策略，在为符合保本条件的投资金额提供保本保障的基础上，追求基金资产的长期增值。

#### 2、投资范围

本基金投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包含国债、金融债、企业债、公司债、债券回购、央行票据、中期票据、可转换债券、可分离交易债券、短期融资券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具）、银行存款、资产支持证券、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金投资组合的资产配置范围为：股票、权证、股指期货等风险资产占基金资产的比例为 0%—40%，其中权证不超过基金资产净值的 3%；债券、银行存款、货币市场工具等安全资产占基金资产的比例为 60%—100%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）不超过基金资产的 40%。

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

### 3、投资理念

严格风险控制，追求稳健收益。

### 4、投资策略

#### （1）类属资产配置策略

本基金投资采用 VPPI 可变组合保险策略（Variable Proportion Portfolio Insurance）。VPPI 策略是国际投资管理领域中一种常见的投资组合保险机制，将基金资产动态优化分配在保本资产和风险资产上；并根据数量分析、市场波动等来调整、修正风险资产与保本资产在投资组合中的比重，在大概率保证风险资产可能的损失金额不超过扣除相关费用后的安全垫的基础上，积极参与分享市场可能出现的风险收益，从而在保证本金安全的前提下实现基金资产长期稳定增值。保本资产主要包括货币市场工具和债券等低风险资产，其中债券包括国债、金融债、企业债、公司债、债券回购、央行票据、中期票据、可转换债券、可分离交易债券、短期融资券、银行存款、资产支持证券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具；风险资产主要包括股票、股指期货、权证等高风险资产。因此，本基金资产配置策略分为通过 VPPI 将基金资产在保本资产和风险资产上的大类资产配置和风险资产下的各子类资产配置的两个层次：

#### 1) VPPI 将基金资产在保本资产和风险资产上的大类资产配置

第一，根据本基金保本周期到期时的最低目标价值和合理的折现率确定当前应持有的

保本资产的价值，即确定组合的价值底线：

第二，计算组合的现时价值超过价值底线的数额，即安全垫（cushion），安全垫提供了风险资产最大损失的边界；

第三，本基金主要根据市场中长期趋势的判断、数量化研究等来确定安全垫的放大倍数，并将相当于安全垫特定倍数的资金投资于风险资产，以创造高于价值底线的收益，其余资产则投资于保本资产上。

## 2) 风险资产下的各子类资产配置

本基金分析宏观经济分析、经济周期判断及其对于各类资产的影响，充分利用股票研究团队的研究成果，分析各类资产价值的变化趋势，配置和调整股票、股指期货、权证等各类风险资产投资比例。

举例说明 VPPI 策略：

假设基金合同生效日基金资产净值为 30 亿元，假定第一个保本周期三年无风险利率（年利率）为 3.30%，且保本周期内未进行分红：

则期初组合价值底线为  $3,000,000,000 \div (1+3.30\%)^3 = 2,721,574,894.98$ ，安全垫金额为  $3,000,000,000 - 2,721,574,894.98 = 278,425,105.02$  元，假设基金管理人根据数量分析、市场波动等确定放大倍数的阈值为 4，在不超过阈值的范围内基金经理根据市场中长期趋势的判断、数量化研究市场等确定初始放大倍数为 3，则期初本基金可投资于风险资产的金额为  $278,425,105.02 \times 3 = 835,275,315.06$  元投资于风险资产，剩余的  $3,000,000,000 - 835,275,315.06 = 2,164,724,684.94$  元投资于保本资产。

假设基金合同生效后的第 t 日，本基金资产净值为 3,300,000,000，组合价值底线变为 2,800,000,000，则安全垫金额为  $3,300,000,000 - 2,800,000,000 = 500,000,000$  元，在运作过程中，基金管理人根据数量分析、市场波动等对风险资产与保本资产的比例进行适时调整，本基金采用 VaR（在险价值，Value at Risk）方法方法作为杠杆系数及杠杆系数阈值设定的参考：

$$M_t = \frac{1}{R}$$

这里 R 为给定置信度下风险资产收益的 VaR 值，M<sub>t</sub> 表示放大倍数。假设置信度为 99%，则 R 表示一个比例，在调整周期内权益类资产的损失小于该比例的概率为 99%。假设参照上述计算方法计算得到的放大倍数 M<sub>t</sub> 的值为 2，则 t 日本基金风险资产为  $500,000,000 \times 2 = 1,000,000,000$  元，保本资产为



$3,300,000,000 - 1,000,000,000 = 2,300,000,000$  元。

假设第一个保本周期届满时，本基金基金资产净值为 40 亿元，此时组合价值底线为 30 亿元，安全垫为 10 亿元，本基金保本周期收益率为 33.33%，实现了保本目标。

## （2）股票投资策略

### 1) 行业配置

本基金注重对股市发展趋势的研究，根据行业发展规律和经济发展趋势，考虑外围国际市场联动关系，把握中国经济发展周期、经济发展方向和经济增长方式，通过剖析行业特征指标、行业竞争结构、行业盈利模式、行业景气度等综合判断行业投资价值，确定和动态调整各行业投资比例。

### 2) 个股选择

本基金认为具有稳定的盈利模式、持续良好的财务状况、领先的行业地位以及良好的治理结构等特征的上市公司在经济发展中会显现出良好的成长和盈利能力。这些企业能够充分自如应对市场竞争，并能获取持续优秀业绩回报。本基金股票资产将重点投资于具有持续成长潜力特征的企业，以获得超额回报。本基金主要考虑的指标包括：

- 上市公司是否有易于理解而且稳定的盈利模式；
- 财务状况是否良好；
- 上市公司的行业地位；
- 上市公司对上下游的定价能力；
- 上市公司是否具有持续管理优势；
- 上市公司是否具有持续技术竞争优势；
- 是否具有良好的治理结构。

本基金通过分散投资、组合投资和流动性管理，降低个股集中性风险和流动性风险。管理人在实际投资中兼顾股票组合的稳定性和收益性，选择具有足够的安全边际和高流动性的上市公司进入股票投资组合。

## （3）债券投资策略

本基金的可转债以外的债券组合根据投资策略分为被动组合投资策略和积极组合投资策略。

被动组合投资主要采取资产负债管理策略，将保本周期的投资者赎回视作基金负债，构建剩余期限与保本周期相匹配的债券作为被动式组合资产，主要按买入并持有方式操作，不排除在极端情况下转为现金。为规避利率风险，被动式组合资产在考虑交易成本以及久

期偏离度下，适时调整个券比例。

积极组合投资以长期利率趋势分析为基础，结合中短期的宏观经济、货币政策等研究和收益率分析，运用利率预期策略、债券互换策略，以及运用子弹式策略、两极策略、梯形策略等收益率曲线追踪策略，以获取适当超额收益，提高整体组合收益率。

可转换债券在分析基础股票的基本面、转债条款和市场面三方面因素的前提下，将敏感度指标（Delta、Vega 等）作为市场风险控制的主要技术指标，利用可转换债券溢价率来判断转债的股性，运用转换套利、溢折价、一级市场申购、纯债券价值及期权价值管理来积极投资，获取超额收益。

#### （4）股指期货投资策略

本基金将依据风险与收益相匹配的原则，有选择地投资于流动性好、交易活跃的期货合约。本基金将基于宏观经济研究、行业研究等方面的综合性分析预判股票市场走势；通过测量持有股票现货组合和期货指数的变动关系，确定现货组合系统性风险程度来决策股指期货持仓比例，在对市场充分研究的基础上来确定持仓方向：

1) 当本基金在充分研究的基础上认为未来股票市场将上涨，为规避踏空风险，减少等待成本，本基金将进行持有股指期货多头头寸锁定风险，即先买入股指期货，然后再逐步买入现货并平仓期货头寸；

2) 当本基金在充分研究的基础上认为未来股票市场将下跌，为规避系统性风险，增加收益，本基金将持有股指期货空头头寸，即多头持有股票头寸，同时卖空股指期货以对冲风险。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，采用科学定量方法确定最优期货合约数量和合理有效的展期策略谨慎投资，以降低投资组合的整体风险。

#### （5）权证投资策略

本基金将在控制投资风险和保障基金财产安全的前提下，对权证进行投资。权证投资策略主要包括以下几个方面：1) 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；2) 根据权证标的股票基本面的研究估值，结合权证理论价值进行权证趋势投资；3) 利用权证衍生工具的特性，通过权证与证券的组合投资，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、看跌保护组合策略等。

在法律法规或者监管机构允许的前提下，利用未来推出的金融衍生工具，增强收益，规避风险。

### 5、业绩比较基准

3 年期银行定期存款利率（税后）。3 年期银行定期存款利率（税后）指按照基金合同生效日或新的保本周期开始日中国人民银行公布并执行的同期金融机构人民币存款基准利率（按照四舍五入的方法保留到小数点后第 2 位，单位为百分数）计算的与当期保本周期同期限的税后收益率。

银行定期存款可以近似理解为保本定息产品。本基金是保本型基金产品，保本周期为 3 年。以 3 年期银行定期存款利率（税后）作为本基金的业绩比较基准，有助于投资者理性判断本基金产品的风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合本基金的业绩基准时，本基金可以在基金管理人与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

## 6、风险收益特征

本基金为保本混合型基金产品，属证券投资基金中的低风险收益品种。

二、变更后的大成景恒稳健增长股票型证券投资基金（以下简称本股票型基金）的投资

### 1、投资目标

本股票型基金将秉承价值投资的基本理念，依据宏观经济长期运行趋势和市场环境的变化预期，自上而下稳健配置资产，自下而上精选证券，有效分散风险，力争实现基金资产的长期稳定增长。

### 2、投资范围

本股票型基金投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包含国债、金融债、企业债、公司债、债券回购、央行票据、中期票据、可转换债券、可分离交易债券、短期融资券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具）、银行存款、资产支持证券、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本股票型基金投资组合的资产配置范围为：股票资产占基金资产的比例为 60%—95%；债券、资产支持证券、货币市场工具等固定收益类资产的投资比例范围为基金资产的 5%—40%；扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，

可以将其纳入投资范围。

### 3、投资理念

严格风险控制，追求稳健收益。

### 4、投资策略

本股票型基金以经风险调整后的收益最大化为目标，在合理运用金融工程技术的基础上，因时制宜，把握宏观经济和投资市场的长期变化趋势，根据经济周期和市场预期动态调整投资组合比例，自上而下配置资产，自下而上精选证券，有效分散风险，谋求基金资产长期稳定的增长。

#### （1）资产配置策略

本股票型基金通过对宏观经济长期运行状况及其政策动态、货币金融中期运行状况及其政策动态、证券市场短期运行状况及其政策动态等因素“自上而下”地进行定性和定量分析，评估各类资产的投资价值，研究各类资产价值的变化趋势，确定组合中股票、债券等各类资产的投资比例。其中，GDP 增速、上市公司总体盈利增长速度、债市和股市的预期收益率比较和利率水平等参考指标是确定大类资产配置比例的主要因素。

#### （2）股票投资策略

##### 1) 行业配置

本股票型基金根据行业发展规律和经济发展趋势，把握中国经济发展周期、经济发展方向和经济增长方式，考虑政府扶植重点产业政策，通过剖析行业特征指标、行业竞争结构、行业盈利模式、行业景气度等综合判断行业投资价值，确定和动态调整各行业投资比例。

##### 2) 个股选择

###### ①建立初选股票库

为控制风险，本股票型基金首先剔除存在重大违规嫌疑并被证券监管部门调查的公司、股价发生异常波动的公司，并在此基础上通过对于主营业务利润率、净资产收益率、主营业务收入增长率、净利润增长率等财务指标进行深入分析，评估企业盈利能力和发展能力，建立初选股票库。本股票型基金通过建立初选股票池，初步避免投资于具有较大风险的股票。

###### ②建立备选股票库

本股票型基金认为具有稳定的盈利模式、持续良好的财务状况、领先的行业地位以及良好的治理结构等特征的上市公司在经济发展中会显现出良好的成长和盈利能力。这些企

业能够充分自如应对市场竞争，并能获取持续优秀业绩回报。本股票型基金股票资产将重点投资于具有持续成长潜力特征的企业，以获得超额回报。本股票型基金在初选股票库的基础上，选择具有以下一项或多项指标的上市公司构建备选股票库：

- 上市公司是否有易于理解而且稳定的盈利模式；
- 财务状况是否良好；
- 上市公司的行业地位；
- 上市公司对上下游的定价能力；
- 上市公司是否具有持续管理优势；
- 上市公司是否具有持续技术竞争优势；
- 是否具有良好的治理结构。

### ③建立股票投资组合

本股票型基金通过分散投资、组合投资和流动性管理，降低个股集中性风险和流动性风险。管理人在实际投资中兼顾股票组合的稳定性和收益性，选择具有足够的安全边际和高流动性的上市公司进入股票投资组合。

### ④调整股票投资组合

股票投资组合建立后，本基金将动态跟踪经济发展、上市公司的盈利前景和估值水平等变化，适时调整，以不断优化投资组合。

## （3）债券投资策略

本股票型基金采取积极组合投资策略，力求在保证基金资产总体的安全性、流动性的基础上获取一定的稳定收益。

积极组合投资以长期利率趋势分析为基础，结合中短期的宏观经济、货币政策等研究和收益率分析，运用利率预期策略、债券互换策略，以及运用子弹式策略、两级策略、梯形策略等收益率曲线追踪策略，以获取适当超额收益，提高整体组合收益率。

可转换债券在分析基础股票的基本面、转债条款和市场面三方面因素的前提下，将敏感度指标（Delta 等）作为市场风险控制的主要技术指标，利用可转换债券溢价率来判断转债的股性，运用转换套利、溢折价管理、一级市场申购、纯债券价值及期权价值管理来积极投资，获取超额收益。

## （4）权证投资策略

本股票型基金在控制投资风险和保障基金财产安全的前提下，对权证进行投资。权证投资策略主要包括以下几个方面：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，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、买入跨式投资策略等。

在法律法规或者监管机构允许的前提下，利用未来推出的金融衍生工具，增强收益，规避风险。

#### （5）股指期货投资策略

本股票型基金投资股指期货将以投资组合避险和有效管理为目的，通过套期保值策略，对冲系统性风险，应对组合构建与调整中的流动性风险，力求风险收益的优化。

套期保值实质上是利用股指期货多空双向和杠杆放大的交易功能，改变投资组合的  $\beta$ ，以达到适度增强收益或控制风险的目的。为此，套期保值策略分为多头套期保值和空头套期保值。多头保值策略是指基于股市将要上涨的预期或建仓要求，需要在未来买入现货股票，为了控制股票买入成本而预先买入股指期货合约的操作；空头套期保值是指卖出期货合约来对冲股市系统性风险，控制与回避持有股票的风险的操作。

基金管理人依据对股市未来趋势的研判、本基金的风险收益目标以及投资组合的构成，决定是否对现有股票组合进行套期保值以及采用何种套期保值策略。

在构建套期保值组合过程中，基金管理人通过对股票组合的结构分析，分离组合的系统性风险（ $\beta$ ）及非系统性风险。基金管理人将关注股票组合  $\beta$  值的易变性以及股指期货与指数之间基差波动对套期保值策略的干扰，通过大量数据分析与量化建模，确立最优套保比率。

在套期保值过程中，基金管理人将不断精细和不断修正套保策略，动态管理套期保值组合。主要工作包括，基于合理的保证金管理策略严格进行保证金管理；对投资组合  $\beta$  系数的实时监控，全程评估套期保值的效果和基差风险，当组合  $\beta$  值超过事先设定的  $\beta$  容忍度时，需要对套期保值组合进行及时调整；进行股指期货合约的提前平仓或展期决策管理。

#### 5、业绩比较基准

基金业绩比较基准为  $80\% \times$  沪深 300 指数  $+ 20\% \times$  中证综合债券指数。

本股票型基金选择市场认同度较高的沪深 300 指数作为本基金股票组合的业绩比较基准，选择用中证综合债券指数作为本基金债券组合的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准

推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

#### 6、风险收益特征

本股票型基金的预期风险与预期收益都要高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。

#### 三、投资决策依据

- 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证券市场的影响。
- 3、利率走势与通货膨胀预期。
- 4、地区及行业发展状况，市场波动和风险特征。
- 5、发债主体基本面研究和信用利差分析。
- 6、上市公司研究，包括上市公司成长性的研究和市场走势。
- 7、VPPI 策略确定的阈值要求。

#### 四、投资决策流程

本股票型基金采用投资决策委员会领导下的基金经理负责制。基金管理人选择具有丰富证券投资经验的人员担任基金经理。本基金的投资管理程序如下：

##### 1、研究员开展研究分析并撰写研究报告

研究员将广泛参考和利用公司外部研究成果，尤其是研究实力雄厚的证券经营机构提供的研究报告，并经常拜访国家有关部委，了解国家宏观经济政策及行业发展状况；走访调查发债主体、上市公司和信用评级机构；经过筛选、归纳、整理，定期撰写并向投资决策委员会和基金经理提供宏观经济分析报告、证券市场行情报告、行业分析报告和发债主体及上市公司研究报告。研究报告是投资决策委员会和基金经理进行投资决策的主要依据之一。

##### 2、投资决策委员会审议并决定基金的总体投资计划

投资决策委员会将定期分析宏观经济和投资研究团队所提供的研究报告，根据基金的投资目标、投资范围、投资策略及保本策略，确定基金的总体投资计划和大类资产配置建议。

##### 3、基金经理制定具体的投资组合方案

基金经理根据投资决策委员会确定的基金总体投资计划，结合本基金的投资目标、VPPI 保本策略确定的阈值要求及业绩比较基准，建立基金的投资组合。其中，重大单项投

资需经投资决策委员会审批。

#### 4、交易管理部独立执行投资交易指令

基金管理人设置独立的交易管理部，由基金经理向交易管理部下达具体交易指令。交易管理部接到基金经理的投资指令后，根据有关规定对投资指令的合规性、合理性和有效性进行检查，确保投资指令在合法、合规的前提下得到高效的执行。

#### 5、多部门多渠道实施投资风险监管

公司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。监察稽核部对投资执行过程进行日常监督，通过交易系统检查包括投资限制、投资权限等交易情况，风险管理部根据 VPPI 策略阈值监控风险资产的比例、投资集中度、投资组合比例等，并定期或不定期向投资决策委员会提出总结报告，使得投资决策委员会随时了解基金的风险水平以及是否符合既定的投资策略。

#### 6、风险管理部进行基金绩效评估

风险管理部定期向投资决策委员会提交基金绩效评估报告。基金经理根据投资决策委员会的意见对投资组合进行调整。

#### 7、投资管理程序的优化调整

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下，有权根据环境变化和实际需要对上述投资管理程序进行调整，并在招募说明书或其更新中予以公告。

### 五、投资禁止行为与限制

#### 1、禁止用本基金财产从事以下行为

- (1) 承销证券；
- (2) 向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- (5) 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- (6) 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、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、行政法规有关法律法规规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。



如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

## 2、基金投资组合比例限制

(1) 本基金投资组合中，股票、权证、股指期货等权益类资产占基金资产的比例为 0%—40%，其中权证不超过基金资产净值的 3%；债券、银行存款、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的比例为 60%—100%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）不超过基金资产的 40%；

(2) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的 10%；

(3) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%；

(4) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

(5) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(6) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；本基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定；

(7) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

(8) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

(9) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(10) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

(11) 本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(12) 本基金参与股指期货交易应当符合基金合同约定的保本策略和投资目标，且每日所持期货合约及有价证券的最大可能损失不得超过基金净资产扣除用于保本部分资产后

的余额；

(13) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定，履行适当程序后，本基金不受上述规定的限制。

3、变更后的大成景恒稳健增长股票型证券投资基金（以下简称本股票型基金）的投资组合限制

(1) 本股票型基金投资组合中，股票资产占基金资产的比例为 60%—95%；扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行；

(2) 本股票型基金持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的 10%；

(3) 本股票型基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券，不得超过该证券的 10%；

(4) 本股票型基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

(5) 本股票型基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；本股票型基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定；

(6) 本股票型基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

(7) 本股票型基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

(8) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(9) 本股票型基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

(10) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(11) 本股票型基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，

所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(12) 本股票型基金投资股指期货合约遵循以下限制：

①本股票型基金在任何交易日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

②本股票型基金在任何交易日终，持有的买入股指期货合约与有价证券市值之和不得超过基金资产净值的 95%，其中，有价证券是指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

③本股票型基金在任何交易日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过本基金持有的股票总市值的 20%；

④本股票型基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值合计（轧差计算）占基金资产的比例为 60%—95%；

⑤本股票型基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

⑥法律法规和证监会规定的其他投资比例限制。

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定，履行适当程序后，本基金不受上述规定的限制。

## 六、投资组合比例调整

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。

## 七、基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关法律法规规定进行融资、融券。

## 八、基金投资组合报告

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据基金合同规定，于 2016 年 7 月 15 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 2016 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	25,507,759.91	3.81
	其中：股票	25,507,759.91	3.81
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	522,074,000.00	78.04
	其中：债券	522,074,000.00	78.04
	资产支持证 券	-	0.00
4	贵金属投资	-	0.00
5	金融衍生品投资	-	0.00
6	买入返售金融资产	97,000,248.50	14.50
	其中：买断式回购 的买入返售金融资 产	-	0.00
7	银行存款和结算备 付金合计	12,318,050.64	1.84
8	其他资产	12,058,061.32	1.80
9	合计	668,958,120.37	100.00

### 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	970,400.00	0.15
B	采矿业	-	0.00
C	制造业	9,387,054.91	1.41
D	电力、热力、燃气及水生产 和供应业	-	0.00
E	建筑业	-	0.00
F	批发和零售业	2,772,630.00	0.42
G	交通运输、仓储和邮政业	1,015,168.00	0.15
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术 服务业	5,541,449.00	0.83
J	金融业	2,665,889.00	0.40
K	房地产业	1,363,428.00	0.20
L	租赁和商务服务业	-	0.00

M	科学研究和技术服务业	-	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	1,791,741.00	0.27
	合计	25,507,759.91	3.83

## 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	600386	北巴传媒	170,100	2,772,630.00	0.42
2	002612	朗姿股份	31,600	1,953,196.00	0.29
3	000034	深信泰丰	86,100	1,791,741.00	0.27
4	300098	高新兴	99,800	1,471,052.00	0.22
5	300113	顺网科技	16,100	1,428,070.00	0.21
6	000558	莱茵体育	72,600	1,363,428.00	0.20
7	601198	东兴证券	50,100	1,352,199.00	0.20
8	300033	同花顺	17,400	1,339,800.00	0.20
9	300064	豫金刚石	134,300	1,330,913.00	0.20
10	600061	中纺投资	68,600	1,313,690.00	0.20

## 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	国家债券	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	50,015,000.00	7.52
	其中：政策性金融债	50,015,000.00	7.52
4	企业债券	419,925,000.00	63.12
5	企业短期融资券	10,091,000.00	1.52
6	中期票据	41,823,000.00	6.29
7	可转债（可交换债）	220,000.00	0.03
8	同业存单	-	0.00
9	其他	-	0.00
10	合计	522,074,000.00	78.47

## 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	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资
----	------	------	-------	---------	------

					产净值比例 (%)
1	1480052	14 太仓资产债	500,000	54,845,000.00	8.24
2	150413	15 农发 13	500,000	50,015,000.00	7.52
3	1280260	12 兴国资债	400,000	34,136,000.00	5.13
4	1380283	13 许昌投资债	300,000	32,667,000.00	4.91
5	1380226	13 弘湘治理债	300,000	32,049,000.00	4.82

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细  
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细  
本基金本报告期末未持有贵金属。

8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细  
本基金本报告期末未持有权证。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

(3) 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

11. 投资组合报告附注

(1) 本基金投资的前十名证券的发行主体本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本基金投资的前十名证券之一同花顺，2015年8月18日因“公司涉嫌违反证券期货法律法规”收到中国证监会《调查通知书》（深证调查通字15150号）。2015年9月7日因“非法经营证券业务的行为”收到中国证监会《行政处罚事先告知书》（处罚字[2015]70号）。本基金认为，对同花顺的调查及处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

(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	128,096.73
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,870,448.83
5	应收申购款	59,515.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,058,061.32

(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) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002612	朗姿股份	1,953,196.00	0.29	重大事项停牌
2	000034	深信泰丰	1,791,741.00	0.27	重大事项停牌

(6) 由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

### 第十三部分 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、自基金合同生效以来（2012年6月15日）至2016年3月31日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：

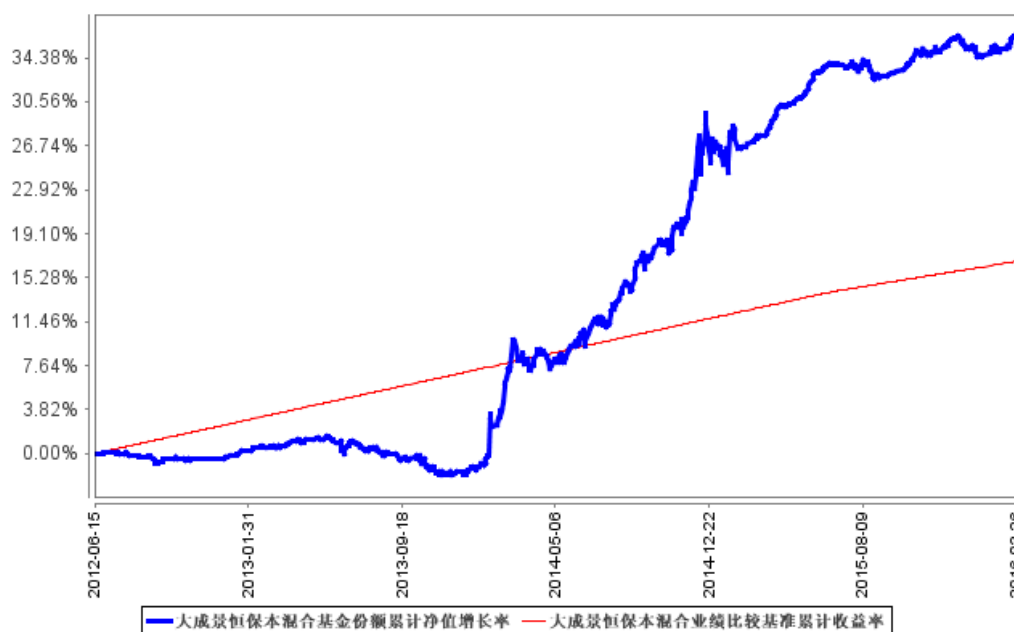
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差 ②	业绩比 较基准 收益率 ③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
2012.06.15—2012.12.31	-0.30%	0.05%	2.55%	0.01%	-2.85%	0.04%
2013.01.01—2013.12.31	-0.90%	0.11%	4.53%	0.01%	-5.43%	0.10%
2014.01.01—2014.12.31	28.64%	0.49%	4.34%	0.01%	24.30%	0.48%

2015.01.01—2015.12.31	7.12%	0.22%	3.62%	0.01%	3.50%	0.21%
2012.06.15—2016.03.31	36.01%	0.29%	16.77%	0.01%	19.24%	0.28%

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：

大成景恒保本混合型证券投资基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年06月15日至2016年3月31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。截至报告期末，本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

## 第十四部分 基金的财产

### （一）基金资产总值

本基金的基金资产总值包括基金所持有的各类有价证券、银行存款本息、基金的应收款项和其他投资所形成的价值总和。

### （二）基金资产净值

本基金的基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### （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资金账户、证券账户和银行间债券托



管账户，与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户独立。

#### （四）基金财产的保管及处分

- 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。
- 5、基金管理人、基金托管人、注册登记机构和基金代销机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

#### （五）基金管理人代表基金行使股东及债权人权利的处理原则及方法

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金资产的安全与增值；
- 3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益。
- 4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

## 第十五部分 基金资产估值

### （一）估值目的

基金估值的目的是为了准确、真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值，并为基金份额申购与赎回提供计价依据。

## （二）估值日

本基金的估值日为相关的证券交易所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

## （三）估值对象

基金所持有的金融资产和金融负债。

## （四）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办法

(1) 交易所上市实行净价交易的债券，对于存在活跃市场的情况下，按估值日收盘价估值；对于存在活跃市场但收盘价未能代表估值日公允价值的情况下，使用调整后的收盘价估值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，采用估值技术确定公允价值；

(2) 交易所上市未实行净价交易的债券，对于存在活跃市场的情况下，按估值日收盘价减去收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；对于存在活跃市场但收盘价未能代表估值日公允价值的情况下，使用调整后的收盘价减去收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，采用估值技术确定公允价值；

(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，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。

(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：

(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。

4、本基金持有的银行存款和备付金余额以本金列示，按相应利率逐日计提利息。

## 5、金融衍生品的估值

(1) 上市流通金融衍生品按估值日其结算价估值；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，以最近交易日的结算价估值；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，调整最近交易结算价，确定公允价格。

(2) 未上市金融衍生品按成本价估值，如成本价不能反映公允价值，则采用估值模型

确定公允价值。

6、在任何情况下，基金管理人采用上述 1-5 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，如果基金管理人具有充足的理由认为按上述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。

7、国家有最新规定的，按国家最新规定进行估值。

#### （五）估值程序

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以双方认可的方式报给基金托管人，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以双方认可的方式将确认结果返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。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。

#### （六）暂停估值的情形

- 1、基金投资所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、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资者的利益，决定延迟估值时；
- 4、中国证监会认定的其他情形。

#### （七）基金份额净值的确认

用于基金信息披露的基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金份额净值予以公布。

基金份额净值的计算精确到 0.001 元，小数点后第 4 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

### （八）估值错误的处理

1、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后3位（含第3位）内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。

2、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。

3、前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。

### （九）特殊情形的处理

1、基金管理人按本条第（四）款有关估值方法规定的第6项条款进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及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，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但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。

## 第十六部分 基金的费用与税收

### （一）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、因基金的证券交易或结算而产生的费用；
- 4、基金合同生效以后的信息披露费用；
- 5、基金份额持有人大会费用；

- 6、基金合同生效以后的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 7、基金资产的资金汇划费用及开户费用；
- 8、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

## （二）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 1.20%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 1.20%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

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。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。保本周期内，本基金的担保费用从基金管理人的管理费收入中列支，由基金管理人支付给担保人。

### 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 0.20%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 0.20%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

3、本条第（一）款第 3 至第 8 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

4、过渡期内本基金不计提管理费和托管费。

5、若保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，基金份额持有人将所持有本基金份额转为变更后的“大成景恒稳健增长股票型证券投资基金”的基金份额，管理费按前一日基金资产净值的 1.5%的年费率计提，托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。计算方法同上。

### （三）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。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他不从基金财产中支付的费用等不列入基金费用。

### （四）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

### （五）税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

## 第十七部分 基金收益与分配

### （一）基金利润的构成

基金利润是指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额。基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

基金可供分配利润是指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

### （二）收益分配原则

- 1、保本周期内本基金仅采取现金分红一种收益分配方式，不进行红利再投资；
- 2、基金转型为“大成景恒稳健增长股票型证券投资基金”后，基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；选择红利再投资的，现金红利则按除权日经除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；
- 3、每一基金份额享有同等分配权；
- 4、基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- 5、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多 12 次；每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 20%。
- 6、投资者的现金红利和分红再投资形成的基金份额均按照四舍五入方法，保留到小数点后 2 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；
- 7、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

### （三）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金截至收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

### （四）收益分配方案的确定、公告与实施

基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核后确定，基金管理人按法律法规的规定向中国证监会备案并公告。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。

### （五）收益分配中发生的费用

在保本周期内，本基金红利分配时所发生的银行转账或其他手续费用可以由投资者自行承担。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，则前述银行转账等手续费用由基金管理人承担。

基金转型为“大成景恒稳健增长股票型证券投资基金”后，基金收益分配时所发生的



银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照业务规则执行。

## 第十八部分 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；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果基金合同生效少于2个月，可以并入下一个会计年度。

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、会计核算制度按国家有关的会计核算制度执行。

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。

6、基金管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关法律法规规定编制基金会计报表，基金托管人定期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、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、具有从事证券业务资格的会计师事务所及其注册会计师等对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计；

2、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告并报中国证监会备案；

3、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。

## 第十九部分 基金的信息披露

基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过至少

一种指定媒体和基金管理人的互联网网站等媒介披露，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）基金招募说明书、基金合同、基金托管协议

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人应当在基金份额发售的3日前，将招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、基金托管协议登载在各自公司网站上。

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，更新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15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）基金资产净值、基金份额净值公告

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资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之后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额销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资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前述最后一个市场交易日的次日，将基金资产净值、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。

### （三）定期报告

基金定期报告由基金管理人按照法律法规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的规定单独编制，由基金托管人按照法律法规的规定对相关内容进行复核。基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告及更新的招募说明书。

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

法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

#### （四）临时报告与公告

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

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

- 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、担保人或保本义务人；
- 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、基金变更、增加、减少基金代销机构；
- 20、基金更换基金注册登记机构；
- 21、基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- 22、基金发生巨额赎回并延期支付；
- 23、基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- 24、基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 25、基金份额持有人大会的决议
- 26、中国证监会规定的其他事项。

#### （五）公开澄清

在基金合同期限内，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。

#### （六）信息披露文件的存放与查阅

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

基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，投资者在支

付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。

## 第二大部分 风险揭示

投资于本基金主要面临以下风险：

### 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，从而导致投资对象价格波动，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，基金所投资于证券的收益水平也会发生变化，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债券的价格和收益率，也会影响企业的融资成本和利润，进而影响基金持仓证券的收益水平。

#### 4. 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。

#### 5. 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。

#### 6. 上市公司经营风险

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

### 二、流动性风险

流动性风险是指在市场或者个股流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

由于开放式基金的特殊要求，本基金必须保持一定的现金比例以应付赎回要求。在管理现金头寸时，有可能存在现金不足的风险或现金过多导致收益下降的风险。

固定收益证券相对于股票而言，市场的流动性较低，从而使投资者在买卖证券时，较难获得合理的价格或者要付出更高的费用。

若出现较大数额的基金赎回申请，可能导致基金资产变现困难，从而使基金面临流动性风险。

### 三、信用风险

基金交易对手方发生交易违约或者基金持仓债券的发行人出现违约、拒绝支付债券本息，或者债券发行人信用质量下降导致债券价格下降，造成基金财产损失的风险。

### 四、投资组合保险机制的风险

本基金采用 VPPI 可变组合保险机制在理论上可以实现为认购并持有到期的基金份额的保本目的，但其中的一个重要假定是投资组合中股票与债券的仓位比例能够根据市场环境的变化作出适时的、连续的调整，而在现实投资过程中可能由于流动性或市场急速下跌等原因影响到 VPPI 可变组合保险机制的保本功能，由此产生的风险为投资组合保险机制的风险。

### 五、到期期间选择风险

基金份额持有人须在到期期间内作出到期选择，将其所有或部分持有到期的基金份额选择赎回、转换为基金管理人管理的其他基金、转入下一保本周期或继续持有变更后基金的基金份额。如基金份额持有人未在到期期间内作出赎回或转换出的，将无法在下一个保本周期开始日前或“大成景恒稳健增长股票型证券投资基金”基金合同生效日前的期间内赎回或进行转换，基金管理人将默认基金份额持有人选择继续持有本基金转入下一保本周期的基金份额或变更后的“大成景恒稳健增长股票型证券投资基金”的基金份额。

### 六、不适用保本条款的风险

以下情形不适用于本基金的保本条款，因此投资人存在不能收回全部投资本金的风险：

1、基金份额持有人认购、或过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期，但在基金当期保本周期到期日前（不包括该日）赎回或转换出的基金份额；

2、基金份额持有人在保本周期内申购或转换入的基金份额；

3、在保本周期内发生本合同规定的基金合同终止或与其他基金合并的情形；

4、在保本周期到期日之后（不包括该日）基金份额发生的任何形式的净值减少；

5、在保本周期内，基金更换基金管理人的，但担保人或保本义务人书面同意继续承担其相关保本保障责任的除外。

6、因不可抗力的原因导致基金投资亏损，或因不可抗力事件直接导致基金管理人无法按约定履行全部或部分义务或延迟履行义务的，或基金合同规定的其他情形基金管理人免于履行保本义务的。

#### 七、保证风险

本基金在引入担保人机制下也会因下列情况的发生而导致保本期到期日认购并持有到期的基金份额的本金不能偿付，由此产生担保风险。这些情况包括但不限于：在保本期内本基金更换管理人，而担保人不同意继续承担保证责任；或发生不可抗力事件，导致本基金亏损或担保人无法履行保证责任；或在保本期内担保人因经营风险丧失保证能力或保本期到期日担保人的资产状况、财务状况以及偿付能力发生不利变化而无法履行保证责任等。

#### 八、操作或技术风险

相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等原因可能引致风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT系统故障等风险。

在开放式基金的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、基金托管人、注册登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等。

#### 九、不可抗力风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产遭受损失。基金管理人、基金托管人、证券交易所、注册登记机构和销售代理机构等可能因不可抗力无法正常工作，从而影响基金的各项业务按正常时限完成；金融危机、行业竞争、代理机构违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金份额持有人利益受损。

## 第二十二部分 基金合同的变更、终止与基金财产清算

### （一）基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，自决议生效之日起在指定媒体公告。

## （二）基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；
- 3、法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他情形。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金财产中获得补偿的权利。

## （三）基金财产的清算

1、基金合同终止，基金管理人应当按法律法规和基金合同的有关规定组织清算组对基金财产进行清算。

### 2、基金财产清算组

（1）自基金合同终止事由之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

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

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

### 3、清算程序

- （1）基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- （2）基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；



- (3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行评估和变现；
- (5) 制作清算报告；
- (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) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (8) 对基金财产进行分配。

#### 4、清算费用

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

#### 5、基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；
- (4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款（1）、（2）、（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

对于基金缴存于中国证券登记结算有限责任公司的最低结算备付金和交易席位保证金等，在中国证券登记结算有限责任公司对其进行调整后方可收回。

#### 6、基金财产清算的公告

基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 第二十三部分 基金合同内容摘要

### 一、基金合同当事人及其权利义务

#### (一) 基金管理人

##### 1、基金管理人基本情况

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

法定代表人：刘卓

成立日期：1999年4月12日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字[1999]10号

经营范围：基金管理业务；发起设立基金；及中国证监会批准的其他业务

组织形式：有限责任公司

注册资本：贰亿元人民币

存续期间：持续经营

##### 2、基金管理人的权利

- (1) 依法募集基金，办理基金备案手续；
- (2) 自基金合同生效之日起，依照法律法规和基金合同独立管理运用基金财产；
- (3) 根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；
- (4) 根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式，获得基金管理费，收取法律法规规定或监管部门批准的其他费用；
- (5) 根据法律法规和基金合同的规定销售基金份额；
- (6) 在本合同的有效期内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本合同的情况进行必要的监督。如认为基金托管人违反了法律法规或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；

(7) 根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议和有关法律法规对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；

(8) 自行担任基金注册登记机构或选择、更换基金注册登记代理机构，办理基金注册登记业务，并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查；

(9) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；

(10) 在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资、融券；

(11) 依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益分配方案；

(12) 按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其他证券所产生的权利；

(13) 在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；

(14) 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；

(15) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；

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

(17) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

### 3、基金管理人的义务

(1) 依法申请并募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

(2) 办理基金备案手续；

(3) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

(4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

(5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理、分别记账，进行证券投资；

(6) 按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基金收益；

(7) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取

利益，不得委托第三人运作基金财产；

(8) 进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；

(9) 依法接受基金托管人的监督；

(10) 编制季度、半年度和年度基金报告；

(11) 采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、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；

(12) 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

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

(14) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除基金法、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；

(15) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(16) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表、代表基金签订的重大合同及其他相关资料；

(17) 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；

(18) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

(19) 保本周期到期日若发生需要保本赔付的情形，则基金管理人应补足保本赔付差额，并根据基金合同约定将该差额支付至指定账户。如基金管理人未能全额补足保本赔付差额，则应根据基金合同约定向担保人发出书面《履行保证责任通知书》，并要求担保人在收到通知书后的约定期限内将需清偿的金额支付至指定账户，如保本周期到期后10个工作日内相应款项仍未到账，基金管理人应当履行催付职责；

(20) 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实施其他法律行为；

(21) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(22) 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人的合法权益，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(23) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人

违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(24) 法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他义务。

## (二) 基金托管人

### 1、基金托管人基本情况

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：田国立

企业类型：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

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

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代营外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。

### 2、基金托管人的权利

- (1) 依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；
- (2) 依照基金合同的约定获得基金托管费；
- (3) 监督基金管理人对本基金的投资运作；
- (4) 在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；
- (5) 依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

### 3、基金托管人的义务

- (1) 安全保管基金财产；
- (2) 设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基

金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

- (3) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
- (4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得以基金财产为自己及任何第三人谋取非法利益，不得委托第三人托管基金财产；
- (5) 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整和独立；
- (6) 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；
- (7) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- (8) 按照基金合同的约定，根据基金管理人的指令，及时办理清算、交割事宜；
- (9) 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；
- (10) 根据法律法规及本合同的约定，办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (11) 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告的相关内容出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- (12) 保存基金份额持有人名册；
- (13) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；
- (14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (15) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- (16) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
- (17) 按照法律法规监督基金管理人的投资运作；
- (18) 因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其责任不因其退任而免除；
- (19) 因基金管理人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；
- (20) 法律法规、基金合同及中国证监会规定的其它义务。

### (三) 基金份额持有人

1、基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，基金投资者自依据基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。每份基金份额具有同等的合法权益。

## 2、基金份额持有人的权利

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法申请赎回其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金份额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、基金合同规定的其他权利。

## 3、基金份额持有人的义务

- (1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- (2) 缴纳基金认购、申购款项及基金合同规定的费用；
- (3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- (4) 不从事任何有损基金、其他基金份额持有人及其他基金合同当事人合法利益的活动；
- (5) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (6) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (7) 遵守基金管理人、销售机构和注册登记机构的相关交易及业务规则；
- (8) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会

(一) 基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

(二) 有以下情形之一时，应召开基金份额持有人大会：

- 1、终止基金合同；
- 2、转换基金运作方式；
- 3、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、基金托管人；

5、变更基金类别，但在保本到期后在基金合同规定范围内变更为“大成景恒稳健增长股票型证券投资基金”除外；

6、变更基金投资目标、范围或策略，但在保本到期后在基金合同规定范围内变更为“大成景恒稳健增长股票型证券投资基金”并按照基金合同约定的“大成景恒稳健增长股票型证券投资基金”的投资目标、范围或策略执行的以及法律法规和中国证监会另有规定的除外；

7、保本周期内更换担保人或保本义务人，但因担保人或保本义务人发生合并或分立，由合并或分立后的法人或者其他组织承继担保人或保本义务人的权利和义务的除外；

8、基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

9、单独或合计持有本基金总份额10%以上（含10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

10、保本周期内担保人、或保本义务人出现足以影响其担保能力或偿付能力的情形；

11、变更基金份额持有人大会议事程序、表决方式和表决程序；

12、本基金与其他基金合并；

13、对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；

14、法律法规或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

（三）有以下情形之一的，不需召开基金份额持有人大会：

1、调低基金管理费率、基金托管费率、其他应由基金或基金份额持有人承担的费用；

2、在法律法规和基金合同规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；

3、因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；

4、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、某一保本周期结束后更换下一保本周期的担保人、或保本义务人；

7、保本周期到期后本基金转型为非保本基金“大成景恒稳健增长股票型证券投资基金”，并由此变更基金的投资目标、投资理念、投资范围、投资策略、业绩比较基准及风险收



益特征等；

- 8、法律法规要求增加的基金费用的收取；
- 9、按照法律法规或基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

（四）召集方式：

1、除法律法规或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

2、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。

基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

3、代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。

基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。

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

4、代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前30日报中国证监会备案。

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

6、基金份额持有人大会的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

（五）通知

召开基金份额持有人大会，召集人应当于会议召开前30日在至少一种指定媒体上公告。基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

- 1、会议召开的时间、地点、方式；
- 2、会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；

- 3、代理投票授权委托书的内容要求(包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等)、送达时间和地点;
- 4、会务常设联系人姓名、电话;
- 5、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;
- 6、如采用通讯表决方式,还应载明具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容。
- 7、出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;
- 8、召集人需要通知的其他事项。

如召集人为基金管理人,还应另行通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督;如召集人为基金托管人,则应另行通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督;如召集人为基金份额持有人,则应另行通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的,不影响计票和表决结果。

#### (六) 开会方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席,现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席,基金管理人或托管人不派代表列席的,不影响表决效力;通讯方式开会指按照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。

在法律法规或监管机构允许的情况下,经会议通知载明,基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决,或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。

现场开会同时符合以下条件时,可以进行基金份额持有人大会议程:

- 1、亲自出席会议者持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定,并且持有基金份额的凭证与基金注册登记机构持有的登记资料相符;
- 2、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,全部有效凭证所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上(含50%)。

在同时符合以下条件时,通讯开会的方式视为有效:

- 1、召集人按基金合同规定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告；
- 2、召集人按基金合同规定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议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；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；
- 3、本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上（含50%）；
- 4、直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的其他代表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与注册登记机构记录相符；
- 5、会议通知公布前已报中国证监会备案。

如果开会条件达不到上述的条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间(至少应在25个工作日后)，且确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日应保持不变。

#### （七）议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

（1）议事内容限为本条前述第（二）款规定的基金份额持有人大会召开事由范围内的事项。

（2）基金管理人、基金托管人、单独或合计代表基金份额10%以上的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；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日前35日提交召集人。召集人对于临时提案应当在大会召开日前30日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与临时提案公告日期有30日的间隔期。

（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：

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

2）程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持

人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

(4) 单独或合计代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，或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，未获得基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于6个月。法律法规另有规定的除外。

(5) 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。

## 2、议事程序

在现场开会的方式下，首先由召集人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议，报经中国证监会核准或备案后生效。

若召集人为基金管理人，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人以所持表决权的50%以上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。基金管理人和基金托管人不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人在会议通知中公布提案，在所通知的表决截止日期第2个工作日由大会聘请的公证机关的公证员统计全部有效表决并形成决议，报经中国证监会核准或备案后生效。

## (八) 表决

1、基金份额持有人所持每份基金份额享有平等的表决权。

2、基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

### (1) 特别决议

对于特别决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。

### (2) 一般决议

对于一般决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的50%以上通过。

更换基金管理人或者基金托管人、转换基金运作方式或终止基金合同应当以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，符合法律法规、基金合同和会议通知规定的书面表决意见

即视为有效的表决；表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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。

#### （九）计票

##### 1、现场开会

（1）基金份额持有人大会的主持人为召集人授权出席大会的代表，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推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员(如果基金管理人为召集人，则监督员由基金托管人的授权代表担任；如基金托管人为召集人，则监督员由基金托管人在出席会议的基金份额持有人中指定)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推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）如果大会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；如果大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或者基金份额持有人代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

（4）在基金管理人或基金托管人担任召集人的情形下，如果在计票过程中基金管理人或者基金托管人拒不配合的，则参加会议的基金份额持有人有权推举三名基金份额持有人代表共同担任监票人进行计票。

##### 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票人在监督人（如果基金管理人为召集人，基金托管人为监督人；如果基金托管人为召集人，基金管理人为监督人）派出的授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证；如监督人经通知但拒绝到场监督，基金管理人或基金托管人应当至少提前两个工作日通知召集人，大会召集人可自行授权3名监票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

#### （十）生效与公告

1、基金份额持有人大会按照《基金法》有关法律法规规定表决通过的事项，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。

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

3、基金份额持有人大会决议应当自中国证监会核准或出具无异议意见后按《信息披露办法》的有关规定，由基金份额持有人大会召集人在指定媒体上公告。

4、如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机关、公证员姓名等一同公告。

(十一) 法律法规或监管机关对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

### 三、基金的收益与分配

#### (一) 基金利润的构成

基金利润是指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额。基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

基金可供分配利润是指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

#### (二) 收益分配原则

1、保本周期内本基金仅采取现金分红一种收益分配方式，不进行红利再投资；

2、基金转型为“大成景恒稳健增长股票型证券投资基金”后，基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；选择红利再投资的，现金红利则按除权日经除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；

3、每一基金份额享有同等分配权；

4、基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

5、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多12次；每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的20%。

6、投资者的现金红利和分红再投资形成的基金份额均按照四舍五入方法，保留到小数点后2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；

7、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

### （三）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金截至收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

### （四）收益分配方案的确定、公告与实施

基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核后确定，基金管理人按法律法规的规定向中国证监会备案并公告。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过15个工作日。

### （五）收益分配中发生的费用

在保本周期内，本基金红利分配时所发生的银行转账或其他手续费用可以由投资者自行承担。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，则前述银行转账等手续费用基金管理人承担。

基金转型为“大成景恒稳健增长股票型证券投资基金”后，基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照业务规则执行。

## 四、基金费用与税收

### （一）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、因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）；
- 4、基金合同生效以后的信息披露费用；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金合同生效以后的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 7、基金资产的资金汇划费用及开户费用；
- 8、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

### （二）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1.20%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1.20%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

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。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。保本周期内，本基金的担保费用从基金管理人的管理费收入中列支，由基金管理人支付给担保人。

## 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0.20%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0.20%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

3、本条第（一）款第3 至第8项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

4、过渡期内本基金不计提管理费和托管费。

5、若保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，基金份额持有人将所持有本基金份额转为变更后的“大成景恒稳健增长股票型证券投资基金”的基金份额，管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提，托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法同上。

### （三）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。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他不从基金财产中支付的费用等不列入基金费用。

### （四）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额



额持有人大会。

#### （五）税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

### 五、基金的投资范围及投资限制

#### （一）投资范围

##### 1、保本周期的投资范围

本基金投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包含国债、金融债、企业债、公司债、债券回购、央行票据、中期票据、可转换债券、可分离交易债券、短期融资券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具）、银行存款、资产支持证券、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金投资组合的资产配置范围为：股票、权证、股指期货等风险资产占基金资产的比例为0%—40%，其中权证不超过基金资产净值的3%；债券、银行存款、货币市场工具等安全资产占基金资产的比例为60%—100%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）不超过基金资产的40%。

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

##### 2、变更后的大成景恒稳健增长股票型证券投资基金（以下简称本股票型基金）的投资范围

本股票型基金投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包含国债、金融债、企业债、公司债、债券回购、央行票据、中期票据、可转换债券、可分离交易债券、短期融资券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具）、银行存款、资产支持证券、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本股票型基金投资组合的资产配置范围为：股票资产占基金资产的比例为60%—95%；债券、资产支持证券、货币市场工具等固定收益类资产的投资比例范围为基金资产的5%—40%；扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府

债券不低于基金资产净值的5%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

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

## （二）投资限制

### 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- 1、承销证券；
- 2、向他人贷款或提供担保；
- 3、从事承担无限责任的投资；
- 4、买卖其他基金份额，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；
- 5、向基金管理人、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债券；
- 6、买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、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、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- 8、当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

## （三）投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

- （1）本基金投资组合中，股票、权证、股指期货等权益类资产占基金资产的比例为0%—40%，其中权证不超过基金资产净值的3%；债券、银行存款、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的比例为60%—100%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）不超过基金资产的40%；
- （2）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的10%；
- （3）本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券，不得超过该证券的10%；
- （4）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值

的40%；

(5) 本基金应投资于信用级别评级为BBB以上（含BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

(6) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的0.5%；本基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定；

(7) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

(8) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；

(9) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；

(10) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；

(11) 本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(12) 本基金参与股指期货交易应当符合基金合同约定的保本策略和投资目标，且每日所持期货合约及有价证券的最大可能损失不得超过基金净资产扣除用于保本部分资产后的余额；

(13) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定，履行适当程序后，本基金不受上述规定的限制。

(四) 基金管理人代表基金行使股东及债权人权利的处理原则及方法

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金资产的安全与增值；
- 3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益。
- 4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益。

(五) 基金的融资融券

本基金可以根据届时有效的有关法律法规和政策的规定进行融资融券。

## 六、基金资产的估值

### （一）估值目的

基金估值的目的是为了准确、真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值，并为基金份额申购与赎回提供计价依据。

### （二）估值日

本基金的估值日为相关的证券交易所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

### （三）估值对象

基金所持有的金融资产和金融负债。

### （四）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办法

##### （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付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，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。

(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：

#### (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。

4、本基金持有的银行存款和备付金余额以本金列示，按相应利率逐日计提利息。

### 5、金融衍生品的估值

(1) 上市流通金融衍生品按估值日其结算价估值；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，以最近交易日的结算价估值；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，调整最近交易结算价，确定公允价格。

(2) 未上市金融衍生品按成本价估值，如成本价不能反映公允价值，则采用估值模型确定公允价值。

6、在任何情况下，基金管理人采用上述1-5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，如果基金管理人有着充足的理由认为按上述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。

7、国家有最新规定的，按国家最新规定进行估值。

#### (五) 估值程序

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以双方认可的方式报给基金托管人，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以双方

认可的方式将确认结果返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。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。

#### (六) 暂停估值的情形

- 1、基金投资所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、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资者的利益，决定延迟估值时；
- 4、中国证监会认定的其他情形。

#### (七) 基金份额净值的确认

用于基金信息披露的基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金份额净值予以公布。

基金份额净值的计算精确到0.001元，小数点后第4位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

#### (八) 估值错误的处理

- 1、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后3位（含第3位）内发生差错时，视为

基金份额净值估值错误。

2、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。

3、前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。

#### （九）特殊情形的处理

1、基金管理人按本条第（四）款有关估值方法规定的第6项条款进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及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，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但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。

### 七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

#### （一）基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，自决议生效之日起在指定媒体公告。

#### （二）基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；
- 3、法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他情形。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金财产中获得补偿的权利。

### （三）基金财产的清算

1、基金合同终止，基金管理人应当按法律法规和基金合同的有关规定组织清算组对基金财产进行清算。

#### 2、基金财产清算组

（1）自基金合同终止事由之日起30个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

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

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

#### 3、清算程序

- （1）基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- （2）基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- （3）基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- （4）对基金财产进行评估和变现；
- （5）制作清算报告；
- （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）将清算报告报中国证监会备案并公告；
- （8）对基金财产进行分配。

#### 4、清算费用

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

#### 5、基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

- （1）支付清算费用；
- （2）交纳所欠税款；
- （3）清偿基金债务；



(4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)、(2)、(3)项规定清偿前,不分配给基金份额持有人。

对于基金缴存于中国证券登记结算有限责任公司的最低结算备付金和交易席位保证金等,在中国证券登记结算有限责任公司对其进行调整后方可收回。

#### 6、基金财产清算的公告

基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计,律师事务所出具法律意见书后,报中国证监会备案并公告。

7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存15年以上。

#### 八、争议的处理

(一) 基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

(二) 基金合同的当事人之间因基金合同产生的或与基金合同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,按照其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。

(三) 除争议所涉内容之外,基金合同的其他部分应当由基金合同当事人继续履行。

#### 九、基金合同的效力

(一) 基金合同是基金合同当事人之间的法律文件,应由基金管理人和基金托管人的法定代表人或其授权签字人签字并加盖公章。基金合同于投资者缴纳认购的基金份额的款项时成立,自基金募集结束报中国证监会备案并获中国证监会书面确认后生效。

(二) 基金合同的有效期限自其生效之日起至本基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

(三) 基金合同自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的基金合同各方当事人具有同等的法律约束力。

(四) 基金合同正本一式六份,除上报有关监管机构二份外,基金管理人、基金托管人各持有二份,每份具有同等的法律效力。

(五) 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同存放在基金管理人和基金托管人住所,投资者在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件复印件,基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。

## 第二十四部分 基金托管协议内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### 1、基金管理人（或简称“管理人”）

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

法定代表人：刘卓

成立时间：1999年4月12日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字[1999]10号

组织形式：有限责任公司

注册资本：贰亿元人民币

经营范围：发起设立基金、基金管理及中国证监会批准的其他业务

存续期间：持续经营

#### 2、基金托管人

##### （二）基金托管人（或简称“托管人”）

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：田国立

企业类型：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

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

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买

卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。

存续期间：持续经营

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：

1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。基金管理人应将拟投资的股票库、债券库等各投资品种的具体范围提供给基金托管人。基金管理人可以根据实际情况的变化，对各投资品种的具体范围予以更新和调整，并通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督；

2、对基金投融资比例进行监督；

(1) 本基金在保本周期内的投资资产配置比例为：

股票、权证、股指期货等风险资产占基金资产的比例为0%—40%，其中权证不超过基金资产净值的3%；债券、货币市场工具等安全资产占基金资产的比例为60%—100%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）不超过基金资产的40%

(2) 如本基金变更为大成景恒稳健增长股票型证券投资基金（以下简称本股票型基金），则本股票型基金的投资资产配置比例为：

股票资产占基金资产的比例为60%—95%；债券、资产支持证券、货币市场工具等固定收益类资产的投资比例范围为基金资产的5%—40%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

(3) 本基金在保本周期内的投资组合遵循以下投资限制：

1) 本基金投资组合中，股票、权证、股指期货等风险资产占基金资产的比例为0%—40%，其中权证不超过基金资产净值的3%；债券、银行存款、货币市场工具等安全资产占基金资产的比例为60%—100%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）不超过基金资产的40%；

2) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的10%；

3) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券, 不得超过该证券的10%;

4) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;

5) 本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间, 如果其信用等级下降、不再符合投资标准, 应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出;

6) 本基金在任何交易日买入权证的总金额, 不超过上一交易日基金资产净值的0.5%; 本基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%, 基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%。法律法规或中国证监会另有规定的, 从其规定;

7) 本基金持有的全部资产支持证券, 其市值不得超过基金资产净值的20%;

8) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例, 不得超过该资产支持证券规模的10%;

9) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券, 不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;

10) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例, 不得超过基金资产净值的10%;

11) 本基金财产参与股票发行申购, 所申报的金额不得超过本基金的总资产, 所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

12) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定, 履行适当程序后, 本基金不受上述规定的限制。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合《基金合同》的有关约定。由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内, 但基金管理人应在10个交易日内进行调整, 以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

(4) 如本基金变更为大成景恒稳健增长股票型证券投资基金(以下简称本股票型基金), 则本股票型基金的投资组合限制为:

1) 本股票型基金投资组合中, 股票资产占基金资产的比例为60%—95%; 债券、资产支持证券、债券逆回购等固定收益类资产的投资比例范围为基金资产净值的5%—40%; 扣

除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行；

2) 本股票型基金、持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的10%；

3) 本股票型基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券，不得超过该证券的10%；

4) 本股票型基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%；

5) 本股票型基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的0.5%；本基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定；

6) 本股票型基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

7) 本股票型基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；

8) 本股票型基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；

9) 本股票型基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；

10) 本股票型基金应投资于信用级别评级为BBB以上（含BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

11) 本股票型基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

12) 本股票型基金投资股指期货合约遵循以下限制：

①本股票型基金在任何交易日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；

②本股票型基金在任何交易日终，持有的买入股指期货合约与有价证券市值之和不得超过基金资产净值的95%，其中，有价证券是指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

③本股票型基金在任何交易日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过本基金持有的股票总市值的20%；

④本股票型基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值合计（轧差计算）占基金资产的比例为60%—95%；

⑤本股票型基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；

⑥法律法规和证监会规定的其他投资比例限制。

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定，履行适当程序后，本股票型基金不受上述规定的限制。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合《基金合同》的有关约定。由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在10个交易日内进行调整，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

4、为对基金禁止从事的关联交易进行监督，基金管理人和基金托管人应相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单，基金托管人和基金管理人均有责任保证该名单的真实、准确和完整性，并及时将更新后的名单发送给对方；

5、基金管理人向基金托管人提供其银行间债券市场交易的交易对手库，交易对手库由银行间交易会员中财务状况较好、实力雄厚、信用等级高的交易对手组成。基金管理人可以根据实际情况的变化，及时对交易对手库予以更新和调整，并通知基金托管人。基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手应符合交易对手库的范围。基金托管人对基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手是否符合交易对手库进行监督；

6、基金托管人对银行间市场交易的交易方式的控制按如下约定进行监督：

基金管理人应按照审慎的风险控制原则，对银行间交易对手的资信状况进行评估，控制交易对手的资信风险，确定与各类交易对手所适用的交易结算方式，在具体的交易中，应尽力争取对基金有利的交易方式。由于交易对手资信风险引起的损失，基金托管人不承担赔偿责任。

7、基金如投资银行存款，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，事先确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合上述名单进行监督；

（二）基金托管人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净

值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行复核。

(三) 基金托管人在上述第(一)、(二)款的监督和核查中发现基金管理人违反法律法规的规定、《基金合同》及本协议的约定,应及时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并改正。在限期内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应及时向中国证监会报告。

(四) 基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规、《基金合同》及本协议的规定,应当拒绝执行,立即通知基金管理人,并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。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法规和其他有关规定,或者违反《基金合同》、本协议约定的,应当立即通知基金管理人,并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。

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

### 三、基金管理人 对基金托管人的业务核查

1、在本协议的有效期内,在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上,基金管理人有权对基金托管人履行本协议的情况进行必要的核查,核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

2、基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、无正当理由未执行或延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反法律法规、《基金合同》及本协议有关规定时,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,基金管理人应依照法律法规的规定报告中国证监会。

3、基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为,包括但不限于:提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性,在规定时间内答复基金管理人并改正。

#### 四、基金财产的保管

##### （一）基金财产保管的原则

- 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 2、基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人的合法合规指令或法律法规、《基金合同》及本协议另有规定，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- 3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户（含期货结算账户）、证券账户及其他基金财产投资所需要的账户。
- 4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。
- 5、除依据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关法律法规规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

##### （二）基金合同生效前募集资金的验资和入账

- 1、基金募集期满或基金管理人宣布停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定的，由基金管理人在法定期限内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方为有效。
- 2、基金管理人应将属于本基金财产的全部资金划入在基金托管人处为本基金开立的基金银行账户中，并确保划入的资金与验资确认金额相一致。
- 3、若基金募集期限届满，未能达到《基金合同》生效的条件，由基金管理人按规定办理退款事宜。

##### （三）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；亦不得使用本基金的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法律法规的有关规定。

##### （四）基金进行定期存款投资的账户开设和管理

基金托管人根据基金管理人的指令以基金名义在基金托管人认可的存款银行的指定营



业网点开立存款账户，并负责该账户的日常管理以及银行预留印鉴的保管和使用。基金管理人应派专人协助办理开户事宜。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中，基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料，并对基金托管人给予积极配合和协助。

#### （五）基金证券账户和结算备付金账户及其他投资账户的开设和管理

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或转让本基金的证券账户，亦不得使用本基金的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、在本托管协议生效日之后，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。

#### （六）债券托管专户的开设和管理

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及银行间市场清算所股份有限公司开设银行间债券市场债券托管账户，并代表基金进行银行间债券市场债券和资金的清算。在上述手续办理完毕之后，由基金托管人负责向中国人民银行报备。

#### （七）基金财产投资的有关有价凭证的保管

基金财产投资的实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管。基金托管人对其以外机构实际有效控制的有价凭证不承担责任。

#### （八）与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

基金管理人、基金托管人分别按照法律法规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及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后30日内将一份正本的原件提交给基金托管人。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当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。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管至少15年。

## 五、基金资产净值计算和会计核算

### （一）基金资产净值的计算和复核

1、基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日该基金份额总数后的价值。基金份额净值的计算保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

2、基金管理人应每开放日对基金财产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个开放日结束后计算得出当日的该基金份额净值，并以双方认可的方式发送给基金托管人。基金托管人按《基金合同》规定的估值方法、时间、程序复核后，并以双方认可的方式将复核结果传送给基金管理人，由基金管理人对外公布。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。

3、当相关法律法规或《基金合同》规定的估值方法不能客观反映基金财产公允价值时，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、基金管理人、基金托管人发现基金估值违反《基金合同》订明的估值方法、程序以及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，双方应及时进行协商和纠正。

5、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后3位以内（含3位）发生差错时，视为基金份额净值估值错误。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；当计价错误达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当在报中国证监会备案的同时并及时进行公告。如法律法规或监管机关对前述内容另有规定的，按其规定处理。

6、除基金合同和本协议另有约定外，由于基金管理人对外公布的任何基金净值数据错误，导致该基金财产或基金份额持有人的实际损失，基金管理人应对此承担责任。若基金托管人计算的净值数据正确，则基金托管人对该损失不承担责任；若基金托管人计算的净值数据也不正确，则基金托管人也应承担部分未正确履行复核义务的责任。如果上述错误造成了基金财产或基金份额持有人的不当得利，且基金管理人及基金托管人已各自承担了

赔偿责任，则基金管理人应负责向不当得利之主体主张返还不当得利。如果返还金额不足以弥补基金管理人和基金托管人已承担的赔偿金额，则双方按照各自赔偿金额的比例对返还金额进行分配。

7、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，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但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、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，基金管理人可以按照其对基金份额净值的计算结果对外予以公布，基金托管人可以将相关情况报中国证监会备案。

## （二）基金会计核算

### 1、基金账册的建立

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

### 2、会计数据和财务指标的核对

基金管理人和基金托管人应定期就会计数据和财务指标进行核对。如发现存在不符，双方应及时查明原因并纠正。

### 3、基金财务报表和定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后5个工作日内完成；招募说明书在《基金合同》生效后每六个月更新并公告一次，于该等期间届满后45日内公告。季度报告应在每个季度结束之日起10个工作日内编制完毕并于每个季度结束之日起15个工作日内予以公告；半年度报告在会计年度半年终了后40日内编制完毕并于会计年度半年终了后60日内予以公告；年度报告在会计年度结束后60日内编制完毕并于会计年度终了后90日内予以公告。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。

基金管理人在月度报表完成当日，将报表盖章后提供给基金托管人复核；基金托管人在收到后应3个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后5个工作日内完

成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在半年度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后10个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人应在收到后15个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以传真的方式或双方商定的其他方式进行。

基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准；若双方无法达成一致以基金管理人的账务处理为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖托管业务部门公章或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书，双方各自留存一份。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

## 六、基金份额持有人名册的保管

### （一）基金份额持有人名册的内容

基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册包括以下几类：

- 1、基金募集期结束时的基金份额持有人名册；
- 2、基金权益登记日的基金份额持有人名册；
- 3、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册；
- 4、每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册。

### （二）基金份额持有人名册的提供

对于每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应在每半年度结束后5个工作日内定期向基金托管人提供。对于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以及基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册，基金管理人应在相关的名册生成后5个工作日内向基金托管人提供。

### （三）基金份额持有人名册的保管

基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册。如基金托管人无法妥善保存持有人名册，基金管理人应及时向中国证监会报告，并代为履行保管基金份额持有人名册的职责。基金托管人应对基金管理人由此产生的保管费给予补偿。

## 七、适用法律与争议解决方式

### （一）本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

(二) 基金管理人与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, 并按其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。

(三) 除争议所涉的内容之外, 本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定。

#### 八、托管协议的变更、终止与基金财产的清算

##### (一) 托管协议的变更

本协议双方当事人经协商一致, 可以对协议进行变更。变更后的新协议, 其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。变更后的新协议应当报中国证监会核准。

##### (二) 托管协议的终止

发生以下情况, 本托管协议应当终止:

- 1、《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》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

##### (三) 基金财产的清算

基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》及有关法律法规的规定对本基金的财产进行清算。

## 第二十五部分 对基金份额持有人的服务

对于基金份额持有人和潜在投资者, 基金管理人将根据具体情况提供一系列的服务, 并将根据基金份额持有人的需要和市场的变化, 增加或变更服务项目。主要服务内容如下:

(一) 客服中心电话服务 投资者拨打基金管理人客服热线400-888-5558 (国内免长途话费) 可享有如下服务: A、自助语音服务: 提供7×24小时电话自助语音的服务, 可进行账户查询、基金净值、基金产品等自助查询服务。 B、人工坐席服务: 提供每周五天, 每天不少于8小时的人工坐席服务 (法定节假日除外)。投资者可以通过该热线获得业务咨询、基金账户查询、交易情况查询、服务投诉及建议、信息定制、资料修改等专项服务。

（二）综合对账单服务 大成基金按季度和年度为基金份额持有人提供综合对账单服务，服务形式包括网站自助查询、电子邮件账单、手机短信账单、客服热线查询、纸质对账单邮寄等。其中，纸质对账单邮寄仅限70岁以上持有人、或确有需要并已订制纸质对账单的持有人。

（三）财经汇资讯服务 大成财经汇是专为大成旗下持有人提供的资讯服务平台，财经汇提供专业、独家、一手的理财资讯。投资者可登录基金管理人网站

（[www.dcfund.com.cn](http://www.dcfund.com.cn)）财经汇平台免费使用。

（四）网站自助服务 基金管理人网站（[www.dcfund.com.cn](http://www.dcfund.com.cn)）为投资者提供基金账户及交易情况查询、个人资料修改、手机短信和电子邮件信息定制等自助服务，提供理财刊物查阅、公司公告、热点问答、市场点评等信息资讯服务。同时，网站还设有电子邮箱服务（客户服务邮箱：[callcenter@dcfund.com.cn](mailto:callcenter@dcfund.com.cn)）和网上在线答疑服务。

（五）网上交易服务 本基金管理人已开通个人投资者网上交易业务。个人投资者通过基金管理人网站[www.dcfund.com.cn](http://www.dcfund.com.cn) 可以办理基金认购、申购、赎回、转换、撤单、基金定投、分红方式修改、账户资料修改、交易密码修改、交易情况查询和账户信息查询等各类业务。其中，基金定投、转换等业务的开通时间，已另行公告为准。

（六）财富俱乐部 财富俱乐部是为基金份额持有人中的高端（VIP）客户专门设立的服务体系，将为高端（VIP）客户提供专项的个性化服务。

（七）投资理财中心 大成基金深圳投资理财中心负责所辖区域高端（VIP）客户的柜台式服务工作。

（八）客户投诉建议受理服务 投资者可以通过基金管理人或销售机构的柜台、投资理财中心、客服热线、网站在线栏目、电子邮件及信函等渠道进行投诉或提出建议。对于受理的投诉或建议，基金管理人承诺最迟T+1日内给予回复；不能及时回复的，在约定的最晚主动联系客户时间内告知客户。

## 第二十六部分 其他应披露的事项

一、本基金管理人、基金托管人目前无重大诉讼事项。

二、最近3年本基金管理人、基金托管人及高级管理人员没有受到任何处罚。

三、2015年12月16日至2016年6月15日发布的公告：

1.2016年1月20日《大成景恒保本混合型证券投资基金2015年第4季度报告》。

2.2016年1月29日《大成景恒保本混合型证券投资基金（第二个保本周期）更新招募

说明书（2015年2期）》、《大成景恒保本混合型证券投资基金（第二个保本周期）更新招募说明书（2015年2期）-摘要》。

3.2016年2月18日《关于增加上海凯石财富基金销售有限公司代销公告》。

4.2016年3月12日《关于增加徽商期货有限责任公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告》。

5.2016年3月17日《关于增加深圳市金斧子投资咨询有限公司为开放式基金代销机构及相关费率优惠的公告》。

6.2016年3月26日《大成景恒保本混合型证券投资基金2015年年度报告》、《大成景恒保本混合型证券投资基金2015年年度报告摘要》。

7. 2016年3月29日《大成景恒保本混合型证券投资基金变更基金经理的公告》、《关于大成基金管理有限公司上海理财中心业务变更的公告》。

8.2016年4月22日《大成景恒保本混合型证券投资基金2016年第1季度报告》。

9.2016年4月27日《关于股权变更及修改《公司章程》的公告》。

10.2016年4月30日《关于增加奕丰金融服务（深圳）有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告》。

11. 2016年5月7日《关于增加珠海盈米财富管理有限公司为开放式基金代销机构并开通相关业务的公告》。

四、招募说明书及在此之前公告的公开说明书及更新的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。本更新的招募说明书未尽事宜，请查阅招募说明书及以前公告的公开说明书及更新的招募说明书。

## 第二十七部分 对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，对2016年1月29日公布的《大成景恒保本混合型证券投资基金更新招募说明书（2015年2期）》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“第三部分、基金管理人”部分。
2. 根据最新资料，更新了“第四部分、基金托管人”部分。

3. 根据最新资料，更新了“第五部分、相关服务机构”部分。
4. 根据最新数据，更新了“第十部分、基金的投资”部分”。
5. 根据最新数据，更新了“第十一部分、基金业绩”部分。
6. 根据最新公告，更新了“第二十六部分、其他应披露的事项”。
7. 根据最新情况，更新了“第二十七部分、对招募说明书更新部分的说明”。

## 第二十六部分 招募说明书的存放及查阅方式

### （一）招募说明书的存放地点

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构的办公场所，并刊登在基金管理人的网站上。

### （二）招募说明书的查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅本基金的招募说明书，也可按工本费购买本招募说明书的复印件，但应以本基金招募说明书的正本为准。

## 第二十七部分 备查文件

备查文件等文本存放在基金管理人、基金托管人和销售机构的办公场所和营业场所，在办公时间内可供免费查阅。

- （一）中国证监会核准大成景恒保本混合型证券投资基金募集的文件
- （二）《大成景恒保本混合型证券投资基金基金合同》
- （三）《大成景恒保本混合型证券投资基金托管协议》
- （四）《大成景恒保本混合型证券投资基金保证合同》
- （五）《大成基金管理有限公司开放式基金注册登记业务规则》
- （六）法律意见书
- （七）基金管理人业务资格批件和营业执照
- （八）基金托管人业务资格批件和营业执照
- （九）中国证监会要求的其他文件

大成基金管理有限公司



二〇一六年七月三十日

附件：大成景恒保本混合型证券投资基金保证合同

鉴于：

大成景恒保本混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）转入第二个保本周期的相关规则公告和《大成景恒保本混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）约定了基金管理人对于持有人在第二个保本周期持有到期的基金份额的保本额承担保本义务。

（注：1、“持有人”为本基金第二个保本周期持有到期的基金份额持有人，即本基金第一个保本周期转入第二个保本周期的过渡期内申购并持有到期的基金份额（进行基金份额折算的，指折算后对应的基金份额）的投资者，以及基金份额持有人从本基金第一个保本周期结束后转入第二个保本周期并持有到期的基金份额（进行基金份额折算的，指折算后对应的基金份额）的持有人。

2、“第二个保本周期持有到期的基金份额的保本额”是指在第一个保本周期转入第二个保本周期的过渡期限定期限内进行过渡期申购的投资者申购并在第二个保本周期持有到期的基金份额在折算日所代表的资产净值以及由本基金第一个保本周期结束后转入第二个保本周期的基金份额持有人所持有并在第二个保本周期持有到期的基金份额在折算日所代表的资产净值（对于过渡期申购的基金份额按其于折算日所代表的资产净值及过渡期申购的费用之和确认；对于从上一保本周期转入的基金份额按其折算日所代表的资产净值确认，并适用下一保本周期的保本条款）。保本额在第二个保本周期内赎回或转换转出的部分，不计入第二个保本周期的保本额。其中，折算日是指第二个保本周期开始日的前一个工作日。）

为保护基金投资者合法权益，依照《中华人民共和国担保法》、《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《关于保本基金的指导意见》等法律法规的规定，基金管理人和担保人在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上，特订立《大成景恒保本混合型证券投资基金保证合同》（以下简称“本合同”或“《保证合同》”）。担保人就本基金第二个保本周期内基金管理人对于持有人在第二个保本周期持有到期的基金份额的保本额所承担保本义务的履行提供不可撤销的连带责任保证。担保人保证责任的承担以本《保证合同》为准。

《保证合同》的当事人包括基金管理人、担保人和持有人。持有人持有基金份额的行为本身即表明其对《保证合同》的承认、接受和同意。

除非本《保证合同》另有约定，本《保证合同》所使用的词语或简称与其在《基金合

同》中的释义部分具有相同含义。

#### 一、保证的范围和最高限额

1、本基金为持有人提供的保本额为：第二个保本周期持有到期的基金份额的保本额。

2、担保人承担保证责任的金额即保证范围为：在保本周期到期日，持有人在第二个保本周期持有到期的基金份额与保本周期到期日基金份额净值的乘积（即“可赎回金额”）加上其第二个保本周期持有到期的基金份额累计分红金额之和计算的总金额低于保本额的差额部分（该差额部分即为第二个保本周期的保本赔付差额）。

3、投资人在第二个保本周期内申购或转换转入的基金份额，以及在第二个保本周期到期日前（不包括该日）赎回或转换出的部分不在保证范围之内，且担保人承担保证责任的最高限额不超过第二个保本周期持有到期的基金份额的保本额。

4、保本周期到期日是指本基金第一个保本周期到期日指本基金基金合同生效之日起至三个公历年后的对应日，本基金第一个保本周期后的各保本周期自基金管理人公告的当期保本周期起始日起至三个公历年后对应日止。如该对应日为非工作日，保本周期到期日顺延至下一个工作日。

#### 二、保证期间

保证期间为基金第二个保本周期到期日起六个月。

#### 三、保证的方式

在保证期间，本担保人在保证范围内承担不可撤销的连带保证责任。

#### 四、除外责任

下列任一情形发生时，担保人不承担保证责任：

1、在保本周期到期日，按基金份额持有人过渡期申购或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上其在过渡期申购或从上一保本周期转入当期保本周期持有到期的基金份额在当期保本周期内的累计分红款项之和计算的总金额不低于其过渡期申购保本金额或从上一保本周期转入当期保本周期的基金份额的保本金额；

2、基金份额持有人过渡期申购或从上一保本周期转入当期保本周期，但在基金保本周期到期日前（不包括该日）赎回或转换出的基金份额；

3、基金份额持有人在保本周期内申购或转换转入的基金份额；

4、在保本周期内发生《基金合同》约定的《基金合同》终止或与其他基金合并的情形；

5、在保本周期到期日之后（不包括该日），基金份额发生的任何形式的净值减少；

6、在保本周期内，基金更换基金管理人的，但担保人或保本义务人书面同意继续承担其相关保本保障责任的除外；

7、因不可抗力的原因导致基金投资亏损；或因不可抗力事件直接导致基金管理人无法按约定履行全部或部分义务或延迟履行义务的，或《基金合同》约定的其他情形基金管理人免于履行保本义务的。

#### 五、责任分担及清偿程序

1、持有人于此同意授权基金管理人作为其代理人代为行使向担保人索偿的权利并办理相关的手续(包括但不限于向担保人发送《履行保证责任通知书》及代收相关款项等)。如果保本周期到期日持有人在第二个保本周期持有到期的基金份额与保本周期到期日基金份额净值的乘积(即“可赎回金额”)加上其第二个保本周期持有到期的基金份额累计分红金额之和计算的总金额低于保本额，基金管理人未能按照《基金合同》的约定全额履行保本义务的，基金管理人应在保本周期到期日后5个工作日内，向担保人发出书面《履行保证责任通知书》(应当载明基金管理人应向持有人支付的本基金保本赔付差额、基金管理人已自行偿付的金额、需担保人支付的代偿款项以及基金管理人指定的本基金在基金托管人处开立的账户信息)。

2、担保人应在收到基金管理人发出的《履行保证责任通知书》后的5个工作日内，将《履行保证责任通知书》载明的代偿款项划入基金管理人指定的本基金在基金托管人处开立的账户中，由基金管理人将该代偿款项支付给持有人。担保人将上述代偿金额全额划入基金管理人指定的本基金在基金托管人处开立的账户中后即为全部履行了保证责任，担保人无须对持有人逐一进行代偿。代偿款项的分配与支付由基金管理人负责，担保人对此不承担责任。

3、基金管理人最迟应在保本周期到期日后10个工作日(含第10个工作日)内将保本赔付差额支付给持有人。

4、如果保本周期到期日持有人在第二个保本周期持有到期的基金份额与保本周期到期日基金份额净值的乘积(即“可赎回金额”)加上其第二个保本周期持有到期的基金份额累计分红金额之和计算的总金额低于保本额，基金管理人及担保人未履行《基金合同》及本合同上述条款中约定的保本义务及保证责任的，自保本周期到期后第21个工作日起，持有人可以根据《基金合同》的约定，直接向基金管理人或担保人请求解决保本赔付差额支付事宜，但持有人直接向担保人追偿的，仅得在保证期间内提出。

#### 六、追偿权、追偿程序和还款方式

1、担保人履行了保证责任后，即有权要求基金管理人归还担保人为履行保证责任支付的全部款项（包括但不限于担保人按《履行保证责任通知书》所载金额支付的实际代偿款项、基金份额持有人直接向担保人要求代偿的金额、基金份额持有人通过召开基金份额持有人大会向担保人要求代偿的金额及担保人为履行保证责任支付的其他金额，前述款项重叠部分不重复计算）和自支付之日起的利息以及担保人的其他费用和损失，包括但不限于担保人为代偿追偿产生的律师费、调查取证费、诉讼费、保全费、评估费、拍卖费、公证费、差旅费、抵押物或质押物的处置费等。

2、基金管理人应自担保人履行保证责任之日起一个月内，向担保人提交担保人认可的还款计划，在还款计划中载明还款时间、还款方式，并按担保人认可的还款计划归还担保人为履行保证责任支付的全部款项和自支付之日起的利息以及担保人的其他费用和损失。基金管理人未能按本条约定提交担保人认可的还款计划，或未按还款计划履行还款义务的，担保人有权要求基金管理人立即支付上述款项及其他费用，并赔偿给担保人造成的损失。

#### 七、担保费的支付

1、基金管理人应按本条规定向担保人支付担保费。

2、担保费支付方式：担保费从基金管理人收取的本基金管理费中列支，按本条第3款公式每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。基金管理人应于每月收到基金管理费之后的五个工作日内向担保人支付担保费。担保人于收到款项后的五个工作日内向基金管理人出具合法发票。

3、每日担保费=为前一日基金资产净值×1.8%/当年天数。

担保费计算期间自基金管理人公告的第二个保本周期开始之日起，至担保人解除保证责任之日或第二个保本周期到期日较早者止，起始日及终止日均应计入期间。

#### 八、适用法律及争议解决方式

本《保证合同》适用中华人民共和国法律。发生争议时，各方应通过协商解决；协商不成的，任何一方可提请位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，按照其时有效的仲裁规则进行仲裁且仲裁裁决为终局，并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

#### 九、其他条款

1、基金管理人应向本基金的基金份额持有人公告本《保证合同》。

2、本《保证合同》自基金管理人、担保人双方法定代表人（或授权代表）签字（或盖人名章）并加盖公司公章之日起成立，自基金管理人公告的第二个保本周期开始之日起生效。

3、本基金第二个保本周期到期日后，基金管理人、担保人双方全面履行了本合同规定的义务，本合同终止。

4、担保人承诺继续对本基金下一个保本周期提供保本保障的，基金管理人、担保人另行签署合同。

大成基金管理有限公司

2016年7月30日