

# 大成中证红利指数证券投资基金 更新招募说明书

(2018年第1期)

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

二〇一八年三月

## 重要提示

大成中证红利指数证券投资基金经中国证监会 2009 年 12 月 22 日证监许可

**【2009】1423 号文核准募集。本基金的基金合同于 2010 年 2 月 2 日正式生效。**

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。

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

投资有风险，投资者申购基金时应认真阅读本更新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。

本招募说明书中与托管业务相关的更新信息已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2018 年 2 月 2 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 12 月 31 日（其中人员变动内容的更新以公告日期为准），财务数据未经审计。

## 目 录

重 要 提 示.....	1
一、绪 言.....	3
二、释 义.....	3
三、基金管理人.....	6
四、基金托管人.....	20
五、相关服务机构.....	23
六、基金合同的生效.....	57
七、基金份额的申购与赎回.....	58
八、基金的投资.....	67
九、基金业绩.....	76
十、基金的融资、融券.....	77
十一、基金的财产.....	77
十二、基金资产估值.....	78
十三、基金的费用与税收.....	83
十四、基金收益与分配.....	84
十五、基金的会计与审计.....	85
十六、基金的信息披露.....	86
十七、风险揭示.....	90
十八、基金合同的变更、终止与基金财产清算.....	92
十九、基金合同内容摘要.....	95
二十、基金托管协议内容摘要.....	109
二十一、对基金份额持有人的服务.....	116
二十二、其他应披露的事项.....	118
二十三、招募说明书更新部分的说明.....	118
二十四、招募说明书的存放及查阅方式.....	119
二十五、备查文件.....	119

## 一、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《大成中证红利指数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《大成中证红利指数证券投资基金基金合同》编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，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《大成中证红利指数证券投资基金基金合同》。

## 二、释 义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1. 基金或本基金：指大成中证红利指数证券投资基金；
2. 基金管理人：指大成基金管理有限公司；
3. 基金托管人：指中国建设银行股份有限公司；
4. 基金合同或本基金合同：指《大成中证红利指数证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充；
5. 托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《大成中证红利指数证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充；
6. 招募说明书：指《大成中证红利指数证券投资基金招募说明书》及其定期的更新；
7. 基金份额发售公告：指《大成中证红利指数证券投资基金份额发售公告》；
8. 法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等；

9. 《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》及颁布机关对其不时做出的修订

10. 《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》及颁布机关对其不时做出的修订

11. 《信息披露办法》：指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布、同年 7 月 1 日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

12. 《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》及对其不时做出的修订

13. 中国证监会：指中国证券监督管理委员会；

14. 银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会；

15. 基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人；

16. 个人投资者：指依据有关法律法规规定或中国证监会批准可投资于证券投资基金的自然人；

17. 机构投资者：指符合法律法规规定的可以投资开放式证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；

18. 合格境外机构投资者：指符合现实有效的相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者；

19. 投资人：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及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人的合称；

20. 基金份额持有人：指依基金合同合法取得基金份额的投资人；

21. 基金销售业务：指基金管理人或代销机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务；

22. 销售机构：指直销机构和代销机构；

23. 直销机构：指大成基金管理有限公司；

24. 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与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构；

25. 基金销售网点：指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点；

26. 注册登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等；

27. 注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。基金的注册登记机构为大成基金管理有限公司或接受大成基金管理有限公司委托代为办理注册登记业务的机构；

28. 基金账户：指注册登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户；

29. 基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖本基金的基金份额变动及结余情况的账户；

30. 基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期；

31. 基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期；

32. 基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月；

33. 存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限；

34. 工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日；

35. T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的工作日；

36. T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日）；

37. 开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日；

38. 交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段；

39. 《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》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金注册登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守；

40. 认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为；

41. 申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为；

42. 赎回：基金投资者根据基金销售网点规定的手续，向基金管理人卖出基金份额的行为；

43. 基金转换：指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规定的

条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金基金份额的行为；

44. 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；

45. 定期定额投资计划：指投资人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人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；

46. 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)超过上一开放日基金总份额的 10%；

47. 元：指人民币元；

48. 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；

49. 基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和；

50. 基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值；

51. 基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数；

52. 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；

53. 指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体；

54. 不可抗力：指本基金合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使本基金合同当事人无法全部或部分履行本基金合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、恐怖袭击、传染病传播、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易。

### 三、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

设立日期：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；2014年10月，任大成基金管理有限公司公司董事；2015年1月起任大成基金管理有限公司副董事长。

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。

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），上海市黄浦区政协委员。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，硕士研究生。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党委委员、总裁助理，兼任投资二部总经理兼行政负责人、投资决策委员会副主任。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：

许国平先生，股东代表监事，中国人民大学国民经济学博士。1987年至2004年先后任中国人民银行国际司处长，东京代表处代表，研究局调研员，金融稳定局体改处处长；2005年6月至2008年1月任中央汇金投资有限责任公司建行股权管理部主任；2005年8月至2016年11月任中国银河金融控股有限责任公司董事、副总经理、党委委员；2007年2月至2016年11月历任中国银河投资管理有限公司董事长、总裁、党委书记；2010年6月至2014年

3月兼任北京银河吉星创业投资有限责任公司董事长；2007年1月至2015年6月任中国银河证券股份有限公司董事；2014年1月至2017年6月任银河基金管理有限公司党委书记；2014年3月至2018年1月任银河基金管理有限公司董事长（至2017年11月）及法定代表人；2018年3月加入大成基金管理有限公司，任股东代表监事。

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、风险管理部总监，现任信息技术部总监。

吴萍女士，职工监事，文学学士，中国注册会计师协会非执业会员。曾任职于中国农业银行深圳分行、日本三和银行深圳分行、普华永道会计师事务所深圳分所。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。2016年10月起兼任大成国际资产管理有限公司董事。

其他高级管理人员：

肖剑先生，副总经理，哈佛大学公共管理硕士。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。曾任职美国Hunton & Williams国际律师事务所纽约州执业律师。中银国际投行业务副总裁，香港三山投资公司董事总经理，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，任首席战略官，2015年8月起任公司副总经理。2016年10月起兼任大成国际资产管理有限公司董事。

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。

谭晓冈先生，副总经理，哈佛大学公共行政管理硕士。曾任财政部世界银行司科长，世界银行中国执基办技术顾问，财政部办公厅处长，全国社保基金理事会办公厅处长、海外投资部副主任。2016年7月加入大成基金管理有限公司，2017年2月起任公司副总经理。

姚余栋先生，副总经理，英国剑桥大学经济学博士。曾任职于原国家经贸委企业司、美国花旗银行伦敦分行。曾任世界银行咨询顾问，国际货币基金组织国际资本市场部和非洲部经济学家，原黑龙江省招商局副局长，黑龙江省商务厅副厅长，中国人民银行货币政策二司副巡视员，中国人民银行货币政策司副司长，中国人民银行金融研究所所长。2016年9月加入大成基金管理有限公司，任首席经济学家，2017年2月起任公司副总经理。

陈翔凯先生，副总经理，香港中文大学工商管理硕士。曾任职于广发证券海南分公司，平安保险集团公司。曾任华安财产保险有限公司高级投资经理，国投瑞银基金管理有限公司固定收益部总监，招商证券资产管理有限公司副总经理。2016年11月加入大成基金管理有限公司，2017年2月起任公司副总经理。

赵冰女士，督察长，清华大学工商管理硕士。曾任职于中国证券业协会资格管理部、专业联络部、基金公司会员部，曾任中国证券业协会分析师委员会委员、基金销售专业委员会委员。曾参与基金业协会筹备组的筹备工作。曾先后任中国证券投资基金业协会投教与媒体公关部负责人、理财及服务机构部负责人。2017年7月加入大成基金管理有限公司，2017年8月起任公司督察长。

## 2. 基金经理

### (1) 现任基金经理

夏高先生，工学博士，6年证券从业经历。2011年1月至2012年5月就职于博时基金管理有限公司，任股票投资部投资分析员。2012年7月加入大成基金管理有限公司，历任数量投资部高级数量分析师及基金经理助理。2014年12月6日起任大成中证红利指数证券投资基金基金经理。2015年6月29日起担任大成中证互联网金融指数分级证券投资基金基金经理。2016年2月3日起担任大成中证360互联网+大数据100指数型证券投资基金基金经理。2017年3月21日起担任大成智慧量化多策略灵活配置混合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	管理本基金时间
袁青	2010年2月2日至2011年5月17日

胡琦	2011年5月18日至2013年3月7日
刘波	2013年3月8日至2014年12月23日

### 3. 公司量化投资决策委员会

公司量化投资决策委员会由6名成员组成，设量化投资决策委员会主席1名，其他委员5名。名单如下：

黎新平，基金经理，数量与指数投资部总监，量化投资决策委员会主席；李绍，期货投资部总监，量化投资决策委员会委员；苏秉毅，基金经理，数量与指数投资部副总监，量化投资决策委员会委员；冉凌浩，基金经理，量化投资决策委员会委员；夏高，基金经理，量化投资决策委员会委员，张钟玉，基金经理，量化投资决策委员会委员。

上述人员之间不存在亲属关系。

#### （三）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。

#### （四）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) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；

- (4) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (5) 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；
- (6) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，符合国务院证券监督管理机构的规定，并履行信息披露义务。

#### （五）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。

#### （六）基金管理人的内部控制制度

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

公司内部控制是指公司为防范和化解风险，保证经营运作符合公司的发展规划，在充分考虑内外部环境的基础上，通过建立组织机制、运用管理方法、实施操作程序与控制措施而形成的系统。公司建立科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系，制定科学完善的内部控制制度。

公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等部分组成。

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

#### 1. 公司内部控制的总体目标

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

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

(3) 确保基金、公司财务和其他信息真实、准确、完整、及时。

## 2. 公司内部控制遵循以下原则

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

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

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

(4) 相互制约原则。公司设置的各部门、各岗位权责分明、相互制衡。

(5) 成本效益原则。公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的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、业绩构成分析以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度，在设定的风险权限额度内进行投资决策。
- 5) 建立科学的投资管理业绩评价体系，包括投资组合情况、是否符合基金产品特征和决策程序、基金绩效归属分析等内容。

(4) 基金交易业务控制主要包括：

- 1) 基金交易实行集中交易制度，基金经理不得直接向交易员下达投资指令或者直接进行交易。
- 2) 建立交易监测系统、预警系统和交易反馈系统，完善相关的安全设施。
- 3) 交易管理部门审核投资指令，确认其合法、合规与完整后方可执行，如出现指令违法违规或者其他异常情况，应当及时报告相应部门与人员。

- 4) 公司执行公平的交易分配制度，确保不同投资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靠性，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，经董事会聘任，对董事会负责。督察长应当经中国证监会相关派出机构认可后方可任职。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。

## 四、基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### (一) 基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

联系人：田 青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于1954年10月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939)，于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

2017年6月末，本集团资产总额216,920.67亿元，较上年末增加7,283.62亿元，增幅3.47%。上半年，本集团实现利润总额1,720.93亿元，较上年同期增长1.30%；净利润较上年同期增长3.81%至1,390.09亿元，盈利水平实现平稳增长。

2016年，本集团先后获得国内外知名机构授予的100余项重要奖项。荣获《欧洲货币》“2016中国最佳银行”，《环球金融》“2016中国最佳消费者银行”、“2016亚太区最佳流动性管理银行”，《机构投资者》“人民币国际化服务钻石奖”，《亚洲银行家》“中国最佳大型零售银行奖”及中国银行业协会“年度最具社会责任金融机构奖”。本集团在英国《银行家》2016年“世界银行1000强排名”中，以一级资本总额继续位列全球第2；在美国《财富》2016年世界500强排名第22位。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等10个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工220余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## （二）主要人员情况

纪伟，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行南通分行、总行计划财务部、信贷经营部任职，并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。其拥有八年托管从业经历，熟悉各项托管业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托

管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原珩，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

### （三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2017年二季度末，中国建设银行已托管759只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行连续11年获得《全球托管人》、《财资》、《环球金融》“中国最佳托管银行”、“中国最佳次托管银行”、“最佳托管专家——QFII”等奖项，并在2016年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

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

### （二）内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作，具有独立行使内控合规工作职权和能力。

### （三）内部控制制度及措施

资产托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，

实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

### 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

#### （一）监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“新一代托管应用监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

#### （二）监督流程

1.每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统，对各基金投资运作比例控制等情况进行监控，如发现投资异常情况，向基金管理人进行风险提示，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，如有重大异常事项及时报告中国证监会。

2.收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。

3.根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性和投资独立性等方面进行评价，报送中国证监会。

4.通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

## 五、相关服务机构

### （一）销售机构及联系人

#### 一、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：乐园



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

全国统一客户服务号码：400-888-5558（免固话长途费）

大成基金深圳投资理财中心

地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层

联系人：肖成卫、关志玲、白小雪

电话：0755-22223523/22223177/22223555

传真：0755-83195235/83195242/83195232

## 二. 代销机构

### 1、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](http://www.ccb.com)

### 2、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：易会满

客服电话：95588

联系人：洪渊

联系电话：010-66105799

传真：010-66107914

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

### 3、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

办公地址：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

联系人：林葛

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

客服电话：95599

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

#### 4、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)

#### 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](http://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](http://www.cmbchina.com)

#### 7、中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人：李庆萍

电话：010-89937369

客服电话：95558

联系人：王晓琳

联系电话：010-89937325

传真：010-65550827

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

#### 8、上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路500号

办公地址：上海市中山东一路12号

法定代表人：吉晓辉

联系人：高天、虞谷云

客服热线：95528

电话：021-61618888

传真：021-63604199

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

#### 9、中国光大银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心

法定代表人：唐双宁

客服电话：95595

联系人：朱红

电话：010-63636153

传真：010-68560312

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

#### 10、中国邮政储蓄银行

注册地址：北京市西城区宣武门西大街131号

办公地址：北京市西城区宣武门西大街131号

法定代表人：李国华

客服电话：95580

传真：010-66415194

联系人：王硕

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

11、北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲17号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙17号

法定代表人：冯丽华

联系人：孔超

电话：010-66223584

传真：010-66226045

客服电话：95526

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

12、华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街22号

办公地址：北京市东城区建国门内大街22号

客服电话：95577

法定代表人：吴建

联系人：李慧

电话：010-85238441

传真：010-85238680

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

13、广发银行股份有限公司

注册地址：广州市越秀区东风东路713号

法定代表人：董建岳

客服电话：95508

电话：020-87310888

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

14、平安银行股份有限公司

注册地址：中国深圳市深南中路1099号

法定代表人：谢永林

电话：021-38637673

传真：0755-22197701

联系人：张莉

客户服务热线：95511-3

网址：<http://bank.pingan.com>

15、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

办公地址：上海市黄浦区中山东二路70号

法定代表人：冀光恒

客服电话：021-962999、400-696-2999

电话：021-61899999

传真：021-50105124

联系人：施传荣

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

16、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)

17、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)

18、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：吴照群

电话：0769-22119061

传真：0769-22117730

客服电话：96228

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

19、杭州银行股份有限公司

办公地址：杭州庆春路46号

法定代表人：吴太普

联系人：严峻

联系电话：0571-85108309

客服电话：95398

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

20、温州银行股份有限公司

注册地址：温州市车站大道华海广场1号楼

办公地址：温州市车站大道196号

法定代表人：邢增福

联系人：林波

电话：0577-88990082

传真：0577-88995217

客户服务热线：96699、浙江省外0577-96699

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

21、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

客服电话：96098、400-86-96098

电话：025-58587018

传真：025-58588164

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

22、渤海银行股份有限公司

注册地址：天津市河东区海河东路218号

法人代表：李伏安

客服电话：95541

联系人：王宏

电话：022-58316666

传真：022-58316259

网址：<http://www.cbhb.com.cn>

23、张家港农村商业银行股份有限公司

注册地址：张家港市杨舍镇人民中路66号

法定代表人：王自忠

客服电话：0512-96065

联系人：施圆圆

电话：0512-56968212

传真：0512-58236370

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

24、深圳农村商业银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南东路3038号合作金融大厦

法定代表人：李伟

电话：0755-25188269

传真：0755-25188785

联系人：王璇

客服电话：961200

网址：[www.961200.net](http://www.961200.net)

25、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)

26、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)

#### 27、哈尔滨银行股份有限公司

注册地址：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

法定代表人：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](http://www.hrbb.com.cn)

#### 28、长沙银行股份有限公司

注册地址：湖南长沙市芙蓉中路1段433号

法定代表人：朱玉国

电话：0731-84305627

传真：0731-89736273

联系人：吴波

客服电话：0731-96511

网址：[www.cscb.cn](http://www.cscb.cn)

#### 29、郑州银行股份有限公司

注册地址：郑州市郑东新区商务外环路22号

法定代表人：王天宇

客服电话：967585(河南地区)、4000-967585(全国)

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

#### 30、中原银行股份有限公司

注册地址：中国河南省郑州郑东新区商务外环路23号中科金座大厦

办公地址：总行地址：郑州市郑东新区CBD商务外环23号中科金座大厦



法定代表人：窦荣兴

联系电话：（86）0371-85517898

传真：（86）0371-85517555

客服电话：95186

网址：<http://www.zybank.com.cn>

31、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>

32、东海期货有限责任公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路23、25、27、29号

办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦8楼

法定代表人：陈太康

联系人：李天雨

联系电话：021-68757102

客服电话：95531/4008888588

网址：[www.qh168.com.cn](http://www.qh168.com.cn)

33、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](http://www.gtja.com)

34、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

35、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号国信证券大厦十六层至二十六层

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

36、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

37、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)

38、中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座

法定代表人：张佑君

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)

39、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：宋卫刚

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

40、海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路689号

法定代表人：瞿秋平（代为履行法定代表人职责）

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

41、申万宏源证券有限公司

通讯地址：上海市徐汇区长乐路989号40层

法定代表人：李梅

客服电话：95523或4008895523

联系人：曹晔

电话：021-54033888

传真：021-54038844

网址：www.sywg.com

42、兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路268号

办公地址：上海市浦东新区长柳路36号

法定代表人：杨华辉

电话：021-38565547

联系人：乔琳雪

网址：www.xyzq.com.cn

客户服务电话：95562

43、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

44、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：王连志

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

45、西南证券股份有限公司

办公地址：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

46、湘财证券股份有限公司

注册地址：长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼

法定代表人：林俊波

客服电话：400-888-1551

联系人：钟康莺

电话：021-68634518-8503

传真：021-68865938

网址：www.xcsc.com

47、万联证券有限责任公司

注册地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501

法定代表人：张建军

联系人：王鑫

联系电话：020-38286651

客服电话：400-8888-133

网址：www.wlzq.com.cn

48、国元证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市寿春路179号

法定代表人：蔡咏

联系电话：0551-2634400

客服电话：400-888-8777、95578

联系人：李蔡

电话：0551-2207114

传真：0551-2207965

网址：www.gyzq.com.cn

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

50、华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路228号

办公地址：南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场

法定代表人：周易

客服电话：4008-888-168、95597

联系人：庞晓芸

电话：0755-82492193

传真：0755-82492962

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

51、山西证券股份有限公司

注册地址：山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

客服电话：0351-8686868

联系人：郭熠

电话：0351-8686659

传真：0351-8686619

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

52、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：95548

联系人：吴忠超

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

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

53、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

客服电话：4008008899

联系人：唐静

联系电话：010-63081000

传真：010-63080978

公司网址：www.cindasc.com

54、东方证券股份有限公司

注册地址：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

客服电话：95503

联系人：胡月茹

电话：021-63325888

传真：021-63326173

网址：www.dfzq.com.cn

55、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

56、长城证券股份有限公司

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

57、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

58、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

59、东北证券股份有限公司

注册地址：长春市生态大街6666号

办公地址：长春市生态大街6666号

法定代表人：李福春

客服电话：95360

联系人：安岩岩

电话：0431-85096517

传真：0431-85096795

网址：www.nesc.cn

60、南京证券股份有限公司

办公地址：南京市玄武区大钟亭8号

法定代表人：步国旬

客服电话：95386

联系人：石健

电话：025-83367888

传真：025-83364032



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

61、上海证券有限责任公司

注册地址: 上海市黄浦区四川中路213号久事商务大厦7楼

法定代表人: 李俊杰

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

62、国联证券股份有限公司

注册地址: 江苏省无锡市县前东街168号

法定代表人: 姚志勇

客服电话: 4008885288

联系人: 沈刚

电话: 0510-82831662

传真: 0510-82830162

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

63、浙商证券股份有限公司

地址: 浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼

法定代表人: 吴承根

联系人: 张智

电话: 021-64716089

客服电话: 95345

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

64、平安证券股份有限公司

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: 曹实凡

客服电话: 95511转8

传真: 0755-82400862

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

65、华安证券有限责任公司

注册地址：安徽省合肥市长江中路357号

法定代表人：李工

客服电话：0551-96518、400-80-96518

联系人：甘霖

电话：0551-5161821

传真：0551-5161672

网址：www.hazq.com

#### 66、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

#### 67、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

#### 68、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：95377

联系人：程月艳、李盼盼、党静

联系电话：0371--69099882

联系传真：0371--65585899

网址：www.ccnew.com

#### 69、国都证券股份有限公司

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

客服电话：400-818-8118

联系人：黄静

电话：010-84183333

传真：010-84183311-3389

网址：www.guodu.com

70、东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州延陵西路23号投资广场18层

办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦

法定代表人：赵俊

电话：021-20333333

传真：021-50498825

联系人：王一彦

客服电话：95531、400-8888-588

网址：www.longone.com.cn

71、中银国际证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层

法定代表人：许刚

客服电话：4006208888

联系人：王炜哲

电话：021-20328309

传真：021-50372474

网址：www.bocichina.com.cn

72、恒泰证券股份有限公司

注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号

法人代表：庞介民

客服电话：0471-4961259

联系人：魏巍

电话：0471-3953168

传真：0471-4930707

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

73、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：徐丽峰

联系人：周欣玲

电话：0791-86281305、13803512671

传真：0791-86281305

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

74、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

客服电话：95538

联系人：吴阳

电话：0531-81283938

传真：0531-81283900

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

75、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](http://www.csc.com.cn)

76、第一创业证券股份有限公司

办公地址：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：95358

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

77、金元证券股份有限公司

注册地址：海南省海口市南宝路36号证券大厦4层（邮政编码：570206）

办公地址：深圳市深南大道4001号时代金融中心17楼（邮政编码：518034）

法定代表人：陆涛

客服电话：4008-888-228

联系人：马贤清

电话：0755-83025022

传真：0755-83025625

网址：www.jyzq.cn

78、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

79、华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层

法定代表人：黄金琳

客服电话：0591-96326

联系人：张宗锐

电话：0591-87383600

传真：0591-87841150

网址：www.gfhfzq.com.cn

80、华龙证券有限责任公司

注册地址：甘肃省兰州市静宁路308号

法定代表人：韩鹏

联系人：杨晓天

联系电话：0931-8784509

传真：0931-4890619

甘肃省客服电话：96668

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

81、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)

82、财通证券有限责任公司

注册地址：杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心

法定代表人：沈继宁

客户联系电话：0571—96336（上海地区：962336）

联系人：乔骏

电话：0571-87925129

传真：0571-87925100

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

83、上海华信证券有限责任公司

注册地址：上海浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼

法定代表人：郭林

客服电话：4008205999

联系人：李颖

电话：021-38784814

传真：021-68774818

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

84、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)

客服电话：021-32109999、029-68918888、4001099918

85、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

客服电话：400-887-8827

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

86、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)

87、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)

88、国融证券股份有限公司（原日信证券）

注册地址：内蒙古自治区呼和浩特市武川县腾飞大道1号4楼

法定代表人：张智河

联系电话：95385、400-660-9839

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

## 89、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

客服电话：95564

网址：www.lxzq.com.cn

## 90、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

## 91、九州证券股份有限公司

注册地址：青海省西宁市南川工业园区创业路108号

办公地址：北京市朝阳区安立路30号仰山公园东一门2号楼

法人代表人：魏先锋

电话：010-57672000

传真：010-57672296

统一客服电话：95305

## 92、国金证券股份有限公司

注册地址：成都市东城根上街95号

客服电话：4006600109

联系人：刘婧漪

电话：028-86690057

传真：028-86690126

客服电话：95310

网址：www.gjzq.com.cn

## 93、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

客服电话：400-889-5618

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

94、华宝证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区环球金融中心57楼

法定代表人：陈林

客服电话：400-820-9898

联系人：刘闻川

电话：021-68778075

传真：021-68868117

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

95、爱建证券有限责任公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1600号1幢32楼

法定代表人：钱华

客服电话：4001-962-502

联系人：陈敏

电话：021-32229888

传真：021-62878783

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

96、英大证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层

法定代表人：吴俊

客服电话：4000-188-688

联系人：吴尔晖

电话：0755-83007159

传真：0755-83007034

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

97、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

客服电话：010-58568118 、400-898-9999

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

98、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

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

99、大通证券股份有限公司

注册地址：大连市中山区人民路24号

办公地址：大连市沙河口区会展路129号大连期货大厦38-39层

法定代表人：李红光

联系人：谢立军

电话：0411-39991807

传真：0411-39673219

客户服务热线：4008-169-169

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

100、宏信证券有限责任公司

办公地址：四川省成都市人民南路二段18号川信大厦10楼

法人代表人：吴玉明

客服电话：4008366366

联系人：刘文涛

电话：02886199765

传真：02886199533

网址：<http://www.hx818.com>

101、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](http://www.txsec.com)

102、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](http://www.new-rand.cn)

客服电话：400-166-1188

103、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

客服电话：400-920-0022

网址：<http://licaike.hexun.com>

104、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](http://www.noah-fund.com)

客服电话：400-821-5399

105、深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦8楼801

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

106、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

客服电话：400-1818-188

网址：www.1234567.com.cn

107、上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室

办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906

法定代表人：杨文斌

客服电话：400-700-9665

联系人：张茹

联系电话：021-58870011

传真：021-68596916

网址：www.ehowbuy.com

108、蚂蚁(杭州)基金销售有限公司（原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：徐晔绯

电话：021-60897840

传真：0571-26698533

客服电话：4000-766-123

网址：www.fund123.cn

## 109、上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层

法定代表人：张跃伟

客服电话：400-820-2899

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

## 110、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

客服电话：4008-773-772

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

## 111、上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室

办公地址：上海市浦东新区峨山路91弄61号1幢14层

法定代表人：李兴春

传真：021-50583633

电话：021-50583533

客服电话：400-921-7755

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

## 112、南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号

办公地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号

法定代表人：刘汉青

客服电话：95177

网址：<https://www.snjjjin.com/>

## 113、北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路甲19号SOHO嘉盛中心30层3001室

法定代表人：周斌

客服电话：4008980618

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

114、北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108

法定代表人：王伟刚

联系人：丁向坤

电话：010-56282140

传真：010-62680827

客服电话：400-619-9059

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

115、北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室

法定代表人：蒋煜

联系人：孙悦

电话：010-58170823

传真：010-58170800

客服电话：400-818-8866

网址：<http://fund.shengshiview.com>

116、北京钱景基金销售有限公司

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)

客服电话：400-893-6885

117、上海万得投资顾问有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座

办公地址：上海市浦东新区福山路33号8楼

法定代表人：王廷富

联系人：姜吉灵

联系电话：021-5132 7185

传真：021-5071 0161

客服电话：400-821-0203

118、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路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)

119、上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济  
发展区）

办公地址：上海市杨浦区昆明路 518 号 a1002 室

法定代表人：王翔

联系人：安彬

客服电话：（021）6537 0077

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

120、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.vstonewealth.com](http://www.vstonewealth.com)

121、上海中正达广投资管理有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室

办公地址：上海市徐汇区龙腾大道2815号3楼

法定代表人：黄欣

公司电话：021-3376 8132

客服电话：400-6767-523

网址：<http://www.zzwealth.cn/>

122、北京虹点基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元

办公地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元

法定代表人：胡伟

传真：010-65951887

电话：010-65951887

客服电话：400-618-0707

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

123、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](http://www.buyfunds.cn)

公司传真：027-87006010

客服电话：400-027-9899

124、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

客服电话：4008219031

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

125、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

客服电话：020-89629066

126、和耕传承基金销售有限公司

注册地址：郑州市郑东新区东风东路东、康宁街北6号楼6楼602、603房间

办公地址：郑州市郑东新区东风东路东、康宁街北6号楼6楼602、603房间

法定代表人：李淑慧

客服电话：4000-555-671

网址：<http://www.hgccpb.com/>

127、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

客服电话：400-684-0500

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

128、北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06

办公地址：北京市大兴区亦庄经济技术开发区科创十一街18号院京东集团总部

法定代表人：江卉

电话：个人业务：95118、400 098 8511

企业业务：400 088 8816

传真：010-8919566

网址：[fund.jd.com](http://fund.jd.com)

129、深圳市金斧子基金销售有限公司

注册地址：深圳市南山区粤海街道科苑路16号东方科技大厦18楼

办公地址：深圳市南山区粤海街道科苑路科兴科学园B3单元7楼

法定代表人：赖任军

联系人：张烨

电话：0755-66892301

传真：0755-26920530

客服电话：4009302888

网址：<https://www.jfz.com/>

130、北京蛋卷基金销售有限公司

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：4000618518

联系人：袁永娇

电话：010-61840688

传真：010-61840699

网址：<https://danjuanapp.com>

#### （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33层

法定代表人：刘卓

电话：0755-83183388

传真：0755-83195229

联系人：黄慕平

#### （三）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

（四）会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址：上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼

执行事务合伙人：李丹

电话：021-23238189

联系人：俞伟敏

经办注册会计师：张振波、俞伟敏

## 六、基金合同的生效

（一）基金合同的生效

根据相关法规和本基金合同的有关规定，本基金合同已于 2010 年 2 月 2 日正式生效。

自基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

（二）基金存续期内基金份额持有人数量和资金量的限制

本基金的基金合同生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 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，如转换运作方式或与其他基金合并等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规另有规定的从其规定。

（三）基金类型及存续期限

基金类型：股票型指数基金

基金运作方式：契约开放式

基金存续期限：不定期

## 七、基金份额的申购与赎回

（一）申购与赎回办理的场所

本基金的申购与赎回将通过基金管理人的直销中心及代销机构的代销网点进行。具体的销售网点将由基金管理人在本招募说明书或其他公告中列明。基金管理人可根据情况变

更或增减代销机构，并予以公告。销售机构可以酌情增加或减少其销售网点、变更营业场所。

## （二）申购与赎回办理的时间

### 1. 开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，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，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

### 2. 申购与赎回的开始时间

本基金已于2010年4月30日起开始办理日常申购、赎回、转换等业务。

## （三）申购与赎回的原则

1. “未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

2. “金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3. 当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销，在当日的开放时间结束后不得撤销。

基金管理人可根据基金运作的实际情况依法对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《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. 申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资人在提交申购申请时须按销售机构规定的方式全额交付申购款项，投资人在提交赎回申请时其在销售机构须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效。

### 2. 申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日)，在正常情况下，本基金注册登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人可在T+2日后(包括该日)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。基金销售机构对申购申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回、转换等申请的确认以注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。对于申购、赎回、转换申请及申购、赎回、转换份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

如基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%，或者基金管理人认为可能存在变相规避50%集中度限制的情形时，基金管理人有权对该单一投资者的申请全部或部分确认失败。由此，给投资者造成的损失，有投资人自行承担。

### 3. 申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将投资人已缴付的申购款项退还给投资人。

投资人赎回申请成功后，基金管理人将通过基金注册登记机构及其相关基金销售机构在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照本基金基金合同有关条款处理。

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

#### （五）申购与赎回的数额限制

1. 投资者每次申购的最低金额为1元人民币。

2. 投资者赎回本基金份额时，可申请将其持有的部分或全部基金份额赎回；本基金可以对投资者每个交易账户的最低基金份额余额以及每次赎回的最低份额做出规定，具体业务规则请见有关公告。

3. 基金管理人可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定的数量或比例限制。基金管理人必须在调整前依照有关规定在指定媒体和基金管理人网站上公告。

4. 单一投资者持有基金份额的比例不得达到或者超过50%，或者以其他方式变相规避50%集中度限制。

#### （六）申购与赎回的费率

本基金目前开通前端收费模式，将来根据市场发展状况和法律法规、监管机构的规定，可能增加新的收费模式，也可能相应增加新的基金份额种类，并可能需计算新基金份额类别的基金份额净值。增加新的收费模式，应当按照法律法规、监管机构的规定，履行适当的程序，并及时公告。新的收费模式的具体业务规则，请见有关公告、通知。

### 1. 申购费率

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

申购金额	申购费率
M<50 万	1.20%
50 万≤M<200 万	0.80%
200 万≤M<500 万	0.50%
500 万≤M	1000 元/笔

### 2. 赎回费率

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

持有年限	赎回费率
Y<1 年	0.50%
1 年≤Y<2 年	0.25%
2 年≤Y	0%

3. 基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

4. 基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资人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必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

5. 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。

### （七）申购份额与赎回支付金额的计算方式

#### 1. 基金申购份额的计算：

净申购金额=申购金额÷（1+申购费率）

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额÷T日基金份额净值

#### 2. 基金净赎回金额的计算：

赎回总额=赎回份数×T日基金份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用

#### 3. 基金份额净值的计算：

T日基金份额净值 = T日基金资产净值÷T日基金份额总数

T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

#### 4. 基金份额、余额的处理：

上述计算结果（包括申购份额）以四舍五入的方法保留小数点后两位。由此误差产生的损失或收益由基金财产承担。

### （八）申购与赎回的注册登记

1. 经基金销售机构同意，基金投资者提出的申购和赎回申请，在基金管理人规定的时间之前可以撤销。

2. 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，自T+2日起的赎回开放日内有权赎回该部分基金份额。

3. 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。

4. 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，并应于实施前2日在至少一种指定媒体上予以公告。

### （九）拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

1. 因不可抗力导致基金无法正常运作。
2. 证券交易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. 发生本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利益的情形。

5. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

6. 基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

发生上述 1—5 暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。

#### （十）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1. 因不可抗力导致基金无法正常运作。
2. 证券交易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. 连续 2 个或 2 个以上开放日发生巨额赎回。
4. 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
5. 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已接受的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。若连续 2 个或 2 个以上开放日发生巨额赎回，延期支付最长不得超过 20 个工作日，并在指定媒体上公告。投资人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并予以公告。

#### （十一）巨额赎回的情形及处理方式

##### 1. 巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请（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）超过前一开放日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

##### 2. 巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回



或部分延期赎回。

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

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10% 的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

(3) 暂停赎回：连续 2 日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒体上进行公告。

### 3. 巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者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，同时在指定媒体上刊登公告。

#### (十二) 暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1. 发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内指定媒体上刊登暂停公告。

2. 如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日的基金份额净值。

3. 如发生暂停的时间超过 1 日但少于 2 周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应最迟提前 2 日在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

4. 如发生暂停的时间超过 2 周，暂停期间，基金管理人应每 2 周至少刊登暂停公告 1 次。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应最迟提前 2 日在指定媒体上连

续刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

### （十三）基金转换

#### 一、业务规则

1、基金转换是指开放式基金份额持有人将其持有某只基金的部分或全部份额转换为同一基金管理人管理的另一只开放式基金的份额，同一只基金的不同份额类别之间不能转换；

2、基金转换只能在同一销售机构已开通代销和转换业务的大成基金管理有限公司管理的开放式基金之间进行；

3、基金转换以基金份额为单位进行申请；

4、基金转换采取未知价法，即基金的转换价格以转换申请受理当日各转出、转入基金的份额资产净值为基准进行计算；

5、基金份额在转换后，持有时间将重新计算；

6、基金份额持有人可将其全部或部分基金份额转换成另一只基金，转出基金最低转出份额为 10 份；

7、单个开放日基金净赎回份额及净转换转出申请份额之和超出上一开放日基金总份额的 10%时，为巨额赎回。发生巨额赎回时，基金转出与基金赎回具有相同的优先级，基金管理人可根据基金资产组合情况，对基金份额持有人提交的转出申请决定全额确认转出或部分确认转出，并且对于基金转出和基金赎回，将采取相同的比例确认；在转出申请得到部分确认的情况下，未确认的转出申请将不予以顺延；

8、投资者办理基金转换业务时，转出方的基金必须处于可赎回状态，转入方的基金必须处于可申购状态；

9、投资者只能在前端收费模式下进行基金转换。

#### 二、基金转换费用

本公司旗下基金间的转换费用由赎回费和申购补差费组成，转出时收取赎回费，转入时收取申购补差费。

基金转出时赎回费的计算：

由非货币基金转出时：

转出总额 = 转出份额 × 转出基金当日基金份额净值

由货币基金转出时：

转出总额 = 转出份额 × 转出基金当日基金份额净值 + 待结转收益（全额转出时）

赎回费用 = 转出总额 × 转出基金赎回费率

转出净额=转出总额-赎回费用

转出份额若含多笔明细时，转出时将按先进先出法(保本型基金按后进先出法)根据各笔明细对应持有期分别计算赎回费用，赎回费用计入基金财产比例遵循转出基金招募说明书约定。

基金转入时申购补差费的计算：

净转入金额=转出净额-申购补差费

其中，申购补差费=MAX【转出净额在转入基金中对应的申购费用-转出净额在转出基金中对应的申购费用，0】

转入份额=净转入金额/转入基金当日基金份额净值

例：投资者申请将持有的大成债券投资基金 3,822.59 份转换为大成精选增值混合型证券投资基金，假设转换当日大成债券投资基金的基金份额净值为 1.0101 元，投资者持有该基金 9 个月，对应赎回费为 0.25%，申购费为 0.8%，大成精选增值混合型证券投资基金的基金份额净值为 0.760 元，申购费为 1.5%，则投资者转换后可得到的大成精选增值混合型基金份额为：

转出总额=3,822.59×1.0101=3,861.20 元

赎回费用=3,861.20×0.25%=9.65 元

转出净额=3,861.20-9.65=3,851.55 元

转出净额在转入基金中对应的净申购金额=3,851.55/1.015=3,794.63 元

转出净额在转入基金中对应的申购费用=3,851.55-3,794.63=56.92 元

转出净额在转出基金中对应的净申购金额=3,851.55/1.008=3,820.98 元

转出净额在转出基金中对应的申购费用=3,851.55-3,820.98=30.57 元

净转入金额=3,851.55-MAX【56.92-30.57，0】=3,825.20 元

转入份额=3,825.20/0.760=5,033.16 份

### 三、基金转换的注册登记

投资者 T 日申请基金转换成功后，注册登记机构将在 T+1 工作日为投资者办理减少转出基金份额、增加转入基金份额的权益登记手续。一般情况下，投资者自 T+2 工作日起有权赎回转入部分的基金份额。

### 四、暂停基金转换的情形及处理

出现下列情况之一时，本公司可以暂停接受基金持有人的基金转换申请：

1、不可抗力的原因导致转出或转入基金无法正常运作。

2、证券交易场所在交易时间非正常停市，导致本公司无法计算当日转出或转入基金资产净值。

3、因市场剧烈波动或其它原因而出现连续巨额赎回，本公司认为有必要暂停接受该基金份额的转出申请。

4、法律、法规、规章规定的其他情形或其他在《基金合同》、《招募说明书》已载明并获中国证监会批准的特殊情形。

发生上述情形之一的，本公司将立即向中国证监会备案并于规定期限内至少一种中国证监会指定媒体上刊登暂停公告。重新开放基金转换时，本公司将按规定予以公告。

#### 五、声明

本公司可以根据市场情况制定或调整上述转换业务规则及有关限制，但应最迟在调整生效前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

#### 六、重要提示

1、投资者欲了解其他情况，请登陆本公司网站（[www.dcfund.com.cn](http://www.dcfund.com.cn)）或拨打本公司热线电话咨询。客户服务中心电话：400-888-5558（免长途通话费）。

2、代销机构受理本公司基金转换业务的具体事宜见各代销机构销售网点的说明。

3、上述基金转换业务规则自2014年7月2日起实行，投资者于2014年7月2日之后（含2014年7月2日）的提交的上述基金转换业务申请适用上述业务规则及转换费率。

4、上述业务的解释权归本公司所有。

#### （十四）基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金注册登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行而产生的非交易过户以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

继承是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、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金注册登记机构的规定办理，并按基金注册登记机构规定的标准收费。

#### （十五）基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构

可以按照规定的标准收取转托管费。

#### （十六）定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人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。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

#### （十七）基金的冻结和解冻

基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

## 八、基金的投资

### （一）投资目标

通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，紧密跟踪标的指数，追求指数投资偏离度和跟踪误差最小化，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。

### （二）投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，主要投资于标的指数的成份股及其备选成份股。此外，为更好的实现投资目标，本基金将适度投资于非标的指数成份股、新股以及法律法规及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%，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。

### （三）投资理念

指数化投资可以在有效分散风险的基础上，以较低的成本获取市场平均回报，有助于投资人实现财富与中国经济及资本市场同步增长的目标；标的指数具有良好的流动性和市场代表性，能够反映沪深证券市场高股息股票的整体走势；通过完全复制法跟踪标的指数，有利于分享优质企业的经营成果。

### （四）投资策略

本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建投资组合，

并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及其他特殊情况（如成份股流动性不足）对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金管理人可以使用其他适当的方法进行调整，以实现跟踪误差的有效控制。

### 1. 投资组合构建

本基金股票资产投资采用完全复制标的指数的方法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建股票投资组合。

### 2. 投资组合调整

本基金为指数型基金，基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整；同时，本基金还将根据法律法规和基金合同规定的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发等因素，对基金投资组合进行调整，追求跟踪误差和跟踪偏离度最小化。

#### （1）定期调整

本基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份股的定期调整，实施定期跟踪调整。

#### （2）不定期调整

##### 1) 与指数相关的调整

根据指数编制规则，当标的指数成份股需进行成份股权重临时调整时，本基金将根据标的指数编制机构发布的临时调整决定及其需调整的权重比例，进行相应调整。

##### 2) 限制性调整

根据法律法规的相关规定及基金合同的约定，如出现标的指数成份股为与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或有其他重大利害关系的公司发行的股票等情形，本基金将进行被动性卖出调整，并相应地对其他资产类别或个股进行微调，保证基金合法规范运行。

##### 3) 根据申购和赎回情况调整

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

##### 4) 其他调整

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

### 3. 替代策略

通常情况下，本基金根据标的指数成份股票在指数中的权重确定成份股票的买卖数量。但在如标的指数成份股流动性严重不足或停牌、标的指数成份股为与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或有其他重大利害关系的公司发行的股票等特殊情况下，本基金可以选择其他股票或股票组合对标的指数中的成份股进行替换。

在选择替代股票时，为尽可能的降低跟踪误差，本基金将采用定性与定量相结合的方法，在对替代与被替代股票上市企业主营业务、价格走势等指标相关性分析的基础上，优先从标的指数成份股及备选成份股中选择基本面良好，流动性充裕的股票进行替代投资。

#### （五）投资决策依据

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

#### （六）投资管理体制及程序

##### 1. 投资管理体制

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

##### 2. 投资程序

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

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

（3）基金经理根据标的指数构成，结合相关研究报告，在基金合同规定的范围内，构建投资组合。在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下，采取适当的方法，降低交易成本、控制投资风险。

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

（5）风险管理部等部门根据市场变化，定期和不定期进行投资绩效评估，并提供相关绩效评估报告。监察稽核部对投资计划的执行进行日常监督和实时风险控制。本基金日均

跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金经理应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

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

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

#### (七) 业绩比较基准

中证红利指数×95%+银行活期存款利率（税后）×5%

本基金的标的指数为中证红利指数，本基金投资范围规定投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%，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%，因此采用中证红利指数和银行活期存款利率（税后）加权的方法构建本基金的业绩比较基准。

中证红利指数由中证指数有限公司编制并发布。该指数精选在上海证券交易所和深圳证券交易所上市的现金股息率高、分红比较稳定、具有一定规模及流动性的 100 只股票作为样本，以反映沪深证券市场高股息股票的整体走势。

如果出现指数编制及发布机构停止本基金标的指数的编制及发布，或标的指数由其他指数替代，或由于指数编制方法等重大变更导致原有标的指数不宜继续作为本基金的标的指数等情形，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，与基金托管人协商一致并履行适当程序后变更本基金的业绩比较基准并及时公告。

#### (八) 风险收益特征

本基金属于股票基金，风险与收益水平高于混合基金、债券基金和货币市场基金。

#### (九) 投资限制

##### 1. 组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

(1) 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；

(2) 本基金的投资比例不得违反本基金合同有关投资范围、投资比例等内容的约定；

(3) 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%；



(4) 相关法律法规以及监管部门规定的其他投资限制；

(5) 法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定；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。

基金的投资组合应在基金合同生效之日起 6 个月内达到规定的标准。由于证券市场波动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比例的，基金管理人应在 10 个交易日内调整达标。

## 2. 禁止行为

依据《基金法》，基金财产不得用于下列投资或活动

1. 承销证券；
2. 违反规定向他人贷款或者提供担保；
3. 从事承担无限责任的投资；
4. 向其基金管理人、基金托管人出资；
5. 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；
6. 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害管理的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，符合国务院证券监督管理机构的规定，并履行信息披露义务。

## (十) 基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

1. 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；

2. 不谋求对上市公司的控股，除依法行使股东权利之外，不参与所投资上市公司的经营管理；

3. 有利于基金财产的安全与增值；

4. 不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

## (十一) 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。

基金托管人中国建设银行根据基金合同规定，于 2018 年 2 月 12 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取自本基金 2017 年第 4 季度报告，截至 2017 年 12 月 31 日。

(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	181,185,538.55	93.11
	其中：股票	181,185,538.55	93.11
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	-	0.00
	其中：债券	-	0.00
	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	-	0.00
	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	12,865,438.94	6.61
8	其他资产	536,311.30	0.28
9	合计	194,587,288.79	100.00

#### 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### (1) 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	0.00
B	采矿业	7,884,112.89	4.08
C	制造业	70,433,146.23	36.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,011,198.46	13.99
E	建筑业	1,364,284.02	0.71
F	批发和零售业	4,550,386.50	2.36
G	交通运输、仓储和邮政业	17,004,238.82	8.80
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	0.00
J	金融业	32,607,108.20	16.88
K	房地产业	16,329,310.53	8.46
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	-	0.00
	合计	177,183,785.65	91.74

## (2) 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	0.00
B	采掘业	-	0.00
C	制造业	3,901,216.01	2.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.01
E	建筑业	-	0.00
F	批发和零售业	-	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	17,957.94	0.01
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,112.55	0.02
J	金融业	-	0.00
K	房地产业	-	0.00
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	32,323.20	0.02
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	-	0.00
	合计	4,001,752.90	2.07

## 3. 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无

## 4. 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投资明细

(1) 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例
----	------	------	-------	---------	-----------

					(%)
1	601088	中国神华	203,391	4,712,569.47	2.44
2	000895	双汇发展	157,900	4,184,350.00	2.17
3	000651	格力电器	76,868	3,359,131.60	1.74
4	600104	上汽集团	103,835	3,326,873.40	1.72
5	600741	华域汽车	106,316	3,156,522.04	1.63
6	600066	宇通客车	129,652	3,120,723.64	1.62
7	601288	农业银行	796,129	3,049,174.07	1.58
8	601398	工商银行	491,427	3,046,847.40	1.58
9	601988	中国银行	712,034	2,826,774.98	1.46
10	601328	交通银行	425,835	2,644,435.35	1.37

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002545	东方铁塔	232,300	2,014,041.00	1.04
2	600309	万华化学	38,458	1,459,096.52	0.76
3	002920	德赛西威	4,569	178,784.97	0.09
4	300735	光弘科技	3,237	46,580.43	0.02
5	002915	中欣氟材	1,085	38,181.15	0.02

#### 5.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7. 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。

#### 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 9.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。

#### 10. 报告期末本基金投资的估值期货交易情况说明

##### (1) 报告期末本基金投资的估值期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

##### (2) 本基金投资估值期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

#### 11. 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。

#### 12. 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未出现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。

(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	15,097.82
2	应收证券清算款	266,752.06
3	应收股利	-
4	应收利息	2,550.33
5	应收申购款	251,911.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	536,311.30

##### (4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

##### (5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

##### (6) 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002545	东方铁塔	2,014,041.00	1.04	临时停牌
2	600309	万华化学	1,459,096.52	0.76	临时停牌

##### (7) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## 九、基金业绩

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

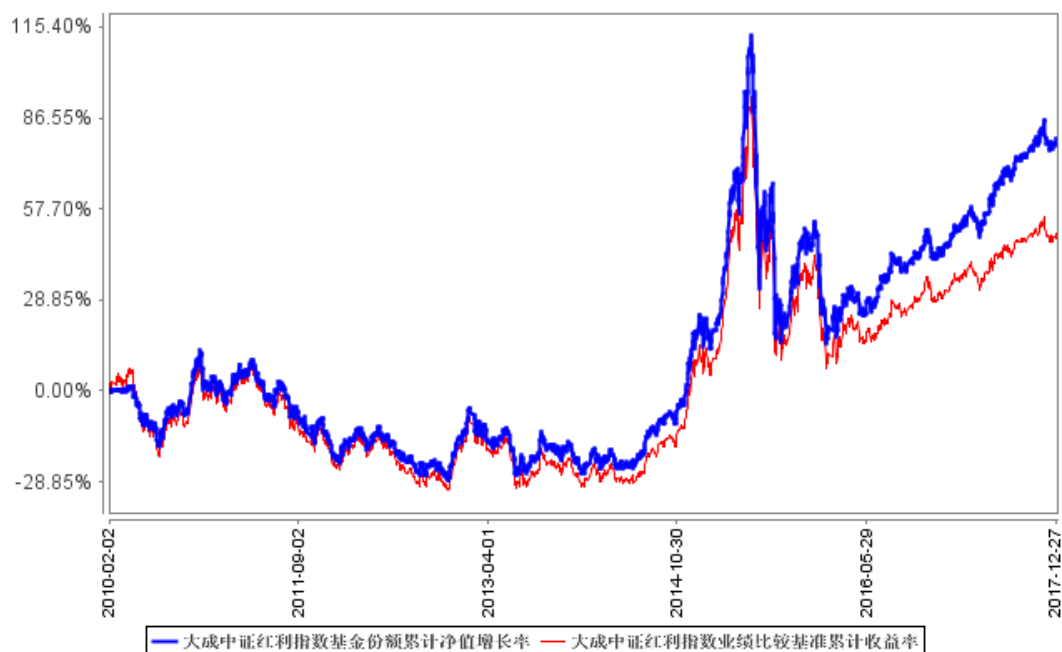
(一) 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较：

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
2010.2.2（基金合同生效日）—2010.12.31	1.60%	1.25%	-1.27%	1.45%	2.87%	-0.20%
2011.1.1—2011.12.31	-22.05%	1.16%	-22.44%	1.19%	0.39%	-0.03%
2012.1.1—2012.12.31	7.20%	1.14%	6.80%	1.15%	0.40%	-0.01%
2013.1.1—2013.12.31	-7.54%	1.38%	-9.54%	1.41%	2.00%	-0.03%
2014.1.1—2014.12.31	51.59%	1.07%	48.70%	1.08%	2.89%	-0.01%
2015.1.1—2015.12.31	25.29%	2.67%	25.90%	2.51%	-0.61%	0.16%
2016.1.1—2016.12.31	-4.49%	1.36%	-7.15%	1.35%	2.66%	0.01%
2017.01.01-2017.12.31	26.26%	0.56%	16.67%	0.56%	9.59%	0.00%
2010.2.2—2017.12.31	79.80%	1.44%	50.04%	1.43%	29.76%	0.01%

(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

本基金份额累计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

(2010年2月2日至2017年12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。在建仓期结束及本报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

## 十、基金的融资、融券

本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资、融券。

## 十一、基金的财产

### （一）基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款以及其他资产的价值总和。

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

本基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、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相独立。

### （四）基金财产的处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产，并由基金托管人保管。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入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的费用。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。基金管理人、基金托管人、基金注册登记机构等以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

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财产。

除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 十二、基金资产估值

### （一）估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场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。

### （二）估值原则

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

2. 对存在活跃市场的投资品种，如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

3. 当投资品种不再存在活跃市场，且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，应采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。

### （三）估值方法

#### 1. 证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的



市价（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，以最近交易日的市价（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，确定公允价值。

（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，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，确定公允价值；

（3）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。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，确定公允价值；

（4）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2. 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

（2）首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

（3）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市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

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

4. 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。

5. 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

6. 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或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，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

#### （四）估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其他投资等资产。

#### （五）估值程序

1. 基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2. 基金管理人应每个工作日对基金资产估值。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。季末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

#### （六）估值错误的处理

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。当基金份额净值小数点后 3 位以内(含第 3 位)发生差错时，视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### 1. 差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或代销机构、或投资人自身等的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失当事人(“受损方”)的直接损失按下述“差错处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

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

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可

抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

## 2. 差错处理原则

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

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

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

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；追偿过程中产生的有关费用，应列入基金费用，从基金资产中支付。

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

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

## 3. 差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

任方；

- (2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；
- (3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；
- (4) 根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认。

4. 基金份额净值差错处理的原则和方法如下：

(1) 基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2) 错误偏差达到基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告。

(3) 因基金份额净值计算错误，给基金或基金份额持有人造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

(4) 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

(5) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

(七) 暂停估值的情形

1. 基金投资所涉及的证券交易市场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资产价值时；
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人的利益，已决定延迟估值；
4. 中国证监会和基金合同认定的其他情形。

(八) 基金净值的确认

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，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产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净值予以公布。

(九) 特殊情况的处理

1. 基金管理人或基金托管人按估值方法的第 5 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。
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，或国家会

计政策变更、市场规则变更等，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免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

### 十三、基金的费用与税收

#### （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. 基金财产拨划支付的银行费用；
4. 基金合同生效后的基金信息披露费用；
5. 基金份额持有人大会费用；
6. 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
7. 基金的证券交易费用；
8. 在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；
9. 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

#### （三）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

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

##### 2. 基金托管人的托管费

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

下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3. 除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

#### （四）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费用不从基金财产中支付。

（五）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人应于新的费率实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

#### （六）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

## 十四、基金收益与分配

### （一）基金收益的构成

1. 买卖证券差价；
2. 基金投资所得红利、股息、债券利息；
3. 银行存款利息；
4. 已实现的其他合法收入；
5. 持有期间产生的公允价值变动。

因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

### （二）可供分配利润

可供分配利润指收益分配基准日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

### （三）收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

1. 本基金的每份基金份额享有同等分配权；
2. 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人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投资人的现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额；
3. 本基金收益每年最多分配 12 次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 20%；
4. 若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；
5. 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
6. 基金红利发放日距离收益分配基准日（即期末可供分配利润计算截至日）的时间不得超过 15 个工作日；
7. 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；
8. 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### （四）收益分配方法

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

#### （五）收益分配的时间和程序

1. 基金收益分配方案由基金管理人拟订，由基金托管人复核，依照《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；
2. 在收益分配方案公布后，基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

## 十五、基金的会计与审计

### （一）基金的会计政策

1. 基金管理人为本基金的会计责任方；
2. 本基金的会计年度为公历每年的 1 月 1 日至 12 月 31 日，基金募集所在的会计年度，如果基金合同生效少于 2 个月，可以并入下一个会计年度；

3. 本基金的会计核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
4. 本基金的会计制度执行国家有关的会计制度；
5. 本基金独立建账、独立核算；
6. 基金管理人保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
7. 基金托管人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书面确认。

## （二）基金的审计

1. 基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。
2. 会计师事务所更换经办注册会计师时，应事先征得基金管理人同意。
3. 基金管理人（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，经基金托管人（或基金管理人）同意，并报中国证监会备案后可以更换。就更换会计师事务所，基金管理人应当依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

## 十六、基金的信息披露

基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应当依法披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应按规定将应予披露的基金信息披露事项在规定时间内通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）和基金管理人、基金托管人的互联网网站（以下简称“网站”）等媒体披露。

本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

1. 虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
2. 对证券投资业绩进行预测；
3. 违规承诺收益或者承担损失；
4. 诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金份额发售机构；
5. 登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；



## 6. 中国证监会禁止的其他行为。

本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

公开披露的基金信息包括：

### （一）招募说明书

招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件。

基金管理人按照《基金法》、《信息披露办法》、基金合同编制并在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书登载在指定报刊和网站上。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，将更新的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人将在公告的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。更新后的招募说明书公告内容的截止日为每6个月的最后1日。

### （二）基金合同、托管协议

基金管理人应在基金份额发售的3日前，将基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应将基金合同、托管协议登载在各自网站上。

### （三）基金份额发售公告

基金管理人应按照《基金法》、《信息披露办法》的有关规定，就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

### （四）基金合同生效公告

基金管理人应在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。基金合同生效公告中应说明基金募集情况。

### （五）基金资产净值公告、基金份额净值公告、基金份额累计净值公告

1. 本基金的基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值；

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

3. 基金管理人应公告半年度和年度最后一个市场交易日（或自然日）基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应在上述市场交易日（或自然日）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。

#### （六）基金份额申购、赎回价格公告

基金管理人应当在本基金的基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资人能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

#### （七）基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告

1. 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。基金年度报告需经具有从事证券相关业务资格的会计师事务所审计后，方可披露；

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

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

5. 基金定期报告应当按有关规定分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

报告期内出现单一投资者持有基金份额比例超过 20% 的情形，基金管理人应当在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告文件中披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及产品的特有风险。

#### （八）临时报告与公告

在基金运作过程中发生如下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时，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：

1. 基金份额持有人大会的召开及决议；
2. 终止基金合同；
3. 转换基金运作方式；
4. 更换基金管理人、基金托管人；
5. 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
6. 基金管理人股东及其出资比例发生变更；
7. 基金募集期延长；

8. 基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
9. 基金管理人的董事在一年内变更超过 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、增加或减少代销机构；
20. 基金更换注册登记机构；
21. 本基金开始办理申购、赎回；
22. 本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
23. 本基金发生巨额赎回并延期支付；
24. 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
25. 本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
26. 中国证监会或本基金合同规定的其他事项。

#### （九）澄清公告

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

#### （十）基金份额持有人大会决议

#### （十一）中国证监会规定的其他信息

#### （十二）信息披露文件的存放与查阅

基金合同、托管协议、招募说明书或更新后的招募说明书、年度报告、半年度报告、季度报告和基金份额净值公告等文本文件在编制完成后，将存放于基金管理人所在地、基

金托管人所在地，供公众查阅。投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

投资人也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。本基金的信息披露事项将在指定媒体上公告。

本基金的信息披露将严格按照法律法规和基金合同的规定进行。

## 十七、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。

## （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）本基金特有风险

### 1. 指数下跌风险

本基金采用完全复制法跟踪标的指数，份额净值增长率与标的指数增长率相似。标的指数成份股票下跌可能造成指数下跌，相应地，本基金份额净值也存在下跌风险。

### 2. 标的指数的风险

由于指数编制方法等原因，有可能导致标的指数的表现与高股息股票的整体表现存在差异，从而存在本基金的净值表现与沪深证券市场高股息股票的整体走势存在差异的风险。

### 3. 跟踪偏离风险

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

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

（3）成份股派发现金红利、新股市值配售收益可能导致基金收益率超过标的指数收益率，从而产生跟踪偏离。

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

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

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

指数的跟踪程度。

(7) 其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同；由于本基金不能投资“基金托管人发行的股票与基金管理人、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”，若标的指数样本股包含上述证券时，可能造成跟踪误差；因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大；因基金申购与赎回带来的现金变动；因指数发布机构指数编制错误等，由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

#### (五) 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。

#### (六) 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。

## 十八、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. 基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

- (1) 转换基金运作方式；
- (2) 变更基金类别；
- (3) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略，但因法律法规要求而变更的除外；
- (4) 变更基金份额持有人大会程序；

- (5) 更换基金管理人、基金托管人；
- (6) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；
- (9) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

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

- (1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- (2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率或调低赎回费率；
- (3) 因相应的法律法规发生变动应当对基金合同进行修改；
- (4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- (5) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- (6) 经监管机构允许，基金管理人、注册登记机构、代销机构在法律法规规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；
- (7) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

2. 关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行，并自生效之日起 2 日内在至少一种指定媒体公告。

## （二）本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

- 1. 基金份额持有人大会决定终止的；
- 2. 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在 6 个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；
- 3. 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；
- 4. 中国证监会规定的其他情况。

## （三）基金财产的清算

### 1. 基金财产清算组

- (1) 自出现基金合同终止事由起 30 个工作日内，成立基金财产清算组，基金财产清

算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

(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。

## 2. 基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- (1) 基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- (2) 基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (3) 对基金财产进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行估价和变现；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- (6) 聘请律师事务所出具法律意见书；
- (7) 将基金财产清算结果报告中国证监会；
- (8) 参加与基金财产有关的民事诉讼；
- (9) 公布基金财产清算结果；
- (10) 对基金剩余财产进行分配。

## 3. 清算费用

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

## 4. 基金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) — (3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

## 5. 基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清



算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

#### 6. 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 十九、基金合同内容摘要

### （一）基金管理人的权利和义务

#### 1. 基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

（1）自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；

（2）依照本基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

（3）发售基金份额；

（4）依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

（5）在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；

（6）根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

（7）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；

（8）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；

（9）自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；

（10）选择、更换代销机构，并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；

（11）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；

（12）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（13）依法召集基金份额持有人大会；

（14）法律法规和基金合同规定的其他权利。

## 2. 基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

- (1) 依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- (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) 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；
- (7) 依法接受基金托管人的监督；
- (8) 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- (9) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；
- (10) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- (11) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- (12) 编制中期和年度基金报告；
- (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，不得泄露基金投资计划、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保密，不得向他人泄露；
- (15) 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- (16) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (17) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- (18) 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；
- (19) 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；

(20) 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合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 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；

(22) 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

(23) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

(24) 执行生效的基金份额持有人大会决议；

(25) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

(26) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

(27) 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

## (二) 基金托管人的权利和义务

### 1. 基金托管人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：

(1) 依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

(2) 监督基金管理人对本基金的投资运作；

(3) 自本基金合同生效之日起，依法保管基金资产；

(4) 在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；

(5) 根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

(6) 依法召集基金份额持有人大会；

(7) 按规定取得基金份额持有人名册资料；

(8) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

### 2. 基金托管人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：

(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) 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；
- (4) 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，不得委托第三人托管基金财产；
- (5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- (6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
- (7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
- (8) 对基金财务会计报告、中期和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照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；
- (9) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- (10) 按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (11) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (12) 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；
- (13) 按照规定监督基金管理人的投资运作；
- (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) 因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (18) 基金管理人因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；
- (19) 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；
- (20) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；
- (21) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- (22) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
- (23) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (24) 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

### （三）基金份额持有人的权利和义务

#### 1. 基金份额持有人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：

- （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、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- （9）法律法规和基金合同规定的其他权利。

每份基金份额具有同等的合法权益。

#### 2. 基金份额持有人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务为：

- （1）遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- （2）交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
- （3）在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- （4）不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；
- （5）执行生效的基金份额持有人大会决议；
- （6）返还在基金交易过程中因各种原因，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；
- （7）法律法规和基金合同规定的其他义务。

### （四）基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

1. 基金份额持有人大会由基金份额持有人组成。基金份额持有人持有的每一基金份额具有同等的投票权。

#### 2. 召开事由

- （1）当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或持有基金份额

10%以上(含 10%，下同)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)提议时，应当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) 变更基金类别；
- 4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略，但因法律法规要求而变更的除外；
- 5) 变更基金份额持有人大会程序；
- 6) 更换基金管理人、基金托管人；
- 7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求提高该等报酬标准的除外；
- 8) 本基金与其他基金的合并；
- 9) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；
- 10) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

(2) 出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同，不需召开基金份额持有人大会：

- 1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- 2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率或调低赎回费率；
- 3) 因相应的法律法规发生变动应当对基金合同进行修改；
- 4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- 5) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- 6) 经监管机构允许，基金管理人、注册登记机构、代销机构在法律法规规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；
- 7) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

### 3. 召集人和召集方式

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

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

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

(4) 代表基金份额 10%以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会,而基金管理人、基金托管人都不召集的,代表基金份额 10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会,但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

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

#### 4. 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

(1) 基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会,召集人必须于会议召开日前 30 日在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容:

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

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

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

#### 5. 基金份额持有人出席会议的方式

##### (1) 会议方式

1) 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。

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

3) 通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

4) 会议的召开方式由召集人确定。

##### (2) 召开基金份额持有人大会的条件

###### 1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

① 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上(含 50%，下同)；

② 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托书代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的注册登记资料相符。

###### 2) 通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

① 召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

② 召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人(分别或共同称为“监督人”)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；

③ 召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见，如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的，不影响表



决效力；

④ 本人直接出具书面意见和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；

⑤ 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人提交的持有基金份额的凭证、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。

## 6. 议事内容与程序

### (1) 议事内容及提案权

1) 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 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就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

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

关联性。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。

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

4) 单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

5) 基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当在基金份额持有人大会召开前 30 日及时公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

### (2) 议事程序

#### 1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的，其授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额 50%以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名(或单位名称)、身份证号码、持有或代表有表决权的基金份额数量、委托人姓名(或单位名称)等事项。

## 2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后第 2 个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，则在公证机关监督下形成的决议有效。

3) 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 7. 决议形成的条件、表决方式、程序

(1) 基金份额持有人所持每一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) 一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的 50%以上通过方为有效，除下列 2)所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过；

### 2) 特别决议

特别决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效；涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。

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

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

(5) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

(6) 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。

## 8. 计票

### (1) 现场开会

1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人；但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

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

3) 如大会主持人对于提交的表决结果有异议，可以对投票数进行重新清点；如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。

### (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，则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。

## 9. 基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

(1) 基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。关于本章第 2. 条所规定的第 1)–8)项召开事由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，关于本章第 2. 条所规定的第 9)、10)项召开事由的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或出具无异议意见后方可执行。

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

(3) 基金份额持有人大会决议应自生效之日起2日内在指定媒体公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

10. 法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

(五) 基金合同解除和终止的事由、程序

1. 基金合同的变更

(1) 基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

1) 转换基金运作方式；

2) 变更基金类别；

3) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略，但因法律法规要求而变更的除外；

4) 变更基金份额持有人大会程序；

5) 更换基金管理人、基金托管人；

6) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外；

7) 本基金与其他基金的合并；

8) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；

9) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

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

1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；

2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率或调低赎回费率；

3) 因相应的法律法规发生变动应当对基金合同进行修改；

4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；

5) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

6) 经监管机构允许，基金管理人、注册登记机构、代销机构在法律法规规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；

7) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

(2) 关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行，并自生效之日起2日内在至少一种指定媒体公告。

## 2. 本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

- (1) 基金份额持有人大会决定终止的；
- (2) 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；
- (3) 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；
- (4) 中国证监会规定的其他情况。

## 3. 基金财产的清算

### (1) 基金财产清算组

1) 自出现基金合同终止事由起30个工作日内，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

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。

### (2) 基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- 1) 基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- 2) 基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- 3) 对基金财产进行清理和确认；
- 4) 对基金财产进行估价和变现；
- 5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- 6) 聘请律师事务所出具法律意见书；

- 7) 将基金财产清算结果报告中国证监会;
- 8) 参加与基金财产有关的民事诉讼;
- 9) 公布基金财产清算结果;
- 10) 对基金剩余财产进行分配。

#### (3) 清算费用

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

#### (4) 基金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) — 3) 项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

#### (5) 基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

#### (6) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

### (六) 争议解决方式

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本基金合同受中国法律管辖。

#### (七) 基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同正本一式 8 份，除中国证监会和银行业监督管理机构各持 2 份外，基金管理

人和基金托管人各持有两份。每份均具有同等的法律效力。

基金合同可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅，但其效力应以基金合同正本为准。

## 二十、基金托管协议内容摘要

### （一）托管协议当事人

#### 1. 基金管理人

名称：大成基金管理有限公司

注册地址：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

邮政编码：518040

法定代表人：刘卓

成立日期：1999 年 4 月 12 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1999]10 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：贰亿元

存续期间：持续经营

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

#### 2. 基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

邮政编码：100033

法定代表人：田国立

成立日期：2004 年 09 月 17 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门

批准的其他业务。

(二) 基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

1. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池和交易对手库，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，主要投资于标的指数的成份股及其备选成份股。此外，为更好的实现投资目标，本基金将适度投资于非标的指数成份股、新股以及法律法规及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%，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。

2. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

(1) 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；

(2) 本基金的投资比例不得违反基金合同有关投资范围、投资比例等内容的约定；

(3) 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%；

(4) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制；

(5) 法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定；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。

基金的投资组合应在基金合同生效之日起 6 个月内达到规定的标准。由于证券市场波动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比例的，基金管理人应在 10 个交易日内调整达标。

3. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对本托管协议第十五条第九款基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关



系的公司名单及有关关联方发行的证券名单。基金管理人和基金托管人有责任确保关联交易名单的真实性、准确性、完整性，并负责及时将更新后的名单发送给对方。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生，如基金托管人采取必要措施后仍无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告。对于基金管理人已成交的关联交易，基金托管人事前无法阻止该关联交易的发生，只能进行事后结算，基金托管人不承担由此造成的损失，并向中国证监会报告。

4. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新，新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的，应向基金托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前3个工作日内与基金托管人协商解决。

基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失，基金托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。若未履约的交易对手在基金托管人与基金管理人确定的时间前仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，基金管理人可以对相应损失先行予以承担，然后再向相关交易对手追偿。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

5. 本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人就相关事项签订补充协议，明确基金投资流通受限证券的比例。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。

6. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、基

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监督和核查。

7. 基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、基金合同和本托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

8. 基金管理人负有义务配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或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律法规、基金合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

9. 若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，由此造成的损失由基金管理人承担。

10. 基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

### （三）基金管理人对于基金托管人的业务核查

1. 基金管理人对于基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括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、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时，应及时以电话提醒及书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到书面通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金管理人发出回

函，就基金管理人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，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。

3. 基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

#### （四）基金财产的保管

##### 1. 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。
- （3）基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。
- （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）基金托管人根据基金管理人的指令，按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。

（6）对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失，基金托管人对此不承担任何责任。

- （7）除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

##### 2. 基金募集期间及募集资金的验资

（1）基金募集期间募集的资金应存于基金管理人在基金托管人的营业机构开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。

（2）基金募集期满或基金停止募集时，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》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金资金账户，同时在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。

- （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

退款等事宜。

### 3. 基金资金账户的开立和管理

(1) 基金托管人可以基金的名义在其营业机构开立基金的银行账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。

(2) 基金资金账户的开立和使用，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任何其他资金账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

(3) 基金资金账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

(4) 在符合法律法规规定的条件下，基金托管人可以通过基金托管人专用账户办理基金资产的支付。

### 4. 基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

(1) 基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

(2) 基金证券账户的开立和使用，仅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未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户，亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

(3) 基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

(4) 基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算互保基金、交收价差资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

(5) 若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，若无相关规定，则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

### 5. 债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

## 6. 其他账户的开立和管理

(1) 因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定，由基金托管人负责开立。新账户按有关规定使用并管理。

(2) 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

## 7. 基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库，也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库，保管凭证由基金托管人持有。实物证券等有价凭证的购买和转让，由基金管理人和基金托管人共同办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

## 8. 与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定外，基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同包括但不限于基金年度审计合同及基金投资业务中产生的重大合同，基金管理人应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时以加密方式将重大合同传真给基金托管人，并在 30 个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限为基金合同终止后 15 年。

## (五) 基金资产净值计算与复核

### 1. 基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

#### (1) 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。

基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数，基金份额净值的计算，精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入，国家另有规定的，从其规定。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，经基金托管人复核，按规定公告。

#### (2) 复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。季末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

(3) 根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见的，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

#### (六) 基金份额持有人名册的登记与保管

基金份额持有人名册至少应包括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由基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，保存期不少于 15 年。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

在基金托管人要求或编制半年报和年报前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其真实性、准确性和完整性。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于本基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

#### (七) 争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均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，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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

本协议受中国法律管辖。

#### (八) 托管协议的修改与终止

##### 1. 托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准或备案后生效。

##### 2. 基金托管协议终止出现的情形

- (1) 基金合同终止；
- (2) 基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；
- (3) 基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；
- (4) 发生法律法规或基金合同规定的终止事项。

## 二十一、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 大成基金为基金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。

（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。

## 二十二、其他应披露的事项

(一) 本基金管理人目前无重大诉讼事项。

(二) 最近 3 年本基金管理人及高级管理人员没有受到任何处罚。

(三) 2017 年 8 月 3 日至 2018 年 2 月 2 日发布的公告:

1. 2017 年 8 月 12 日《大成基金管理有限公司督察长任职公告》。
2. 2017 年 8 月 24 日《大成中证红利指数证券投资基金 2017 年半年度报告》。
3. 2017 年 9 月 1 日《大成基金管理有限公司关于通过网上直销系统大成钱柜交易实施费率优惠活动的公告》。
4. 2017 年 9 月 8 日《关于增加招商银行股份有限公司为销售机构的公告》。
5. 2017 年 9 月 9 日《关于增加华西证券股份有限公司为代销机构的公告》。
6. 2017 年 9 月 15 日《大成中证红利指数证券投资基金更新招募说明书(2017 年第 2 期)》、《大成中证红利指数证券投资基金更新招募说明书(2017 年第 2 期)-摘要》。
7. 2017 年 9 月 18 日《关于旗下部分基金增加上海中正达广投资管理有限公司为销售机构的公告》。
8. 2017 年 10 月 12 日《关于增加上海利得基金销售有限公司为销售机构的公告》。
9. 2017 年 10 月 27 日《大成中证红利指数证券投资基金 2017 年第 3 季度报告》。
10. 2017 年 12 月 8 日《关于旗下部分基金增加和耕传承基金销售有限公司为销售机构的公告》。
11. 2017 年 12 月 12 日《关于增加南京苏宁基金销售有限公司为销售机构的公告》。
12. 2018 年 1 月 20 日《大成中证红利指数证券投资基金 2017 年四季度报告》。

## 二十三、招募说明书更新部分的说明

本更新的招募说明书依据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》及其他有关法律法规的要求,对 2017 年 9 月 15 日公布的《大成中证红利指数证券投资基金



更新的招募说明书 2017 年第 2 期)》进行了补充和更新，主要修改内容如下：

1. 根据最新资料，更新了“重要提示”部分内容。
2. 根据最新资料，更新了“三、基金管理人”部分。
3. 根据最新资料，更新了“四、基金托管人”部分。
4. 根据最新资料，更新了“五、相关服务机构”部分。
5. 根据最新情况，更新了“七、基金份额的申购与赎回”部分内容。
6. 根据最新数据，更新了“九、基金的投资”部分。
7. 根据最新数据，更新了“十、基金业绩”部分。
8. 根据最新情况，更新了“十六、基金的信息披露”部分内容。
9. 根据最新公告，更新了“二十二、其他应披露的事项”。
10. 根据最新公告，更新了“二十三、对招募说明书更新部分的说明”。

## 二十四、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、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。

## 二十五、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中证红利指数证券投资基金募集的文件
- （二）《大成中证红利指数证券投资基金基金合同》
- （三）《大成中证红利指数证券投资基金托管协议》
- （四）《大成基金管理有限公司开放式基金注册登记业务规则》
- （五）法律意见书
- （六）基金管理人业务资格批件和营业执照

- (七) 基金托管人业务资格批件和营业执照
- (八) 中国证监会要求的其他文件

大成基金管理有限公司

二〇一八年三月十六日