

**大成策略回报混合型证券投资基金**  
**(原大成策略回报股票型证券投资基金)**  
**基金合同**

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

## 目 录

一、前 言.....	2
二、释 义.....	3
三、基金的基本情况.....	6
四、基金份额的发售.....	7
五、基金备案.....	8
六、基金份额的申购、赎回与转换.....	9
七、基金的非交易过户、转托管、冻结与质押.....	15
八、基金合同当事人及其权利义务.....	16
九、基金份额持有人大会.....	21
十、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序.....	27
十一、基金托管.....	29
十二、基金的销售.....	29
十三、基金份额的注册登记.....	29
十四、基金的投资.....	30
十五、基金的融资、融券.....	38
十六、基金的财产.....	38
十七、基金资产估值.....	39
十八、基金费用与税收.....	44
十九、基金收益与分配.....	46
二十、基金的会计与审计.....	47
二十一、基金的信息披露.....	47
二十二、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	51
二十三、违约责任.....	53
二十四、争议的处理.....	54
二十五、基金合同的效力.....	54
二十六、业务规则.....	54
二十七、其他事项.....	55
二十八、基金合同当事人盖章及法定代表人或授权代表签字、签订地、签订日.....	55

## 一、前言

为保护基金投资者合法权益，明确基金合同当事人的权利与义务，规范基金运作，依照《中华人民共和国合同法》、《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《运作管理办法》）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露管理办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售管理办法》）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）及相关法律法规，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者合法权益的原则基础上，订立《大成策略回报混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“本基金合同”或“基金合同”）。

本基金合同是约定本基金合同当事人之间基本权利义务的法律文件，其他与本基金相关的涉及基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，如与本基金合同冲突，以本基金合同为准。本基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金管理人和基金托管人自本基金合同生效之日起成为本基金合同的当事人。基金投资者自依本基金合同取得本基金基金份额起，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本基金合同的承认和接受。基金份额持有人作为本基金合同当事人并不以在本基金合同上书面签章为必要条件。本基金合同的当事人应按照《基金法》、本基金合同及其他有关法律法规的规定享有权利、承担义务。

大成策略回报混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）由基金管理人按照《基金法》、本基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）核准。中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对本基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

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，但由于证券投资具有一定的风险，因此不保证投资于本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益。

投资人应当认真阅读基金合同、基金招募说明书、基金产品资料概要等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

本基金合同约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《信息披露办法》实施

之日起一年后开始执行。

现行法律法规变更引起本基金合同事项变更,或者本基金合同相关事项变更对基金份额持有人权利或权益无不良影响,经基金管理人和托管人协商一致,并经监管机关备案,依法进行公告,可以不召开基金份额持有人大会即对本合同进行修改。

## 二、释 义

本基金合同中,除非文意另有所指,下列词语或简称具有如下含义:

基金或本基金:	指大成策略回报混合型证券投资基金;
基金合同或本基金合同:	指《大成策略回报混合型证券投资基金基金合同》及对本合同的任何有效修订和补充;
招募说明书:	指《大成策略回报混合型证券投资基金招募说明书》及其更新;
发售公告:	指《大成策略回报股票型证券投资基金基金份额发售公告》;
托管协议:	指《大成策略回报混合型证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充;
基金产品资料概要	指《大成策略回报混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新
中国证监会:	指中国证券监督管理委员会;
中国银监会:	指中国银行业监督管理委员会;
交易所或证券交易所:	指上海证券交易所和/或深圳证券交易所;
法律法规:	指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、地方法规、地方规章、部门规章及其他规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充;
《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的自2013年6月1日起施行的《中华人民共和国证券投资基金法》及不时做出的修订;
《运作管理办法》:	指《公开募集证券投资基金运作管理办法》;
《销售管理办法》:	指《证券投资基金销售管理办法》;
《信息披露管理办法》:	指中国证监会2019年7月26日颁布、同年9月1日实施的《公开募集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;
《流动性风险管理规定》:	指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日实施的

	《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订
元：	指人民币元；
基金合同当事人：	指受本基金合同约定，根据本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；
基金管理人：	指大成基金管理有限公司；
基金托管人：	指中国光大银行股份有限公司；
注册登记业务：	指本基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等；
注册登记机构：	指办理本基金注册登记业务的机构。本基金的注册登记机构为大成基金管理有限公司或接受大成基金管理有限公司委托代为办理本基金注册登记业务的机构；
投资者：	指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者、人民币合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者；
个人投资者：	指依据中华人民共和国有关法律法规及其他有关规定可以投资于证券投资基金的自然人；
机构投资者：	指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资于证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；
合格境外机构投资者：	指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内合法设立的证券投资基金的中国境外的机构投资者；
人民币合格境外机构投资者	指经主管部门批准，运用在境外募集的人民币资金开展境内证券投资业务的相关主体
基金份额持有人大会：	指按照本基金合同规定召集、召开并由基金份额持有人进行表决的会议；
基金募集期：	指基金合同和招募说明书中载明，并经中国证监会核准的基金份额募集期限，自基金份额发售之日起最长不超过3个月；
基金合同生效日：	指基金募集期满，基金募集的基金份额总额和募集金额超过核准的最低募集份额总额及最低募集金额，并且基金份额持

---

	有人人数符合相关法律法规和基金合同规定，基金管理人依据《基金法》向中国证监会办理备案手续后，中国证监会的书面确认之日；
存续期：	指本基金合同生效至终止之间的不定期期限；
基金合同终止日：	指本基金合同规定的合同终止事由出现后，按照本基金合同规定的程序终止本基金合同的日期；
工作日：	指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日；
认购：	指在基金募集期内，投资者按照本基金合同的规定申请购买本基金基金份额的行为；
申购：	指在本基金合同生效后的存续期间，投资者申请购买本基金基金份额的行为；
赎回：	指在本基金合同生效后的存续期间，基金份额持有人申请卖出本基金基金份额的行为；
转换：	指基金份额持有人按基金管理人规定的条件，申请将其持有的基金管理人管理的某一基金的基金份额转换为该基金管理人管理的另一只基金的基金份额的行为；
转托管：	指基金份额持有人将其所持有的某一基金的基金份额从同一个基金账户下的一个交易账户指定到另一交易账户进行交易的行为；
投资指令：	指基金管理人在运用基金财产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令；
代销机构：	指接受基金管理人委托代为办理本基金认购、申购、赎回和其他基金业务的机构；
销售机构：	指基金管理人及本基金代销机构；
基金销售网点：	指基金管理人的直销中心及基金代销机构的代销网点；
指定媒介：	指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介；
基金账户：	指注册登记机构为基金投资者开立的记录其持有的由该注册登记机构办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账户；
交易账户：	指销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务的基金份额的变动及结余情况的账户；

开放日：	指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日；
T 日：	指销售机构受理投资者申购、赎回或其他业务申请的日期；
T+n 日：	指 T 日后（不包括 T 日）第 n 个工作日，n 指自然数；
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、银行存款利息及其他合法收入；
基金资产总值：	指基金持有的各类有价证券、银行存款本息、应收申购款以及以其他资产等形式存在的基金财产的价值总和；
基金资产净值：	指基金资产总值减去基金负债后的价值；
基金份额净值：	指基金资产净值除以基金份额余额所得的基金份额的价值；
基金资产估值：	指计算、评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程；
流动性受限资产：	指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等；
不可抗力：	指任何无法预见、无法克服、无法避免的事件和因素，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律变化、突发停电或其他突发事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等。

### 三、基金的基本情况

- （一）基金名称：大成策略回报混合型证券投资基金
- （二）基金的类别：混合型
- （三）基金的运作方式：契约型、开放式
- （四）基金投资目标：追求基金资产的长期稳健增值，兼顾当期收益；同时，实施积极的分红政策，回报投资者。
- （五）基金份额初始面值和认购费用：基金份额初始面值是人民币 1.00 元；本基金认购费率不高于认购金额（含认购费）的 5%，实际执行费率在招募说明书中载明。
- （六）基金最低募集份额总额：本基金的最低募集份额总额为 2 亿份。
- （七）基金存续期限：不定期

## 四、基金份额的发售

### （一）募集期限

本基金募集期限自基金份额发售之日起不超过 3 个月，具体发售时间由基金管理人根据相关法律法规以及本基金合同的规定，在基金份额发售公告中确定并披露。

### （二）发售方式

本基金通过各销售机构的基金销售网点向投资者公开发售。

### （三）发售对象

本基金的发售对象为中华人民共和国境内的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者、人民币合格境外机构投资者等（法律法规和有关规定禁止购买证券投资基金者除外）。

### （四）认购原则

1. 基金份额的认购采用金额认购方式；
2. 投资者认购基金份额时，须按销售机构规定的方式全额交付认购款项；
3. 募集期内，投资者可多次认购基金份额，已被注册登记机构受理的认购申请不得撤销；
4. 认购期间单个投资者的累计认购规模没有限制。

### （五）认购费用以及基金认购份额的计算

本基金采用金额认购方法，认购费用以认购金额为基数采用比例费率或者定额费率等计算。本基金认购费率不高于认购金额（含认购费）的 5%，实际执行费率在招募说明书中载明。

本基金认购费用不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、客户服务等募集期间发生的各项费用。

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。前端收费模式下的认购份额计算方法如下：

$$\text{净认购金额} = \text{认购金额} / (1 + \text{认购费率})$$

$$\text{认购费用} = \text{认购金额} - \text{净认购金额}$$

$$\text{认购份额} = (\text{净认购金额} + \text{利息}) / \text{基金份额初始面值}$$



上述计算结果（包括认购份额）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由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

#### （六）认购数额限制

投资者认购本基金的最低认购金额详见招募说明书、份额发售公告或其他公告。

#### （七）募集期间认购资金利息的处理方式

本基金认购款项在募集期产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息的具体金额，以本基金的注册登记机构计算并确认的结果为准。

#### （八）基金募集规模

本基金设首次募集规模上限，具体情况请见基金份额发售公告等有关公告。基金合同生效后，基金规模不受首次募集规模上限的限制。

#### （九）募集期间的资金与费用

基金募集期间募集的资金应当存入专门账户，在基金募集期结束前，任何人不得动用。

基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不得从基金财产中列支。

## 五、基金备案

#### （一）基金备案的条件

本基金募集期限届满，在满足基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币，并且基金份额持有人的人数不少于 200 人的条件下，基金管理人可以依据相关法律法规向中国证监会申请办理基金备案手续。

#### （二）基金的备案

基金募集期限届满，具备上述基金备案条件的，基金管理人应当自募集期限届满之日起 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续。

#### （三）基金合同的生效

自中国证监会书面确认之日起，基金备案手续办理完毕且基金合同生效。基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日予以公告。

#### （四）基金合同不能生效时的处理方式

基金募集期限届满，不能满足基金备案条件的，基金合同不能生效。基金管理人应当：

1. 以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

2. 在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的认购款项，并加计银行同期存款利息。

#### （五）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

本基金合同生效后的存续期内，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。

法律法规或监管部门另有规定的，按其规定办理。

## 六、基金份额的申购、赎回与转换

### （一）申购与赎回的场所

本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。

投资者可以在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购与赎回。

### （二）申购与赎回办理的开放日及时间

#### 1. 开放日及开放时间

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

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

#### 2. 申购与赎回的开始时间

本基金的申购自基金合同生效后不超过 3 个月的时间开始办理。

本基金的赎回自基金合同生效后不超过 3 个月的时间开始办理。

在确定申购开始时间与赎回开始时间后，由基金管理人最迟于开放前 2 日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒介上公告。

### （三）申购与赎回的原则

1. “未知价”原则，即基金的申购与赎回价格以受理申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

2. “金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；
3. 当日的申购与赎回申请可以在当日开放时间结束前撤销，在当日的开放时间结束后不得撤销；
4. 基金管理人不得在本基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回；
5. 基金管理人可以根据基金运作的实际情况，在不损害基金份额持有人实质权益的情况下调整上述原则，但最迟应在新原则实施前 2 日在至少一种中国证监会指定媒介上予以公告。

#### （四）申购与赎回的程序

##### 1. 申购与赎回申请的提出

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

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

##### 2. 申购与赎回申请的确认

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

##### 3. 申购与赎回申请的款项支付

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

投资者赎回申请确认后，基金管理人应通过注册登记机构按规定向投资者支付赎回款项。赎回款项在自受理基金投资者有效赎回申请之日起不超过 7 个工作日内划往投资者银行账户。在发生巨额赎回时，赎回款项的支付办法按本基金合同的有关规定处理。

#### （五）申购与赎回的数额限制

1. 基金管理人可以规定投资者首次申购最低金额和追加申购的最低金额，具体规定详见招募说明书等相关公告。

2. 基金管理人可以规定基金份额持有人每次申请赎回的最低份额，具体规定详见招募说明书等相关公告。

3. 基金管理人可以规定基金份额持有人每个交易账户的最低基金份额余额，具体规定详见招募说明书等相关公告。

4. 基金管理人可以规定单个投资者累计持有的基金份额上限，具体规定详见招募说明书等相关公告。

5. 基金管理人可事先设定基金规模，当本基金规模超过事先设定的规模时，基金管理人有权暂停申购，具体规定详见招募说明书等相关公告。

6. 当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。具体请参见相关公告。

7. 基金管理人在不损害基金份额持有人实质权益的情况下可以根据市场情况对以上限制进行调整，最迟于调整前 2 日在至少一种中国证监会指定媒介上予以公告并报中国证监会备案。

#### （六）申购和赎回的费用及其用途

##### 1. 申购费用

本基金申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、客户服务等各项费用。

本基金申购费率最高不超过 5%，具体收费方式详见招募说明书等相关公告。

##### 2. 赎回费用

本基金赎回费用由基金赎回人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。

本基金赎回费率最高不超过赎回总金额的 5%。赎回费在扣除手续费后，余额不低于赎回费总额 25% 的部分，应当归入基金财产。具体费率详见招募说明书等相关公告。其中对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产。

3. 基金管理人可以在法律法规和本基金合同规定范围内调整申购费率、赎回费率等。费率如发生变更，基金管理人应最迟于实施前 2 日在至少一种中国证监会指定媒介上予以公告。

#### （七）申购份额的计算方式

关于基金收费模式的分类与基金份额的分类，请参见本基金合同第四章“基金份额的发售”之第（五）节。前端收费模式下的申购份额的计算方法如下：

净申购金额=申购金额/（1+申购费率）

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/T 日基金份额净值

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

损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

#### （八）赎回金额的计算方式

前端收费模式下的赎回金额计算如下：

赎回金额为赎回总额扣减赎回费用之后的余额。其中：

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

上述计算结果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由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

#### （九）申购与赎回的注册登记

1. 投资者 T 日申购基金成功后，基金注册登记机构在 T+1 日为投资者增加权益并办理注册登记手续，自 T+2 日起的赎回开放日内有权赎回该部分基金份额。

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

3. 基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并应于实施前 2 日在至少一种中国证监会指定媒介上予以公告。

#### （十）巨额赎回的认定及处理方式

##### 1. 巨额赎回的认定

单个开放日基金净赎回（赎回申请总数与基金转换申请转出份额总数之和扣除申购申请总数及基金转换申请转入份额总数的余额）申请超过上一工作日基金总份额的 10% 时，为巨额赎回。

##### 2. 巨额赎回的处理方式

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

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

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额 10% 的前提下，对其余赎回申请予以延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个基金份额持有人申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，

确定该单个基金份额持有人当日办理的赎回份额；当日赎回申请中未被受理部分，除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获受理部分予以撤销外，自动延迟至下一开放日办理。依照上述规定转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权，并将按下一个开放日赎回申请总量确定赎回份额及以下一个开放日的基金份额净值为准计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

开放式基金发生巨额赎回并延期办理的，基金管理人应当在 3 个工作日内通过邮寄、传真、或者招募说明书规定的其他方式通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在至少一种中国证监会指定媒介上予以公告。

若本基金发生巨额赎回且发生单个开放日内单个基金份额持有人申请赎回的基金份额占前一开放日基金总份额的比例超过 10% 时，本基金管理人有权对该单个基金份额持有人超过前一开放日基金总份额 10% 的赎回申请实施延期赎回；对该单个基金份额持有人占前一开放日基金总份额 10% 的赎回申请，与当日其他赎回申请一起，按上述（1）或（2）方式处理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍旧超出前一开放日基金总份额 10% 的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占前一开放日基金总份额的比例低于 10%。

基金管理人在履行适当程序后，有权根据当时市场环境调整前述比例和办理措施，并在指定媒介上进行公告。

本基金连续两个开放日以上（含两个开放日）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但延期期限不得超过 20 个工作日，并应当在至少一种中国证监会指定媒介上予以公告。

#### （十一）拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

1. 在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

- （1）因不可抗力导致基金管理人无法接受投资者的申购申请；
- （2）证券交易场所交易时间临时停市，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）基金财产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益的情形；
- （5）个别投资者的申购、赎回过于频繁，导致基金的交易费用和变现成本增加，或使得基金管理人无法顺利实施投资策略，继续接受其申购可能对其他基金份额持有人的利益产生损害；

(6) 申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资者单日或单笔申购金额上限的；

(7) 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%，或者变相规避 50%集中度的情形时；

(8) 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施；

(9) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时，申购款项将退回投资者账户。基金管理人决定暂停接受申购申请时，应当在当日向中国证监会备案，并及时公告、通知。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并予以公告、通知。发生上述第(6)、(7)项情形时，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。如果法律法规、监管要求调整导致上述第(6)项内容取消或变更的，基金管理人在履行适当程序后，可修改上述内容，不需召开基金份额持有人大会。

2. 在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请：

(1) 因不可抗力导致基金管理人无法支付赎回款项；

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

(3) 基金发生巨额赎回，根据本基金合同规定，可以暂停接受赎回申请的情况；

(4) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；

(5) 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。

(6) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应当在当日向中国证监会备案，并及时公告。已接受的赎回申请，基金管理人应当足额支付；如暂时不能足额支付，应当按单个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受的赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分在后续开放日予以支付。

在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并及时公告。

3. 暂停基金的申购、赎回，基金管理人应按规定公告。

4. 暂停期间结束，基金重新开放时，基金管理人应按规定公告。

(1) 如果发生暂停的时间为一天，基金管理人应于重新开放日，在至少一种中国证监会指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公告最新的基金份额净值。

(2) 如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应当在两日内，在至少一种中国证监会指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最新的基金份额净值。

(3) 如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 日，在至少一种中国证监会指定媒介上连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最新的基金份额净值。

#### (十二) 基金转换

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

## 七、基金的非交易过户、转托管、冻结与质押

(一) 非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资者基金账户转移到另一投资者基金账户的行为，包括继承、捐赠、强制执行等，及基金注册登记机构认可的其他行为。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是合格的个人投资者或机构投资者等。其中：

1. “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；

2. “捐赠”仅指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或其他具有社会公益性质的社会团体；

3. “强制执行”是指国家有权机关依据生效的法律文书将基金份额持有人持有的基金份额强制执行划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。

(二) 办理非交易过户业务必须提供基金注册登记机构规定的相关资料，并通过其销售渠道向基金注册登记机构统一申请办理。

(三) 符合条件的非交易过户申请按相关规定办理；申请人按基金注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。



(四) 基金份额持有人可以办理其基金份额在不同销售机构的转托管手续。转托管在转出方进行申报，基金份额转托管一次完成。投资者于 T 日转托管基金份额成功后，转托管份额于 T+1 日到达转入方网点，投资者可于 T+2 日起在开放日赎回该部分基金份额。

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

(六) 根据相关法律法规的规定，基金管理人将可以办理基金份额的质押业务或其他基金业务，并制定和实施相应的业务规则。

## 八、基金合同当事人及其权利义务

### (一) 基金管理人

#### 1. 基金管理人基本情况

名称：大成基金管理有限公司

住所：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层

法定代表人：刘卓

成立日期：1999 年 4 月 12 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字【1999】10 号

经营范围：基金管理业务；发起设立基金；及中国证监会批准的其他业务

组织形式：有限责任公司

注册资本：贰亿元人民币

存续期间：持续经营

#### 2. 基金管理人的权利

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

- (1) 依法募集资金，办理基金备案手续；
- (2) 自基金合同生效之日起，依照法律法规和基金合同独立管理运作基金财产；
- (3) 根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；
- (4) 根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式，获得基

金管理费，收取认购费、申购费、基金赎回手续费及其他事先核准或公告的合理费用以及法律法规规定的其他费用；

(5) 根据法律法规和基金合同的规定销售基金份额；

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

(7) 根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构，并有权依照代销协议对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；

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

(9) 在基金合同约定的范围内，增加或减少交易模式；

(10) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；

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

(12) 依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益分配方案；

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

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

(15) 在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；

(16) 依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；

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

(18) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

### 3. 基金管理人的义务

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

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

(3) 办理基金备案手续；

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

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

(6) 按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

(7) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

(8) 进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；

(9) 依法接受基金托管人的监督；

(10) 编制中期和年度基金报告；

(11) 采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、申购、赎回对价的方法符合基金合同等法律文件的规定；

(12) 计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回对价；

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

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

(15) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(16) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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

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

(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的合法权益，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(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) 法律法规、基金合同及国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

(二) 基金托管人

### 1. 基金托管人基本情况

名称：中国光大银行股份有限公司

住所：北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心

法定代表人：李晓鹏

成立时间：1992 年 8 月 18 日

注册资本：466.79095 亿元人民币

批准设立机关：国务院

批准设立文号：国函[1992]7 号

基金托管业务批准文号：证监基金字【2002】75 号

组织形式：股份有限公司

存续期间：持续经营

### 2. 基金托管人的权利

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

- (1) 依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；
- (2) 依照基金合同的约定获得基金托管费；
- (3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如基金托管人发现基金管理人的投资指令违反基金合同或有关法律法规的规定，不予执行并向中国证监会报告；
- (4) 在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；
- (5) 依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

### 3. 基金托管人的义务

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

- (1) 安全保管基金财产；
- (2) 设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- (3) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
- (4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得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) 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整和独立；
- (6) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

- (7) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- (8) 按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (9) 保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；
- (10) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (11) 对基金财务会计报告、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》及《托管协议》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》及《托管协议》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- (12) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (13) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值和基金份额申购、赎回价格；
- (14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (15) 依据基金管理人的指令或有关法律法规的规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- (16) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
- (17) 按照规定监督基金管理人的投资运作；
- (18) 因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其责任不因其退任而免除；
- (19) 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；
- (20) 法律法规、基金合同及国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

### (三) 基金份额持有人

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

#### 2. 基金份额持有人的权利

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

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；

- (3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额;
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会;
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会,对基金份额持有人大会审议事项行使表决权;
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料;
- (7) 监督基金管理人的投资运作;
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金份额销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼;
- (9) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

### 3. 基金份额持有人的义务

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

- (1) 遵守法律法规及基金合同;
- (2) 了解所投资基金产品,了解自身风险承受能力,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险;
- (3) 缴纳基金认购、申购款项及基金合同规定的费用;
- (4) 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;
- (5) 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;
- (6) 返还在基金交易过程中因任何原因,自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利;
- (7) 执行基金份额持有人大会的决议;
- (8) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

## 九、基金份额持有人大会

### (一) 召开原则

基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人合法的授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的表决权。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

持有人大会决议须经基金份额持有人大会审议通过。基金份额持有人大会通过事项自表决通过之日起生效。

## （二）召开事由

1. 终止基金合同；
2. 转换基金运作方式；
3. 更换基金托管人、基金管理人；
4. 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
5. 本基金与其他基金的合并；
6. 变更基金类别；
7. 变更基金投资目标、范围或策略；
8. 变更基金份额持有人大会程序；
9. 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
10. 单独或合计持有基金份额 10%以上（含 10%）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）书面要求召开基金份额持有人大会；
11. 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

## （三）以下情况无须召开基金份额持有人大会

1. 调低基金管理费率、基金托管费率；
2. 在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
3. 因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；
4. 对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生实质性变化；
5. 对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
6. 除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

## （四）召集方式

1. 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，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

3. 代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有

人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。

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

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

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

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

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

#### （五）通知

召开基金份额持有人大会，召集人应当于会议召开前 30 天，在至少一种中国证监会指定媒介上公告通知。基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

1. 会议召开的时间、地点、方式；
2. 会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；
3. 代理投票授权委托书送达时间和地点；
4. 会务常设联系人姓名、电话；
5. 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
6. 如采用通讯表决方式，还应载明具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容；
7. 召集人认为需要通知的其他事项。

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

#### （六）开会方式



基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。

现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席；通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。会议的召开方式由召集人确定。

现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

1. 亲自出席会议者持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、本基金合同和会议通知的规定；

2. 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，全部有效的基金份额不少于权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的 50%，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

在符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

2. 召集人按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；

3. 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额不少于权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）；

4. 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的其他代表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定；

采取通讯方式进行表决时，符合法律法规、基金合同和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决；表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

#### （七）议事内容与程序

##### 1. 议事内容及提案权

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

（2）基金管理人、基金托管人、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交须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：

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

② 程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，须征得原提案人同意；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) 代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获得基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

(5) 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 2. 议事程序

在现场开会的方式下，首先由召集人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议，报中国证监会备案；在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前 30 天公布提案，在所通知的表决截止日期第 2 个工作日在公证机构监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议，报经中国证监会备案，持有人大会决议自表决通过之日起生效。

### (八) 表决

1. 基金份额持有人所持每份基金份额享有平等的表决权。

2. 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

#### (1) 特别决议

对于特别决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的 2/3 以上（含 2/3）通过。

#### (2) 一般决议

对于一般决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过。

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

3. 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。
4. 采取通讯方式进行表决时，符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决。
5. 基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

#### （九）计票

##### 1. 现场开会

（1）基金份额持有人大会的主持人为召集人授权出席大会的代表，如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员（如果基金管理人为召集人，则监督员由基金托管人担任；如基金托管人为召集人，则监督员由基金管理人在出席会议的基金份额持有人中指定）共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中推举 3 名基金份额持有人担任监票人。

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

（3）如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或者基金份额持有人代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

（4）在基金管理人或基金托管人担任召集人的情形下，如果在计票过程中基金管理人或者基金托管人拒不配合的，则参加会议的基金份额持有人有权推举 3 名基金份额持有人代表共同担任监票人进行计票。

##### 2. 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式可采取如下方式：

由大会召集人聘请的公证机关的公证员进行计票。

#### （十）生效与公告

1. 基金份额持有人大会按照《基金法》有关法律法規规定表决通过的事项，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。

2. 关于基金合同变更、更换基金管理人、基金托管人等项目的基金份额持有人大会决

议经持有人表决通过后方可执行。

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

4. 基金份额持有人大会决议应当自表决通过后 2 日内，由基金份额持有人大会召集人在至少一种中国证监会指定媒介上予以公告。

(十一) 本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

## 十、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序

(一) 基金管理人和基金托管人的更换条件

1. 有下列情形之一的，基金管理人职责终止，须更换基金管理人：

- (1) 基金管理人被依法取消基金管理资格；
- (2) 基金管理人依法解散、依法被撤销或被依法宣告破产；
- (3) 基金管理人被基金份额持有人大会解任；
- (4) 法律法规规定的其他情形。

2. 有下列情形之一的，基金托管人职责终止，须更换基金托管人：

- (1) 基金托管人被依法取消基金托管资格；
- (2) 基金托管人依法解散、依法被撤销或被依法宣告破产；
- (3) 基金托管人被基金份额持有人大会解任；
- (4) 法律法规规定的其他情形。

(二) 基金管理人和基金托管人的更换程序

1. 基金管理人的更换程序

原基金管理人退任后，基金份额持有人大会须在 6 个月内选任新基金管理人。在新基金管理人产生前，中国证监会可指定临时基金管理人。

(1) 提名：新任基金管理人由基金托管人或由代表 10% 以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人提名。

(2) 决议：基金管理人职责终止的，基金份额持有人大会应当在 6 个月内对被提名的新任基金管理人形成决议，该决议须经基金份额持有人大会 2/3 以上表决权通过方为有效。

(3) 备案并公告：基金份额持有人大会选任基金管理人的决议须经中国证监会备案。基金管理人更换后，由基金托管人在更换基金管理人的基金份额持有人大会决议生效后 2 日内在至少一种中国证监会指定媒介上公告。

(4) 交接：基金管理人职责终止的，应当妥善保管基金管理业务资料，及时办理基金管理业务的移交手续，新任基金管理人或者临时基金管理人应当及时接收。新任基金管理人或者临时基金管理人应与基金托管人核对基金资产总值和净值。

(5) 审计并公告：基金管理人职责终止的，应当按照规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案。

(6) 基金名称变更：基金管理人更换后，本基金应替换或删除基金名称中与大成基金管理有限公司有关的字样。

## 2. 基金托管人的更换程序

原基金托管人退任后，基金份额持有人大会须在 6 个月内选任新基金托管人。在新基金托管人产生前，中国证监会可指定临时基金托管人。

(1) 提名：新任基金托管人由基金管理人或由代表 10% 以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人提名。

(2) 决议：基金托管人职责终止的，基金份额持有人大会应当在 6 个月内对被提名的新任基金托管人形成决议，该决议须经基金份额持有人大会 2/3 以上表决权通过方为有效。

(3) 备案并公告：基金份额持有人大会更换基金托管人的决议须报中国证监会备案；基金托管人更换后，由基金管理人在更换基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后 2 日内在至少一种指定媒介上予以公告。

(4) 交接：基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续，新基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收。新任基金托管人或临时基金托管人与基金管理人核对基金资产总值和净值。

(5) 审计并公告：基金托管人职责终止的，应当按照规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案。

## 3. 基金管理人和基金托管人的更换程序

(1) 提名：如果基金管理人和基金托管人同时更换，由单独或合计持有基金份额 10% 以上（含 10%）的基金份额持有人提名新的基金管理人和基金托管人；

- (2) 基金管理人和基金托管人的更换分别按上述程序进行；
- (3) 公告：新任基金管理人和新任基金托管人应当依照有关规定予以公告并报中国证监会备案。

## 十一、基金托管

本基金财产由基金托管人依法持有并保管。基金管理人应与基金托管人按照《基金法》、本基金合同及其他有关法律法规规定订立《大成策略回报混合型证券投资基金托管协议》，以明确基金管理人与基金托管人之间在基金份额持有人名册登记、基金财产的保管、基金财产的管理和运作及相互监督等相关事宜中的权利、义务及职责，确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

## 十二、基金的销售

(一) 本基金的销售业务指接受投资者申请为其办理本基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管、定期定额投资和客户服务等业务。

(二) 本基金的销售业务由基金管理人及基金管理人委托的其他符合条件的机构办理。基金管理人委托其他机构办理本基金认购、申购、赎回等业务的，应与代理机构签订委托代理协议，以明确基金管理人和代销机构之间在基金份额认购、申购、赎回等事宜中的权利和义务，确保基金财产的安全，保护基金投资者和基金份额持有人的合法权益。销售机构应严格按照法律法规和本基金合同规定的条件办理本基金的销售业务。

基金管理人及代销机构等相关机构，应友好协商、积极配合，支持和鼓励基金销售模式的不断改进和交易手段的不断完善。

## 十三、基金份额的注册登记

(一) 本基金基金份额的注册登记业务指本基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括但不限于投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等。

(二) 本基金的注册登记业务由基金管理人或基金管理人委托的其他符合条件的机构办理。基金管理人委托其他机构办理本基金注册登记业务的，应与代理机构签订委托代理协议，以明确基金管理人和代理机构在投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等事宜中的权利和义务，保护基金投

资者和基金份额持有人的合法权益。

基金管理人、基金托管人、代销机构和其他相关服务机构，应与注册登记机构一道，友好协商、互相配合，采取必要的措施，保证注册登记业务的顺利进行及其合理改进，保护基金投资者和基金份额持有人的合法权益。

（三）注册登记机构享有如下权利：

1. 取得注册登记费；
2. 保管基金份额持有人开户资料、交易资料、基金份额持有人名册等；
3. 在法律法规允许的范围内，对注册登记业务的办理时间进行调整，并最迟于开始实施前 2 日在至少一种中国证监会指定媒介上予以公告；
4. 法律法规规定的其他权利。

（四）注册登记机构承担如下义务：

1. 保管基金份额持有人开户资料、交易资料、基金份额持有人名册等；
2. 配备足够的专业人员办理本基金的注册登记业务；
3. 严格按照法律法规和本基金合同规定的条件办理本基金的注册登记业务；
4. 接受基金管理人的监督；
5. 保管基金份额持有人名册及相关的申购与赎回等业务记录 15 年以上；
6. 对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但按照法律法规的规定进行披露的情形除外；
7. 按本基金合同及招募说明书、有关公告的规定，为投资者办理非交易过户业务、提供其他必要的服务；
8. 法律法规规定的其他职责。

## 十四、基金的投资

（一）投资目标

追求基金资产的长期稳健增值，兼顾当期收益；同时，实施积极的分红政策，回报投资者。

（二）投资范围

1. 本基金投资于国内依法公开发行的股票、权证、债券、资产支持证券及法律法规或监管机构允许基金投资的其他金融工具。

2. 本基金的股票投资比例范围为基金资产的 60%—95%；权证投资比例范围为基金资产的 0%-3%；债券投资比例范围为基金资产的 0%—35%；资产支持证券投资比例范围为基金资产的 0%-20%；现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券比例不低于基金资产净值的 5%。

3. 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他证券市场或者其他品种或变更权证、资产支持证券等投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以相应调整本基金的投资范围、投资比例规定。

### （三）投资理念

“以处于合理估值范围内的价格投资于具有持续稳定高分红记录的企业、具备持续稳定分红潜力的企业以及成长性良好的企业，并在坚持长期投资的基础上，通过积极的配置策略，应对短期波动，获取超额收益”是本基金的核心投资理念。

### （四）投资策略

本基金在控制风险的前提下，采取趋势投资策略进行总体资产配置；在行业配置、个股投资上分别实施行业轮动投资策略、核心-卫星策略、价值投资策略、买入并持有策略，以期在承担中高风险的前提下获取尽可能高的投资收益；同时，强调收益管理，实施收益管理策略，以期在增长期及时锁定收益，制度性的减少未来可能的下跌风险，增加投资总收益。

#### 1. 总体资产配置策略

本基金以股票投资为主、债券投资为辅进行积极资产配置。其中，股票资产占基金资产的比例范围为 60%—95%；债券资产占基金资产的比例范围为 0%—35%；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

本基金采取趋势投资策略进行总体资产配置，即通过对宏观经济运行状况及其政策动态、货币金融运行状况及其政策动态、证券市场运行状况及其政策动态等因素“自上而下”的定量和定性分析，形成对各个市场的趋势判断，在此基础上基于稳健的战略资产配置策略和积极的战术资产配置策略，确定组合中股票、债券和货币市场工具的投资比例。

#### 2. 行业配置策略

本基金采用行业轮动投资策略进行行业配置，即紧密跟踪国家产业和行业经济运行状况及其政策动态，关注产业结构调整，通过行业周期分析、行业特征指标分析、行业内竞争结构分析以及国际产业迁移进程分析等确定本基金各行业的投资比例，当预计某个行业的投资收益率发生变化时，动态调整各行业的投资比例。同时，利用数量化模型优化行业组合，增强本基金行业配置效率。



本基金将重点投资于符合国家宏观经济和产业发展政策，与国民经济增长高度相关，能够适应、满足、推动消费升级及产业升级等需要，具有垄断特征以及高附加值等行业，适时采用行业集中或者行业分散策略，获取行业超额收益，平抑宏观经济的周期性变化对股价波动带来的影响，保持基金分红水平与净值的长期协调稳定增长。

### 3. 个股选择策略

本基金采用核心-卫星策略，进行股票资产配置，即本基金股票资产主要投资于红利股，同时兼顾成长股的投资，以实现基金资产的长期资本增值；本基金投资于红利股不低于基金股票资产的 80%。

本基金对于红利股、成长股分别采用价值投资策略、买入并持有策略进行投资。

#### (1) 红利股

对于红利股投资，本基金采用价值投资策略，即适时评估红利股的内在价值，并与其市场价格进行比较，投资处于合理估值范围内的红利股。红利股是指过去两年有分红记录的上市公司。本基金将综合考察企业的历史分红记录、现有分红能力、流动性等特征，挖掘具有长期分红潜力的红利股企业进行投资。主要考核标准包括：

- ① 历史分红记录良好，过去两年连续分红；
- ② 现金红利派息率高于市场平均水平；
- ③ 短期负债率较低，长期负债率处于合理范围以内，自由现金流良好。

#### (2) 成长股

对于成长股的投资，本基金采用买入并持有投资策略，即通过精选具备持续成长潜力的股票进行长期投资，充分分享由于股票市场价值不断上升所带来的收益。本基金将综合考察企业估值水平、盈利能力、管理层能力、核心竞争力等特征，选择具有持续增长能力的企业投资。主要考核标准包括：

- ① 主营业务清晰，成长性良好

企业的盈利能力取决于主营业务的盈利能力。主营业务突出、成长性良好的企业具有较高的投资价值。本基金将深入分析企业的利润构成，通过对每股收益、每股收益增长率、净资产收益率等指标的定量分析，评价企业的盈利能力。

- ② 具备高效的管理团队，重视股东利益

企业的管理团队对企业的发展方向、资源的配置效率起着重要作用。本基金将通过实地调研、高层访谈等方式对企业管理层的管理能力、团队氛围、是否重视股东利益、是否具有制定和调整企业发展战略的能力等特征进行定性分析。

### ③ 具备核心竞争优势

资源独占、技术领先、品牌优势、企业凝聚力等特质所形成的核心竞争力是企业长期积累的结果，也是企业宝贵的无形资产，有助于企业以较低的成本获取较高的收益。本基金将通过定性和定量相结合的方法深入挖掘企业的核心竞争优势。

本基金将密切跟踪市场变化，结合本基金收益实现情况，适时调整（1）、（2）两个层面的权重分配，以期达至最优组合绩效。

### 4. 债券投资策略

本基金的债券投资将采取较为积极的策略，通过利率预测分析、收益率曲线变动分析、债券信用分析、收益率利差分析等，力求在保证基金资产总体的安全性、流动性的基础上获取一定的稳定收益。

#### （1）利率预测分析

准确预测未来利率走势能为债券投资带来超额收益。当预期利率下调时，适当加大组合中长期债券的投资比例，为债券组合获取价差收益；当预期利率上升时，减少长久期债券的投资，降低债券组合的久期，以控制利率风险。

#### （2）收益率曲线变动分析

收益率曲线会随着时间、市场情况、市场主体的预期变化而改变。本基金通过预测收益率曲线形状的变化，调整债券组合内部品种的比例获得投资收益。

#### （3）债券信用分析

本基金通过对债券的发行者、流动性、所处行业等因素进行深入、细致的调研，准确评价债券的违约概率，提早预测债券评级的改变，捕捉价格优势或套利机会。

#### （4）收益率利差分析

本基金将在预测和分析同一市场不同板块之间、不同市场的同一品种之间、不同市场不同板块之间的收益率利差的基础上，采取积极投资策略，选择适当品种，获取投资收益。

### 5. 其他金融工具投资策略

本基金在控制投资风险和保障基金财产安全的前提下，对权证进行投资。权证投资策略主要包括以下几个方面：主要采用市场公认的多种期权定价模型对权证进行定价，作为权证投资的价值基准；根据权证对应公司基本面的研究估值，结合权证理论价值进行权证的趋势投资；利用权证衍生工具的特性，通过权证与证券的组合投资，来达到改善组合风险收益特征的目的，包括但不限于杠杆交易策略、看跌保护组合策略、保护组合成本策略、获利保护策略、买入跨式投资策略。

本基金将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等策略投资资产支持证券，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后的收益较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

本基金将在充分考虑收益性、流动性和风险特征的基础上，积极运用监管机构允许基金投资的其他金融工具，以期降低组合风险，锁定既有收益，在一定程度上实现基金资产的保值、增值。

## 6. 收益管理策略

本基金强调对收益的管理，以期在增长期及时锁定收益，制度性的减少未来可能的下跌风险，增加投资总收益。

本基金的收益管理策略分别体现在类属资产配置、股票投资、风险管理工具的运用和定期收益监控四个方面。本基金在类属资产配置过程中重视趋势预测，及时调整组合风险水平；本基金在股票投资过程中，重视短期收益和长期资本增值的匹配；本基金采用积极策略运用风险管理工具，对冲风险、锁定收益；本基金在运作过程中将制度性的按季监控收益实现状态，综合考虑证券市场趋势、投资计划安排等因素，在法律法规以及基金合同规定的范围内，最大限度的积极分配收益。

### （五）投资组合管理

#### 1. 资产配置和行业配置的决策程序

##### （1）资产配置

宏观研究员就政治形势、政策趋势、宏观经济形势、利率走势以及证券市场发展趋势等进行分析，向投资决策委员会和基金经理提交研究报告。

投资决策委员会根据相关报告，对市场中长期发展趋势做判断，向基金经理提出资产配置指导性意见。

基金经理根据投资决策委员会的指导性意见并结合自己的研究分析结果，拟定基金资产配置建议书，提交投资决策委员会审议。

投资决策委员会对基金资产配置建议书的可行性进行分析，形成投资决议并授权基金经理执行。

##### （2）行业配置

基金经理综合各行业研究员的研究成果，根据不同行业景气的周期变化，向投资决策委员会提交行业配置建议书。经投资决策委员会批准后，基金经理制定详细的行业配置计划并经授权后执行。

## 2. 投资品种选择的决策程序

### (1) 股票投资的决策程序

本基金所投资的上市公司必须已经进入本基金股票投资备选库,进入备选库的股票必须经过股票投资基本库、股票投资初选库和股票投资备选库的筛选程序,具体过程如下:

① 研究员根据法律法规和基金合同规定,判断股票是否存在明显风险,确定股票投资基本库;

② 研究员通过大量研读券商研究报告,根据自己的综合分析判断,在股票投资基本库的基础上确定股票投资初选库;

③ 研究员选择初选库中的股票,进行深入分析和实地调研后,提交投资研究联席会议讨论。投资研究联席会议经过充分讨论和论证,确定该股票是否进入股票投资备选库;

④ 基金经理从股票投资备选库中选择股票构建投资组合。

### (2) 债券投资的决策程序

本基金投资的债券包括国债、金融债、企业债(含可转换债券)等债券品种。

基金经理根据经投资决策委员会审批的资产配置计划,向债券投资研究员提出债券投资需求,债券投资研究员在对利率变动趋势、债券市场发展方向和各债券品种的流动性、安全性和收益性等因素进行综合分析的基础上,提出债券投资建议。基金经理根据债券投资研究员的债券投资建议,制定债券投资方案。

## 3. 交易指令的下达和执行

基金管理人设置独立的集中交易室,基金经理下达的投资指令通过集中交易室实施。集中交易室接到基金经理的投资指令后,根据有关规定对投资指令的合规性、合理性和有效性进行检查,确保投资指令在合法、合规的前提下得到高效的执行。

## 4. 投资风险的监控和管理

### (1) 监察稽核部对投资风险的日常监管

监察稽核部通过交易系统检查包括投资集中度、投资组合比例、投资禁止、投资限制、投资权限等交易情况。

### (2) 基金绩效评估和风险管理

基金管理人设有基金绩效评估和风险管理小组,定期向基金绩效评估和风险管理会议提交基金绩效评估和风险管理报告。基金经理根据基金绩效评估和风险管理会议的意见对投资组合进行调整。

## (六) 业绩比较基准

80%×沪深 300 指数+20%×中债综合指数

本基金作为混合型基金，股票投资比例范围为 60%—95%，债券投资比例范围为 0%—35%，所以采用股票指数和债券指数加权复合的方法构建业绩比较基准。由于沪深 300 指数是反映沪深两市 A 股综合表现的跨市场成份指数，中债综合指数全面反映债券市场价格变动趋势的指数，两者均具有良好的市场代表性，因此，选择沪深 300 指数作为股票投资部分的业绩比较基准，同时，选取中债综合指数作为债券投资部分的比较基准。

如果指数编制单位停止计算编制有关指数或更改指数名称或今后市场出现更适用于本基金的指数，本基金可以在取得基金托管人同意，报中国证监会备案后变更业绩比较基准，并及时公告。

#### （七）风险收益特征

本基金属于风险收益水平适中的混合型基金品种，其长期平均的预期收益和风险低于股票基金，高于债券基金和货币市场基金。

#### （八）投资限制和禁止行为

##### 1. 投资限制

依照有关法律法规的规定，基金管理人运用基金财产进行证券投资，须遵守以下限制：

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

（2）本基金持有一家公司发行的证券市值，不超过基金资产净值的 10%；

（3）本基金管理人管理的全部基金持有一家上市公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

（4）本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

（5）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（6）本基金投资于股权分置改革中发行的权证，在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

（7）本基金持有的全部权证市值不得超过基金资产净值的 3%；

- (8) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；
- (9) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- (10) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- (11) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
- (12) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
- (13) 现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券比例不低于基金资产净值的 5%；
- (14) 本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；
- (15) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与本基金合同约定的投资范围保持一致；
- (16) 本基金不得违反基金合同关于投资范围、投资策略和投资比例等规定；
- (17) 遵守法律法规及中国证监会规定的其他限制。

除上述（5）、（13）、（15）项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

## 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。

3. 如果法律法规对本基金合同约定的投资限制和禁止行为进行变更的，本基金将履行适当程序后相应变更或取消上述强制性规定。

#### （九）投资组合比例调整

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

#### （十）基金管理人代表基金行使所投资证券项下权利的原则及方法

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

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

## 十五、基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关法律法规规定进行融资、融券。

## 十六、基金的财产

### （一）基金资产总值

本基金基金资产总值指基金持有的各类有价证券、银行存款本息、应收申购款以及以其他资产等形式存在的基金财产的价值总和。

### （二）基金资产净值

本基金基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

本基金根据相关法律法规、规范性文件开立基金专用银行存款账户以及证券账户，与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册登记机构的自有财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### （四）基金财产的保管及处分

1. 本基金财产独立于基金管理人及基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产。
2. 基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归基金财产。

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

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

## 十七、基金资产估值

### （一）估值目的

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

### （二）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。

### （三）估值原则

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

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

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

### （四）估值方法

#### 1. 股票估值方法：

（1）上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

#### （2）未上市股票的估值：

##### 1) 首次发行未上市的股票，按成本计量；



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

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估值；

4) 非公开发行有明确锁定期的流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

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

(4) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## 2. 债券估值方法：

(1) 在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值；

(2) 对在交易所市场上市交易的可转换债券，按照每日收盘价作为估值全价，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；

(3) 发行未上市债券采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

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

(5) 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；

(6) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)－(5)小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第(1)－(5)小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

(7) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## 3. 权证估值方法：

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

值；

未上市交易的权证采用估值技术确定公允价值；在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

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

(3) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

4. 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。

5. 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。

#### (五) 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。

#### (六) 估值程序

1. 基金份额净值是按照每个开放日闭市后，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4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。基金管理人每个开放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。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

#### (七) 估值错误的处理

基金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的当事人（“受损方”）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。

### (八) 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. 出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，导致基金管理人不能出售或评估基金资产的；

4. 当前一估值日基金资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致的；

5. 中国证监会和基金合同认定的其他情形。

### （九）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。

### （十）特殊情况的处理

1. 基金管理人或基金托管人按股票估值方法的第（3）项、债券估值方法的第（6）项或权证估值方法的第（2）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机构发送的数据错误，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。

## 十八、基金费用与税收

### （一）基金费用的种类

1. 基金管理人的管理费；
2. 基金托管人的托管费；
3. 基金的证券交易费用；
4. 基金合同生效以后的信息披露费用；
5. 基金份额持有人大会费用；
6. 基金合同生效以后的会计师费和律师费；
7. 基金银行汇划费用；
8. 按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1. 基金管理人的管理费

本基金的管理费按基金资产净值的 1.50% 年费率计提，即本基金的年管理费率为 1.50%。

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

管理费每日计提，逐日累计。对于已确认的管理费，由基金托管人于次月前 5 个工作日内，依据基金管理人的指令从基金资产中一次性支付给基金管理人。

## 2. 基金托管人的托管费

本基金的托管费按基金资产净值的 0.25% 年费率计提，即本基金的年托管费率为 0.25%。

计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

托管费每日计提，逐日累计。对于已确认的托管费，由基金托管人于次月前 5 个工作日内，依据基金管理人的指令从基金资产中一次性支取。

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

### （三）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

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

### （四）基金管理费、基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人等可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率或改变收费模式。调高基金管理费率、基金托管费率等相关费率，须召开基金份额持有人大会审议，除非获得监管机构的豁免、基金合同或相关法律法规另有规定；调低基金管理费率、基金托管费率等相关费率或在不提高整体费率水平的情况下改变收费模式，无须召开基金份额持有人大会。

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

基金管理人最迟于新的费率实施日前 2 日在至少一种中国证监会指定媒介上予以公告，并报中国证监会备案。

### （五）税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

## 十九、基金收益与分配

### （一）收益的构成

1. 基金收益包括：基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券差价、银行存款利息以及其他收入。
2. 因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。
3. 基金净收益为基金收益扣除按照有关法律法规规定可以在基金收益中扣除的费用等项目后的余额。

### （二）收益分配原则

1. 基金收益分配采用现金方式，基金份额持有人可选择将获取的现金红利自动转为基金份额进行再投资，红利再投资部分以除息日的基金份额净值为计算基准，确定再投资份额；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；
2. 每一基金份额享有同等分配权；
3. 基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；
4. 基金当期出现亏损，则不进行收益分配；
5. 在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年最多不超过 12 次；
6. 全年基金收益分配比例不得低于年度基金可供分配收益的 60%。基金合同生效当年不满 3 个月，可不进行收益分配；
7. 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

### （三）收益分配方案

基金收益分配方案中载明基金收益的范围、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式及有关手续费等内容。

### （四）收益分配方案的确定与公告

基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人核实后确定，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

### （五）收益分配中发生的费用

1. 收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。

2. 收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。

## 二十、基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

1. 基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日。
2. 基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。
3. 会计核算制度按国家有关的会计核算制度执行。
4. 本基金独立建账、独立核算。
5. 本基金会计责任人为基金管理人，基金管理人也可以委托具有从事证券、期货相关业务资格的独立的会计师事务所担任基金会计，但该会计师事务所不能同时从事本基金的审计业务。
6. 基金管理人和基金托管人应各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关法律法规的规定编制基金会计报表。
7. 基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### （二）基金审计

1. 基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、具有从事证券相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师等对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计；
2. 会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意；
3. 基金管理人（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，须经基金托管人（或基金管理人）同意，按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

## 二十一、基金的信息披露

本基金的信息披露按照《基金法》、《运作管理办法》、《信息披露管理办法》及其实施准则、本基金合同及其他有关规定办理。

基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊和基金管理人、基金托管人的互联网网站等媒介披露，并保证投资者能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

### （一）基金招募说明书、基金合同、基金托管协议、基金产品资料概要



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

《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

基金产品资料概要基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

#### （二）基金份额发售公告

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

#### （三）基金合同生效公告

基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。

#### （四）基金净值信息

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日基金份额净值和基金份额累计净值。

#### （五）基金份额申购、赎回价格

基金管理人应在基金合同、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，并保证投资者能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或复制前述信息资料。

#### （六）定期报告

基金定期报告由基金管理人按照法律法规和中国证监会颁布的有关证券投资基金信息

披露内容与格式的相关文件的规定单独编制，由基金托管人按照法律法规的规定对相关内容进行复核。基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告。

1. 基金年度报告：基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

2. 基金中期报告：基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

3. 基金季度报告：基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

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

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、中期报告、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，中国证监会认定的特殊情形除外。

本基金持续运作过程中，应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

#### （七）临时报告与公告

基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上。

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

1. 基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
2. 基金合同终止、基金清算；
3. 转换基金运作方式、基金合并；
4. 更换基金管理人、基金托管人；
5. 基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项
6. 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
7. 基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
8. 基金募集期延长或提前结束募集；

9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；

10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；

11. 涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼；

12. 基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；

13、基金管理人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，或者从事其他重大关联交易事项，中国证监会另有规定的情形除外；

14. 基金收益分配事项；

15. 管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

16. 基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；

17. 基金改聘会计师事务所；

18. 基金更换基金注册登记机构；

19. 基金开始办理申购、赎回；

20. 基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；

21. 基金发生巨额赎回并延期支付；

22. 基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；

23. 基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

24. 发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等其他重大事项；

25. 基金信息披露义务人认为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其他事项或中国证监会规定的其它事项。

#### （八）基金份额持有人大会决议

召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前 30 日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

基金份额持有人依法自行召集持有人大会，基金管理人、基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的，召集人应履行相关信息披露义务。

#### （九）清算报告

基金合同终止的,基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上,并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### (十) 公开澄清

任何公共媒介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,以及可能损害基金份额持有人权益的,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。

#### (十一) 中国证监会规定的其他信息

(十二) 本基金在条件成熟的情况下,为方便投资者交易本基金,可增加信息披露的范围。

#### (十三) 信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后,基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于公司住所,供社会公众查阅、复制。

## 二十二、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### (一) 基金合同的变更

1. 以下变更基金合同的事项应经基金份额持有人大会决议通过:

- (1) 终止基金合同;
- (2) 转换基金运作方式;
- (3) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准,但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外;
- (4) 更换基金管理人、基金托管人;
- (5) 本基金与其他基金的合并;
- (6) 变更基金类别;
- (7) 变更基金投资目标、范围或策略;
- (8) 变更基金份额持有人大会程序;
- (9) 基金合同等约定的其他事项。

2. 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备案,并自持有人大会表决通过之日起生效。

3. 如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形，或者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或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改，报中国证监会备案后公告。

## （二）基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

1. 基金合同经基金份额持有人大会决定终止的；
2. 因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；
3. 基金管理人职责终止，而在 6 个月内没有新基金管理人承接其原有职责的；
4. 基金托管人职责终止，而在 6 个月内没有新基金托管人承接其原有职责的；
5. 法律法规规定或中国证监会规定的其他情况。

## （三）基金财产的清算

1. 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。
2. 基金财产清算组

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

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

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

## 3. 清算程序

- （1）基金合同终止后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- （2）基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- （3）基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- （4）对基金财产进行评估和变现；
- （5）制作清算报告；
- （6）聘请会计师事务所对基金财产清算报告进行外部审计；
- （7）聘请律师事务所对基金财产清算报告出具法律意见书；

(8) 将基金清算结果报告中国证监会；

(9) 公布基金清算公告；

(10) 对基金财产进行分配。

#### 4. 清算费用

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

#### 5. 基金财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

(1) 支付清算费用；

(2) 交纳所欠税款；

(3) 清偿基金债务；

(4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

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

#### 6. 基金财产清算的公告

基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由清算组公告。

7. 基金财产清算账册及文件由基金托管人保存15年以上。

## 二十三、违约责任

(一) 本基金合同当事人不履行本基金合同或履行本基金合同不符合约定的，应当承担违约责任。

(二) 因基金管理人或基金托管人违约给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任，因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任。

(三) 一方当事人违反本基金合同，给其他基金合同当事人或基金财产造成损失的，应承担相应的赔偿责任。

(四) 发生下列情况时，当事人可以免责：

1. 基金管理人和/或基金托管人按照中国证监会的规定或当时有效的法律法规的作为或不作为而造成的损失等；

2. 在没有欺诈或过失的情况下，基金管理人由于按照本基金合同规定的投资原则进行

的投资所造成的损失等；

### 3. 不可抗力。

(五) 在发生一方或多方当事人违约的情况下，基金合同能够继续履行的应当继续履行。

(六) 本合同当事人一方违约后，其他当事人应当采取适当措施防止损失的扩大；没有采取适当措施致使损失扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。守约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

## 二十四、争议的处理

(一) 本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

(二) 本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可通过友好协商解决，但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，根据提交仲裁时该会的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

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

## 二十五、基金合同的效力

(一) 本基金合同是基金合同当事人之间的法律文件。基金合同在基金募集结束，报中国证监会备案并获中国证监会书面确认后生效。

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

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

(四) 本基金合同正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。

(五) 基金合同可印制成册，供投资者查阅；投资者也可复印本基金合同等法律文件，但若有歧义，则应以本基金合同等法律文件的正本为准。

## 二十六、业务规则

基金份额持有人应遵守基金管理人或注册登记机构等相关机构制定的相关业务规则及

其更新的各项业务规则。

在法律法规规定的范围内，基金管理人或注册登记机构等相关机构可以根据实际情况制订、解释与修改相关业务规则，必要时须报监管机关备案。

## **二十七、其他事项**

（一）在基金存续期间，基金管理人的内部机构设置、职能划分可能会发生变化，职能也可能会相应地做出调整，但不得影响本基金的投资理念、投资目标、投资范围和投资运作。

（二）本基金合同如有未尽事宜，由基金合同当事人各方通过监管机构规定的程序依据有关法律法规和规定协商处理。

## **二十八、基金合同当事人盖章及法定代表人或授权代表签字、签订地、签订日**