

# 大成标普 500 等权重指数证券投资基金 更新的招募说明书摘要

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

二〇一九年十二月

## 重要提示

大成标普 500 等权重指数证券投资基金经中国证监会 2010 年 12 月 20 日证监许可【2010】1876 号文核准募集，本基金的基金合同于 2011 年 3 月 23 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。

大成标普 500 等权重指数证券投资基金为美国股票指数型证券投资基金，风险与预期收益高于混合型基金、债券基金以及货币市场基金。本基金投资于美国证券市场，基金净值除了会因美国证券市场波动等因素产生波动之外，还需面临汇率风险等投资海外市场的特殊风险。投资者在投资本基金前，应仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对申购基金的意愿、时机、数量等投资行为做出独立、谨慎决策，获得基金投资收益，亦承担基金投资中出现的各类风险。

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

投资有风险，投资者申购基金时，请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同。

基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，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。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、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，应详细查阅基金合同。

本更新的招募说明书已经本基金托管人复核。所载内容截止日为 2019 年 9 月 23 日（其中人员变动信息以公告日为准），有关财务数据和净值表现截止日为 2019 年 6 月 30 日（财务数据未经审计）。

## 一、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：吴庆斌

电话：0755-83183388

传真：0755-83199588

联系人：肖剑

### （二）主要人员情况

#### 1. 董事会成员

吴庆斌先生，董事长，清华大学法学及工学双学士。先后任职于西南证券飞虎网、北京国际信托有限责任公司、广联（南宁）投资股份有限公司等机构。2012 年 7 月至今，任广联（南宁）投资股份有限公司董事长；2012 年任职于中泰信托有限责任公司，2013 年 6 月至今，任中泰信托有限责任公司董事长。2019 年 11 月 3 日起任大成基金管理有限公司董事长。

翟斌先生，副董事长，北京大学经济学硕士。曾在深圳市建材集团、君安证券、新华信托、招商证券股份有限公司等多家机构任职，2017 年 8 月加入光大证券股份有限公司，历任机构业务总部董事总经理、机构业务总部总经理兼私募业务部总经理，现任光大证券股份有限公司机构业务总部总经理。2019 年 11 月 3 日起任大成基金管理有限公司副董事长。

谭晓冈先生，董事、总经理，哈佛大学公共管理硕士。曾在财政部、世界银行、全国社保基金理事会任职。2016 年 7 月加入大成基金管理有限公司，2016 年 12 月至 2019 年 8 月任大成国际资产管理有限公司总经理，2017 年 2 月至 2019 年 6 月任大成基金管理有限公司副总经理，2019 年 7 月起任大成基金管理有限公司总经理，2019 年 8 月起任大成国际资

产管理有限公司董事长。

李超女士，董事，华中科技大学管理学学士。2007 年 6 月至 2008 年 5 月，任职于深圳晨星咨询有限责任公司；2008 年 7 月至 2011 年 8 月，任德勤华永会计师事务所高级审计员；2011 年 8 月至 2018 年 5 月，任平安信托有限责任公司稽核监察部模型团队团队经理；2018 年 5 月至今，任中泰信托有限责任公司稽核审计部总经理。

郭向东先生，董事，中国人民大学金融学在职研究生。1996 年至 1998 年在中国新技术创业投资公司负责法律事务；1998 年至 2000 年在中国华融信托投资公司负责法律事务；2000 年至 2006 年任职于中国银河证券有限责任公司法律部；2007 年 1 月加入中国银河投资管理有限公司，任职于负债处置部；2007 年 7 月至 2013 年 2 月，历任人力资源部负责人、风险控制部总经理、监事会办公室主任、审计部负责人，曾兼任北京银河吉星创业投资有限责任公司监事；2013 年 2 月起任资产管理部总经理兼行政负责人。

杨晓帆先生，独立董事，香港浸会大学工商管理学士。2006 年至 2011 年，任惠理集团有限公司高级投资分析师兼投资组合经理；2012 年至 2016 年，任 FALCON EDGE CAPITAL LP 合伙人和大中华区负责人；2016 年至今，任晨曦投资管理公司(ANATOLE INVESTMENT MANAGEMENT) 主要创始人。

胡维翊先生，独立董事，波士顿大学国际银行与金融法硕士。1991 年 7 月至 1994 年 4 月，任全国人大常委会办公厅研究室政治组主任科员；1994 年 5 月至 1998 年 8 月，任北京乾坤律师事务所合伙人；2000 年 2 月至 2001 年 4 月任北京市中凯律师事务所律师；2001 年 5 月至今，历任北京市天铎律师事务所副主任、主任，现任北京市天铎律师事务所合伙人。

金李先生，独立董事，美国麻省理工学院金融学博士。现任北京大学光华管理学院副院长，九三学社中央常委，全国政协委员，经济委员会委员。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。

黄隽女士，独立董事，中国人民大学经济学博士。现任中国人民大学应用经济学院教授、副院长。研究方向为货币政策、商议银行理论与政策、艺术品金融，出版多本专著，在经济、金融类学术核心期刊上发票多篇学术论文，具有丰富的教学和科研经验。

## 2. 监事会成员

许国平先生，监事会主席，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，任监事会主席。

邓金煌先生，职工监事，上海财经大学管理学硕士。2001 年 9 月至 2003 年 9 月任职于株洲电力局；2003 年 9 月至 2006 年 1 月攻读硕士学位；2006 年 4 月至 2010 年 5 月任华为三康技术有限公司人力资源专员；2010 年 5 月至 2011 年 9 月任招商证券人力资源部高级经理；2011 年 9 月至 2016 年 8 月任融通基金管理有限公司综合管理部总监助理；2016 年 8 月加入大成基金管理有限公司，任人力资源部副总监；现任大成基金管理有限公司人力资源部总监。

陈焱女士，职工监事，吉林大学法学硕士。2005 年 8 月至 2008 年 3 月任金杜律师事务所深圳分所公司证券部律师；2008 年 3 月加入大成基金管理有限公司，历任监察稽核部律师、总监助理；现任大成基金管理有限公司监察稽核部副总监。

### 3. 高级管理人员情况

吴庆斌先生，董事长。简历同上。

谭晓冈先生，总经理。简历同上。

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。2014 年 11 月加入大成基金管理有限公司，2015 年 1 月起任公司副总经理，2019 年 8 月起任大成国际资产管理有限公司总经理。

温智敏先生，副总经理，哈佛大学法学博士。曾任职于美国 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。

周立新先生，副总经理兼首席信息官，中央党校经济管理本科。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，2019年5月起兼任首席信息官。

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。

赵冰女士，督察长，清华大学工商管理硕士。曾供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。

#### 4. 基金经理

##### (1) 现任基金经理

冉凌浩：金融学硕士。证券从业年限16年。2003年4月至2004年6月就职于国信证券研究部，任研究员。2004年6月至2005年9月就职于华西证券研究部，任高级研究员。2005年9月加入大成基金管理有限公司，曾担任金融工程师、境外市场研究员及基金经理助理。2011年8月26日起任大成标普500等权重指数型证券投资基金基金经理。2014年11月13日起任大成纳斯达克100指数证券投资基金基金经理。2016年12月2日起任大成恒生综合中小型股指数基金(QDII-LOF)基金经理。2016年12月29日起任大成海外中国机会混合型证券投资基金(LOF)基金经理。2017年8月10日起任大成恒生指数证券投资基金(LOF)基金经理。2019年3月20日起任大成中华沪深港300指数证券投资基金(LOF)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
张英辉	2011年3月23日至2011年8月25日

#### 5. 量化投资决策委员会境外投资决策小组

量化投资决策委员会境外投资决策小组由3名成员组成，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境外投资决策小组成员；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境外投资决策小组成员；冉凌浩，基金经理，量化投资决策委员会境外投资决策小组成员。

上述人员之间不存在亲属关系。

## 二、基金托管人

### （一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

首次注册登记日期：1983 年 10 月 31 日

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：刘连舸

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：(010) 66594942

中国银行客服电话：95566

### （二）基金托管部门及主要人员情况

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

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

### （三）证券投资基金托管情况

截至 2019 年 6 月 30 日，中国银行已托管 716 只证券投资基金，其中境内基金 676 只，QDII 基金 40 只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF 等多种类型的基

金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

#### （四）托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007 年起，中国银行连续聘请外部会计会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2017 年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

#### （五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

### 三、境外托管人

#### 一、中银香港概况

名称：[中国银行(香港)有限公司]

住所：[香港中环花园道 1 号中银大厦]

办公地址：[香港中环花园道 1 号中银大厦]

法定代表人：[高迎欣总裁]

成立时间：[1964 年 10 月 16 日]

组织形式：[股份有限公司]

存续期间：[持续经营]

联系人：[黄晚仪 副总经理 托管业务主管]

联系电话：[852-3982-6753]

中国银行(香港)有限公司（“中银香港”）早于 1964 年成立，并在 2001 年 10 月 1 日正式重组为中国银行(香港)有限公司，是一家在香港注册的持牌银行。其控股公司-中银香港(控股)有限公司（“中银香港(控股)”）-则于 2001 年 2 日在香港注册成立，并于 2002 年 7 月 25 日开始在香港联合交易所主板上市，2002 年 12 月 2 日被纳入为恒生指数成分股。中银香港目前主要受香港金管局、证监会以及联交所等机构的监管。

截至 2018 年底，中银香港(控股)有限公司的总资产超过 29,529 亿港元，资本总额超过 2,570 亿港元，总资本比率为 23.1%。中银香港(控股)的财务实力及双 A 级信用评级，可媲美不少大型全球托管银行，其最新信评如下(截至 2018 年 12 月 31 日):

	穆迪投资 服务	标准普 尔	惠誉国际 评级
评级展望	稳定	稳定	稳定
长期	Aa3	A+	A
短期	P-1	A-1	F1
展望	稳定	稳定	稳定

中银香港作为香港第二大银行集团，亦为三家本地发钞银行之一，拥有最庞大分行网络与广阔的客户基础，且连续五年成为“亚太及香港区最稳健银行”《银行间杂志》。

托管服务是中银香港企业银行业务的核心产品之一，目前为超过六十万企业及工商客户提供一站式的证券托管服务。对于服务国内企业及机构性客户(包括各类 QDII 及其各类产品等)，亦素有经验，于行业处于领先地位，包括于 2006 年被委任为国内首只银行类 QDII 产品之境外托管行，于 2007 年被委任为国内首只券商类 QDII 集成计划之境外托管行，另于 2010 年服务市场首宗的跨境 QDII-ETF 等;至于服务境外机构客户方面亦成就显著：

在“债券通”的领域 =>自开通至今，持续维持最大的市场份额

在人民币合格境外机构投资者(RQFII)的领域 =>成为此类人民币产品的最大香港服务商

在离岸人民币 CNH 公募基金的领域  
月) =>成为市场上首家服务商(2010 年 8

=>目前亦为最大的服务商

在港上市的交易所买卖基金(ETF)

=>中资发行商的最大服务商之一

在离岸私募基金的领域  
之一

=>新募长仓基金的最大服务商

在非上市的股权/债权投资领域

=>香港少有的服务商之一

在“中港基金互认计划”领域

=>获得领先地位

在“香港上海黄金交易所(SGE)”

=>任命为香港唯一结算银行

其业务专长及全方位的配备,令中银香港成为目前本地唯一的中资全面性专业全球托管银行,亦是唯一获颁行业奖项的中资托管行:

专业杂志	所获托管奖项
	亚洲投资人杂志 (Asian Investors) 服务提供者奖项: 最佳跨境托管亚洲银行 (2012)
	财资杂志(The Asset) Triple A 托管专家系列奖项: 最佳 QFII 托管行 (2013) 最佳中国区托管专家 (2016)  财资杂志(The Asset) Triple A 个人领袖奖项: Fanny Wong - 香港区年度托管银行家 (2014)

	<p>财资杂志 (The Asset) Triple A 资产服务、机构投资者及保险机构系列奖项:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- 最佳 QDII 托管行 (2018); 及</li> <li>- 最佳 QDII 客户个案 (2018)</li> </ul>
	<p>获债券通有限公司颁发:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- “债券通优秀托管机构” (2018)</li> <li>- “债券通优秀托管行” (2019)</li> </ul>

截至 2018 年末, 中银香港(控股)的托管资产规模达 10,984 亿港元。

## 二、托管部门人员配备、安全保管资产条件的说明

### (一) 主要人员情况

托管业务是中银香港的核心产品之一, 由管理委员会成员兼副总裁王兵先生直接领导。针对国内机构客户而设的专职托管业务团队现时有二十多名骨干成员, 职级均为经理或以上, 分别主理结算、公司行动、账务(Billing)、对账(Reconciliation)、客户服务、产品开发、营销、次托管网络管理及合规等方面。骨干人员均来自各大跨国银行, 平均具备 15 年以上的专业托管工作经验(包括本地托管及全球托管), 并操流利普通话, 可说是香港最资深的托管团队。

除配备专职的客户关系经理, 中银香港更特设为内地及本地客户服务的专业托管业务团队, 以提供同时区、同语言的高素质服务。

除上述托管服务外, 若客户需要估值、会计、投资监督等增值性服务, 则由中银香港的附属公司中银国际英国保诚信托有限公司(“中银保诚”)提供。作为「强制性公积金计划管理局」认可的信托公司, 中银保诚多年来均提供国际水平的估值、会计、投资监督等服务, 其专职基金会计与投资监督人员达 50 多名, 人员平均具备 10 年以上相关经验。

中银香港的管理层对上述服务极为重视, 有关方面的人员配置及系统提升正不断加强。另外, 其它中/后台部门亦全力配合及支持托管服务的提供, 力求以最高水平服务各机构性客户。

关键人员简历

黄晚仪女士

托管业务主管

黄女士于香港大学毕业，并取得英国 Heriot-Watt University 的工商管理硕士及英国特许银行公会的会士资格。黄女士从事银行业务超过二十年，大部分时间专职于托管业务，服务企业及机构性客户。效力的机构包括曾为全球最大之金融集团 - 花旗集团 - 及本地两大发钞银行 - 渣打及中银香港。参加中银香港前，黄女士为花旗集团之董事及香港区环球托管业务总监。目前黄女士专职于领导中银香港的全球托管及基金服务发展，并全力配合中国合格境内机构投资者之境外投资及理财业务之所需，且担任中银香港集团属下多家代理人公司及信托公司的企业董事。黄女士亦热心推动行业发展，包括代表中银香港继续担任「香港信托人公会」行政委员会之董事一职；自 09 年 9 月至 2015 年 6 月期间，获「香港交易所」委任作为其结算咨询小组成员；另外，黄女士目前亦是香港证监会产品咨询委员会的委员之一。

郑丽华女士

托管运作及产品开发主管

郑女士乃英国特许公认会计师公会之资深会员及香港会计师公会之会员，并持有伦敦大学专业会计硕士学位。郑女士从事金融与银行业务超过二十年，其中十多年专职于托管业务，服务企业及机构性客户。曾经工作的机构包括全球最大之金融集团 - 美国摩根大通银行与汇丰银行及本地银行 - 恒生银行，对托管业务操作、系统流程及有关之风险管理尤为熟悉。

阮美莲女士

财务主管

阮女士拥有超过二十年退休金及信托基金管理经验，管理工作包括投资估值、基金核算、投资合规监控及信托运作等。加入中银国际集团前，阮女士曾于百慕达银行任职退休金部门经理一职，以及于汇丰人寿任职会计经理，负责退休金基金会计工作。阮女士是香港会计师公会及英国特许公认会计师公会资深会员，并持有英国列斯特大学硕士学位。

## （二）安全保管资产条件

在安全保管资产方面，为了清楚区分托管客户与银行拥有的资产，中银香港目前已以托管人身份在本港及海外存管或结算机构开设了独立的账户以持有及处理客户的股票、债券等资产交收。

除获得客户特别指令或法例要求外，所有实物证券均透过当地市场之次托管人以该次托管人或当地存管机构之名义登记过户，并存放于次托管人或存管机构内，以确保客户权益。

至于在异地市场进行证券交割所需之跨国汇款，除非市场/存托机构/次托管行等另有要求，否则中银香港会尽可能在交收日汇入所需款项，以减少现金停留于相关异地市场的风险。

先进的系统是安全保管资产的重要条件。

中银香港所采用的托管系统名为” Custody & Securities System” 或简称 CSS，是中银香港聘用一支科技专家、并结合银行内部的专才，针对机构性客户的托管需求在原有的零售托管系统上重新组建而成的。CSS 整个系统构建在开放平台上，以 IBM P5 系列 AIX 运行。系统需使用两台服务器，主要用作数据存取及支持应用系统软件，另各自附有备用服务器配合。此外，一台窗口服务器已安装 NFS (Network File System, for Unix)模块，负责与 AIX 服务器沟通。

新系统除了采用尖端科技开发，并融合机构性客户的需求与及零售层面的系统优势，不单符合 SWIFT-15022 之要求，兼容 file transfer 等不同的数据传输，亦拥有庞大的容量 (原有的零售托管系统就曾多次证实其在市场买卖高峰期均运作如常，反观部分主要银行的系统则瘫痪超过 1.5 小时)。

至于基金估值、会计核算以及投资监督服务，则采用自行研发的 FAMEX 系统进行处理，系统可相容多种货币、多种成本定价法及多种会计核算法，以满足不同机构客户及各类基金的需要。系统优势包括：多种货币；多种分类；实时更新；支持庞大数据量；简易操作,方便用户。系统所支持的核算方法包括：权重平均(Weighted Average)；后入先出(LIFO)；先入先出(FIFO)；其它方法可经与客户商讨后实施。系统所支持的估值方法有：以市场价格标明 (Marking to Market)；成本法；成本或市场价的较低者；入价与出价(Bid and offer)；分期偿还(Amortization)；含息或除息(Clean/dirty)；及其它根据证券类别的例外估值等。

### 三、托管业务的主要管理制度

作为一家本地持牌银行，中银香港的业务受香港金融管理局全面监管；另外，作为本地上市的金融机构，中银香港亦需严格遵守香港联合交易所的规定及要求。

中银香港实施严格的内部控制制度和风险管理流程，所有重要环节均采用双人复核，减少人工操作风险；并由独立风险管理部门就任何新产品/服务/措施等进行全面评核及监控，避免人为失误或道德风险。任何外判安排，除上述风险分析外，还需寻求监管机构之批准。

对于次托管行或服务商的委任，中银香港亦制定了有关选任、服务标准、及日常服务水平监控等制度及要求，以确保服务质量。对托管客户而言，中银香港亦承担其次托管行之服务疏失等风险，并在托管合约中清楚订明。

中银香港具备经审核之应变计划以应付各种各样特殊情况的发生。应变计划每年均会进行测试及演练，模拟在突发情形下之业务运作，并对测试结果进行检讨及评估，以确保在突发情形下仍能提供服务。系统方面，灾难应变措施中心亦已预留独立应用程序及数据库服务

器，随时取代生产服务器运作。

托管业务之规章制度及工作手册乃根据与托管相关的监管条例或指引(如：员工守则，了解你的客户政策、防洗钱政策及个人私隐条例等)与中银香港本身制定的内控制度(如：信息安全管理办法，包括托管系统用户之管理、权限之设定等)缮制，并因应有关条例、指引或政策之修订而适时调整，以确保乎合对外、对内的监控要求。

有关托管业务的重要规章制度包括《托管业务标准操作规程》(Custody - Standard Operating Procedure Overview)，主要内容包括：账户开立、客户账户管理、结算程序、公司行动程序、资产核对、资金报告、账单、投诉、应急计划等等。以及《托管系统进入控制规程》(Custody - System Access Control Procedure Overview)，内容涵盖系统范围、系统描述、用户概况、功能列表、职责定义、增加、删除、修改程序、请求格式、控制与备份安排等。

中银香港设有独立的稽核委员会，直接向董事会负责，对各部门进行定期及不定期之稽核。至于年度审计，则委任安永 (Ernst & Young)会计师事务所进行。在核心托管团队中，特有一名合规人员，专注负责托管业务的风险控制，确保实施全银行的合规标准。

中银集团系内各企业法人或业务条线均严格分开，并设严密的防火墙，以确保客户资料高度保密。

#### 四、重大处罚

中银香港托管业务自成立至今已超过十二年，从未受到监管机构的重大处罚，亦没有重大事项正在接受司法部门、监管机构的立案调查。

#### 四、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：吴庆斌

电话：0755-83183388

传真：0755-83199588

联系人：教姣

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：吴海灵、关志玲、白小雪

电话：0755-22223556/22223177/22223555

传真：0755-83195235/83195242/83195232

邮编：518040

## 二. 代销机构

### 1、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

办公地址：北京西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：刘连舸

客服电话：95566

联系人：王永民

电话：010-66594896

传真：010-66594942

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

### 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

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：陈四清

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 F9

法定代表人：周慕冰

联系人：贺倩

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、交通银行股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

法定代表人：彭纯

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)

#### 5、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

办公地址：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)

#### 6、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、甲 25 号中国光大中心

办公地址：北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心

法定代表人：李晓鹏

客服电话：95595

联系人：石立平

电话：010-63639180

传真：010-68560312

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

7、上海农村商业银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东大道 981 号

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)

8、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)

9、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>

10、西安银行股份有限公司

注册地址：西安市高新路 60 号

办公地址：西安市高新路 60 号

法定代表人：郭军

联系人：白智

电话：029-88992881

传真：029-88992475

客服电话：全国 400-86-96779；陕西 96779

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

11、江苏江南农村商业银行股份有限公司

注册地址：常州市和平中路 413 号

办公地址：常州市和平中路 413 号

法人代表：陆向阳

公告联系人：李仙

联系电话：0519-89995939

公告传真：0519-89995170

客服电话：0519-96005

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

12、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)

13、江西银行股份有限公司

注册地址：江西省南昌市红谷滩新区金融大街 699 号

法定代表人：陈晓明

联系人：陈云波

电话：0791-86796029

传真：0791-86771100

客服电话：400-789-6266

网站：[www.jx-bank.com](http://www.jx-bank.com)

14、恒丰银行股份有限公司

注册地址：山东省烟台市芝罘区南大街 248 号

法定代表人：蔡国华

联系人：蒋悦

电话：021-20501975

传真：012-20501978

客服电话：95395

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

15、晋城银行股份有限公司

注册地址：山西省晋城市文昌西街 1669 号

办公地址：山西省太原市高新区高新街联合大厦

法定代表人：贾沁林

联系人：朱丹

联系电话：18734835708

客服电话：95105757

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

16、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>

17、九江银行股份有限公司

注册地址：江西省九江市濂溪区长虹大道 619 号

法定代表人：刘羨庭

办公地址：江西省九江市长虹大道 619 号

客服热线：95316

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

18、中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中信三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、  
14 层

办公地址：深圳市福田区中信三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、  
14 层

法定代表人：张皓

联系人：刘宏莹

联系电话：010-60833754

传真：0755-83217421

客服电话：400-990-8826

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

#### 19、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>

#### 20、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)

#### 21、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

#### 22、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

#### 23、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

#### 24、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

25、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)

26、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 2-6 层

法定代表人：陈共炎

客服电话：4008-888-888

联系人：辛国政

联系电话：010-83574507

传真：010-83574807

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

27、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：周杰

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)

28、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](http://www.sywg.com)

29、兴业证券股份有限公司

住所：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](http://www.xyzq.com.cn)

客户服务电话：95562

30、长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：杨泽柱

客户服务热线：95579、4008-888-999

联系人：奚博宇

电话：027-65799999

传真：027-85481900

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

31、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：95517

联系人：陈剑虹

电话：0755-82825551

传真：0755-82558355

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

32、西南证券股份有限公司

地址：重庆市渝中区临江支路 2 号合景国际大厦 A 幢

法定代表人：余维佳

客服电话：4008096096

联系人：张煜

联系电话：023-63786633

网址：www.swsc.com.cn

### 33、湘财证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

办公地点：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

法定代表人：孙永祥

电话：021-38784580-8918

传真：021-68865680

联系人：李欣

邮编：410004

客服电话：95351

公司网址：www.xcsc.com

### 34、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

### 35、民生证券股份有限公司

地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座

法定代表人：余政

客服电话：4006198888

联系人：赵明

联系电话：010-85127622

联系传真：010-85127917

公司网址：www.msza.com

### 36、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)

37、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)

38、中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

法定代表人：姜晓林

客服电话：95548

联系人：焦刚

电话：0531-89606166

传真：0532-85022605

网址：<http://sd.citics.com/>

39、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](http://www.cindasc.com)

#### 40、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](http://www.dfzq.com.cn)

#### 41、方正证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

法定代表人：雷杰

客服电话：95571

联系人：徐锦福

电话：010-57398062

传真：010-57398058

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

#### 42、长城证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16-17 层

法定代表人：曹宏

联系人：金夏

电话：0755-83516289

传真：-83515567

客户服务热线：400-666-6888

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

#### 43、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：周健男

客服电话：95525

联系人：龚俊涛

电话：021-22169999

传真：021-22169134

网址：www.ebscn.com

44、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

45、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

46、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：步国甸

客服电话：95386

联系人：石健

电话：025-83367888

传真：025-83364032

网址：www.njzq.com.cn

47、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)

48、平安证券股份有限公司

办注册地址：深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心 61 层-64 层

法定代表人：何之江

客户服务热线：95511-8

联系人：王阳

电话：021-38632136

传真：021-58991896

网址：<http://stock.pingan.com>

49、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](http://www.cfzq.com)

50、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](http://www.dgzq.com.cn)

51、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

52、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：王少华

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

53、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

54、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)

55、申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

法定代表人：韩志谦

电话：010-88085858

传真：010-88085195

联系人：李巍

客服电话：400-800-0562

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

56、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)

57、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)

58、第一创业证券股份有限公司

地址：深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25F

法人代表：刘学民

电话：95358

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

59、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](http://www.avicsec.com)

60、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](http://www.gfhfzq.com.cn)

61、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)

## 62、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)

## 63、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

## 64、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)

## 65、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)

66、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)

67、国融证券股份有限公司

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)

68、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](http://www.lxzq.com.cn)

69、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：400662288

联系人：周俊

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

70、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

71、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.gjq.com.cn](http://www.gjq.com.cn)

72、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)

73、华宝证券有限责任公司

地址：上海市浦东新区环球金融中心 57 楼

法定代表人：陈林

客服电话：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)

74、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)

75、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)

76、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)

77、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>

78、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)

79、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

80、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>

81、上海挖财基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 楼 01、02、03 室

法定代表人：冷飞

客服电话：021-50810673

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

82、北京百度百盈基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区上地十街 10 号 1 幢 1 层 101

办公地址：北京市海淀区信息路甲 9 号奎科大厦

法人代表：张旭阳

公告联系人：杨琳

公告电话：010-61952702

公告传真：010-61951007

客服电话：95055-9

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

83、诺亚正行基金销售有限公司

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

84、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](http://www.zlfund.cn)

客服电话：4006-788-887

85、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](http://www.1234567.com.cn)

86、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](http://www.ehowbuy.com)

87、蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F

法人代表：陈柏青

联系人：韩爱彬

电话：021-60897840

传真：0571-26697013

客服电话：4000-766-123

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

88、上海长量基金销售有限公司

办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层

法定代表人：张跃伟

客服电话：4008202899

联系人：邱燕芳

电话：021-20691931

传真：021-20691861

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

89、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

90、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

91、嘉实财富管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层 5312-15 单元

法定代表人：赵学军

电话：010-65215588

传真：010-85712195

联系人：李雯

联系人邮箱：liwen@harvestwm.cn

客服电话：400-021-8850

网址：www.harvestwm.cn

92、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：王锋

客服电话：95177

网址：<https://www.snjijin.com/>

93、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)

94、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>

95、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

96、上海联泰基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

邮编：200335

法定代表人：燕斌

联系人：兰敏

电话：021-52822063

传真：021-52975270

客服电话：400-166-6788

公司网址：[www.66zichan.com](http://www.66zichan.com)

97、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心龙园 3 号

法定代表人：林卓

联系人：张晓辉

电话：0411-88891212

传真：0411-84396536

客服电话：400-6411-999

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

98、上海基煜基金销售有限公司

住所：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：400-820-5369

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

99、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：400-643-3389

联系人：葛佳蕊

电话：021-63333319

传真：021-63332523

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

100、上海中正达广基金销售有限公司

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.zhongzhengfund.com>

101、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)

102、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

103、上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

法定代表人：王之光

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

联系人：宁博宇

客服电话：4008219031

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

104、珠海盈米基金销售有限公司

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

105、和耕传承基金销售有限公司

注册地址：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北 6 号楼 5 楼 503 房间

办公地址：北京市朝阳区酒仙桥路 6 号院国际电子城 b 座

法定代表人：王旋

客服电话：4000-555-671

网址：<http://www.hgccpb.com/>

106、奕丰基金销售有限公司

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航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室

法定代表人：TEO WEE HOWE

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)

107、北京肯特瑞基金销售有限公司

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：95118（个人业务）、400 098 8511

企业业务：400 088 8816

传真：010-8919566

网址：[fund.jd.com](http://fund.jd.com)

108、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技园中区科苑路 15 号科兴科学园 B 栋 3 单元 11

层

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：刘昕霞

电话：0755-29330513

传真：0755-26920530

客服电话：400-9302-888

网址：<https://www.jfz.com/>

109、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>

110、上海华夏财富投资管理有限公司

注册地址：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室

法定代表人：毛淮平

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B8 层

客服热线：400-817-5666

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

111、阳光人寿保险股份有限公司

注册地址：海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层

办公地址：北京市朝阳区朝阳门外大街乙 12 号院 1 号昆泰国际大厦 12 层

法定代表人：李科

电话：010-85632771

传真：010-85632773

联系人：王超

客服热线：95510

公司网站：<http://fund.sinosig.com/>

112、金惠家保险代理有限公司

注册地址：北京市西城区阜成门外大街 2 号 19 层 A2017

办公地址：北京市西城区阜成门外大街 2 号 19 层 A2017

法定代表人：夏予柱

联系人：胡明哲

联系电话：010-56203275

传真：010-68091380

客服电话：400-106-0101

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

基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

(二) 注册登记机构

名称：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：吴庆斌

电话：0755-83183388

传真：0755-83195239

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：沈娜、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：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：陈薇瑶

经办注册会计师：张振波、陈薇瑶

### 五、基金的名称

大成标普 500 等权重指数证券投资基金

### 六、基金的类型

股票型指数基金

### 七、基金的运作方式

契约型开放式

### 八、基金的投资目标

通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪，追求跟踪误差最小化。

## 九、基金的投资范围

本基金主要投资于标普 500 等权重指数成份股、备选成份股，与标普 500 等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金、结构性产品等，固定收益类证券、银行存款、现金等货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他产品或金融工具。

本基金投资于标普 500 等权重指数成份股、备选成份股以及与标普 500 等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金、结构性产品的比例为基金资产净值的 80%—95%，其中投资于与标普 500 等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金、结构性产品的比例不超过 10%；投资于现金、银行存款、固定收益类证券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具的比例为基金资产净值的 5%—20%，其中投资于现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券的比例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或变更投资比例限制，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。

## 十、基金的投资策略

本基金将按照标的指数的成份股及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如股票停牌、流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

本基金还可能将一定比例的基金资产投资于与标普 500 等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金，以优化投资组合的建立，达到节约交易成本和有效追踪标的指数表现的目的。

本基金在投资的过程中，由于必须保有一定比例的现金资产，导致在市場上漲的过程中，基金投资组合的表现可能会落后于标的指数的表现。另外，由于基金投资组合权重与目标指数成份股权重的不一致、股票买卖价格与股票收盘价的差异、指数成份股的调整与指数成份股权重的调整所产生的交易费用、基金运作过程中的各项费用与开支都会使基金投资组合产生跟踪误差。

基金管理人会定期对跟踪误差进行归因分析，为基金投资组合下一步的调整及跟踪目标指数偏离风险的控制提供量化决策依据。在正常情况下，本基金力争控制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 0.5%，年化跟踪误差不超过 5%（以美元资

产计价)。

未来,随着跟踪标普 500 等权重指数投资工具的增加,本基金可相应调整和更新相关投资策略,并在招募说明书更新中公告。

## 十一、基金的业绩比较基准

标普 500 等权重指数(全收益指数)

未来,如果标普 500 等权重指数的提供商标准普尔公司终止对基金管理人继续使用该指数的授权,或者是标准普尔公司基于其独立判断停止继续发布该指数,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时,本基金管理人在保护持有人合法利益的前提下,以不损害持有人利益为原则,可以与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

## 十二、基金的风险收益特征

本基金为美国股票指数型证券投资基金,风险与预期收益高于混合型基金、债券基金以及货币市场基金。

## 十三、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行根据基金合同规定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 2019 年半年度报告,截至 2019 年 6 月 30 日。(财务数据未经审计)

### 1. 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	164,727,142.40	92.15
	其中:普通股	164,727,142.40	92.15
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-

	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	13,149,267.70	7.36
8	其他各项资产	874,048.28	0.49
9	合计	178,750,458.38	100.00

## 2. 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

金额单位：人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比列 (%)
美国	164,727,142.40	93.78
合计	164,727,142.40	93.78

## 3. 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

## (1) 报告期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值	占基金资产净值比列 (%)
医疗保健	20,287,720.71	11.55
信息技术	22,757,316.99	12.96
非日常生活消费品	20,296,329.94	11.55
日常消费品	10,441,748.90	5.94
能源	9,856,087.59	5.61
金融	22,164,965.83	12.62
原材料	9,220,344.35	5.25
公用事业	9,176,141.33	5.22
工业	22,899,093.95	13.04
房地产	10,434,556.81	5.94
通信服务	7,192,836.00	4.09
合计	164,727,142.40	93.78

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

## (2) 报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

## 4. 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

(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权益投资明细

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券 代码	所在 证券 市场	所属 国家 (地 区)	数量 (股)	公允价值(人 民币元)	占基金 资产净 值比例 (%)
1	ALLERGAN PLC	艾尔建有 限公司	AGN UN	美国 纽约 证券 交易 所	美国	401	461,563.44	0.26
2	ADVANCED MICRO DEVICES	AMD 公司	AMD UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	2,083	434,898.40	0.25
3	WESTERN DIGITAL CORP	西部数据 公司	WDC UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,281	418,748.63	0.24
4	TECHNIPFMC PLC	TechnipFM C 公共有 限公司	FTI UN	美国 纽约 证 券 交	美国	2,224	396,605.29	0.23

				易所				
5	FLOWSERVE CORP	福斯公司	FLS UN	美国 纽约 证券 交易 所	美国	1,072	388,308.35	0.22
6	HESS CORP	赫斯公司	HES UN	美国 纽约 证券 交易 所	美国	880	384,581.72	0.22
7	APPLIED MATERIALS INC	应用材料 股份有 限公 司	AMAT UQ	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美国	1,243	383,767.27	0.22
8	JACOBS ENGINEERING GROUP INC	雅各布工 程集团	JEC UN	美国 纽约 证 券 交 易 所	美国	652	378,261.67	0.22
9	IQVIA HOLDINGS INC	IQVIA 控 股股份 有限公 司	IQV UN	美国 纽约 证 券	美国	341	377,193.48	0.21

				交易所				
10	Corteva Inc.	Corteva 公司	CTVA UN	美国纽约证券交易所	美国	1,848	375,670.46	0.21

(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权益投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

5. 报告期末按债券信用等级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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金额衍生品。

9. 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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

10. 投资组合报告附注

(1) 申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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。

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

(2) 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

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) 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	195,027.59

4	应收利息	913.60
5	应收申购款	564,191.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	113,915.51
8	其他	-
9	合计	874,048.28

(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处于转股期的可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

①报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中无流通受限情况。

②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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

(6) 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。

#### 十四、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：

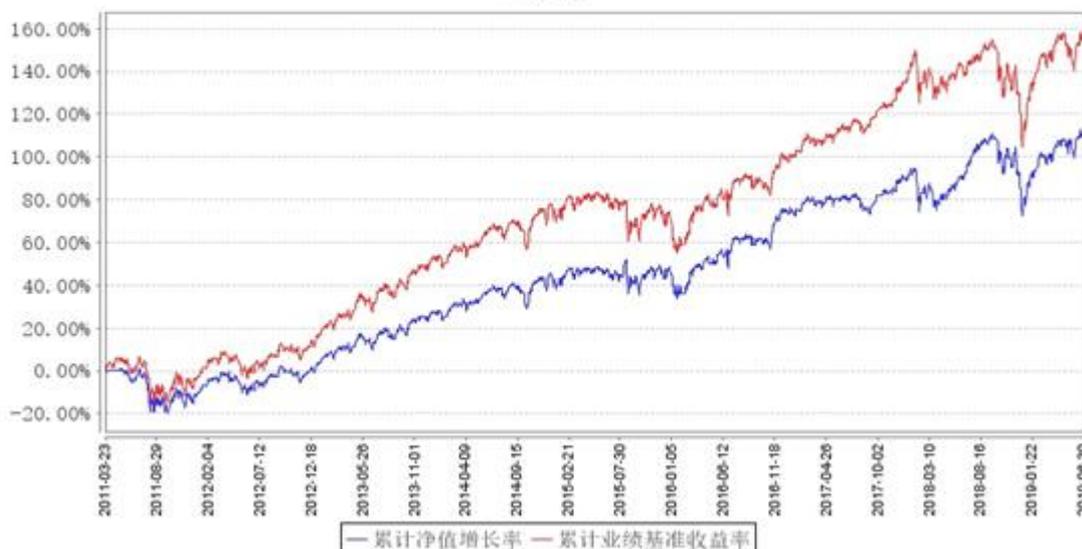
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2011.3.23-2011.12.31	-11.70%	1.67%	-4.14%	1.79%	-7.56%	-0.12%
2012.1.1-2012.12.31	13.82%	0.82%	17.65%	0.89%	-3.83%	-0.07%
2013.1.1-2013.12.31	27.26%	0.75%	36.16%	0.78%	-8.90%	-0.03%
2014.1.1-2014.12.31	11.91%	0.67%	14.49%	0.70%	-2.58%	-0.03%
2015.1.1-2015.12.31	2.35%	1.00%	-2.20%	1.22%	4.55%	-0.22%
2016.1.1-2016.12.31	18.15%	0.86%	14.80%	0.93%	3.35%	-0.07%
2017.1.1-2017.12.31	9.03%	0.49%	18.90%	0.46%	-9.87%	0.03%
2018.01.01-2018.12.31	-4.02%	0.98%	-7.64%	1.01%	3.62%	-0.03%
2019.01.01-2019.06.30	17.39%	0.78%	19.19%	0.81%	-1.80%	-0.03%
2011.03.23-2019.06.30	112.66%	0.94%	158.36%	0.98%	-45.70%	-0.04%

(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

本基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2011年3月23日至2019年6月30日)

大成标普500等权重指数QDII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



注：1、按基金合同规定，本基金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，建仓期结束时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。

2、同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

## 十五、费用概览

### (一) 基金费用的种类

1. 基金管理人的管理费；
2. 基金托管人的托管费；
3. 因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）；
4. 基金合同生效以后的信息披露费用；
5. 基金份额持有人大会费用；
6. 基金合同生效以后的会计师费和律师费；
7. 基金的资金汇划费用；

8. 基金进行外汇兑换交易的相关费用；
9. 与基金缴纳税收有关的手续费、汇款费等；
10. 基金合同生效以后的基金的指数使用费与指数数据费；
11. 按照国家有关规定可以列入的其他费用。

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

## （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### 1. 基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费（如基金管理人委托投资顾问，包括投资顾问费）按基金资产净值的 1.0% 年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.0% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

### 2. 基金托管人的托管费

基金托管人的基金托管费（如基金托管人委托境外资产托管人，包括向其支付的相应服务费）按基金资产净值的 0.25% 年费率计提。

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

3. 本条第（一）款第 3 至第 10 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

本条第（一）款约定以外的其他费用，基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行

义务导致费用支出或基金资产的损失,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。

#### (四) 基金费用调整

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

#### (五) 税收

本基金运作过程中涉及各纳税主体,依照国家法律法规和境外市场规定履行纳税义务。

### 十六、对招募说明书更新部分的说明

本更新招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其他有关法律法规的要求,并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动,对 2019 年 5 月 8 日公布的《大成标普 500 等权重指数证券投资基金更新招募说明书(2019 年 1 期)》进行了内容补充和更新,本更新的招募说明书主要更新的内容如下:

根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》,更新了“二、释义”、“八、基金份额的申购、赎回与转换”、“十四、基金收益与分配”、“十五、基金的会计与审计”、“十六、基金的信息披露”、“十九、基金合同内容摘要”、“二十、基金托管协议内容摘要”。

大成基金管理有限公司

2019 年 12 月 17 日