

大成标普 500 等权重指数证券投资基金 更新的招募说明书

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

二〇二一年三月

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。

本基金标的指数为标普 500 等权重指数。

（1）指数样本空间

标普 500 指数样本

（2）选样方法

标普 500 指数中的公司按 GICS 行业分类，每个行业指数均由 GICS 行业的所有股票组成。

指数成分与标普 500 指数相关 GICS 行业相同。倘标普 500 指数的 GICS 行业发生变动，相关成分股的变动将纳入标普等权重行业指数，但标普 500 等权重 Plus 指数除外，这些指数也会包含追加股票。如成分股公司在重新分类后迁至新的标普 500 等权重行业指数中，则维持其修正指数份额。这会导致该公司离开和加入的标普 500 等权重行业指数的除数调整。

在季度重新调整时，倘为标普 500 等权重 Plus 指数选出的公司不足 22 家，则从标普中盘 400 指数中选出合格 GICS 行业内流通市值最高的公司补足指数，直到达到 22 家公司

的最低要求。倘标普 500 指数的合资格 GICS 行业季内增添成分股，使指数达到所需的最低成分股数目，则追加的公司将留在指数内，直到下次季度重新调整时对这些股票进行评审。

倘需要追加股票而当前成分股中至少有一只为追加股票，则在季度重新调整时应用缓冲，以使所添加的追加股票的流通市值须高于被替代的追加股票 1.2 倍（高出 20%）。添加的每只追加股票相对于其所替代的现有追加股票的缓冲会进行评估。例如，评比流通市值最高的非指数成分追加股票与流通市值最低的指数成分追加股票，评比第二大非指数成分追加股票与倒数第二指数成分追加股票等。该过程将重复进行至并无添加的追加股票超出缓冲区间。

加权。该等指数将在 3 月、6 月、9 月和 12 月的第三个周五交易结束后重设为均等加权，每季度一次。加权参考日期为重新加权月份的第二个周五，所作变动采用重新加权参考日期的价格以及重新加权生效日期 的成分股、已发行股份和 IWF，在下个周五收市后生效。

有关标的指数具体编制方案及成份股信息详见标普道琼斯指数（S&P Dow Jones Indices）网站，网址：chinese.spindices.com。

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 2020 年 3 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 12 月 31 日（财务数据未经审计）。

目 录

重 要 提 示	0
一、绪 言	4
二、释 义	4
三、风险揭示	8
四、基金的投资	12
五、基金业绩	25
六、基金管理人	26
七、基金合同的生效	39
八、基金份额的申购与赎回	40
九、基金的费用与税收	48
十、基金的资产	50
十一、基金资产的估值	51
十二、基金收益与分配	54
十三、基金的会计与审计	55
十四、基金的信息披露	56
十五、基金合同的变更、终止与基金资产的清算	61
十六、基金托管人	63
十七、境外托管人	64
十八、相关服务机构	70
十九、基金合同内容摘要	104
二十、基金托管协议内容摘要	116
二十一、对基金份额持有人的服务	126
二十二、其他应披露的事项	127
二十三、招募说明书的存放及查阅方式	129
二十四、备查文件	129

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》）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》（以下简称《试行办法》）、《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》）、《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》（以下简称《指数基金指引》）、《大成标普 500 等权重指数证券投资基金基金合同》（以下简称基金合同）及其他有关规定编写。

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《大成标普 500 等权重指数证券投资基金基金合同》编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。投资者取得依基金合同所发行的基金份额，即成为基金份额持有人和本基金基金合同的当事人，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》、《流动性风险管理规定》、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《大成标普 500 等权重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：

基金或本基金：	指大成标普 500 等权重指数证券投资基金；
基金合同或本基金合同：	指《大成标普 500 等权重指数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《大成标普 500 等权重指数证券投资基金招募说明书》及其更新；
托管协议：	指《大成标普 500 等权重指数证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充；

发售公告：	指《大成标普 500 等权重指数证券投资基金发售公告》；
基金产品资料概要：	指《大成标普 500 等权重指数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；
中国银保监会：	指中国银行保险监督管理委员会；
外管局：	指国家外汇管理局；
《证券法》：	指《中华人民共和国证券法》；
《合同法》：	指《中华人民共和国合同法》；
《基金法》：	指《中华人民共和国证券投资基金法》；
《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；
《信息披露办法》	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；
《指数基金指引》	指中国证监会 2021 年 1 月 22 日颁布、同年 2 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》及颁布机关对其不时做出的修订
元：	如无特指，指人民币；
基金合同当事人：	指受本《基金合同》约束，根据本《基金合同》享受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：	指中国银行股份有限公司；
境外托管人：	指基金托管人委托的、负责基金境外财产的保管、存管、清算等境外资产托管业务的境外金融机构；
投资顾问：	是指符合《试行办法》规定的条件，根据合同为基金管理人境外证券投资提供证券买卖建议或投资组合管理等服务并取得收入的境外金融机构；
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、机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者；
个人投资者：	指依据中华人民共和国有关法律法规可以投资于证券投资基金的自然人；
机构投资者：	指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资于证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；
基金份额持有人：	指依招募说明书和基金合同合法取得本基金基金份额的投资者；
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三个月；
基金合同生效日：	基金募集达到法律规定及基金合同约定的条件，基金管理人聘请法定机构验资并办理完毕基金合同备案手续,获得中国证监会书面确认之日；
存续期：	指本基金合同生效至终止之间的不定期期限；
日：	指公历日；
月：	指公历月；
工作日：	指上海证券交易所和深圳证券交易所以及美国主要证券交易所同时交易的正常交易日；
开放日：	指基金管理人为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日；
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，投资者根据基金合同和招募说明书的规定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，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求基金管理人购回本基金基金份额的行为；
基金转换：	指基金份额持有人按基金管理人规定的条件，申请将其持有的基金管理人管理的某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金的基金份额的行为；
转托管：	基金份额持有人将其基金账户内的某一基金的基金份额从一

	个销售机构托管到另一销售机构的行为；
投资指令：	指基金管理人或其委托的第三方机构在运用基金资产进行投资时，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：	指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格，并接受基金管理人委托代为办理本基金认购、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而引起的基金份额的变动及结余情况的账户；
T 日：	指销售机构受理投资者申购、赎回或其他业务申请的开放日；
T+n 日：	指自 T 日起第 n 个工作日（不包括 T 日）；
基金收益：	指基金投资所得红利、股息、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：	指基金购买的各类证券、银行存款本息、应收申购款以及其他资产等形式存在的基金资产的价值总和；
基金资产净值：	指基金资产总值减去基金负债后的价值；
基金份额净值：	指以计算日基金资产净值除以计算日基金份额总额后得出的基金份额资产净值；
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；
标的指数：	指标普 500 等权重指数以及未来可能发生变更的其他指数；
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；
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：

指任何不能预见、不能避免、不能克服的客观情况，包括但不限于《基金法》及其他有关法律法规及重大政策调整、台风、洪水、地震、流行病及其他自然灾害，战争、骚乱、火灾、政府征用、戒严、没收、恐怖主义行为、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易等事件。

三、风险揭示

本基金为投资于美国市场的股票型指数基金，其主要面临以下三类风险：一是境外投资的特殊风险，包括海外市场风险，汇率风险、政府管制风险、法律风险、政治风险以及税务风险；二是指数化投资的特殊风险，包括对指数编制方法的认知风险、指数授权风险、金融模型风险、跟踪误差风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、指数编制机构停止服务的风险、成份股停牌的风险；三是开放式基金投资的一般风险，包括上市公司经营风险、流动性风险、信用风险、利率风险、大宗交易风险、会计核算风险、交易结算风险、操作或技术风险以及不可抗力风险。

（一）境外投资的特殊风险

1. 海外市场风险

海外市场风险是指由于基金投资于海外证券市场，因而会受到不同国家或地区（对本基金而言，主要指美国）特有的政治因素、法律制度、经济周期等基本因素的影响，导致基金绩效面临较大的波动性和存在潜在损失的风险。例如美国证券交易市场对每日证券交易价格并无涨跌幅上下限的规定，使得证券的每日涨跌幅有存在较大空间的可能性。另外，美国的会计准则和信息披露制度与中国相比会有较大差异，可能导致基金管理人对公司盈利能力和投资价值判断产生偏差，从而也会给投资带来潜在的风险。

2. 汇率风险

本基金以人民币募集和计价，经过换汇后投资于美国市场以美元计价的金融工具。美元相对于人民币的汇率变化将会影响本基金以人民币计价的基金资产价值，从而导致基金资产

面临潜在风险。

3. 政府管制风险

政府管制风险是指国家政府机关通过制定相关法律法规或采用行政干预手段对社会经济行为实施直接控制而使基金资产有遭受损失的风险。在境外证券投资过程中，基金所投资的国家/地区（对本基金而言，主要是美国）可能会不时采取某些管制措施，如资本或外汇管制、对公司或行业的国有化、没收资产以及征收高额税收等，造成相应的财产受损、交易延误等相关风险，从而对基金收益以及基金资产带来不利影响。

4. 法律风险

由于美国的法律法规与中国不同的原因，可能导致本基金在投资运作、交易结算以及资金汇出入等方面受到限制，从而使得基金资产面临损失的可能性。

5. 政治风险

美国因政治局势变化（如罢工、暴动、战争等）或法令的变动，可能导致市场的较大波动，从而给本基金的投资收益造成直接或间接的影响。

6. 税务风险

由于美国在税务方面的法律法规存在一定差异，可能会要求基金就股息、利息、资本利得等收益向当地税务机构缴纳税金，该行为会使基金收益受到一定影响。此外，美国的税收规定可能发生变化，或者实施具有追溯力的修订，从而导致基金向美国缴纳在基金销售、估值或者出售投资当日并未预计的额外税项。

（二）指数化投资的特殊风险

1. 指数编制方法的认知风险

本基金跟踪的标的指数为标普 500 等权重指数。该指数是在标普 500 指数的基础上，给予每一个成份股公司初始权重为 0.2%。由于成份股价格的走势导致了成份股权重可能发生变化，该指数每季度对成份股权重进行调整，使其重新回归至 0.2%。等权重指数并不意味着指数成份股的权重永远相等，而是在兼顾指数换手率与等权重特征的基础上，设定了定期调整机制，使成份股权重在某一时刻保持几乎相等的状态。与市值加权指数相比，等权重指数具有以下特点：(1)等权重指数中小市值公司所占的比重较高；(2)等权重指数中小公司行业所占的比重较高。等权重指数的上述特点决定了其风险收益特征高于按市值加权的指数。

2. 指数授权风险

本基金管理人依据指数授权许可协议依法取得在中国境内发行跟踪标普 500 等权重指数基金的权利。未来，如果标的指数提供商标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。

3. 金融模型风险

本基金为指数基金。指数基金的管理人会借用一定的金融模型来进行投资决策。然而任何金融模型都是建立在一定理论假设的基础之上，理论假设是对现实情况的高度抽象，这使得金融模型在实际运用当中可能会产生偏差。此外，在实际运作中，可能因市场结构、投资者行为模式等条件发生变动，导致有关模型出现重大偏离的问题，从而引起基金资产损失的风险。

4. 跟踪误差风险

指数基金的跟踪误差是指指数基金的收益率与业绩比较基准之间的偏差。在跟踪指数的过程中，跟踪误差来源主要有：实际组合与标准指数组合构成的差异，指数成份股分红、配股、增发，指数成份股的调整以及上述过程中发生的交易成本、基金的管理费、申购赎回带来的调整成本等。

5. 跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.5% 以内，年化跟踪误差控制在 5% 以内，但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

6. 指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护，未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护，本基金将根据基金合同的约定自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，基金合同终止。投资人将面临更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等风险。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定并实施前，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作，该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异，影响投资收益。

7. 成份股停牌的风险

标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌，发生成份股停牌时可能面临如下风险：基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

（三）基金投资的一般风险

1. 上市公司经营风险

上市公司的经营受多种因素影响，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。虽然本基金可通过分散化投资减少这种非系统性风险，但并不能完全消除该种风险。

2. 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的下降风险。

3. 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，造成基金资产损失的风险。

4. 利率风险

利率风险是指由于利率的变动导致证券价格波动，由此给基金的收益带来不确定因素。利率与证券的价格一般呈反方向变化。当市场上的利率普遍提高时，证券价格会下降(包括股票和债券)。一般债券对利率的变化反应较快，方向基本是反向的；而股票的反应相对慢一些，同时股票价格的变化在短期和长期对利率变动的反应方向可能是相反的。利率风险是固定收益证券、债券的主要风险，利率变动对长期债券的影响大于短期债券。

5. 大宗交易风险

大宗交易是指单笔交易规模远大于市场平均单笔交易规模的交易。大宗交易价格的形成并非完全是由市场供求关系决定的，可能与市场价格存在一定差异，从而导致大宗交易参与者的非正常损益。

6. 会计核算风险

会计核算风险是指由于会计核算及会计管理上失误或违规操作形成的风险，如基金管理人在计算、整理、制证、填单、登账、编表、保管及其相关业务处理中，由于客观原因与非

主观故意所造成的行为过失，从而对基金收益造成影响的风险。

7. 交易结算风险

交易结算风险是指基金在投资交易的过程中，因交易对手方无法履行支付义务而使基金资产有遭受损失的可能性。

8. 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、境外投资顾问、基金托管人、境外资产托管人、注册登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等。

9. 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、境外投资顾问、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；金融市场危机、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。

四、基金的投资

（一）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。

（二）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。

（三）投资理念

通过指数化投资最大限度的分享美国经济长期增长的稳定收益。

（四）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，导致在市场上涨的过程中，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。

（五）业绩比较基准

标普 500 等权重指数（全收益指数）

未来若出现标的指数不符合《指数基金指引》要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求及法律法规、监管机构另有规定的除外）、指数编

制机构退出等情形，基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。

（六）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。

（七）投资决策流程

1. 投资组合的建立

基金管理人构建投资组合的过程主要分为 3 步：确定目标组合、确定建仓策略和逐步调整。

（1）确定目标组合：基金管理人根据完全复制方法确定目标组合。

（2）确定建仓策略：基金经理根据对成份股流动性的分析，确定合理的建仓策略。

（3）逐步调整：通过完全复制法最终确定目标组合之后，基金经理在规定时间内采用适当的手段调整实际组合直至达到跟踪指数要求。

本基金将在基金合同生效之日起 6 个月的时间内达到这一投资比例。此后，如因标的指数成份股调整、基金申购或赎回带来现金等因素导致基金不符合这一投资比例的，基金管理人将在合理期限内进行调整。

2. 投资组合的管理

（1）每日投资组合管理

1) 成份股公司行为信息的跟踪与分析

跟踪标的指数成份股公司行为（如：增发、配股、拆股、缩股、分红、停牌、复牌、暂停交易等）信息，以及成份股公司其他重大信息，分析这些信息对指数的影响，进而进行组合调整分析，为投资决策提供依据。

2) 成份股的调整

根据标的指数的编制规则及不定期的调整公告，基金经理依据境外投资决策委员会的决策，在指数成份股调整生效前，分析并确定组合调整策略，尽量减少变更成份股带来的跟踪偏离度和跟踪误差。

3) 标的指数的跟踪与分析

跟踪标的指数编制方法的变化,确定指数变化是否与预期一致,分析是否存在差异及差异产生的原因,为投资决策提供依据。

4) 每日申购赎回情况的跟踪与分析

根据本基金每日申购和赎回信息,分析由此对组合产生的系列影响。

5) 组合持有证券、现金头寸及流动性分析:

基金经理分析实际组合与目标组合的差异及其原因,并进行成份股调整的流动性分析。

6) 组合调整:

① 利用数量化分析模型,确定将实际组合调整到目标组合的最优方案和组合交易计划。

② 如发生成份股变动、成份股公司合并及其他重大事项,及时提请境外投资决策委员会召开会议,决定基金的操作策略。

③ 调整组合,达到目标组合的持仓结构。

(2) 定期(每月)投资组合管理

1) 每月末,根据基金合同中基金管理费、基金托管费等的支付要求,及时检查组合中现金的比例,进行支付现金的准备。

2) 每月末,在基金经理会议上对投资操作、组合、跟踪误差等进行分析。分析最近基金组合与标的指数间的跟踪偏离度情况,找出未能有效控制较大偏离的原因。

3) 每月末,公司境外投资决策委员会对基金的操作进行指导与决策。基金经理根据公司境外投资决策委员会的决策开展下一阶段的工作。

3. 投资组合调整

(1) 投资组合调整原则

本基金为指数型基金,基金所构建的投资组合将根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时,本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况等变化,对基金投资组合进行适时调整,以保证基金净值增长率与基准指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

(2) 投资组合调整方法

1) 成份股变动的调整

本基金所构建的指数化投资组合将根据所跟踪的标普 500 等权重指数对其成份股的调整而进行相应的跟踪调整。

① 标普 500 等权重指数的审核、公布与调整

标普 500 等权重指数委员会不定期举行会议，决定成份股的变动，即将某只（某几只）股票新纳入标普 500 等权重指数或将某只（某几只）股票自标普 500 等权重指数成份股中剔除。

② 本基金投资组合调整期间

根据标普 500 等权重指数的审核公布与调整频率，本基金指数化投资组合的调整期间原则上为不定期调整。

具体调整期间原则上定为：标普 500 等权重指数调整决定公布日起至该股票正式纳入（剔除）标普 500 等权重指数后的五个交易日之内。

③ 本基金投资组合调整方法

本基金将按照标普 500 等权重指数对成份股及其权重的调整方案，结合本基金投资组合的构造原则和权重，在考虑跟踪误差风险的基础上，对股票投资组合进行相应调整。

2) 成份股权重的调整

根据指数编制规则，标普 500 等权重指数每季度对成份股的权重进行调整，使每一个指数成份股的权重重新回至 0.2%。本基金将根据标普 500 等权重指数成份股权重变动公告，及时进行相应调整。当标普 500 等权重指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时，本基金将根据标普 500 等权重指数成份股公司的股权变动公告及时计算需要调整的权重比例，并适时进行相应调整。

调整期间原则上定为：对于每季度的成份股权重的定期调整，在调整日（通常为每季度末的最后一个月的第三个周五收盘后）之前 5 个交易日与之后的 5 个交易日内完成。对于因公司行动进行成份股调整时，在标普 500 等权重指数调整决定公布日起至该股票除权日后的 5 个交易日之内进行调整。

3) 其它调整

① 限制性调整

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

② 大额赎回调整

由于本基金开放式基金的特点，当发生大额赎回超过最高现金保有比例 5% 时，本基金将对股票投资组合进行同比例的被动性卖出调整，以保证基金正常运行。

4) 指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基

金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，综合考虑成份股的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响，据此制定成份股替代策略，并对投资组合进行相应调整。

（八）投资限制

1、本基金持有同一家银行的存款不得超过基金资产净值的 20%。在基金托管账户的存款可以不受上述限制。

2、本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。

3、本基金持有非流动性资产市值不得超过基金资产净值的 10%。此项非流动性资产是指法律或基金合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产。

4、本基金持有境外基金的市值合计不得超过基金资产净值的 10%，但持有货币市场基金不受此限制。

5、基金管理人所管理的全部基金持有任何一只境外基金，不超过该境外基金总份额的 20%。

6、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 10%；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。

7、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；

8、法律法规和基金合同规定的其他限制。

（九）禁止行为

1. 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。

2. 基金管理人不得有下列行为：

- (1) 不公平对待不同客户或不同投资组合。
- (2) 除法律法规规定以外，向任何第三方泄露客户资料。
- (3) 中国证监会禁止的其他行为。

(十) 若法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使现行法律法规的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在履行适当程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

(十一) 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。除上述“(八) 投资限制”中的第 6、7 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 30 个工作日内进行调整。

对于因基金份额拆分、大比例分红等集中持续营销活动引起的基金净资产规模在 10 个工作日内增加 10 亿元以上的情形，而导致证券投资比例低于基金合同约定的，基金管理人同基金托管人协商一致并及时书面报告中国证监会后，可将调整时限从 30 个工作日延长到 3 个月。

法律法规另有规定时，从其规定。

(十二) 基金管理人代表基金行使所投资证券产生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相关权利，保护基金投资者的利益；
2. 有利于基金资产的安全与增值。

(十三) 代理投票

基金管理人作为基金份额持有人的代理人，应行使所投资股票的投票权。基金管理人将本着维护持有人利益的原则，勤勉尽责的代理基金份额持有人行使投票权。在履行代理投票职责过程中，基金管理人可根据实际操作需要，委托基金托管人或其他专业机构提供代理投票的建议、协助完成代理投票的程序等，基金管理人应对代理机构的行为进行必要的监督，保留投票记录，并承担相应责任。

(十四) 证券交易

1. 券商的选择标准

- (1) 资历雄厚，信誉良好；
- (2) 财务状况良好，经营行为规范；
- (3) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度（包括但不限于公平交易制度及保密制度），并能满足本基金运作高度保密的要求；
- (4) 针对本基金需要能及时、定期、全面地提供各方面研究报告及周到的信息服务；
- (5) 具备本基金运作所需的交易执行能力；
- (6) 具备本基金运作所需的后台清算执行能力；
- (7) 能够提供本基金运作、管理所需的其他服务。

2. 券商的交易量分配程序

根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》中关于“一家基金公司通过一家券商的交易席位买卖证券的年交易佣金，不得超过其当年所有基金买卖证券交易佣金的 30%”的规定。

对券商服务的评价主要由以下几个方面组成：

- (1) 交易服务能力：包括券商所能够提供的交易方式、所能覆盖的交易市场范围及在该交易市场的交易执行能力、交易前后的交易执行分析评价能力等；
- (2) 交易执行质量：包括但不限于成交价格、数量是否符合指令要求；交易成本最小化、交易回报的及时性和准确性、公平交易安排以及保密制度的执行情况等；
- (3) 研究服务水平：包括但不限于研究报告、研究资源及路演服务等质量；
- (4) 清算协作表现：包括清算、交收服务的及时性和准确性；
- (5) 其他协作评价。

基金管理人将根据上述标准每季度对券商进行综合评价，并根据评价结果分配基金在各家券商的交易量。

3. 其他事项

本基金管理人将根据有关规定，在基金定期报告中按规定将所选择的证券经营机构的有关情况、基金通过该证券经营机构买卖证券的成交量、支付的佣金等予以披露，同时将本着维护基金份额持有人的利益的原则，对券商选择和分仓中存在或潜在的利益冲突进行妥善处理，并向中国证监会报告。

（十五）基金的融资和融券

1. 为了应付赎回、交易清算等临时用途，可以借入现金。该临时用途借入现金的比例不得超过本基金资产净值的 10%。

2. 为了应付交易清算等临时用途,可以按照相关法律法规的规定,参与证券借贷交易。并且应当遵守下列规定:

(1) 所有参与交易对手方(中资商业银行除外)应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级。

(2) 应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的 102%。

(3) 借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦借方违约,本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要。

(4) 除中国证监会另有规定外,担保物可以是以下金融工具或品种:

1) 现金;

2) 存款证明;

3) 商业票据;

4) 政府债券;

5) 中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构(作为交易对手方或其关联方的除外)出具的不可撤销信用证。

(5) 本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券。

(6) 基金管理人应当对本基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

3. 本基金可以根据正常市场惯例,按照相关法律法规的规定参与正回购交易、逆回购交易。并且应当遵守下列规定:

(1) 所有参与正回购交易对手方(中资商业银行除外)应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级。

(2) 参与正回购交易,应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已售出证券市值的 102%。一旦买方违约,本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要。

(3) 买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红。

(4) 参与逆回购交易,应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入证券市值不低于支付现金的 102%。一旦卖方违约,本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要。

(5) 基金管理人应当对本基金参与证券正回购交易、逆回购交易中发生的任何损失负相应责任。

4. 本基金参与证券借贷交易、正回购交易，所有已借出而未归还证券总市值或所有已售出而未回购证券总市值均不得超过本基金总资产的 50%。

前项比例限制计算，本基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入本基金总资产。

5. 本基金如参与证券借贷交易、正回购交易、逆回购交易，基金管理人应当按照规定建立适当的内控制度、操作程序和进行档案管理。

(十六) 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于 2020 年 4 月 2 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 2019 年第四季度报告，截至 2019 年 12 月 31 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	229,997,351.38	88.05
	其中：普通股	229,997,351.38	88.05
	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	27,739,881.45	10.62

8	其他各项资产	3,473,488.79	1.33
9	合计	261,210,721.62	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	占基金资产净值比例(%)
美国	229,997,351.38	94.11
合计	229,997,351.38	94.11

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	占基金资产净值比例(%)
原材料	13,009,665.99	5.32
医疗保健	27,985,491.25	11.45
信息技术	32,196,768.65	13.17
通信服务	10,188,754.79	4.17
日常消费品	15,282,182.28	6.25
能源	13,414,777.26	5.49
金融	29,820,936.89	12.20
公用事业	13,032,371.47	5.33
工业	31,841,862.92	13.03
非日常生活消费品	28,815,574.51	11.79
房地产	14,408,965.37	5.90
合计	229,997,351.38	94.11

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	CONAGRA BRANDS INC	康尼格拉 品牌股份 有限公司	CAG UN	纽 约 交	美国	2,291	547,239.92	0.22

				易所				
2	APACHE CORP	阿帕契	APA UN	纽约 交易 所	美国	3,018	538,776.25	0.22
3	WESTERN DIGITAL CORP	西部数据 公司	WDC UQ	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	1,197	530,006.96	0.22
4	MOSAIC CO/THE	Mosaic 公司	MOS UN	纽约 交易 所	美国	3,491	527,018.70	0.22
5	MACY'S INC	梅西百货	M UN	纽约 交易 所	美国	4,284	508,062.69	0.21
6	Corteva Inc.	Corteva 公司	CTVA UN	纽约 交易 所	美国	2,455	506,261.44	0.21
7	ADVANCED MICRO DEVICES	AMD 公司	AMD UQ	纳斯 达克 证 券 交 易 所	美国	1,580	505,487.08	0.21
8	Noble Energy Inc	Noble 能 源股份有 限公司	NBL UQ	纳斯 达克	美国	2,906	503,577.28	0.21

				证 券 交 易 所				
9	EOG RESOURCES INC	EOG 资源	EOG UN	纽 约 交 易 所	美 国	861	503,105.13	0.21
10	DEVON ENERGY CORP	戴文能源	DVN UN	纽 约 交 易 所	美 国	2,770	501,846.20	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	331,834.25
4	应收利息	1,894.25
5	应收申购款	3,139,760.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,473,488.79

(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。

五、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%
2019.01.01-2019.12.31	26.98%	0.79%	29.24%	0.83%	-2.26%	-0.04%
2011.03.23-2019.12.31	130.02%	0.93%	180.15%	0.98%	-50.13%	-0.05%

注：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。

（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 12 月 31 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。

六、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。

林昌先生，副董事长，北京大学经济学硕士。1993 年进入中国光大银行从事证券业务。1996 年光大证券有限责任公司重组设立时，林昌先生随所在部门整体调入光大证券，先后担任光大证券南方总部研究部总经理、光大证券南方总部副总经理、光大证券投资银行总部总经理、光大证券助理总裁等职务。2005 年 3 月至 2020 年 11 月担任光大保德信基金管理有限公司董事长。2020 年 12 月起担任光大证券股份有限公司深化改革高级顾问、资深董事总经理。2020 年 12 月 28 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表多篇学术论文，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介公关部负责人、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。

(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. 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资产；
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资产；

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，保证所管理的基金资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、分别记帐，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》、《试行办法》、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资产；

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，并配合基金托管人收集与本基金有关的基金资产投资所在国家及地区法律的相关规定及限制；

10. 编制季报、中期报告和年度报告；

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》、《试行办法》、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》、《试行办法》、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. 保存基金资产管理业务活动的记录、帐册、报表、代表基金签订的重大合同和其他相关资料；

17. 依据《基金法》、《试行办法》、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；

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实施其他法律行为；

19. 组织并参加基金资产清算组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；

20. 因违反基金合同导致基金资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资产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

22. 基金管理人对其委托的投资顾问及其他第三方机构的行为承担责任；

23. 进行境外证券投资，应当遵守当地监管机构、交易所的有关法律法规规定；

24. 中国证监会规定的其他职责。

（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资产从事证券投资；

（2）不公平地对待其管理的不同基金资产；

（3）利用基金资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》、《试行办法》的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，保证基金资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. 不从事损害基金资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，公司基金资产、自有资产与其他资产的运作相互分离。

(4) 相互制约原则。公司设置的各部门、各岗位权责分明、相互制衡。

(5) 成本效益原则。公司运用科学化的经营管理方法降低运营成本，提高经济效益，以合理的成本控制达到最佳的内部控制效果。

3. 公司制定内部控制制度遵循以下原则

(1) 合法合规性原则。公司内控制度符合国家法律法规、规章和各项规定。

(2) 全面性原则。内部控制制度涵盖公司经营管理的各个环节，不得留有制度上的空白或漏洞。

(3) 审慎性原则。制定内部控制制度以审慎经营、防范和化解风险为出发点。

(4) 适时性原则。随着有关法律法规的调整和公司经营战略、经营方针、经营理念等

内外部环境的变化进行及时的修改或完善内部控制制度。

4. 内部控制的基本要素

内部控制的基本要素包括控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通和内部监控。

(1) 控制环境构成公司内部控制的基础，控制环境包括经营理念和内控文化、公司治理结构、组织结构、员工道德素质等内容。

(2) 公司管理层牢固树立内控优先和风险管理理念，培养全体员工的风险防范意识，营造一个浓厚的内控文化氛围，保证全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度，使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个环节。

(3) 健全公司法人治理结构，充分发挥独立董事和监事会的监督职能，禁止不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生，保护投资者利益和公司合法权益。

(4) 公司的组织结构体现职责明确、相互制约的原则，各部门有明确的授权分工，操作相互独立。公司建立决策科学、运营规范、管理高效的运行机制，包括民主、透明的决策程序和管理议事规则，高效、严谨的业务执行系统，以及健全、有效的内部监督和反馈系统。

(5) 依据公司自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的内控防线：

1) 各岗位职责明确，有详细的岗位说明书和业务流程，各岗位人员在上岗前均应知悉并以书面方式承诺遵守，在授权范围内承担责任。

2) 建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，相关部门和岗位之间相互监督制衡。

3) 公司督察长和内部监察稽核部门独立于其他部门，对内部控制制度的执行情况实行严格的检查和反馈。

(6) 建立有效的人力资源管理制度，健全激励约束机制，确保公司各级人员具备与其岗位要求相适应的职业操守和专业胜任能力。

(7) 建立科学严密的风险评估体系，对公司内外部风险进行识别、评估和分析，及时防范和化解风险。

(8) 建立严谨、有效的授权管理制度，授权控制贯穿于公司经营活动的始终。

1) 确保股东会、董事会、监事会和管理层充分了解和履行各自的职权，建立健全公司授权标准和程序，保证授权制度的贯彻执行。

2) 公司各业务部门、分支机构和各级人员在规定授权范围内行使相应的职责。

3) 公司重大业务的授权采取书面形式，明确授权书的授权内容和时效。

4) 公司适当授权，建立授权评价和反馈机制，包括已获授权的部门和人员的反馈和评价，对已不适用的授权及时修改或取消授权。

(9) 建立完善的资产分离制度, 公司资产与基金资产、不同基金的资产之间和其他委托资产, 实行独立运作, 分别核算。

(10) 建立科学、严格的岗位分离制度, 明确划分各岗位职责, 投资和交易、交易和清算、基金会计和公司会计等重要岗位不得有人员重叠。重要业务部门和岗位进行物理隔离。

(11) 制订切实有效的应急应变措施, 建立危机处理机制和程序。

(12) 维护信息沟通渠道的畅通, 建立清晰的报告系统。

(13) 建立有效的内部监控制度, 设置督察长和独立的监察稽核部门, 对公司内部控制制度的执行情况进行持续的监督, 保证内部控制制度落实。公司定期评价内部控制的有效性, 并根据市场环境、新的金融工具、新的技术应用和新的法律法规等情况进行适时改进。

5. 内部控制的主要内容

(1) 公司自觉遵守国家有关法律法规, 按照投资管理业务的性质和特点严格制定管理规章、操作流程和岗位手册, 明确揭示不同业务可能存在的风险点并采取控制措施。

(2) 研究业务控制主要包括:

- 1) 研究工作保持独立、客观。
- 2) 建立严密的研究工作业务流程, 形成科学、有效的研究方法。
- 3) 建立投资对象备选库制度, 根据基金合同要求, 在充分研究的基础上建立和维护备选库。

4) 建立研究与投资的业务交流制度, 保持通畅的交流渠道。

5) 建立研究报告质量评价体系。

(3) 投资决策业务控制主要包括:

1) 严格遵守法律法规的有关规定, 符合基金合同所规定的投资目标、投资范围、投资策略、投资组合和投资限制等要求。

2) 健全投资决策授权制度, 明确界定投资权限, 严格遵守投资限制, 防止越权决策。

3) 投资决策有充分的投资依据, 重要投资有详细的研究报告和风险分析支持, 并有决策记录。

4) 建立投资风险评估与管理制度, 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稽核性,信息技术系统投入运行前,经过业务、运营、监察稽核等部门的联合验收。

(14) 通过严格的授权制度、岗位责任制度、门禁制度、内外网分离制度等管理措施,确保系统安全运行。

(15) 计算机机房、设备、网络等硬件要求符合有关标准，设备运行和维护整个过程实施明确的责任管理，严格划分业务操作、技术维护等方面的职责。

(16) 公司软件的使用充分考虑到软件的安全性、可靠性、稳定性和可扩展性，具备身份验证、访问控制、故障恢复、安全保护、分权制约等功能。信息技术系统设计、软件开发等技术人员不得介入实际的业务操作。用户使用的密码口令定期更换，不得向他人透露。数据库和操作系统的密码口令分别由不同人员保管。

(17) 对信息数据实行严格的管理，保证信息数据的安全、真实和完整，并能及时、准确地传递到会计等各职能部门；严格计算机交易数据的授权修改程序，并坚持电子信息数据的定期查验制度。

建立电子信息数据的即时保存和备份制度，重要数据异地备份并且长期保存。

(18) 信息技术系统定期稽核检查，完善业务数据保管等安全措施，进行排除故障、灾难恢复的演习，确保系统可靠、稳定、安全地运行。

(19) 依据《中华人民共和国会计法》、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《企业财务通则》等国家有关法律法规制订基金会计制度、公司财务制度、会计工作流程和会计岗位工作手册，并针对各个风险控制点建立严密的会计系统控制。

(20) 明确职责划分，在岗位分工的基础上明确各会计岗位职责，禁止需要相互监督的岗位由一人独自操作全过程。

(21) 以基金为会计核算主体，独立建账、独立核算，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。基金会计核算与公司会计核算相互独立。

(22) 采取适当的会计控制措施，以确保会计核算系统的正常运转。

1) 建立凭证制度，通过凭证设计、登录、传递、归档等一系列凭证管理制度，确保正确记载经济业务，明确经济责任。

2) 建立账务组织和账务处理体系，正确设置会计账簿，有效控制会计记账程序。

3) 建立复核制度，通过会计复核和业务复核防止会计差错的产生。

(23) 采取合理的估值方法和科学的估值程序，公允反映基金所投资的有价证券在估值时点的价值。

(24) 规范基金清算交割工作，在授权范围内，及时准确地完成基金清算，确保基金资产的安全。

(25) 建立严格的成本控制和业绩考核制度，强化会计的事前、事中和事后监督。

(26) 制订完善的会计档案保管和财务交接制度，财会部门妥善保管密押、业务用章、

支票等重要凭据和会计档案，严格会计资料的调阅手续，防止会计数据的毁损、散失和泄密。

(27) 严格制定财务收支审批制度和费用报销运作管理办法，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。

七、基金合同的生效

(一) 基金合同的生效

根据相关法规和《大成标普 500 等权重指数 QDII 证券投资基金基金合同》的有关规定，基金合同已于 2011 年 3 月 23 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

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，如转换运作方式或其他基金合并等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

（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：契约型开放式

基金存续期限：不定期

八、基金份额的申购与赎回

（一）申购与赎回办理的场所

本基金的销售机构包括基金管理人及基金管理人委托的代销机构。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书、基金份额发售公告或其他公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并在管理人网站公示。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）申购与赎回办理的时间

1. 开放日及开放时间

基金投资者在开放日申请办理基金份额的申购和赎回。上海证券交易所、深圳证券交易所和美国主要证券交易所同时交易的正常交易日为本基金的开放日，开放日的具体业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所交易日的交易时间。投资者在《基金合同》约定的日期和时间之外提出申购、赎回申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

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

本基金已于 2011 年 4 月 25 日起开始办理日常申购、赎回及定投业务。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。基金投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

（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的基金份额净值（折算为

人民币) 为基准进行计算;

2. 基金采用金额申购和份额赎回的方式, 即申购以金额申请, 赎回以份额申请;

3. 当日的申购与赎回申请可以在当日业务办理时间结束前撤销, 在当日业务办理时间结束后不得撤销;

4. 基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则, 但最迟应在新的原则实施两日前在至少一种指定媒介公告。

(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

T 日规定时间受理的申请, 正常情况下, 本基金注册登记人在 T+2 日内为投资者对该交易的有效性进行确认。投资者应在 T+3 日(包括该日)后及时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。因投资者未及时进行该查询而造成的后果由其自行承担。

3. 申购与赎回申请的款项支付

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

投资者赎回申请成交后, 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十个工作日内划往投资者银行账户。如果交易所等基金投资市场休市, 赎回款项将在自受理基金投资者有效赎回申请之日起不超过十三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有关规定处理。

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. 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。

4. 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介和基金管理人网站上公告。

（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

本基金申购费用由基金申购人承担，不列入基金资产，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 M	申购费率
$M < 100$ 万	1.50%
$100 \text{ 万} \leq M < 500 \text{ 万}$	1.00%
$M \geq 500$ 万	每笔 1000 元

2. 赎回费率

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。本基金对持续持有基金份额少于 7 日的投资人收取的赎回费，将全额计入基金财产；对持续持有基金份额长于 7 日（含 7 日）的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 25% 归入基金财产。

持有基金时间 T	赎回费率
$T < 7$ 日	1.5%
$7 \text{ 日} \leq T < 1 \text{ 年}$	0.50%
$1 \text{ 年} \leq T < 2 \text{ 年}$	0.25%
$T \geq 2 \text{ 年}$	0

3. 基金管理人可以在履行相关手续后，在基金合同约定的范围内调整申购费率、调低

赎回费率或调整收费方式,基金管理人依照有关规定最迟应于新的费率或收费方式实施日前在指定媒介和基金管理人网站上公告。

4. 对特定交易方式(如网上交易、电话交易等),基金管理人可以采用低于柜台交易方式的基金申购费率和基金赎回费率并依法公告。

5. 基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划,针对基金投资者定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后,对基金投资者适当调整基金申购费率、转换费率和调低赎回费率。

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担,赎回费用在扣除手续费后余额不得低于赎回费总额的 25%应当归入基金资产,其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。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。

(七) 申购份额与赎回支付金额的计算方式

1. 申购份额、余额的处理方式:申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后,以申请当日基金份额净值为基准计算,各计算结果均保留至小数点后两位,小数点后第 3 位四舍五入。

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中,

净申购金额=申购金额/(1+申购费率)

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值。

例:某投资人于开放期投资 4 万元申购本基金基金份额,申购费率为 1.50%,假设申购当日基金份额净值为 1.040 元,则其可得到的申购份额为:

净申购金额=40,000/(1+1.50%)= 39,408.87 元

申购费用=40,000- 39,408.87 =591.13 元

申购份额=39,408.87/1.04= 37,893.14 份

2. 赎回净额的处理方式:赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以申请当日基金份额净值的金额,赎回净额为赎回金额扣除相应的费用的金额,各计算结果均保留至小数点后两位,小数点后第 3 位四舍五入。

本基金的赎回净额为赎回金额扣减赎回费用。其中,

赎回金额=赎回份数×T 日基金份额净值

赎回费用=赎回金额×赎回费率

赎回净额=赎回金额—赎回费用

例：某投资者在持有基金份额时间为 1 年时赎回本基金 10,000 份基金份额，对应的赎回费率为 0.25%，假设赎回当日基金份额净值是 1.050 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总金额=10,000×1.050=10,500.00 元

赎回费用=10,500.00×0.25%=26.25 元

净赎回金额=10,500.00—26.25=10,473.75 元

（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. 投资者申购基金成功后，基金注册登记机构在 T+2 日为投资者增加权益并办理注册登记手续，投资者自 T+3 日起有权赎回该部分基金份额。

3. 投资者赎回基金成功后，基金注册登记机构在 T+2 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，并最迟于开始实施两日前在指定媒介上公告。

（九）巨额赎回的认定及处理方式

1. 巨额赎回的认定

单个开放日中，本基金的基金份额净赎回申请（赎回申请总份额扣除申购申请总份额后的余额）与净转出申请（转出申请总份额扣除转入申请总份额后的余额）之和超过上一日基金总份额的 10%，为巨额赎回。

2. 巨额赎回的处理方式

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

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

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

当日未获受理部分予以撤销者外,延迟至下一开放日办理,赎回价格为下一个开放日的价格。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权,以此类推,直到全部赎回为止。

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。

(3) 当发生巨额赎回并延期办理时,基金管理人应当通过邮寄、传真或招募说明书规定的其他方式,在三个工作日内通知基金份额持有人,说明有关处理方法,并在 2 日内在至少一种指定媒介予以公告。

(4) 暂停接受和延缓支付:本基金连续两个或两个开放日以上发生巨额赎回,如基金管理人认为有必要,可暂停接受赎回申请;已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项,但延缓期限不得超过二十个工作日,并应当在至少一种指定媒介公告。

(十) 拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

1. 在如下情况下,基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请:

(1) 因不可抗力导致基金管理人无法接受投资者的申购申请;

(2) 本基金主要投资市场的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;

(5) 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;

(6) 本基金已经达到监管机构核定的本基金的募集规模;

(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) 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。

(10) 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。发生上述除第(7)项暂停申购情形时，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。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。当发生上述第(7)、(9)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(7)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不能支付赎回款项；

(2) 本基金主要投资市场的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) 发生连续巨额赎回，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，已经确认的赎回申请，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。

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。

发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。

(十一) 暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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家指定媒介及基金管理人网站刊登基金重新开放申购或赎回的公告并公布最近一个开放日的基金份额净值。

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，基金管理人应提前 2 日在至少一家指定媒介及基金管理人网站刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开始办理申购或赎回的开放日公告最近一个工作日的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次。暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 日在至少一家指定媒介及基金管理人网站连续刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日的基金份额净值。

（十二）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。基金转换的程序及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。

（十三）基金份额的上市交易

未来若条件允许，在不损害持有人利益的前提下，本基金份额可在交易所交易、进行场内申购、赎回，不需召开持有人大会。

（十四）基金的非交易过户、转托管、冻结与质押

1. 非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资者基金账户转移到另一投资者基金账户的行为，包括继承、捐赠、司法强制执行及基金注册登记机构认可的其他行为。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）“司法强制执行”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。

2. 办理非交易过户业务必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料，并向基金注册登记机构申请办理。

3. 符合条件的非交易过户申请自申请受理日起二个月内办理；申请人按基金注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。

4. 基金份额持有人在变更办理基金申购与赎回等业务的销售机构（网点）时，应办理已持有基金份额的转托管。基金份额转托管可分一步或两步完成，具体按各销售机构要求办理。对于有效的基金转托管申请，基金份额将在转托管业务确认成功后转入其指定的销售机构（网点）。

5. 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一律转为基金份额并冻结。

6. 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。

（十五）定期定额投资计划

本基金可为基金投资者提供定期定额投资计划服务，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。

（十六）基金的冻结和解冻

基金账户和基金份额冻结、解冻的业务，由注册登记机构办理。

基金注册登记机构只受理国家有关机关依法要求的基金账户或基金份额的冻结与解冻以及注册登记机构认可的其他情况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，被冻结基金份额所产生的权益一并冻结，法律法规、中国证监会或法院判决、裁定另有规定的除外。

当基金份额处于冻结状态时，基金注册登记机构或其他相关机构应拒绝该部分基金份额的赎回申请、非交易过户以及基金的转托管。

九、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

1. 基金管理人的管理费；
2. 基金托管人的托管费；
3. 因基金的证券交易或结算而产生的费用（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的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的各项纳税主体，依照国家法律法规和境外市场的规定履行纳税义务。

十、基金的资产

（一）基金资产总值

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

（二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

（三）基金资产的账户

本基金根据相关法律法规、规范性文件在境内开立基金资金账户及证券账户，与基金管理人、基金托管人和境外资产托管人自有的财产账户以及其他基金资产账户独立。

（四）基金资产的保管及处分

1. 本基金资产独立于基金管理人、基金托管人、境外资产托管人和代销机构的固有财产。基金管理人、境外资产托管人不得将基金资产归入其固有财产。

2. 基金托管人和境外资产托管人应安全保管基金资产。

3. 基金管理人、基金托管人、境外资产托管人因基金资产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归基金资产。

4. 基金托管人或境外资产托管人按照规定或境外市场惯例开设基金资产的所有资金账

户和证券账户。

5. 基金托管人对所托管的不同基金资产分别设置账户，确保基金资产的完整与独立。

6. 基金管理人、基金托管人以其自有的财产承担自身相应的法律责任，其债权人不得对基金资产行使请求冻结、扣押或其他权利。基金管理人和境外投资顾问、基金托管人和境外托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金资产不属于其清算范围。

7. 非因基金资产本身承担的债务，不得对基金资产强制执行。

十一、基金资产的估值

（一）估值目的

基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金资产的价值，确定基金资产净值，并为基金份额的申购、赎回、转换等业务提供计价依据。

（二）估值日

基金合同生效后，本基金的估值日为上海证券交易所、深圳证券交易所和美国主要证券交易所同时交易的正常交易日。

（三）估值对象

本基金所拥有的股票和银行存款本息、应收款项和其它投资等资产。

（四）估值原则

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

（五）估值方法

1. 股票估值方法

(1) 上市流通股票：

按估值日当日其所在证券交易市场的收盘价估值；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：

送股、转增股、配股和公开增发新股等方式发行的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

首次发行且未上市的股票，按成本价估值；首次发行且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。

2. 债券估值方法：

(1) 对于上市流通的债券，证券交易所市场实行净价交易的债券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。证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值，估值日没有交易的，按最近交易日债券收盘价减去所含的最近交易日债券应收利息后得到的净价估值。

(2) 对于非上市债券，参照主要做市商或其他权威价格提供机构的报价进行估值。

若债券价格无法通过公开信息取得的，由基金管理人负责从其经纪商处取得，及时通过书面形式告知基金托管人。

3. 基金估值方法：

(1) 上市交易型基金的估值按估值日当日其所在证券交易市场的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

(2) 未上市交易的基金按照可取得的最近估值日的基金份额净值估值；若基金份额净值无法通过公开渠道获得，则由基金管理人和基金托管人协商一致，按照最能反映基金公允价值的基金份额净值估值。

(3) 若某只基金同时存在上市交易型部分和未上市交易部分，则区分上市交易型部分和未上市交易部分后分别按上述方法估值

4. 非流动性资产或暂停交易的证券估值方法

对于未上市流通、或流通受限、或暂停交易的证券，应参照上述估值原则进行估值。如果上述估值方法不能客观反映公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

5. 在任何情况下，基金管理人如采用本项第 1-4 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 1-4 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。

6. 对于按照中国法律法规和基金投资所在地的法律法规规定应交纳的各项税金，本基金将按权责发生制原则进行估值；对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与估算的应交税金有差异的，基金将在相关税金实际支付日进行相应的估值调整。

7. 国家法律法规对此有新的规定的，按其新的规定进行估值。

8. 估值中的汇率选取原则：

估值计算中涉及美元、港币、欧元、日元、英镑对人民币汇率的，采用当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价；涉及其他货币对人民币的汇率，采用美元作为中间货币进行换算。

（六）估值程序

基金管理人与基金托管人可以委托第三方机构进行基金资产估值，但不改变基金管理人与基金托管人对基金资产估值承担的责任。

基金日常估值由基金管理人和基金托管人一同进行。基金管理人将估值结果以书面形式发送基金托管人，基金托管人按本合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

（七）暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的主要证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管人、境外资产托管人、投资顾问无法准确评估基金资产价值时；
- 3、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；
- 4、中国证监会认定的其它情形。

（八）基金份额净值的确认

用于基金信息披露的基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人进行复核。基金管理人每个工作日将计算的前一工作日的基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人。

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

（九）估值错误的处理

1. 当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后三位（含第三位）内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。

2. 基金管理人和基金托管人将采取必要、适当合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当估值错误达到或超过基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。

3. 前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。

（十）特殊情形的处理

1. 基金管理人按本条（四）估值方法中的第 4 项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

2. 由于交易机构或独立价格服务商发送的数据错误，或有关会计制度变化以及由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

十二、基金收益与分配

（一）基金利润的构成

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

（二）基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

（三）收益分配原则

1. 本基金的每份基金份额享有同等分配权；
2. 基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；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；

3. 在符合基金收益分配条件的情况下，基金收益分配每年最多不超过 12 次，全年基金收益分配比例不低于基金期末可分配利润的 10%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

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

5. 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

（四）收益分配方案

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

（五）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，并由基金托管人复核后确定，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

（六）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。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《大成基金管理有限公司开放式基金注册登记业务规则》执行。

十三、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制度执行。

4. 本基金独立建账、独立核算。

5. 本基金会计责任人为基金管理人。

6. 基金管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表，基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

（二）基金年度审计

1. 基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人、境外资产托管人相独立的、具有从事证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师等机构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. 基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须经基金托管人同意，更换会计师事务所按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

十四、基金的信息披露

（一）本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。

（二）信息披露义务人

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、法人和非法人组织。

本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点，按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。

本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（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”）等媒介披露，并保证基金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。

（三）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销售机构；
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。

（四）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。

（五）公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

1. 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。

基金产品资料概要是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。

2. 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。

3. 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媒介和网站上登载基金合同生效公告。

4. 基金开始申购、赎回公告

基金管理人应于申购开始日、赎回开始日前 2 日在指定媒介及基金管理人网站上公告。

5. 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各类基金份额的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赎回之后，基金管理人应当在不晚于每个开放日后的两个工作日通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点以及其他指定媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日后的两个工作日，在指定网站披露半年

度和年度最后一日各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

6. 基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在基金合同、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者复制前述信息资料。

7. 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。

(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。

基金合同生效不足两个月的，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。

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者利益，基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下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本基金的特有风险，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。

7. 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两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) 基金终止上市交易、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、基金份额登记机构,基金改聘会计师事务所;
- (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或仲裁;
- (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或延缓支付赎回款项;
- (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) 更换投资顾问、境外资产托管人;

(25) 基金运作期间如遇投资顾问主要负责人员变动,基金管理人认为该事件有可能对基金投资产生重大影响;

(26) 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;

(27) 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他事项。

8. 公开澄清

在基金合同期限内,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、基金上市交易的证券交易所。

9. 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。

10. 基金份额持有人大会决议

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。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基金份额持有人大会,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,召集人应当履行相关信息披露义务。

11. 中国证监会规定的其他信息。

(七) 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、基金上市交易的证券交易所,供社会公众查阅、复制。

(八) 信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度,指定专门部门及高级管理人员负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息,应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则等法规的规定。

基金托管人应当按照相关法律、行政法规、中国证监会的规定和基金合同的约定,对基

金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但不得早于指定媒介和基金上市交易的证券交易所网站，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

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

十五、基金合同的变更、终止与基金资产的清算

（一）基金合同的变更

1. 变更基金合同涉及法律法规规定或本合同的约定应经基金份额持有人大会决议通过事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。

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核准或备案，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

3. 但如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形，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后公告，并报中国证监会备案。

（二）基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同终止：

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

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

（三）基金资产的清算

1. 基金合同终止，基金管理人应当按法律法规和本基金合同的有关法律法规规定对基金资产进行清算。

2. 基金资产清算组

（1）自基金合同终止事由之日起三十个工作日内由基金管理人组织成立基金资产清算组，在基金资产清算组接管基金资产之前，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资产安全的职责。

（2）基金资产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、期货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。基金资产清算组可以聘用必要的工作人员。

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

3. 清算程序

- （1）基金合同终止情形发生后，由基金资产清算组统一接管基金资产；
- （2）基金资产清算组根据基金资产的情况确定清算期限；
- （3）基金资产清算组对基金资产进行清理和确认；
- （4）对基金资产进行评估和变现；
- （5）制作清算报告；
- （6）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- （7）将清算报告报中国证监会备案并公告；
- （8）对基金剩余资产进行分配。

4. 清算费用

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

5. 基金剩余财产的分配

基金资产按下列顺序清偿：

- (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。

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

6. 基金资产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告，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。

- 7. 基金资产清算账册及文件由基金托管人保存二十年以上。

十六、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：许俊

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 12 月 31 日，中国银行已托管 764 只证券投资基金，其中境内基金 722 只，QDII 基金 42 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。

十七、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 2019 年 6 月 30 日，中银香港(控股)有限公司的总资产超过 29,884 亿港元，资本总额超过 2,683 亿港元，总资本比率为 23%。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 2019 年 6 月 30 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	=>成为市场上首家服务商 (2010 年 8 月) =>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	=>新募长仓基金的最大服务商之一
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) 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： - 最佳 QDII 托管行 (2018)； 及 - 最佳 QDII 客户个案 (2018)
	获债券通有限公司颁发“债券通优秀托管机构”(2018) 获债券通有限公司颁发“债券通优秀託管行”(2019)

截至 2019 年 6 月 30 日，中银香港(控股)的托管资产规模达 12,072 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软件及数据库服务器，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，以确保合乎对外、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。

十八、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

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

联系人：王永民

客服电话：95566

电话：010-66594896

传真：010-66594942

网址：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

（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

（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

(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

传真：0755-83195049

网址：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

(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

(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

（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

（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

（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

（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

（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

（15）浙江绍兴瑞丰农村商业银行股份有限公司

办公地址：浙江省绍兴市柯桥区笛扬路 1363 号

法定代表人：章伟东

客服电话：40088-96596

联系人：朱江良

电话：0575-81103096

传真：0575-84788167

网址: <http://www.borf.cn>

(16) 泉州银行股份有限公司

办公地址: 泉州市丰泽区云鹿路 3 号

法定代表人: 傅子能

客服电话: 400-88-96312

联系人: 董培姗

电话: 0595-22551071

传真: 059522572612

网址: <http://www.qzccbank.com>

(17) 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

(18) 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>

(19) 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.jjccb.com

（20）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

（21）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

（22）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：上海市静安区南京西路 768 号国泰君安大厦

法定代表人：贺青

联系电话：021-38676666

传真：021-38670666

联系人：钟伟镇

网址：www.gtja.com

服务热线：95521、4008888666

（23）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

（24）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：李颖

电话：0755-82133066

传真：0755-82133952

网址：www.guosen.com.cn

（25）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

（26）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

（27）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

（28）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

（29）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

（30）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

（31）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

客户服务电话：95562

（32）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

（33）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

（34）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

（35）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

（36）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

（37）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

(38) 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

(39) 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

(40) 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/>

(41) 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

（42）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

（43）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

（44）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

（45）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：刘秋明

客服电话：95525

联系人：龚俊涛

电话：021-22169999

传真：021-22169134

网址：www.ebscn.com

（46）中信证券华南股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

法定代表人：胡伏云

联系人：陈靖

联系电话：020-88836999

客户服务电话：95396

传真：020-88836984

网址：www.gzs.com.cn

（47）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

（48）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

（49）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

（50）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>

（51）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

（52）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

（53）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

（54）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

（55）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：钱俊文

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

（56）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

（57）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

（58）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

（59）世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市前海深港合作区南山街道桂湾五路 128 号前海深港基金小镇对冲基金中心 406

办公地址：深圳市福田区深南大道招商银行大厦 40-42 层

法定代表人：李强

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

（60）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

（61）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

（62）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

（63）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

（64）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

（65）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

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

（66）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

（67）中国中金财富证券有限公司

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

（68）中山证券有限责任公司

公司名称：中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7 层、8 层

办公地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7 层、8 层

法定代表人：林炳城

电话：0755-82943755

传真：0755-82960582

客户服务电话：95329

网址：www.zszq.com

（69）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

（70）粤开证券股份有限公司

注册地址：惠州市江北东江三路 55 号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层

办公地址：深圳市福田区深南中路 2002 号中广核大厦北楼 10 层

法定代表人：严亦斌

联系人：彭莲

联系电话：0755-83331195

客户服务电话：95564

公司网址：<http://www.ykzq.com>

(71) 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：956007

联系人：周俊

网址：www.jhzq.com.cn

(72) 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

(73) 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

(74) 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

(75) 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

(76) 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

(77) 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

(78) 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>

（79）联储证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦 9 楼

办公地址：北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 27 层联储证券

法定代表人：吕春卫

联系人：丁倩云

联系电话：010-86499427 13051859661

传真：0755-23947482

客服电话：400-620-6868

网址：<http://www.lczq.com/>

（80）华瑞保险销售有限公司

注册地址：上海市嘉定区南翔镇众仁路 399 号运通星财富广场 1 号楼 B 座 13、14 层

办公地址：上海市浦东新区向城路 288 号国华人寿金融大厦 8 层 806

法定代表人：路昊

联系人：茆勇强

联系电话：021-68595698

传真：021-68595766

客服电话：52303

网址：<http://www.huaruisales.com>

（81）玄元保险代理有限公司

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室

法定代表人：马永谱

联系人：卢亚博

联系电话：021-50701003

传真：021-50701053

客服电话：400-080-8208

网址：www.licaimofang.cn

（82）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/>

（83）方德保险代理有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号楼 7 层 711

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号楼 7 层 711

法定代表人：林柏均

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.jhjfund.com

（84）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

（85）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006 号

法定代表人：杨懿

办公地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006 号

联系人：张燕

联系电话：010-58325388*1588

网站：www.new-rand.cn

客服电话：400-166-1188

（86）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>

（87）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

（88）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

（89）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

客服电话：400-821-5399

（90）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

（91）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

（92）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

（93）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

（94）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

（95）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

（96）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

（97）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

（98）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/

（99）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：http://www.hcjijin.com

（100）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

(101) 北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期（西扩）N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期（西扩）N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

法定代表人：李昭琛

联系人：李唯

联系电话：010-58982465

传真：010-62676582

客服电话：010-62675369

网址：<http://www.fund.sina.com.cn>

(102) 上海万得基金销售有限公司

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：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼

法定代表人：黄伟

联系人：徐亚丹

联系电话：021-50712782

传真：021-50710161

客服电话：400-799-1888

网址：www.520fund.com.cn

(103) 凤凰金信（银川）基金销售有限公司

注册地址：宁夏银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路 142 号 14 层 1402 办公用房

办公地址：北京市朝阳区紫月路 18 号院 18 号楼

法定代表人：张旭

联系人：汪莹

联系电话：010-58160084

传真：010-58160173

客服电话：400-810-5919

网址：<http://www.fengfd.com/>

(104) 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

（105）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

（106）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

（107）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

（108）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>

（109）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

（110）武汉市伯嘉基金销售有限公司

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

法定代表人：陶捷

联系人：杨帆

电话：027-87006003/87006009

网站：www.buyfunds.cn

公司传真：027-87006010

客服电话：400-027-9899

（111）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

（112）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

（113）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/

（114）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

（115）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：个人业务：95118 、400 098 8511

企业业务：400 088 8816

传 真：010-8919566

网址：fund.jd.com

（116）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/>

（117）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>

（118）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

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

十九、基金合同内容摘要

一、基金合同当事人及权利义务

（一）基金管理人

1. 基金管理人的权利

- （1）依法申请并募集基金，办理基金备案手续；
- （2）依照法律法规和基金合同运用基金资产；
- （3）自基金合同生效之日起，基金管理人依照法律法规和基金合同独立管理基金资产；
- （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，获得基金管理人报酬，收取认购费、申购费、基金赎回手续费及其它事先批准或公告的合理费用以及法律法规规定的其它费用；
- （5）根据法律法规和基金合同之规定销售基金份额；
- （6）在本合同的有效期内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本合同的情况进行必要的监督。如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金资产、其它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，以及采取其它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，并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查；
- （9）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；
- （10）在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资；
- （11）依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益的分配方案；
- （12）按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其它证券所产生的权利；
- （13）在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；
- （14）依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；
- （15）依照有关规定行使因基金资产投资于证券所产生的权利；

(16) 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；

(17) 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募集、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；

(18) 选择、更换基金投资顾问，委托境外投资顾问协助投资管理等业务；

(19) 委托第三方机构办理本基金的交易、清算、估值、结算等业务；

(20) 法律法规、基金合同以及依据基金合同制订的其它法律文件所规定的其它权利。

2. 基金管理人的义务

(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) 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资产；

(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资产；

(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，保证所管理的基金资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、分别记帐，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》、《试行办法》、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资产；

(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，并配合基金托管人收集与本基金有关的基金资产投资所在国家及地区法律的相关规定及限制；

(10) 编制季报、中期报告和年度报告；

(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》、《试行办法》、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) 保存基金资产管理业务活动的记录、帐册、报表、代表基金签订的重大合同和其他相关资料；

(17) 依据《基金法》、《试行办法》、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；

(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实施其他法律行为；

(19) 组织并参加基金资产清算组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；

(20) 因违反基金合同导致基金资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资产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 基金管理人对其委托的投资顾问及其他第三方机构的行为承担责任；

(23) 进行境外证券投资，应当遵守当地监管机构、交易所的有关法律法规规定；

(24) 中国证监会规定的其它职责。

(二) 基金托管人

1. 基金托管人的权利

(1) 依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金资产；

(2) 依照基金合同的约定获得基金托管费；

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作；

(4) 在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；

(5) 依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；

(6) 选择、更换境外资产托管人并为之签署有关协议；

(7) 法律法规、基金合同规定的其它权利。

2. 基金托管人的义务

(1) 安全保管基金资产，准时将公司行为信息通知基金管理人，确保基金及时收取所有应得收入；

(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，负责基金资产境内托管事宜；

(3) 按规定开设基金资产的资金帐户和证券帐户；

- (4) 除依据《基金法》、《试行办法》、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；
- (5) 对所托管的不同基金资产分别设置账户，确保基金资产的完整和独立；
- (6) 保管（或委托境外资产托管人）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、帐册、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》、《试行办法》、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、定期报告出具意见，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) 因过错违反基金合同导致基金资产损失，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资产损失时，应为基金向基金管理人追偿；
- (20) 对其委托第三方机构相关事项的法律后果承担责任；
- (21) 按法律法规规定向中国证监会和国家外管局报告基金管理人境外投资情况，并按相关规定进行国际收支申报；
- (22) 办理基金管理人的有关结汇、售汇、收汇、付汇和人民币资金结算业务；
- (23) 保存基金管理人的资金汇出、汇入、兑换、收汇、付汇、资金往来、委托及成交记录等相关资料，其保存的时间应当不少于 20 年；

(21) 法律法规和相关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。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。每份基金份额具有同等的合法权益。

2. 基金份额持有人的权利

- (1) 分享基金资产收益;
- (2) 参与分配清算后的剩余基金资产;
- (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) 法律法规、基金合同规定的其它权利。

3. 基金份额持有人的义务

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

二、基金份额持有人大会

(一) 本基金的基金份额持有人大会,由本基金的基金份额持有人组成。

(二) 有以下事由情形之一时,应召开基金份额持有人大会:

1、终止基金合同;

- 2、转换基金运作方式，但基金合同另有约定的除外；
- 3、提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- 4、更换基金管理人、基金托管人；
- 5、变更基金类别；
- 6、变更基金投资目标、范围或策略；
- 7、变更基金份额持有人大会程序；
- 8、本基金与其它基金合并；
- 9、对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；
- 10、法律法规或中国证监会规定的其它应当召开基金份额持有人大会的事项。

（三）以下情况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、其他应由基金或基金份额持有人承担的费用；
- 2、在法律法规和基金合同规定的范围内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、在不损害持有人利益的前提下，基金份额在交易所交易；
- 7、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它情形。

（四）召集方式：

- 1、除法律法规或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。
- 2、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，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六十日内召开；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、代表基金份额百分之十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十日内决定是否召集，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六十日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额百分之十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十日内决定是否召集，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六十日内召开。

4、代表基金份额百分之十以上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，代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前三十日报中国证监会备案。

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

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

（五）通知

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

- 1、会议召开的时间、地点、方式；
- 2、会议拟审议的主要事项；
- 3、投票委托书送达时间和地点；
- 4、会务常设联系人姓名、电话；
- 5、权益登记日；
- 6、如采用通讯表决方式，则载明具体通讯方式、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。

（六）开会方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席，基金管理人或基金托管人不派代表出席的，不影响表决效力；通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。会议的召开方式由召集人确定，但决定基金管理人更换或基金托管人的更换、转换基金运作方式和提前终止基金合同事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

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，全部有效凭证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%）。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

- 1、召集人按基金合同规定公告会议通知后，在两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它代表，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；

5、会议通知公布前已报中国证监会备案。

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

（七）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

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

（2）基金管理人、基金托管人、代表基金份额 10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

（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进行解释和说明。

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作出决定。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作出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

（4）单独或合并持权益登记日基金总份额 10%或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,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,其时间间隔不少于六个月。法律法规另有规定的除外。

(5) 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

在现场开会的方式下,首先由召集人宣读提案,经讨论后进行表决,并形成大会决议,报经中国证监会核准或备案后生效;在通讯表决开会的方式下,首先由召集人在会议通知中公布提案,在所通知的表决截止日期第二个工作日由大会聘请的公证机关的公证员统计全部有效表决并形成决议,报经中国证监会核准或备案后生效。

(八) 表决

1、基金份额持有人所持每份基金份额享有平等的表决权。

2、基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:

(1) 特别决议

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

(2) 一般决议

对于一般决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的百分之五十以上(含百分之五十)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提前终止基金合同应当以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时,符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决。

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。

3、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。

(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,则监督员由基金托管人在出席会议的基金份额持有人中指定)共同担任监票人;如大会由基金份额持有人自行召集,基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中推举三名基金份额持有人担任监票人。

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

(3) 如果会议主持人对于提交的表决结果有怀疑,可以对所投票数进行重新清点;如果会议主持人未进行重新清点,而出席会议的基金份额持有人或者基金份额持有人代理人对会议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,会议主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

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

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。

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》有关规定表决通过的事项,召集人应当自通过之日起五日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

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

3、基金份额持有人大会决议应当自中国证监会核准或出具无异议意见后 2 日内,由基

金份额持有人大会召集人在指定媒介公告。

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

（十一）法律法规或监管机关对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

三、基金合同的变更、终止与基金资产的清算

（一）基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本合同的约定应经基金份额持有人大会决议通过事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。

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核准或备案，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

3、但如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形，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后公告，并报中国证监会备案。

（二）基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同终止：

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

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

（三）基金资产的清算

1、基金合同终止，基金管理人应当按法律法规和本基金合同的有关法律法规规定对基金资产进行清算。

2、基金资产清算组

（1）自基金合同终止事由之日起三十个工作日内由基金管理人组织成立基金资产清算组，在基金资产清算组接管基金资产之前，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资产安全的职责。

(2) 基金资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。基金资产清算组可以聘用必要的工作人员。

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

3、清算程序

- (1) 基金合同终止情形发生后，由基金资产清算组统一接管基金资产；
- (2) 基金资产清算组根据基金资产的情况确定清算期限；
- (3) 基金资产清算组对基金资产进行清理和确认；
- (4) 对基金资产进行评估和变现；
- (5) 制作清算报告；
- (6) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (7) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (8) 对基金资产进行分配。

4、清算费用

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

5、基金剩余财产的分配

基金资产按下列顺序清偿：

- (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。

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

6、基金资产清算的公告

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

7、基金资产清算账册及文件由基金托管人保存二十年以上。

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应首先通过友好协商解决。但若自一方书面要求协商解决争议发生之日起 60 日内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, 根据当时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的, 对仲裁各方当事人均具有约束力。

(三) 除争议所涉内容之外, 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。

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, 应由基金管理人和基金托管人的法定代表人或其授权签字人签字并加盖公章。基金合同于投资者缴纳认购的基金份额的款项时成立, 于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资产清算结果报中国证监会批准并公告之日止。

(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本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二份外, 基金管理人、基金托管人各持二份, 每份具有同等的法律效力。

(五) 基金合同可印制成册, 存放在基金管理人和基金托管人住所, 供投资者查阅, 基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。

二十、基金托管协议内容摘要

一、基金托管协议当事人

(一) 基金管理人

名称: 大成基金管理有限公司

住所: 深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层

法定代表人: 吴庆斌

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

（二）基金托管人

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

变更注册登记日期：2004 年 8 月 26 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

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

托管及投资者服务部总经理：李爱华

托管部门信息披露联系人：唐州徽

电话：（010）66594855

传真：（010）66594942

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

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

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

2、对基金投融资比例进行监督。基金托管人根据有关法律法规及基金合同中有关投资限制的约定，对基金的投资进行监督；

3、对基金投资禁止行为进行监督。基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同中

有关禁止行为的约定，对本托管协议第十六条基金投资禁止行为进行监督。基金托管人对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。为对基金禁止从事的关联交易进行监督，基金管理人和基金托管人应相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单，基金托管人和基金管理人均有责任保证所提供名单的真实、准确和完整性，并及时将更新后的名单发送给对方；

4、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。本基金管理人承诺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与本基金合同约定的投资范围保持一致，并承担由于不一致所导致的风险或损失。基金管理人向基金托管人提供其回购交易及监督所需的其他投资品种的交易对手库，交易对手库由信用等级符合《通知》要求的交易对手组成。基金托管人只对进行金融衍生品、证券借贷、回购交易之交易对手作出监督。监督范围并不包括一般证券买卖之券商。基金管理人可以根据实际情况的变化，及时对交易对手库予以更新和调整，并通知基金托管人。基金管理人进行金融衍生品、证券借贷、回购交易时，交易对手应符合交易对手库的范围。基金托管人对交易对手是否符合交易对手库进行监督；

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

6、对法律法规规定及《基金合同》中实际可以监控事项约定的基金投资的其他方面进行监督。

（二）基金托管人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行复核。

（三）基金托管人发现基金管理人或其投资顾问的违规行为，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人，由基金管理人或由基金管理人责成投资顾问限期纠正；基金管理人收到通知后应及时进行核对确认并回函；在限期内，基金托管人有权对通知事项进行复查，如基金管理人未予纠正或基金管理人未责成投资顾问纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

（四）基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，包括但不限于：在规定时间内答复基金托管人并改正，就基金托管人的疑义进行解释或举证，对基金托管人按照法

规要求需向中国证监会报送基金监督报告的,基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

(五)基金托管人对投资管理人对基金资产的投资运作于估值日结束且相关数据齐备后,进行交易后的投资监控和报告。

(六)基金托管人的投资监督报告的准确性和完整性受限于基金管理人或其投资顾问及其他中介机构提供的数据和信息,基金托管人对这些机构的信息的准确性和完整性不作任何担保、暗示或表示,并对这些机构的信息的准确性和完整性所引起的损失不负任何责任。

(七)基金托管人对基金管理人或其投资顾问的投资行为(包括但不限于其投资策略及决定)及其投资回报不承担任何责任。

三、基金管理人 对基金托管人的业务核查

(一)在本协议的有效期内,在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上,基金管理人有权对基金托管人履行本协议的情况进行必要的核查,核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金资产、开设基金资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。

(二)基金管理人发现基金托管人或其委托的境外托管人擅自挪用基金资产、未对基金资产实行分账管理、无正当理由未执行或延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反法律法规、《基金合同》及本协议有关规定时,应及时以电话或书面形式通知基金托管人限期纠正,基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内,基金管理人有权随时对通知事项进行复查,督促基金托管人或境外托管人改正。基金托管人或境外托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金管理人应报告中国证监会。上述情况中属于境外托管人存在违规事项的,基金托管人有义务负责规范境外托管人的相关行为,否则基金托管人应对境外托管人的行为造成的后果承担责任。

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。

(三)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,就基金管理人的疑义进行解释或举证。基金管理人 对基金托管人的信息的准确性和完整性不作任

何担保、暗示或表示,并对基金托管人的信息的准确性和完整性所引起的损失不负任何责任。

四、基金资产的保管

(一) 基金资产保管的原则

- 1、基金资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资产,未经基金管理人的合法合规指令或法律法规、《基金合同》及本协议另有规定,不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- 3、基金托管人按照规定开设基金资产的所有资金账户和证券账户。
- 4、基金托管人对所托管的不同基金资产分别设置账户,确保基金资产的完整与独立。
- 5、基金托管人可将基金资产安全保管和办理与基金资产过户有关的手续等职责委托给第三方机构履行。
- 6、托管人或其境外托管人按照有关市场的适用法律、法规和市场惯例,支付现金、办理证券登记等托管业务。
- 7、除非基金托管人及其境外托管人存在过失、疏忽、欺诈或故意不当行为,基金托管人将不保证其或其境外托管人所接收基金资产中的证券的所有权、合法性或真实性(包括是否以良好形式转让)。

8、托管人或其境外托管人在因依法解散、撤销或者被依法宣告破产等原因进行终止清算时,不得将基金资产归入其清算财产,但投资运作地法律法规或行业惯例另有规定的除外;

(二) 基金募集期间及募集资金的验资

- 1、基金募集期间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以基金管理人的名义开立并管理。
- 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合同及其他有关规定后,基金管理人应在规定时间内,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。验资完成后,基金管理人应将属于基金资产的全部资金划入基金托管人开立并指定的基金托管银行账户中,并确保划入的资金与验资确认金额相一致。
- 3、若基金募集期限届满,未能达到基金合同及其他有关规定的生效条件,由基金管理人按规定办理退款等事宜。

(三) 基金银行账户的开立和管理

- 1、基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。

2、基金托管人以本基金的名义开设本基金的托管账户。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的托管账户进行。

3、本基金托管账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人、基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用本基金的银行账户进行本基金业务以外的活动。

4、基金资金结算账户的开立和管理应符合账户所在国或地区监管机构的有关规定。

（四）基金证券账户的开立和管理

1、基金托管人在基金所投资市场的交易所或登记结算机构或境外资产托管人处，按照该交易所或登记结算机构的业务规则开立证券账户。

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以及各自委托代理人均不得出借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相关证明文件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、基金证券账户的开立和管理应符合账户所在国或地区有关法律的规定。

（五）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，可以根据投资市场所在国家或地区法律法规和基金合同的规定，由基金托管人或境外资产托管人负责开立。新账户按有关规则使用并管理。

2、投资市场所在国家或地区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。

（六）基金资产投资的有关有价凭证等的保管

基金资产投资的有价凭证等的保管按照实物证券相关规定办理。

（七）与基金资产有关的重大合同的保管

基金托管人按照法律法规保管由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应及时将一份正本的原件提交给基金托管人。除另有规定外，基金管理人或其委托的第三方机构在代表基金签署与基金资产有关的重大合同时一般应保证有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本原件。重大合同由基金管理人与基金托管人按规定各自保管至少 20 年。

五、基金资产净值计算和会计核算

基金资产的净值计算和会计核算按照相关的法律法规进行。

（一）资产定价

基金托管人、境外托管人负责按基金管理人和基金托管人约定的定价原则对基金资产进行定价。在进行资产定价时，基金托管人、境外托管人有权本着诚意原则，依赖本协议所约定的经纪人、定价服务机构或其他机构的定价信息，但在不存在过错的前提下，基金托管人、境外托管人对上述机构提供的信息的准确性和完整性不作任何担保，并对这些机构的信息的准确性和完整性所引起的基金管理人或基金资产损失不负任何责任。

基金资产净值的计算和复核

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价值。基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数后的价值。

2、复核程序

基金管理人每个估值日对基金进行估值，估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定。用于基金信息披露的基金净值信息由基金管理人负责计算，基金托管人复核。每个开放日 14:30 之前，基金管理人将前一开放日的基金估值结果以书面形式报送基金托管人。基金托管人应在收到上述传真后对净值计算结果进行复核，并在当日 18:00 之前盖章或签字后以传真方式将复核结果传送给基金管理人，由基金管理人定期对外公布。基金月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

3、当相关法律法规或《基金合同》规定的估值方法不能客观反映基金资产公允价值时，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

4、基金管理人、基金托管人发现基金估值违反《基金合同》订明的估值方法、程序以及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，双方应及时进行协商和纠正。

5、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后三位（含第三位）内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当估值错误达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。如法律法规或监管机关对前述内容另有规定的，按其规定处理。

6、如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在偏差并且偏差在合理的范围内，基金份额净值以基金管理人的计算结果为准，基金管理费和基金托管费也应以基金管

理人的净值计算结果计提。

7、由于基金管理人对外公布的任何基金净值数据错误，导致该基金资产或基金份额持有人的实际损失，基金管理人应对此承担责任。若基金托管人计算的净值数据正确，则基金托管人对该损失不承担责任；若基金托管人计算的净值数据也不正确，则基金托管人也应承担未正确履行复核义务的责任。如果上述错误造成了基金资产或基金份额持有人的不当得利，且基金管理人及基金托管人已各自承担了赔偿责任，则基金管理人应负责向不当得利之主体主张返还不当得利。如果返还金额不足以弥补基金管理人承担的赔偿金额，则双方按照各自赔偿金额的比例对返还金额进行分配。

8、由于证券交易所及其登记结算公司及其他中介机构发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响，基金管理人应履行追偿义务。

9、如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，基金管理人可以按照其对基金份额净值的计算结果对外予以公布，基金托管人可以将相关情况报中国证监会备案。

（二）基金会计核算

1、基金账册的建立

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

2、会计数据和财务指标的核对

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

3、基金财务报表和定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人编制，基金托管人复核。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成。

《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招募说明书。

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。基金管理人应当在季度结束之日起 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。

基金合同生效不足两个月的，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。

基金管理人在月度报表完成当日，将报表盖章后提供给基金托管人复核；基金托管人在收到后应立即进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人机构在季度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 5 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在中期报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 10 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人应在收到后 15 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以加密传真的方式或双方商定的其他方式进行。

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

六、基金份额持有人名册的登记与保管

（一）基金份额持有人名册的内容

基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册包括以下几类：

1、基金募集期结束时的基金份额持有人名册；

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

（二）基金份额持有人名册的提供

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

（三）基金份额持有人名册的保管

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

基金托管人对基金份额持有人名册负有保密义务。除法律法规、基金合同和本协议另有规定外，基金托管人不得将基金份额持有人名册及其中的任何信息以任何方式向任何第三方披露，基金托管人应将基金份额持有人名册及其中的信息限制在为履行基金合同和本协议之目的而需要了解该等信息的人员范围之内。

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现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。

争议处理期间，双方当事人应各自继续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。

本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

八、托管协议的修改、终止与基金资产的清算

（一）托管协议的修改程序

本协议经双方当事人经协商一致，可以书面形式对协议进行修改。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后生效。

（二）基金托管协议终止出现的情形

发生以下情况，本托管协议终止：

- 1、《基金合同》终止；
- 2、本基金更换基金托管人；
- 3、本基金更换基金管理人；
- 4、发生《基金法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

（三）基金资产的清算

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

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

（三）财经汇资讯服务 大成财经汇是专为大成旗下持有人提供的资讯服务平台，财经汇提供专业、独家、一手的理财资讯。投资者可登录基金管理人网站（www.dcfund.com.cn）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）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）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 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、基金托管人的托管业务部门目前无重大诉讼事项。

（二）最近 3 年本基金管理人、基金托管人的托管业务部门及高级管理人员没有受到任何处罚。

（三）2019 年 9 月 24 日至 2021 年 3 月 30 日发布的公告。

1. 2019 年 10 月 23 日《大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2019 年三季度报告》。
2. 2019 年 10 月 28 日《大成标普 500 等权重指数证券投资基金恢复大额申购（含定期定额申购）业务的公告》。
3. 2019 年 11 月 8 日《大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加玄元保险代理有限公司为销售机构的公告》。
4. 2019 年 11 月 14 日《大成基金管理有限公司关于旗下部分基金增加泉州银行股份有限公司为销售机构的公告》。
5. 2019 年 11 月 26 日《大成标普 500 等权重指数证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购、赎回及定投业务的公告》。
6. 2019 年 12 月 17 日《大成标普 500 等权重指数证券投资基金招募说明书更新》、《大成标普 500 等权重指数证券投资基金招募说明书摘要更新》、《大成标普 500 等权重指数证券投资基金基金合同更新》、《大成标普 500 等权重指数证券投资基金托管协议更新》。
7. 2019 年 12 月 21 日《大成标普 500 等权重指数证券投资基金暂停申购、赎回及定投业务的公告》。
8. 2019 年 12 月 31 日《大成基金关于网上直销系统开展平安银行支付渠道费率优惠活

动的公告》。

9. 2020 年 1 月 4 日《大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2020 年境外主要市场节假日暂停申购赎回安排的公告》。

10. 2020 年 1 月 9 日《大成标普 500 等权重指数证券投资基金暂停大额申购（含定期定额申购）业务的公告》。

11. 2020 年 1 月 15 日《大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2019 年度第 1 次分红的公告》。

12. 2020 年 1 月 17 日《大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2019 年四季度报告》。

13. 2020 年 1 月 30 日《大成基金管理有限公司关于 2020 年春节假期延长期间调整公司公募基金开放时间等相关事宜的公告》。

14. 2020 年 2 月 11 日《大成标普 500 等权重指数证券投资基金调整大额申购（含定期定额申购）业务的公告》。

15. 2020 年 2 月 18 日《大成标普 500 等权重指数证券投资基金调整大额申购（含定期定额申购）业务的公告》、《大成关于公司旗下部分基金估值调整的公告》。

16. 2020 年 2 月 26 日《大成基金关于 APP 交易平台汇款交易费率优惠的公告》。

17. 2020 年 2 月 29 日《大成基金管理有限公司关于注销青岛分公司的公告》

18. 2020 年 3 月 11 日《大成标普 500 等权重指数证券投资基金调整大额申购（含定期定额申购）业务的公告》。

19. 2020 年 3 月 21 日《大成基金管理有限公司关于注销南京分公司的公告》。

20. 2020 年 4 月 29 日《大成标普 500 等权重指数 QDII 基金 2019 年年度报告》。

21. 2020 年 7 月 21 日《大成标普 500 等权重指数 QDII 基金 2020 年第 2 季度报告》。

22. 2020 年 8 月 28 日《大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2020 年中期报告》。

23. 2020 年 10 月 28 日《大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2020 年第 3 季度报告》。

24. 2020 年 12 月 31 日《大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2021 年境外主要市场节假日暂停申购赎回安排的公告》。

25. 2021 年 1 月 14 日《大成基金管理有限公司关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2020 年度第一次分红的公告》。

26. 2021 年 1 月 22 日《大成标普 500 等权重指数证券投资基金 2020 年第 4 季度报告》。

27. 2021 年 3 月 11 日《关于大成标普 500 等权重指数证券投资基金恢复大额申购（含定期定额申购）业务的公告》。

28. 2021 年 3 月 30 日《大成基金管理有限公司关于公司旗下指数基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告》。

(四) 招募说明书或以前的更新的招募说明书与本次更新的招募说明书内容若有不一致之处，以本次更新的招募说明书为准。

二十三、招募说明书的存放及查阅方式

(一) 招募说明书的存放地点

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

(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。

二十四、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标普 500 等权重指数证券投资基金募集的文件
- (二) 《大成标普 500 等权重指数证券投资基金基金合同》
- (三) 《大成标普 500 等权重指数证券投资基金注册登记业务规则》
- (四) 《大成标普 500 等权重指数证券投资基金托管协议》
- (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

2021 年 3 月 30 日