

# 大成创新成长混合型证券投资基金（LOF） 基金合同

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

二〇二三年七月

## 目录

一、前言.....	2
二、释义.....	4
三、基金的基本情况.....	9
四、基金的沿革.....	9
五、基金的存续.....	10
六、基金份额的申购、赎回.....	10
七、基金份额的转换.....	18
八、基金份额的上市交易.....	18
九、基金份额的非交易过户.....	19
十、基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转托管.....	19
十一、基金合同当事人及权利义务.....	20
十二、基金份额持有人大会.....	25
十三、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序.....	30
十四、基金的托管.....	31
十五、基金份额的注册登记.....	32
十六、基金的销售.....	33
十七、基金的投资.....	33
十八、基金的融资、融券.....	40
十九、基金财产.....	40
二十、基金资产估值.....	41
二十一、基金费用与税收.....	45
二十二、基金收益与分配.....	46
二十三、基金的会计与审计.....	47
二十四、基金的信息披露.....	48
二十五、基金合同的变更、终止和基金财产的清算.....	52
二十六、违约责任.....	54
二十七、争议的处理.....	54
二十八、基金合同的效力.....	54
二十九、业务规则.....	55
三十、其他.....	55
三十一、基金管理人和基金托管人签章见签署页。.....	55

## 一、前言

（一）订立《大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）基金合同》的目的、依据和原则。

1、订立《大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“本基金合同”）的目的是保护基金投资者合法权益、明确本基金合同当事人的权利与义务、规范大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）（以下简称“基金”或“本基金”）的运作；

2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》、《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）和《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售管理办法》）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）；

3、订立本基金合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护投资者合法权益。

（二）中国证监会对有关本基金的核准，并不表明其对基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益。

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

本基金合同约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

（三）本基金合同是约定本基金合同当事人之间基本权利义务的法律文件，其他与本基金相关的涉及本基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，均以本基金合同为准。本基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金管理人和基金托管人自基金合同签订之日起成为基金合同的当事人。基金投资者自依本基金合同取得本基金的基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对本基金合同的承认和接受。基金份额持有人作为本基金合同当事人并不以在本基金合同上书面签章为必要条件。本基金合同的当事人应依照《基金法》、本基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

（四）现行法律法规变更引起本基金合同事项变更，或者本基金合同相关事项变更对基金份额持有人权利或权益无不良影响，经基金管理人和基金托管人协商一致，并经中国证监会核准，依法进行公告，可以不召开基金份额持有人大会即对本合同进行修改。

（五）本基金的投资范围包括存托凭证，可能面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与存托凭证发行机制相关的风险。

## 二、释义

本基金合同中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

基金或本基金：	指大成创新成长混合型证券投资基金（LOF），本基金由景博证券投资基金转型而成；
景博基金：	指景博证券投资基金，运作方式为契约型封闭式；
基金合同或本基金合同：	指《大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）基金合同》及对本合同的任何有效修订和补充，基金合同由《景博证券投资基金基金合同》修订而成；
招募说明书：	指《大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》及其更新；
集中申购公告：	指《大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）集中申购期基金份额发售公告》；
托管协议：	指《大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）托管协议》及其任何有效修订和补充，托管协议由《景博证券投资基金托管协议》修订而成；
基金产品资料概要	指《大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）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；
交易所或证券交易所：	指上海证券交易所和/或深圳证券交易所；
《基金法》：	指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过的自2004年6月1日起施行的《中华人民共和国证券投资基金法》及不时做出的修订；
《运作办法》：	指《证券投资基金运作管理办法》；
《销售管理办法》：	指《证券投资基金销售管理办法》；
《信息披露管理办法》：	指中国证监会2019年7月26日颁布、同年9月1日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
《业务规则》：	指《深圳证券交易所上市开放式基金业务规则》；
《流动性风险管理规定》：	指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订
元：	指人民币元；
基金合同当事人：	指受本基金合同约束，根据本基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人；
基金管理人：	指大成基金管理有限公司；

基金托管人：指中国农业银行股份有限公司；  
基金份额持有人：指依照法律法规或基金合同合法取得基金份额的投资者；

基金转型：	指景博基金由封闭式基金转为开放式基金，调整存续期限，终止上市，调整投资目标、范围和策略，修订基金合同和更名为“大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）”等一系列事项；
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中国证券登记结算有限责任公司；
注册登记系统：	指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金注册登记系统；
证券登记结算系统：	指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统；
投资者：	指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者；
个人投资者：	指依据中华人民共和国有关法律法规及其他有关规定可以投资于证券投资基金的自然人；
机构投资者：	指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资于证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；
合格境外机构投资者：	指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》规定的条件，可以投资于在中国境内合法设立的证券投资基金的中国境外的机构投资者；
基金份额持有人大会：	指按照本基金合同规定召集、召开并由基金份额持有人进行表决的会议；
基金合同生效日：	指《大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）基金合同》生效起始日，本基金合同自景博基金终止上市之日起生效，《景博证券投资基金基金合同》自同日起失效；
基金合同终止日：	指本基金合同规定的合同终止事由出现后，按照本基金合同规定的程序终止本基金合同的日期；
基金存续期：	指自《景博证券投资基金基金合同》生效之日起至《大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）基金合同》终止且基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止的不定期期限；

集中申购期：	指本基金合同生效后仅开放申购、不开放赎回的一段时间，最长不超过 1 个月；
工作日：	指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日；
申购：	指在本基金合同生效后的存续期间，投资者向基金管理人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，基金份额持有人要求基金管理人购回本基金份额的行为；
上市交易：	指在本基金合同生效后的存续期间，投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为；
转换：	指基金份额持有人按基金管理人规定的条件，申请将其持有的基金管理人管理的某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的另一只基金的基金份额的行为；
系统内转托管：	指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为；
跨系统转登记：	指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为；
证券账户：	指注册登记机构为投资者开立的用于记录投资者持有证券的账户，包括人民币普通股票账户（A 股账户）和证券投资基金账户，记录在该账户下的基金份额登记在注册登记机构的证券登记结算系统；
投资指令：	指基金管理人在运用基金财产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令；
销售机构：	指基金管理人及本基金代销机构；
代销机构：	指接受基金管理人委托代为办理本基金申购、赎回和其他基金业务的机构；
直销机构：	指基金管理人，即大成基金管理有限公司；
会员单位：	指具有开放式基金代销资格的深圳证券交易所会员单位；
销售场所：	指场外销售场所和场内销售场所，分别简称场外和场内；
场外：	指通过深圳证券交易所外的销售机构进行基金份额申购和赎回等的场所；
场内：	指通过深圳证券交易所内的会员单位进行基金份额申购、赎回和上市交易等的场所；
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申购、赎回、转换及转托管等业务的基金份额的变动及结余情况的账户；
开放日：	指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日；
T日：	指销售机构受理投资者申购、赎回或其他业务申请的日期；
T+n日：	指T日后（不包括T日）第n个工作日，n指自然数；
基金收益：	指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入；
基金资产总值：	指基金持有的各类有价证券、银行存款本息、应收申购款以及以其他资产等形式存在的基金财产的价值总和；
基金资产净值：	指基金资产总值减去基金负债后的价值；
基金份额净值：	指基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数所得的基金份额的价值；
基金资产估值：	指计算、评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程；
流动性受限资产：	指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等
法律法规：	指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、地方法规、地方规章、部门规章及其他规范性文件以及对于该等法律法规的不时修改和补充；
不可抗力：	指任何无法预见、无法克服、无法避免的事件和因素，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律变化、突发停电或其他突发事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等。

### 三、基金的基本情况

- （一）基金名称：大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）
- （二）基金的类别：混合型基金
- （三）基金运作方式：契约型、上市开放式
- （四）基金投资目标：在控制风险和保证流动性的前提下，超越业绩比较基准，寻求基金资产的长期稳健增值。
- （五）基金份额每份初始面值：人民币 1.00 元
- （六）基金存续期限：不定期限

### 四、基金的沿革

本基金由景博证券投资基金（以下简称“景博基金”）转型而来。

景博基金由巨博证券投资基金（以下简称“巨博基金”）扩募更名而来。巨博基金前身为 1992 年由原中国人民建设银行湖南省信托投资公司和原中国农业银行湖南省信托投资公司，以向社会公众募集方式分别发行并设立的湘建信基金和湘农信基金。1996 年 7 月，经湘银发（1996）332 号文《关于请求准予“湘建信基金”管理人更换为湘财证券有限责任公司的报告》，确认湘建信基金总规模为 15,000 万份基金份额。1996 年 9 月，经湘银发（1996）

366 号文《关于请求准予湘农信基金管理人更换为湘财证券有限责任公司的报告》确认湘农信基金总规模为 10,001.70 万份基金份额。

1998 年 12 月，分别经 1998 年度湘建信基金临时持有人大会和湘农信基金临时持有人大会决议通过，原湘建信基金和湘农信基金合并，并更名为“巨博证券投资基金”，基金总规模为 25001.70 万份基金份额，基金发起人为湘财证券有限责任公司和湖南昌龙房地产开发公司，由湘财证券有限责任公司担任基金管理人，负责基金的运作管理。

1999 年 8 月，根据中国证券监督管理委员会证监基金字（1999）24 号文《关于湖南省原有投资基金清理规范实施方案的批复》，巨博基金进行清理规范。在规范过程中，湘财证券有限责任公司将其持有的部分基金发起人份额共计 500 万份（占基金总份额的 2%）转让给大成基金管理有限公司，巨博基金发起人变更为湘财证券有限责任公司和大成基金管理有限公司，基金管理人变更为大成基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行，存续期间调整为 1992 年 7 月 1 日至 2002 年 6 月 30 日，并经深圳证券交易所深证上（1999）94 号文审核同意，于 1999 年 10 月 22 日在深圳证券交易所挂牌交易。

1999 年 11 月，根据 1999 年度巨博基金临时持有人大会决议，经中国证券监督管理委员会证监基金字（1999）33 号文《关于同意巨博证券投资基金扩募和续期的批复》批准，巨博基金扩募至 10 亿份基金份额，基金名称变更为“景博证券投资基金”，基金存续期延长 5 年至 2007 年 6 月 30 日。2007 年 5 月 15 日，景博证券投资基金基金份额持有人大会以现

场方式召开，大会讨论通过了景博基金转型议案，内容包括景博基金由封闭式基金转为开放式基金、调整存续期限、终止上市、调整投资目标、范围和策略以及修订基金合同等。依据中国证监会 2007 年 6 月 4 日证监基金字[2007]155 号文核准，持有人大会决议生效。依据持有人大会决议，基金管理人将向深圳证券交易所申请基金终止上市，自基金终止上市之日起，原《景博证券投资基金基金合同》失效，《大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）基金合同》生效，基金正式转型为开放式基金，存续期限调整为无限期，基金投资目标、范围和策略调整，同时基金更名为“大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）”。

## 五、基金的存续

### （一）基金份额的变更登记

景博基金终止上市后，基金管理人将向中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司申请办理基金份额的变更登记。中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司根据基金管理人的申请，进行基金份额更名以及必要的信息变更。

### （二）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金存续期内，如连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会，说明出现上述情况的原因和解决方案。

## 六、基金份额的申购、赎回

### （一）申购和赎回的场所

投资者应当在销售机构办理基金申购、赎回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。本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。

销售机构名单及联系方式详见本基金招募说明书及其他相关公告。基金管理人可根据具体情况变更或增减代销机构，并在管理人网站公示。

### （二）申购和赎回的对象

中华人民共和国境内的自然人、法人及其他组织（法律法规禁止购买证券投资基金者除外），合格境外机构投资者，以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

### （三）申购和赎回的开始时间

本基金自景博基金终止上市后开始办理集中申购，暂不开放赎回，集中申购期不超过 1

个月。集中申购期结束后，本基金可暂停办理申购和赎回，暂停期间不超过 1 个月。暂停期间结束后，本基金将开放申购、赎回。基金管理人最迟应于申购开始日、赎回开始日前 1 个工作日在至少一种指定媒介公告。

#### （四）场内申购和赎回

##### 1、开放日及开放时间

本基金为投资者办理场内申购与赎回等基金业务的时间即开放日为深圳证券交易所工作日，业务办理时间为深圳证券交易所交易时间。基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定公告暂停申购或赎回时除外。

##### 2、申购与赎回的原则

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

（2）“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请。申购和赎回申报单位以深圳证券交易所的规定为准；

（3）当日的申购与赎回申请可以在当日交易结束时间前撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销；

（4）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；

（5）基金管理人可以根据基金运作的实际情况，在不损害基金份额持有人实质权益的情况下调整上述原则，但最迟应于新原则实施前 2 日在至少一种指定媒介上予以公告。

##### 3、申购和赎回的程序

###### （1）申购和赎回的申请方式

基金投资者需遵循深圳证券交易所场内申购赎回相关业务规则，在开放日的业务办理时间内提出申购或赎回申请。投资者在申购本基金时须按业务办理单位规定的方式备足申购资金。投资者在提交赎回申请时，应确保账户内有足够的基金份额余额，否则赎回申请无效。

###### （2）申购和赎回申请的确认

基金注册登记机构以交易时间结束前收到申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T 日），并在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。通常情况下，T 日提交的有效申请，投资者可在 T+2 日到场内申购、赎回业务办理单位或以其规定的其他方式查询申购、赎回申请的确认情况。

###### （3）申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，申购款项本金将退回投资者账户，由此产生的利息等损失由投资者自行承担。投资者赎回申请成功后，基金托管人按有关规定将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法按本基金合同有关规定处理。

#### 4、申购和赎回的数额限制

(1) 基金管理人可以规定投资者单个基金账户单笔申购的最低金额以及单笔赎回的最低份额。

(2) 基金管理人可以规定投资者单个交易账户最低基金份额余额。

(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、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司可以根据市场情况，在不违反相关法律法规规定的前提下，调整上述限制。基金管理人调整上述限制，最迟应于调整日前2日在至少一种指定媒介上刊登公告并报中国证监会备案。

#### 5、申购、赎回的价格、费用及其用途

##### (1) 基金申购份额的计算

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率) 申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购日基金份额净值

申购份额保留到整数位，计算所得整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资者资金账户，返还资金的计算公式及方法请参见招募说明书。

##### (2) 基金赎回金额的计算

赎回价格 = 赎回日基金份额净值 赎回金额 = 赎回份数 × 赎回价格 赎回费用 = 赎回金额 × 赎回费率 净赎回金额 = 赎回金额 - 赎回费用

赎回总金额、净赎回金额按四舍五入的原则保留到小数点后两位，由此误差产生的收益归基金财产所有，产生的损失由基金财产承担。

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

##### (4) 基金份额净值的计算公式

T基金份额净值 = T日基金资产净值 ÷ T日发行在外的基金份额总数 基金份额净值保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入。

(5) 本基金的场内申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

(6) 本基金的场内赎回费用由赎回人承担，赎回费总额的25%归基金财产，其余用于支付注册登记费、销售手续费等各项费用。具体费率及收费方式详见招募说明书等相关公告。

(7) 本基金申购费率最高不超过申购金额的5%，赎回费率最高不超过基金份额赎回总金额的3%。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。

(8) 本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定

并在招募说明书中列示。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施前 2 日在至少一种指定媒介上予以公告。

## 6、申购与赎回的登记结算

本基金场内申购和赎回的注册与过户登记业务，按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

7、办理本基金份额场内申购、赎回业务应遵守深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，按新规定执行。

### （五）场外申购和赎回

#### 1、开放日及开放时间

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

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

#### 2、申购与赎回的原则

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

（2）“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

（3）当日的申购与赎回申请可以在当日开放时间结束前撤销，在当日开放时间结束后不得撤销；

（4）基金管理人不得在本基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回；

（5）基金管理人可以根据基金运作的实际情况，在不损害基金份额持有人实质权益的情况下调整上述原则，但最迟应于新原则实施前 2 日在至少一种指定媒介上予以公告。

#### 3、申购和赎回的程序

##### （1）申购和赎回的申请方式

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、赎回的申请。投资者申购本基金时，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）申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前收到申购、转换或赎回申请的当天作为申购、转换或赎回申请日（T日），并在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。通常情况下，T 日提交的有效申请，投资者可在 T+2 日到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。

### （3）申购和赎回的款项支付

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，申购不成功的款项将退回投资者账户。

投资者赎回申请成功后，基金管理人应指示基金托管人按有关规定划付赎回款项。赎回款项应在自受理投资者有效赎回申请之日起不超过 7 个工作日内划往投资者银行账户。在发生巨额赎回时，款项的支付办法按本基金合同有关规定处理。

基金管理人、基金托管人、注册登记机构可在法律法规允许的范围内，对上述业务办理时间进行调整并公告。但基金管理人、注册登记机构最迟须于受理申购、赎回申请之日起 3 个工作日内，对申请的有效性进行确认。

### 4、申购与赎回的数额限制

本基金申购和赎回的数额限制由基金管理人确定并在招募说明书及其他相关公告中列示，包括但不限于：

- （1）基金管理人可以规定投资者首次申购最低金额和追加申购的最低金额。
- （2）基金管理人可以规定基金份额持有人每次申请赎回的最低份额。
- （3）基金管理人可以规定基金份额持有人每个交易账户的最低基金份额余额。
- （4）基金管理人可以规定单个投资者累计持有的基金份额上限。
- （5）基金管理人可以事先设定基金规模，当本基金规模超过事先设定的规模时，基金管理人有权暂停申购。
- （6）当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。具体请参见相关公告。
- （7）基金管理人在不损害基金份额持有人实质权益的情况下可以根据市场情况对以上限制进行调整，最迟于调整前 2 日在至少一种指定媒介上予以公告，并报中国证监会备案。

### 5、申购和赎回的价格、费用及其用途

#### （1）基金申购份额的计算

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} \div (1 + \text{申购费率}) \quad \text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} \div \text{T 日基金份额净值}$$

申购份额、净申购金额按四舍五入的原则保留到小数点后两位，由此误差产生的收益归基金财产所有，产生的损失由基金财产承担。

#### （2）基金赎回金额的计算

$$\text{赎回总额} = \text{赎回份数} \times \text{T 日基金份额净值} \quad \text{赎回费用} = \text{赎回总额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回总额} - \text{赎回费用}$$

赎回总金额、净赎回金额按四舍五入的原则保留到小数点后两位，由此误差产生的收益

归基金财产所有，产生的损失由基金财产承担。

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

（4）基金份额净值的计算公式

$T$ 基金份额净值 =  $T$ 日基金资产净值 ÷  $T$ 日发行在外的基金份额总数  
基金份额净值保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入。

（5）本基金的场外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。

（6）本基金的场外赎回费用由赎回人承担，赎回费总额的25%归基金财产，其余用于支付注册登记费、销售手续费等各项费用。具体费率及收费方式详见招募说明书等相关公告。

（7）本基金申购费率最高不超过申购金额的5%，赎回费率最高不超过基金份额赎回总金额的3%。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。

（8）本基金的申购费率、赎回费率和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定并在招募说明书中列示。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施前2日在至少一种指定媒介上予以公告。

（六）巨额赎回的认定及处理方式

1、巨额赎回的认定

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

2、巨额赎回的处理方式

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

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

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一工作日基金总份额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外，延迟至下一开放日办理，以下一个开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额，转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权，以此类推，直到办理完毕全部赎回申请为止。



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）当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在3个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在2日内在指定媒介上刊登公告。

（4）暂停接受和延缓支付：本基金连续2个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经确认的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过20个工作日，并应当在指定媒介上予以公告。

#### （七）拒绝或暂停申购的情形及处理

1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

- （1）因不可抗力导致基金管理人无法接受投资者的申购申请；
- （2）证券交易场所交易时间临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- （3）发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- （4）基金财产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益的情形；
- （5）基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购；
- （6）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；
- （7）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；
- （8）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；
- （9）法律法规规定或本基金合同约定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述第（6）、（8）项情形时，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。如果法律法规、监管要求调整导致上述第（6）项内容取消或变更的，基金管理人在履行适当程序后，可修改

上述内容，不需召开基金份额持有人大会。

2、基金管理人决定拒绝或暂停接受某些投资者的申购申请时，申购款项将退回投资者账户。基金管理人决定暂停接受申购申请时，应当在当日向中国证监会备案，并及时公告或通知。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并予以公告或通知。

#### （八）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形及处理

1、在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请：

- （1）因不可抗力导致基金管理人无法接受投资者的赎回申请或无法支付赎回款项；
- （2）证券交易场所交易时间临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- （3）基金连续2个开放日以上发生巨额赎回；
- （4）发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- （5）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）法律法规规定或本基金合同约定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应当在当日向中国证监会备案，并及时公告。已接受的赎回申请，基金管理人应当足额支付；如暂时不能足额支付，应当按单个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受的赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分在后续开放日予以支付，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。赎回申请的延期办理最迟不得超过20个工作日。投资者在申请赎回时可选择将当日未获受理部分予以撤销。

2、在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并及时公告。

3、暂停基金的申购、赎回，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

#### （九）申购和赎回暂停期间与重新开放的公告

暂停期间结束，基金重新开放时，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

1、如果发生暂停的时间为1天，基金管理人应于重新开放日，在至少一种指定媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公告最近1个工作日的基金份额净值。

2、如果发生暂停的时间超过1天但少于2周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前1个工作日，在至少一种指定媒介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1个工作日的基金份额净值。

3、如果发生暂停的时间超过2周，暂停期间，基金管理人应每2周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过2个月时，可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前2日，在至少一种指定媒介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1个工作日的基金份额净值。

## 七、基金份额的转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同、招募说明书的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他开放式基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同、招募说明书的规定制定并在相关业务公告中列示。基金管理人应提前告知基金托管人与相关机构。

场内暂时未开通基金转换业务，若届时开通的，本基金管理人将及时公告。

## 八、基金份额的上市交易

本基金开放日常申购、赎回3个月后，基金管理人可以根据有关规定，申请本基金的基金份额上市交易。基金上市后，登记在证券登记结算系统中的基金份额可直接在深圳证券交易所上市交易；登记在注册登记系统中的基金份额可通过办理跨系统转登记业务将基金份额转登记在证券登记结算系统中，再上市交易。

（一）上市交易的地点：深圳证券交易所。

（二）上市交易的时间：在确定上市交易的时间后，基金管理人最迟于上市前2个工作日在至少一种指定媒介上予以公告。

（三）上市交易的规则

- 1、本基金上市首日的开盘参考价为前一交易日基金份额净值；
- 2、本基金实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为10%，自上市首日起实行；
- 3、本基金买入申报数量为100份或其整数倍；
- 4、本基金申报价格最小变动单位为0.001元人民币；
- 5、本基金上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及其他有关规定。

（四）上市交易的费用

本基金上市交易的费用遵循《深圳证券交易所交易规则》及《业务规则》的相关规定。

（五）上市交易的行情揭示

本基金在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金前一交易日的基金份额净值。

（六）上市交易的注册登记

投资者T日买入成功后，注册登记机构在T日自动为投资者登记权益并办理注册登记手续，投资者自T+1日（含该日）后有权卖出该部分基金份额；投资者T日卖出成功后，注册登记机构在T日自动为投资者办理扣除权益的注册登记手续。

（七）上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市

本基金的停牌、暂停上市、恢复上市按照深圳证券交易所的相关规定执行。

#### （八）终止上市的情形和处理方式

发生下列情况之一时，本基金应终止上市交易：

- 1、自暂停上市之日起半年内未能消除暂停上市原因；
- 2、基金合同终止；
- 3、基金份额持有人大会决定终止上市；
- 4、深圳证券交易所认为须终止上市的其他情况。

发生上述终止上市情形时，由证券交易所终止其上市交易，基金管理人报中国证监会备案后终止本基金的上市，并在至少一种指定媒介上刊登终止上市公告。

（九）相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，本基金基金合同相应予以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会，并在本基金更新的招募说明书中列示。

### 九、基金份额的非交易过户

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

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指受理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；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。办理非交易过户必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请自申请受理日起2个月内办理，并按基金注册登记机构规定的标准收费。具体条件、程序及收费标准以《中国证券登记结算有限责任公司开放式证券投资基金登记结算业务指南》为准。

### 十、基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转托管

#### （一）基金份额的登记

1、本基金的份额采用分系统登记的原则。原景博基金份额变更登记为本基金的份额以及本基金场内申购或上市交易买入的基金份额登记在证券登记结算系统持有人证券账户

下；场外申购买入的基金份额登记在注册登记系统持有人开放式基金账户下。

2、登记在证券登记结算系统中的基金份额既可以在深圳证券交易所上市交易，也可以直接申请场内赎回。

3、登记在注册登记系统中的基金份额可以申请场外赎回。

#### （二）系统内转托管

1、系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为。

2、基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理基金赎回业务的销售机构（网点）时，销售机构（网点）之间不能通存通兑的，可办理已持有基金份额的系统内转托管。

3、基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理上市交易或场内赎回的会员单位（席位）时，可办理已持有基金份额的系统内转托管。

#### （三）跨系统转登记

1、跨系统转登记是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为。

2、本基金跨系统转登记的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

## 十一、基金合同当事人及权利义务

### （一）基金管理人

#### 1、基金管理人基本情况

名称：大成基金管理有限公司

住所：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层

法定代表人：吴庆斌

成立时间：1999 年 4 月 12 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字【1999】10 号组织形式：有限责任公司

注册资本：贰亿元人民币

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存续期间：持续经营

#### 2、基金管理人的权利

（1）自基金合同生效之日起，基金管理人根据法律法规和本基金合同的规定依照诚实

信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

（2）根据本基金合同的规定获得基金管理费，收取或委托收取投资者申购费、赎回费及其他事先公告的合理费用及法律法规规定的其他费用；

（3）根据本基金合同的规定，制订并公布有关基金申购、赎回、转托管、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；

（4）根据本基金合同规定销售基金份额；

（5）提议召开基金份额持有人大会；

（6）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（7）在法律法规允许的前提下，以基金的名义依法为基金进行融资、融券，并以相应基金财产履行偿还融资和支付利息的义务；

（8）选择、更换基金代销机构，对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；如果基金管理人认为基金代销机构的作为或不作为违反了法律法规、本基金合同或基金销售代理协议，基金管理人应行使法律法规、本基金合同或基金销售代理协议赋予、给予、规定的基金管理人的任何及所有权利和救济措施，以保护基金财产的安全和基金投资者的利益；

（9）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；

（10）依照《基金法》、《运作办法》及相关法律法规等有关规定，代表基金行使因基金投资而获得的任何权利；

（11）依据本基金合同及有关法律的规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了本基金合同及国家有关法律法规并对基金财产或基金份额持有人利益造成重大损失的，应呈报中国证监会和中国银监会，并有权提议召开基金份额持有人大会，由基金份额持有人大会表决更换基金托管人，或采取必要措施保护基金投资者的利益；

（12）《基金法》、《运作办法》、本基金合同以及其他法律法规规定的权利。

### 3、基金管理人的义务

（1）依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

（2）办理基金备案登记手续；

（3）自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

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

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

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

- (7) 接受基金托管人依法进行的监督；
- (8) 采取适当合理的措施使计算基金份额申购、赎回对价的方法符合基金合同等法律文件的规定，按规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回对价；
- (9) 严格按照《基金法》、《运作办法》、本基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- (10) 保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等。除法律法规、本基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；
- (11) 按基金合同规定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
- (12) 不谋求对上市公司的控制和直接经营管理；
- (13) 依据《基金法》、《运作办法》、本基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会，或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (14) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- (15) 编制季度报告、中期报告和年度报告；
- (16) 保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；
- (17) 组织并参加基金财产清算组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (18) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
- (19) 因违反《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他法律法规，导致基金财产损失或损害基金份额持有人合法权益的，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (20) 按照法律法规和本基金合同的规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- (21) 确保向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间内发出；保证投资者能够按照基金合同规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并得到有关资料的复印件；
- (22) 不从事任何有损基金及本基金其他当事人利益的活动；
- (23) 负责为基金聘请注册会计师和律师；
- (24) 由于基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金托管人追偿；
- (25) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (26) 法律法规规定的其他义务。

(二) 基金托管人

1、基金托管人的基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街69号

法定代表人：周慕冰

成立时间：2009年1月15日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复【2009】13号

组织形式：股份有限公司

注册资本：32,479,411.7万元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字【1998】23号

## 2、基金托管人的权利

- (1) 依法保管基金的财产；
- (2) 根据法律法规和本基金合同的规定监督基金管理人的投资运作；
- (3) 依照基金合同的约定获得基金托管费；
- (4) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；
- (5) 监督基金管理人，如认为基金管理人违反了本基金合同及国家有关法律法规，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (6) 有权不予执行基金管理人的违法、违规投资指令，并向中国证监会报告；
- (7) 《基金法》、《运作办法》、基金合同以及其他法律法规规定的权利。

## 3、基金托管人的义务

- (1) 基金托管人将遵守《基金法》、《运作办法》、本基金合同及其他相关法律法规，为基金份额持有人的最大利益处理基金事务；基金托管人保证恪尽职守，依照诚实信用、勤勉尽责的原则，谨慎、有效地持有并安全保管基金财产；
- (2) 设有专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备有足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- (3) 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，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人固有资产以及不同的基金财产相互独立；对不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
- (4) 除依据《基金法》、本基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
- (5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- (6) 按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户，负责基金投资于证券的清算交割，执行基金管理人的投资指令，并负责办理基金名下的资金往来；
- (7) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (8) 保守基金商业秘密，除《基金法》、本基金合同及其他法律法规另有规定外，在



基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；但因遵守和服从司法机构、中国证监会或其他监管机构的判决、裁决、决定、命令而做出的披露不应视为基金托管人违反本基金合同规定的保密义务；

（9）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值及基金申购、赎回价格；

（10）按规定出具基金业绩和基金托管情况的报告，并报送中国证监会和中国银监会；

（11）建立并保存基金份额持有人名册；

（12）按有关规定，保存基金的会计账册、报表、记录和其他相关材料 15 年以上；

（13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

（14）负责基金的申购、赎回和基金转换的资金保管和清算；

（15）监督基金管理人的投资运作，发现基金管理人的投资指令违法、违规的，不予执行，并向中国证监会报告；

（16）对基金财务会计报告、季度报告、中期和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照本基金合同及托管协议的规定进行，如果基金管理人未执行本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；

（17）按照基金合同的约定，依据基金管理人的指令或有关规定向相应的基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

（18）按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；

（19）参加基金财产清算组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

（20）面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会和中国银监会，并通知基金管理人；

（21）因违反《基金法》、《运作办法》、基金合同及有关法律法规，导致基金财产损失损失的，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

（22）基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；

（23）不从事任何有损基金及基金其他当事人利益的活动；

（24）法律法规规定的其他义务。

（三）基金份额持有人

#### 1、基金份额持有人权利

每份基金份额具有同等的合法权益。

（1）按本基金合同的规定出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，并对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

（2）按本基金合同的规定取得基金收益；

（3）监督基金经营情况，查询或获取公开的基金业务及财务状况的资料；

- (4) 依法转让或申请赎回其持有的基金份额；
- (5) 参与分配基金清算后的剩余基金财产；
- (6) 要求基金管理人或基金托管人按法律法规、本基金合同以及依据本基金合同制定的其他法律文件的规定履行其义务；
- (7) 依照本基金合同的规定，要求召开基金份额持有人大会；
- (8) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (9) 监督基金管理人的投资运作；
- (10) 对基金管理人、基金托管人、基金份额销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- (11) 《基金法》、《运作办法》、本基金合同以及其他法律法规规定的权利。

## 2、基金份额持有人义务

- (1) 遵守本基金合同；
- (2) 交纳基金申购款项等，并承担基金合同规定的其他费用；
- (3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者终止的有限责任；
- (4) 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人利益的活动；
- (5) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

## 十二、基金份额持有人大会

### (一) 召开事由

#### 1、有以下情形之一的，应召开基金份额持有人大会：

- (1) 修改基金合同（基金合同中约定可由基金管理人和基金托管人协商后修改而无需召开基金份额持有人大会的情形除外）；
- (2) 变更基金类别；
- (3) 变更基金的投资目标、投资范围和投资策略；
- (4) 变更基金份额持有人大会程序；
- (5) 更换基金管理人、基金托管人；
- (6) 终止基金合同；
- (7) 与其他基金合并；
- (8) 转换基金运作方式；
- (9) 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；
- (10) 法律法规及中国证监会规定的其他情形。

2、有以下情形之一的，经基金合同约定可由基金管理人和基金托管人协商后修改，无需召开基金份额持有人大会：

- (1) 调低基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- (2) 在基金合同约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必须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) 按照法律法规或基金合同规定不需要召开基金份额持有人大会的其他情形。

## (二) 召集方式

1、基金合同生效后，基金管理人经与基金托管人协商一致，可以定期或不定期召集基金份额持有人大会，审议有关基金运作的重大事项。

2、在正常情况下，基金份额持有人大会由基金管理人召集，基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

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

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

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

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

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

6、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。

## (三) 通知

召开基金份额持有人大会，召集人应当至少提前 30 天，在至少一种指定媒介公告通知。基金份额持有人大会通知至少应载明以下内容：

- 1、会议召开的时间、地点和会议方式；
- 2、会议拟审议的主要事项、议事程序；

- 3、有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- 4、代理投票授权委托书送达时间和地点；
- 5、会议的表决方式；
- 6、会务常设联系人姓名、电话；
- 7、与会者需要准备或履行的文件和手续；
- 8、召集人认为需要通知的其他事项。

采取通讯方式开会并进行表决的情况下，会议通知应报中国证监会备案，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见的寄交和收取方式等。

#### （四）会议召开方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会与通讯方式开会。

会议的召开方式由召集人确定，但终止基金合同、转换基金运作方式、更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

基金份额持有人大会应当有代表在权益登记日基金总份额 **50%**以上的基金份额持有人参加方可召开。

##### 1、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，基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席；

现场开会并符合下列条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

本人出席会议者持有本基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有本基金份额的凭证及委托人的授权委托书应符合法律法规、本基金合同和会议通知的规定；

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，有效的基金份额为本基金在权益登记日基金总份额的 **50%**以上。

##### 2、通讯方式开会

通讯方式开会应以书面方式进行表决。符合以下条件的通讯开会有效：

（1）召集人应按本基金合同规定公告会议通知，在 **2** 个工作日内在指定媒介上连续公布相关提示性公告；

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

（3）召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；

（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代理人提交的持有本基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有本基金份额的凭证及委托人的授权委托书应符合法律法规、本基金合同和会议通知的规定；

(5) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具意见的，基金份额持有人所持有的基金份额在基金权益登记日基金总份额的 50% 以上；

(6) 会议通知已报中国证监会备案。

3、不论现场开会或通讯方式开会，若该次会议不符合本基金合同规定的开会条件，则该次会议不得审议会议通知中的各项议题，但召集人可以按照本基金合同规定的方式和程序，对于同一议题再次召集基金份额持有人大会。

再次开会日期的提前通知期限为 30 天，但确定有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人资格的权益登记日不发生变化；再次召开的基金份额持有人大会需满足上述现场开会或通讯方式开会的各项条件方为有效。

#### (五) 议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

议事内容限为本条前述第（一）款规定的基金份额持有人大会召开事由范围内的事项。基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日基金总份额 10% 以上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。

大会召集人在会议通知公告前应当按照以下原则对提案进行审核：

(1) 关联性。提案涉及事项与本基金有直接关系，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提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

(2) 程序性。大会召集人可以对提案涉及的程序性问题做出决定。如将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，召集人可就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

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

对于召集人未列入会议通知并公告的提案，该提案的提案人可在本次基金份额持有人大会后按本基金合同的规定自行召集基金份额持有人大会。

##### 2、议事程序

###### (1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第（七）款规定的程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人未能主持大会的情况下，由基金托管人授权出席会议的代表主持；如果基金管理人和基金托管人均未能主持大会，则由出席大会的基金份

额持有人以所代表的基金份额 50%以上多数选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。

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

## （2）通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，由召集人至少提前 30 天公布提案，在所通知的表决截止日期第二天统计全部有效表决，在公证机构及监督人的监督下形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，则在公证机构监督下形成的决议有效。

## （六）表决

1、基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权，基金份额持有人可以委托代理人出席基金份额持有人大会并行使表决权。

2、基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

### （1）一般决议

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

### （2）特别决议

特别决议须经参加大会的基金份额持有人所持表决权的 2/3 以上通过方可做出。更换基金管理人或者基金托管人、终止基金合同、转换基金运作方式必须以特别决议通过方为有效。

3、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

4、采取通讯方式进行表决时，符合会议通知规定的书面表决意见为有效表决。除非在计票时有充分的相反证据证明，否则符合法律法规、基金合同和会议通知的书面表决意见为有效表决；表决意见模糊不清或相互矛盾的为无效表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

5、基金份额持有人大会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。

6、基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。

## （七）计票

### 1、现场开会

（1）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选举 2 名基金份额持有人代表与大会召集人授权的 1 名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举 3 名基金份额持有人代表担任监票人。但如基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行

选举 3 名基金份额持有人代表担任监票人，记票、表决结果仍然有效。

（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的代理人对会议主持人宣布的表决结果有异议，有权在宣布表决结果后立即要求重新清点；重新清点以一次为限，会议主持人应当于重新清点后当场公布重新清点结果。

（4）计票过程应由公证机关予以公证。

## 2、通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的 2 名监督员在监督人授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对计票过程予以公证。如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权 3 名监督员进行计票，并由公证机构对其计票过程予以公证。

## （八）生效与公告

基金份额持有人大会表决通过的事项，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

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。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在至少一种指定媒介上公告。

## 十三、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序

（一）有下列情形之一的，基金管理人职责终止：

- 1、被依法取消基金管理人资格；
- 2、被基金份额持有人大会解任；
- 3、依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产；
- 4、法律法规和基金合同规定的其他情形。

（二）有下列情形之一的，基金托管人职责终止：

- 1、被依法取消基金托管人资格；
- 2、被基金份额持有人大会解任；
- 3、依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产；
- 4、法律法规和基金合同规定的其他情形。

（三）更换基金管理人的程序

原基金管理人退任后，基金份额持有人大会需在 6 个月内选任新基金管理人。在新基金

管理人产生前，中国证监会可指定临时基金管理人。

1、提名：新任基金管理人由基金托管人或由代表 50%以上（含 50%）基金份额的基金份额持有人提名。

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

3、核准并公告：基金份额持有人大会决议自通过之日起 5 日内，由大会召集人报中国证监会核准，并应自中国证监会核准后 2 日内在至少一种指定媒介上公告。

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

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

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

#### （四）更换基金托管人的程序

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

1、提名：新任基金托管人由基金管理人或由代表 50%以上（含 50%）基金份额的基金份额持有人提名。

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

3、核准并公告：基金份额持有人大会决议自通过之日起 5 日内，由大会召集人报中国证监会核准，并应自中国证监会核准后 2 日内在至少一种指定媒介上予以公告。

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

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

## 十四、基金的托管

本基金财产由基金托管人保管。基金托管人与基金管理人必须按照《基金法》、本基金合同及其他有关规定订立托管协议。订立托管协议的目的是明确基金托管人与基金管理人之



间在基金份额持有人名册登记、基金财产的保管、基金财产的管理和运作及相互监督等相关事宜中的权利、义务及职责，确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

## 十五、基金份额的注册登记

### （一）基金注册登记业务

本基金的注册登记业务指本基金登记、存管、过户、清算、结算和交收等业务，具体内容包括但不限于基金份额持有人基金账户管理、基金份额注册登记、清算和结算、基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等。

### （二）注册登记机构

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

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

### （三）注册登记机构权利

- 1、建立和管理投资者基金账户；
- 2、取得注册登记费；
- 3、保管基金份额持有人开户资料、交易资料、基金份额持有人名册等；
- 4、在法律法规允许的范围内，对注册登记业务的办理时间进行调整，并最迟于开始实施前 2 个工作日内在至少一种指定媒介上公告；
- 5、法律法规规定的其他权利。

### （四）注册登记机构义务

- 1、配备足够的专业人员办理本基金的注册登记业务；
- 2、严格按照法律法规和本基金合同规定的条件办理基金的注册登记业务；
- 3、接受基金管理人的监督；
- 4、保管基金份额持有人名册及相关的申购与赎回等业务记录 15 年以上；
- 5、对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或基金或其他任何方带来的损失，须以其自身财产承担相应的赔偿责任，但司法强制检查及法律法规规定的其他情形除外；

6、按本基金合同及招募说明书规定为投资者办理非交易过户业务、转托管和提供其他必要的服务；

7、如因注册登记机构的原因而造成基金管理人或者基金份额持有人损失的，依法承担相应的赔偿责任；

8、法律法规规定的其他义务。

## 十六、基金的销售

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

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

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

## 十七、基金的投资

### （一）投资目标

在控制风险和保证流动性的前提下，超越业绩比较基准，寻求基金资产的长期稳健增值。

### （二）投资范围

本基金的投资范围限于国内依法发行上市的股票、存托凭证、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。

本基金股票、存托凭证投资比例范围为基金资产的 40%—95%；现金和固定收益类证券投资比例范围为基金资产的 5%—60%，其中资产支持证券投资比例范围为 0—20%，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）和到期日在一年以内的政府债券等短期金融工具的投资比例不低于基金资产净值的 5%。

如法律法规或中国证监会修改基金投资品种的规定，基金管理人在履行相应程序后，可以依据新的规定修订基金的投资范围；如法律法规或中国证监会变更对权证或资产支持证券等投资的比例限制，基金管理人可相应调整基金的投资比例规定，不需经基金份额持有人

大会审议。

### （三）投资理念

通过对内在价值和安全边际的全面分析，降低投资风险；通过对盈利能力和增长潜力的深入挖掘，获取投资超额收益；通过有效处理资产价值、盈利能力价值、增长性价值之间的权重分配，实现基金财产的长期稳健增值。

### （四）投资策略

本基金以股票投资为主，采用积极的投资策略，精选具备持续增长能力，价格处于合理区间的优质股票构建投资组合；本基金以固定收益品种投资为辅，确保投资组合具有良好的流动性。

#### 1、资产配置策略

本基金在经济因素分析、经济周期分析、经济政策分析的基础上完成战略资产配置（SAA）。其中：经济因素分析主要包括利率分析、汇率分析和通货膨胀率分析；经济周期分析主要通过对国民生产总值、工业生产总值、消费总量、投资总量等宏观统计数据的周期性波动的定量分析完成；经济政策分析包括存款准备金率、再贴现率和公开市场操作等货币政策分析以及政府购买水平、政府转移支付水平和税率变动情况等财政政策分析。本基金在通过战略资产配置确定各类别资产权重后，根据对投资组合中各类资产短期收益率变化的预测，确定资产类别定价差异，实现从相对较高估值资产到相对较低估值资产的再配置，即战术资产配置（TAA），以获得更高的投资收益。

#### 2、股票投资策略

本基金的股票投资策略包获取超额收益和控制风险两个层面。

##### （1）收益层面

盈利的增长是支持股票价格快速、长期上涨的动力，而盈利增长水平是众多因素共同作用的结果，其中行业因素是影响企业增长性的主要外部因素；科技创新、消费趋势等则是影响企业增长性的主要内部因素。本基金将主要通过行业分析和企业研究进行股票投资的收益性选择。

##### ① 行业分析

本基金将通过行业发展现状分析、行业竞争结构分析和行业发展趋势分析，评价行业增长潜力：

##### A. 行业发展现状分析，主要包括：

- （A）行业增长率、产品集中度、企业地域分布分析；
- （B）发达国家行业发展状况及行业梯度转移趋势分析；
- （C）政府政策导向分析等。

##### B. 行业竞争结构分析，主要包括：

- （A）行业价值链分析及行业内主导竞争作用力分析；

- (B) 行业内主要竞争者财务状况及其竞争策略分析；
  - (C) 行业所处周期及需求状况分析等。
- C. 行业未来发展趋势分析，主要包括：
- (A) 行业未来需求趋势及行业演变规律分析；
  - (B) 行业内购并整合的可能性分析等。

## ② 企业研究

本基金通过对企业利润增长水平的定量分析和企业创新能力、管理水平的定性分析，评价企业的增长潜力：

### A. 利润增长水平分析，主要包括：

- (A) 企业主营业务收入增长率分析；
- (B) 企业净利润增长率分析；
- (C) 企业净资产收益率分析；
- (D) 企业资产负债水平分析等。

### B. 企业创新能力分析，主要包括：

- (A) 企业主营产品是否符合产业升级趋势，是否顺应大众消费潮流；
- (B) 企业是否采取了不易被模仿和不易受到竞争对手反击的创新，确保企业在较长一段时间内独享创新带来的超额利润，并扩大市场占有率；
- (C) 企业是否具有品牌优势、资源独占等核心竞争优势等。

### C. 企业管理水平分析，主要包括：

- (A) 企业是否具有明确的发展战略；
- (B) 企业是否具有较高的资源配置效率；
- (C) 企业管理团队是否重视股东权益等。

## (2) 风险层面

在风险控制方面，本基金通过相对价值法和贴现现金流法的综合运用，在横向和纵向比较的基础上，客观评价企业的估值水平，选择价值被市场低估或者处于合理估值区间的股票，作为控制投资风险的重要手段，主要考察指标包括：

- ① 资产重置价格
- ② 市盈率（P/E）
- ③ 市净率（P/B）
- ④ 贴现现金流（DCF）
- ⑤ 经济价值/息税折旧摊销前利润（EV/EBITDA）

本基金将根据宏观经济状况、收益实现情况合理分配收益层面和风险层面的权重，做到可攻可守、进退有度，以期在合理控制风险的前提下，实现基金财产的长期稳健增值。

## 3、固定收益品种投资策略

本基金可以投资于国债、央行票据、金融债、企业债和资产支持证券等固定收益品种。本基金固定收益品种投资将采取较为积极的策略，通过利率预测分析、收益率曲线变动分析、信用度分析、收益率利差分析等，力求在保证基金资产总体的安全性、流动性的基础上获取一定的收益。

#### 4、存托凭证投资策略

在控制风险的前提下，本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。

#### 5、其他金融工具投资策略

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

### （五）投资组合管理

#### 1、投资组合管理原则

##### （1）积极成长原则

基金管理人以专业技能管理和运用基金财产，经过综合分析判断，选择最具成长潜力的行业及该行业中最具成长潜力的上市公司作为投资对象，在有效规避风险的情况下，争取基金财产的快速增值。

##### （2）重点投资和分散投资相结合原则

通过对最具成长潜力的行业和公司的透彻把握、分析，集中对其中的少数公司重点投资，以实现资源的优化和投资回报的最大化。同时，对于其他具有成长潜力及未来成长相对不确定的公司，采取分散投资的策略，以利于更好地分散风险、把握机遇。

##### （3）长期稳定增值原则

在积极主动投资的同时，基金管理人更注重资产的长期稳定增值。通过对未来几年中国宏观经济形势、行业及公司成长性的跟踪分析，实行中长期投资为主、阶段操作为辅的投资策略，以实现基金财产的长期稳定增值。

#### 2、资产配置和行业配置的决策程序

##### （1）资产配置

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

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

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

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

理执行。

## （2）行业配置

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

## 3、投资品种选择的决策程序

### （1）股票投资的决策程序

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

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

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

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

④ 基金经理从股票投资备选库中选择股票构建投资组合。

### （2）债券投资的决策程序

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

## 4、交易指令的下达和执行

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

## 5、投资风险的监控和管理

### （1）监察稽核部对投资风险的日常监管

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

### （2）基金绩效评估和风险管理

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

## （六）投资限制和禁止行为

## 1、投资限制

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

- （1）基金财产参与股票发行申购时，本基金所申报的金额不得超过基金总资产，本基金所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- （2）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- （3）本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券总和，不超过该证券的 10%；
- （4）本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；
- （5）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；
- （6）本基金投资于股权分置改革中发行的权证，在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；
- （7）本基金持有的全部权证市值不得超过基金资产净值的 3%；
- （8）本基金与本基金管理人管理的其他基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；
- （9）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- （10）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- （11）本基金与本基金管理人管理的其他基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
- （12）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
- （13）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；
- （14）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；
- （15）本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算；
- （16）遵守法律法规及中国证监会规定的其他限制。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 3 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。除上述第（5）、（14）项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基

金管理人以外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

## 2、禁止行为

依据《基金法》，基金财产不得用于下列投资或活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- (6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- (7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (8) 依照法律、行政法规有关法律法规规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

3、如果法律法规对本基金合同约定的投资限制和禁止行为进行变更的，本基金将相应变更或取消上述强制性规定，不需经基金份额持有人大会审议。

### (七) 证券交易席位选用的原则

基金管理人负责选择证券经营机构，租用其专用交易席位作为本基金买卖证券专用。选择使用交易席位的证券经营机构的标准为：

- 1、资力雄厚、信誉良好。
- 2、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- 3、经营行为规范。
- 4、内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。
- 5、具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需求，并能为基金提供全面的信息服务。
- 6、研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

选用交易席位的证券经营机构由基金管理人根据上述标准考察后确定。

### (八) 业绩比较基准

沪深 300 指数×70 % + 中国债券总指数×30%

在本基金的运作过程中，如果由于外部投资环境或法律法规的变化而使得调整业绩比较基准更符合基金份额持有人的利益，则基金管理人可以对业绩比较基准进行适当调整，在报中国证监会核准后，公告并予以实施。



#### （九）风险收益特征

本基金为混合型基金，风险收益水平高于货币市场基金和债券型基金，属于中高风险的证券投资基金品种。

#### （十）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

- 1、不谋求对所投资公司的控股或者直接管理；
- 2、所有参与行为均应在合法合规和维护基金份额持有人利益的前提下进行，并谋求基金财产的保值和增值。

### 十八、基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关法律法规规定进行融资、融券。

### 十九、基金财产

#### （一）基金资产总值

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

#### （二）基金资产净值

本基金基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

#### （三）基金财产的账户

本基金根据相关法律法规、规范性文件开立基金资金账户以及证券账户，与基金管理人和基金托管人固有财产账户以及其他基金财产账户独立。

#### （四）基金财产的保管和处分

本基金财产应独立于基金管理人和基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人以其固有财产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。

基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归基金财产所有。基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算范围。基金财产的债权不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销；不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

除依据《基金法》、本基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。

## 二十、基金资产估值

### （一）估值目的

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

### （二）估值日

本基金的估值日为相关的证券交易所的正常营业日。

### （三）估值方法

#### （1）股票估值方法：

1) 上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

#### 2) 未上市股票的估值：

① 首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本价估值；

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

③ 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日在证券交易所上市的同一股票的市价进行估值；

④ 非公开发行的且在发行时明确一定期限锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

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

4) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

#### （2）债券估值方法：

1) 在证券交易所市场挂牌交易实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；估值日没有交易，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

2) 在证券交易所市场挂牌交易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，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到

的净价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

3) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

4) 交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量。

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

6) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值；

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

8) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

#### (3) 权证估值办法：

1) 基金持有的权证，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；估值日没有交易，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。2) 首次发行未上市的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

3) 因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

4) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第 1) — 3) 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) — 3) 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。

5) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

(4) 本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。

(5) 其他有价证券等资产按国家有关规定进行估值。

#### (四) 估值对象

基金依法拥有的各类有价证券，以及应收应付款等项目。

#### (五) 估值程序

基金日常估值由基金管理人和基金托管人同时进行。基金资产净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核；基金托管人复核无误后签字返回给基金管理人；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。

#### （六）暂停估值的情形

在下列情形中，暂停基金财产估值：

- 1、基金投资涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 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他情形。

#### （七）基金份额净值的确认

基金份额净值的计算，精确到 0.001 元，小数点后第 4 位四舍五入。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

#### （八）估值错误的处理

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

基金管理人和基金托管人应采取必要、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。

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。

#### 2、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人、基金托管人、注册登记机构、代销机构或投资者自身的原因造成差错，导致其他当事人遭受损失的，责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力。

由于不可抗力原因造成投资者的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

#### 3、差错处理原则

因基金估值错误给投资者造成损失的应由基金管理人和基金托管人依照法律法规及托管协议的规定予以承担。本基金合同的当事人应将按照以下约定的原则处理基金估值差错。

(1) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成的损失由差错责任方承担；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，由此造成或扩大的损失由差错责任方和未更正方根据各自的差错程度分别各自承担相应的赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

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

(3) 因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责，如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失，则差错责任方应当要求获得不当得利的当事人返还不当得利。

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人原因造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人原因造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，由基金管理人负责向差错方追偿。

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

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

#### 4、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

- (1) 查明差错发生的原因，列明所有当事人，根据差错发生的原因确定差错责任方；
- (2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；
- (3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；
- (4) 根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构的交易数据的，基金管理人应要求基金注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认；
- (5) 基金管理人及基金托管人基金资产净值计算错误偏差达到或超过基金资产净值 0.25% 时，基金管理人应当及时通知基金托管人并报中国证监会；错误偏差达到基金资产净值 0.5% 时，基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案。

#### (九) 特殊情形的处理

基金管理人或基金托管人按股票估值方法的第(3)项、债券估值方法的第(7)项或权证估值方法的第(4)项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

由于本基金所投资的各个市场及其登记结算机构发送的数据错误，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但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。

## 二十一、基金费用与税收

### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、证券交易费用；
- 4、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和信息披露费用；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的资金汇划费用；
- 7、按照有关法律法规规定或经中国证监会认定可以从基金资产中列支的其他费用。

### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

在通常情况下，该项费用按前一日的基金资产净值 1.2% 的年费率计提，即本基金的年管理费率为 1.2%。计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付。基金托管人应于次月首日起 10 个工作日内按照基金管理人指令从基金财产中一次性支付。

#### 2、基金托管人的托管费

在通常情况下，该项费用按前一日的基金资产净值 0.2% 的年费率计提，即本基金的年托管费率为 0.2%。计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付。基金托管人应于次月首日起 10 个工作日内按照基金管理人指令从基金财产中一次性支付。

#### 3、上述“（一）基金费用的种类”第 3 至 7 项费用根据有关法规及相应协议规定，按费

用实际支出金额，由基金托管人从基金财产中支付。

### （三）不列入基金费用的项目

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

### （四）费率的调整

基金管理人和基金托管人等可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率或改变收费模式。调高基金管理费率和基金托管费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率和基金托管费率等相关费率或在不提高整体费率水平的情况下改变收费模式，无须召开基金份额持有人大会。

将来法律法规许可的情况下，本基金可以依法提取业绩报酬和/或业绩风险准备金。基金管理人最迟于新的费率实施前 2 日在至少一种指定媒介上予以公告，并报中国证监会备案。

### （五）基金税收

本基金及基金份额持有人应依据国家有关规定依法纳税。

## 二十二、基金收益与分配

### （一）基金收益的构成

- 1、基金投资所得红利、股息、债券利息；
- 2、买卖证券价差；
- 3、银行存款利息；
- 4、其他收入。

因运用基金财产带来的成本或费用的节约计入基金收益。若法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

### （二）基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按照国家有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

### （三）基金收益分配原则

- 1、每一基金份额享有同等分配权。
- 2、基金当期收益弥补上期亏损后，才可进行当期收益分配。
- 3、基金投资当期亏损，则不进行收益分配。
- 4、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年最多不超过 6 次，全年基金收益分配比例不低于基金年度可分配收益的 50%。
- 5、登记在注册登记系统持有人开放式基金账户下的基金份额，可以选择取得现金红利或将所获红利再投资于本基金，投资者选择采取红利再投资形式的，红利再投资部分以除权日的基金份额净值为计算基准，确定再投资份额；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利。

6、登记在证券登记结算系统持有人证券账户下的基金份额的分红方式为现金红利，投资者暂不能选择其他的分红方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。

7、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

#### （四）基金收益分配方案

基金收益方案中应载明基金收益的范围、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

#### （五）基金收益分配方案的确定与公告

本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，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；如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，注册登记机构自动将该基金份额持有人的现金红利按除权日的基金份额净值转为基金份额。

## 二十三、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年度的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、会计制度执行国家有关会计制度；

4、本基金独立建账、独立核算；

5、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；

6、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### （二）基金审计

1、本基金管理人聘请会计师事务所及其注册会计师对基金年度财务报表以及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师应具有从事证券、期货相关从业资格，并与基金管理人、基金托管人相互独立。

2、会计师事务所更换经办注册会计师，须事先征得基金管理人和基金托管人同意，并报中国证监会备案。



3、基金管理人（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，须经基金托管人（或基金管理人）同意，并按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

## 二十四、基金的信息披露

本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露管理办法》及其实施准则、本基金合同及其他有关规定。

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及其日常机构等法律法规、行政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至少一种指定媒介和基金管理人、基金托管人的互联网网站（以下简称“网站”）等媒介披露，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。

（一）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销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

（二）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不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的，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。

（三）基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金产品资料概要

1、《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《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。

3、基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

4、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。

#### （四）集中申购公告

基金管理人应当就集中申购的具体事宜编制集中申购公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

#### （五）基金份额上市交易公告

基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易 2 个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

#### （六）基金净值信息

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次基金份额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者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。（五）基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在《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。

#### （七）基金份额申购、赎回价格

基金管理人应在基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或复制前述信息资料。

#### （八）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

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。

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。

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

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

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。

#### （九）临时报告与公告

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

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

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、基金终止上市交易、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；

15、基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；

17、基金开始办理申购、赎回；

18、基金发生巨额赎回并延期支付；

22、基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；

23、基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

24、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等其他重大事项；

25、基金份额停牌、复牌、暂停上市、恢复上市或终止上市交易；

26、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。

#### （十）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。

#### （十一）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，应当依法报国务院证券监督管理机构备案，并予以公告。

#### （十二）清算报告

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

（十三）本基金投资存托凭证的信息披露依照境内上市交易的股票执行。

（十四）中国证监会规定的其他信息

（十五）本基金在条件成熟的情况下，为方便投资者，可增加信息披露的范围

#### （十六）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，但是其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

基金管理人、基金托管人除按法律法规要求披露信息外，也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度，在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响基金正常投资操作的前提下，自主提升信息披露服务的质量。具体要求应当符合中国证监会及自律规则的相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用，该费用不得从基金财产中列支。

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，供社会公众查阅、复制。

## 二十五、基金合同的变更、终止和基金财产的清算

### （一）基金合同的变更

变更基金合同应召开基金份额持有人大会，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。

但如属于本基金合同第十二条第（一）款规定的不需召开基金份额持有人大会的情形，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布，并报中国证监会备案。

### （二）基金的终止

有下列情形之一的，基金应当终止

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人职责终止，在6个月内没有新基金管理人承接的；
- 3、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金托管人承接的；
- 4、有关法律法规或中国证监会规定的其它情形。

### （三）基金财产的清算

1、基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。

## 2、基金财产清算组

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

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

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

## 3、清算程序

- （1）基金合同终止后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- （2）基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- （3）基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- （4）对基金财产进行评估和变现；
- （5）制作清算报告；
- （6）聘请会计师事务所对基金财产清算报告进行外部审计；
- （7）聘请律师事务所对基金财产清算报告出具法律意见书；
- （8）将基金清算结果报中国证监会备案；
- （9）公布基金清算公告；
- （10）对基金财产进行分配。

## 4、清算费用

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

## 5、基金财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

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

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

## 6、基金财产清算的公告

基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告。

7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十六、违约责任

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

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

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

2、在没有欺诈或过失的情况下，基金管理人由于按照本基金合同规定的投资原则进行的投资所造成的损失等；

3、不可抗力。

（三）基金合同当事人违反基金合同，给其他当事人造成直接损失的，应承担赔偿责任。在发生一方或多方当事人违约的情况下，基金合同能继续履行的，应当继续履行。

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

（五）因第三方原因而导致基金合同一方当事人违约，给其他当事人造成损失的，违约方并不免除其赔偿责任。

## 二十七、争议的处理

（一）本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

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

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

## 二十八、基金合同的效力

（一）本基金合同由《景博证券投资基金基金合同》修订而成。本基金合同经基金管理

人和基金托管人盖章以及双方法定代表人或其授权代表签字，报中国证监会核准后，自景博基金终止上市之日起生效，《景博证券投资基金基金合同》自同一日起失效。

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

（三）本基金合同自生效之日对本基金合同当事人具有同等的法律约束力。

（四）本基金合同正本一式 6 份，报有关监管机构 2 份，基金管理人、基金托管人各持 2 份。每份具有同等的法律效力。

（五）本基金合同可印制成册，供投资者在基金管理人和基金托管人住所查阅，但应以本基金合同正本为准。

## 二十九、业务规则

基金份额持有人应遵守基金管理人或注册登记机构等相关机构制定的相关业务规则及其更新的各项业务规则。

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

## 三十、其他

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

（二）本基金合同如有未尽事宜，由基金合同当事人各方通过中国证监会规定的程序依据有关法律法规和规定协商解决。

## 三十一、基金管理人和基金托管人签章见签署页。



（本页为大成创新成长混合型证券投资基金基金合同签署页，无正文）

基金管理人：大成基金管理有限公司（法人盖章）

法定代表人或授权代表（签字）：

签订地：北京

签订日：           年    月    日

基金托管人：中国农业银行股份有限公司（法人盖章）

法定代表人或授权代表（签字）：

签订地：北京

签订日：           年    月    日