

# 大成內需增長混合型證券投資基金

根據基金管理人與基金託管人訂立的於 2011 年 6 月 14 日起生效的基金合同（經不時修訂）而  
設立  
並根據《中華人民共和國證券投資基金法》受規管的基金

---

## 香港說明文件

---

本文件（以下稱為「香港說明文件」）為大成內需增長混合型證券投資基金（「本基金」）的招募說明書（「招募說明書」）（不時更新）及本基金產品資料概要的補充，為其組成部分且應與其一併閱讀。除本香港說明文件另有規定者外，招募說明書所界定的詞彙應與本香港說明文件具有相同意義。

2020年12月

## 致投資者的重要資料

倘閣下對招募說明書、本香港說明文件或產品資料概要的內容存有疑惑，應諮詢閣下的銀行經理、法律顧問、會計師或其他獨立財務顧問。

大成基金管理有限公司（本基金的基金管理人）就招募說明書、本香港說明文件及本基金產品資料概要所載資料的準確性承擔全部責任，並經作出一切合理查詢後確認，盡其所知所信，並無遺漏其他導致該等文件任何聲明產生誤導的事實。然而，在任何情況下，招募說明書、本香港說明文件或本基金產品資料概要的派發，或提呈發售或發行基金份額概不構成該等文件所載資料截至刊發日期之後任何時間均屬正確的聲明。該等文件或會不時更新。

本基金為根據基金管理人與基金託管人訂立的於 2011 年 6 月 14 日起生效的基金合同（經不時修訂）而設立的開放式合約型的投資基金。本基金已向中國證券監督管理委員會（「**中國證監會**」）註冊，並受中國證監會的持續監管。

本基金已獲香港證券及期貨事務監察委員會（「**證監會**」）根據香港《證券及期貨條例》（「**《證券及期貨條例》**」）第 104 條認可，可向香港公眾人士出售。該項認可並非對本基金作出推介或認可，亦非對本基金的商業價值或表現作出保證，並不表示本基金適合所有投資者，或認可其適合任何特定投資者或類別投資者。

本香港說明文件僅為於香港派發而編製。本香港說明文件載有關於本基金獲認可於香港分銷的額外詳情，必須與本基金的最近期可得招募說明書及產品資料概要一併閱讀。

基金份額僅基於招募說明書、本香港說明文件及產品資料概要（僅在隨附本基金最近期年度報告及（倘隨後刊發）本基金最近期中期報告及季度報告副本時方為有效）所載資料提呈發售。

### 內地與香港基金互認安排（「**基金互認安排**」）

於 2015 年 5 月 22 日，證監會與中國證監會簽署了《關於內地與香港基金互認安排的監管合作備忘錄》（「**備忘錄**」）。備忘錄就互相認可公開發售基金在中國證監會與證監會之間提供框架，致使該等獲認可基金可向兩地市場的公眾人士提呈發售。

根據基金互認安排框架，由中國證監會監管並向中國內地（即中華人民共和國，就本香港說明文件而言，不包括香港、澳門及台灣）的公眾人士提呈發售的證券投資基金，可獲證監會認可，並根據證監會施加的任何其他規定，向香港公眾人士提呈發售。

本基金已向中國證監會註冊及受其監管，並已獲證監會根據基金互認安排的條款而根據《證券及期貨條例》認可。基金互認安排根據以下原則運作：

- a) 本基金符合證監會頒佈的現行合資格規定；

- b) 本基金仍於中國證監會註冊，且獲准向中國內地公眾人士推銷；
- c) 本基金通常根據中國內地相關法律法規及其組成文件（即基金合同）運營及管理；
- d) 於香港出售及分銷本基金須遵守香港的適用法律法規；
- e) 本基金將遵守證監會就規管認可、認可後及持續遵守以及本基金於香港銷售及分銷所頒佈的額外規則；及
- f) 於本基金仍獲證監會認可期間，基金管理人須確保中國內地及香港的基金份額持有人在投資者保障、行使權利、賠償及資料披露方面獲得公平及同等的待遇。

基金管理人確認，中國內地及香港的基金份額持有人將根據上文(f)項所述而獲得公平同等的待遇。

在不損害對中國內地及香港投資者的公平對待原則下，招募說明書所述的若干服務可能無法提供予香港投資者（舉例而言，招募說明書「二十二、對基金份額持有人的服務」一節所載的服務）。香港投資者應向獲授權分銷商查詢有關向香港投資者提供的服務詳情。不同獲授權分銷商就本基金投資所提供的服務或有不同。投資者可向獲授權分銷商了解詳情。

本基金為符合以下資格規定的基金互認安排基金：

- a) 本基金為基金互認安排下的合資格基金類型；
- b) 本基金根據中國內地法律法規及其組成文件而設立、管理及運營；
- c) 本基金為根據《中華人民共和國證券投資基金法》於中國證監會註冊的公開發售證券投資基金；
- d) 本基金已成立超過 1 年；
- e) 本基金最低基金規模不少於人民幣 2 億元或不同貨幣的等價金額；
- f) 本基金並非主要投資於香港市場；及
- g) 售予香港投資者的本基金的基金份額價值不得超過本基金總資產價值的 50%。

基金管理人根據中國內地法律法規於中國內地註冊及運營，且獲中國證監會發牌以管理公開發售證券投資基金。

基金託管人根據中國內地法律法規合資格擔任公開發售證券投資基金的託管人。

獲證監會認可後，倘本基金不再符合證監會不時制訂的規定，基金管理人須立即通知證監會，

且本基金不得繼續向香港公眾人士推銷，亦不得接受新的認購。

投資者務請注意，當向香港投資者出售的本基金的基金份額價值接近上文(g)分段所述的 50% 限額時，本基金應立即以書面形式知會證監會，並暫停認購或採用公平安排以分攤認購指令，直至達到 50%限額為止。在這種情況之下，香港投資者可能面臨無法認購其有意認購的基金份額數目（或根本無法認購任何基金份額）的風險。為免生疑問，即使達到 50%限額，香港投資者仍可繼續於本基金中持有其現有基金份額，且有關基金份額不會被強制贖回。

## 香港代表

香港代表為大成國際資產管理有限公司。香港代表已獲大成基金管理有限公司根據《單位信託及互惠基金守則》（「《守則》」）委任。香港代表的費用（如有）由基金管理人承擔。

### 香港代表的聯絡資料：

地址：香港康樂廣場 1 號怡和大廈 3516 室－3519 室

電話：3765 6788

## 查詢及投訴

投資者如對本基金有任何查詢或投訴，可通過「香港代表」一節所載香港代表的聯絡地址或聯絡電話+852 3765 6788，或電子郵件 enquiry@dcfund.com.hk 聯絡香港代表。

香港代表將於 3 個工作日內，以電話答覆投資者的一般查詢或投訴。

## 其他資料

有關本基金的更多資料（包括發售文件及財務報告、最近期的每基金份額資產淨值及致香港投資者的通知），投資者可瀏覽香港代表的網站 <http://www.dcfund.com.hk>。此網站未經證監會審閱。

## 未獲證監會認可的計劃

就香港發售文件所載的基金而言，只有本基金獲證監會根據《證券及期貨條例》第104條認可向香港公眾人士提呈發售。

**警告：**請注意，香港發售文件提及的其他基金可能未獲證監會認可向香港公眾人士提呈發售。除非《證券及期貨條例》第103條下的豁免適用，否則向香港公眾人士提呈發售未獲證監會認可的任何該等基金屬違法行為。中介機構應對此加以注意。

## 供香港投資者認購的基金份額類別

僅有H類基金份額可供香港投資者認購。香港投資者應注意本香港說明文件披露的H類基金份額的詳情及具體特點。倘招募說明書中有關H類基金份額的任何資料有任何歧義，應以本香港說明文件披露者為準。

H類基金份額以人民幣計值。於首個香港交易日，每H類基金份額的初始價值將定為A類基金份額的每基金份額的現行資產淨值。

H類基金份額每基金份額資產淨值於收市後透過將H類基金份額的資產淨值除以相關香港交易日H類基金份額的總數計算。

H類基金份額買賣將根據下文「香港的交易與結算程序」所載程序進行。

### **變動及通知**

對本基金作出的更改將根據中國內地適用法律法規及本基金組成文件的規定進行。有關更改須獲中國證監會批准或符合中國內地適用程序後方告生效，並且隨後將被提交至證監會存檔，惟倘該等更改根據適用監管規定須獲得證監會的事先批准，則屬例外，包括但不限於(i)有關本基金於基金互認安排下資格的變動，及(ii)只對香港投資者有影響及屬於《守則》第11.1章範圍的變動。

基金份額持有人將根據適用監管規定獲悉有關變動。有關影響香港投資者的變動的通知（英文及繁體中文版本）將刊登於香港代表的網站<http://www.dcfund.com.hk>。此網站未經證監會審閱。

基金管理人應採取合理步驟和措施，以確保本基金的通知及持續資料披露須同時派發和提供予中國內地投資者和香港投資者，惟僅涉及並無於香港提供且與香港投資者無關的本基金的基金份額類別而向中國內地投資者發出，或相關問題不影響香港投資者的任何通知除外。

### **投資目標及策略**

謹請投資者注意招募說明書「八、基金的投資」一節及產品資料概要有關本基金投資的投資目標、策略及其他詳情。有關本基金投資目標和策略的額外資料載於下文，供投資者進一步參考：

本基金的投資目標為透過主要投資於受益於內需增長的行業中的中國內地上市公司，追求基金資產的長期穩健增值。

本基金的投資對象為流動性較好的金融工具，包括中國內地股票（包括創業板、中國內地中小型企業股票及其他經中國證監會核准上市的股票）、存託憑證、債券、權證、股指期貨及法律、法規或監管機構允許的其他金融工具。

本基金股票資產及存託憑證佔基金資產淨值的比例範圍為60%-95%；固定收益類資產和現金投資（例如債券、資產抵押證券及債券反向回購）比例範圍為基金資產淨值的 5%-40%；現金投資（不包括結算備付金、存出保證金、後續應收申購款等）或到期日在一年以內的政府債券的比例不低於基金資產淨值的 5%；權證、股指期貨及其他金融工具的投資比例依照法律法規或監管機構的規定執行；本基金將 80%以上的股票資產及存託憑證投資於受益於內需增長的行

業中的中國內地企業。

在其股票資產投資範圍內，本基金可投資於在深圳證券交易所的中小企業板及／或創業板及／或科技創新板上市的股票的資產淨值部分不受任何限制。

本基金不會投資於任何城投債或未獲評級或獲中國內地信貸評級機構評為 BB+級或以下的任何債務證券。本基金將不投資於資產支持商業票據。

如本基金投資於金融衍生工具（包括權證及股指期貨），該等工具將僅作對沖用途。

有關本基金投資目標及策略詳情，請參閱招募說明書「八、基金的投資」一節。

本基金的總槓桿水平不會超過基金資產淨值的 40%（即資產總值不超過資產淨值的 140%），及僅透過回購交易設置槓桿。

### 使用衍生工具／投資於衍生工具

本基金的衍生工具風險承擔淨額最多可達本基金資產淨值的 50 %。

### 證券借出及／或回購和反向回購交易的額外披露

本基金並不從事證券借出交易。

在符合實現本基金投資目標與策略的最低投資要求及其他適用監管要求的前提下，本基金可進行回購交易（「回購」）及反向回購交易（「反向回購」），分別最多不超過本基金資產淨值的 40% 及 35%。實際上，本基金對反向回購的投資參與可能會有所不同（須受上述限制規限）。

本基金將僅在中國內地的交易所市場及銀行間市場進行「質押」回購／反向回購交易（即用作抵押品的相關債券的擁有權將不會轉移至另一方，原因為相關債券將由證券結算機構託管，直至償付協定的現金款額為止）。若本基金進行回購交易，則本基金將獲得現金（即借入現金）。若本基金進行反向回購交易，本基金將支付現金（即借出現金）。

本基金於回購交易中獲得的現金將主要用於流動性管理及再投資。關於反向回購交易，由於抵押品將由證券結算機構託管持有，抵押品不會進行再投資，而本基金不會將該等抵押品用作其他回購交易的抵押品以獲取現金。

### 中國內地的回購／反向回購

中國的回購／反向回購市場由兩個市場組成：銀行間回購／反向回購市場和交易所買賣回購／反向回購市場，這兩個市場受不同規例監管。銀行間回購／反向回購市場僅向商業銀行、非銀行金融機構（如保險公司、互惠基金及證券公司）及若干非金融機構開放。交易所買賣回購／反向回購市場向商業銀行以外的所有境內投資者開放。

本基金將在銀行間回購／反向回購市場及／或交易所買賣回購／反向回購市場進行回購或反向回購交易。

### 交易所市場

交易所買賣回購／反向回購市場受中國證監會規管。交易所買賣回購／反向回購市場上的交易在上海或深圳證券交易所進行，且透過中國證券登記結算有限責任公司（「中國結算」）結算及交收。該公司擔任所有交易的中央對手方。

若本基金在交易所市場進行回購，本基金將獲得現金並將債券質押予中國結算作為抵押品。對於交易所市場上的反向回購，本基金將向中國結算支付現金，因此會面臨來自中國結算的對手方風險。該交易的對手方將向中國結算借入債券和將債券質押予中國結算作為抵押品。於回購／反向回購交易中質押的抵押品存於由中國結算託管的特定「質押賬戶」。

證券交易所決定可用作抵押品的債券類型，當中可能包括政府債券、地方政府債券及／或中國內地信用評級機構整體給予 AA 或以上評級的企業債券。此外，回購／反向回購交易的抵押品要求及抵押品的適用扣減率均由證券交易所規管。除其他規定外，抵押品每日按市價計值。若抵押品的價值跌至低於擔保金額，相關參與者會被要求交付額外的現金或抵押品，如未能交付，中國結算有權處置現有抵押證券及向違約參與者收取任何未付金額。

### 銀行間市場

銀行間回購／反向回購市場受中國人民銀行規管，在該等市場上進行的交易不同於在交易所買賣回購／反向回購市場上進行的交易。對手方和抵押品要求由個別參與者酌情及商議決定。

在銀行間市場上的回購交易，本基金將獲得現金並將債券質押予對手方作為抵押品。若本基金在銀行間市場進行反向回購，本基金將向對手方支付現金且抵押品將由對手方（借款人）質押予本基金。質押為抵押品的債券在銀行間市場清算所股份有限公司（「上海清算所」）或中央國債登記結算有限責任公司（「中央國債登記結算公司」）的託管下存放於基金賬戶（若本基金進行回購），或對手方的賬戶（若本基金進行反向回購）。

在為任何有關交易選擇對手方時，基金管理人將以應有的審慎行事及進行盡職審查，以確保對手方符合基金託管人和基金管理人議定的審批標準。僅在基金管理人已盡合理努力令其自身信納相關對手方在進行交易時已向本基金提供符合若干標準的抵押品（金額至少等於已出售證券的當前市價）時，才會進行任何有關交易。

倘若本基金在銀行間回購／反向回購市場進行回購或反向回購交易，基金管理人將結合內部評估及外部資格信貸評級，篩選各對手方。採用以下篩選標準：於本基金進行有關交易之日，對手方必須 1)就外部資格信貸評級而言，對手方具有中國人民銀行給予最低為「A」的資格信貸評級；及 2)就內部評估而言，基金管理人將考慮已繳股本、交易量及交易記錄，以評估對手方的信貸質素並向各對手方給予信貸評級。基金管理人對具有不同信貸評級的對手方施加不同的交易限制。基金管理人亦可不時施加其認為恰當的其他篩選標準。

基金管理人設法透過將借貸總額或其他風險限於單一對手方（而非對任何特定貸款進行限制）及在評估各項交易風險時應用一致標準，以減低對手方風險。

### 銀行間反向回購的抵押品安排

倘若本基金在銀行間反向回購市場進行反向回購交易，則採用以下標準。於這些交易中，本基金可接受的抵押品可能包括政府債券、企業債券、政策性銀行債券、商業票據、中期期票及央行匯票。

就作為抵押品的證券而言，基金管理人基於以下標準批准抵押品：

- (a) 抵押品的流動性（基於證券的市場規模）、莊家／交易商的數量、買賣價差、基準價差、交易量及持股集中度；
- (b) 抵押品的市場風險（基於價格波動性及其他相關參數的波動性）；在若干情況下，與被抵押證券的相關度；
- (c) 債務證券的發行人風險（基於發行人的信譽），而由價格波動高的資產所組成的任何抵押品，將採用保守的扣減率（基金管理人就抵押品採用審慎的扣減政策）；
- (d) 抵押品組合多元化，以避免將風險集中於任何單一發行人，且持有任何抵押品須受本基金的投資限制規限；
- (e) 將避免對手方與收到的抵押品有關聯。

與交易所市場上的反向回購交易不同的是，抵押品不會每日按市價計值。銀行間市場反向回購交易的年期視乎基金管理人對市況的觀點而變動。

#### 源自交易及關連方交易的收入

所產生的任何增加收入將在扣除操作或管理有關交易的各方（例如證券交易所及結算機構）收取的任何費用後，記入本基金賬戶。

回購／反向回購交易可透過基金管理人、基金託管人或他們的關連人士進行，在有關情況下，各方（視情況而定）有權按商業基準保留一筆費用，惟所有交易須按公平及所獲得的最佳條款執行（即費用不得高於規模和性質相同的交易的現行市場費率），以及定期在本基金的年度報告中披露應付予上述各方的有關費用。

如上述證券借出、回購及反向回購交易政策有變，將事先尋求監管批准，並事先向基金份額持有人發出不少於一個月的通知。

#### **風險因素**

投資者應參閱招募說明書「十八、風險披露」一節，以了解與本基金投資相關的風險及以下有關投資於本基金的風險的額外資料：

##### **1. 有關基金互認安排的風險**

- **額度限制：**內地與香港基金互認安排（基金互認安排）計劃受一項整體額度限制所規限。若該額度用盡，本基金可能隨時暫停接受基金份額的認購。
- **未能達到合資格規定：**如本基金不再符合基金互認安排下的任何合資格規定，可能不得接受任何新認購。在最壞的情況下，證監會可能甚至就違反合資格規定撤銷其對本基金在香港進行公開發售的認可。並無保證本基金可以持續符合有關規定。
- **中國內地稅務風險：**現時於兩地基金互認計劃下，本基金及／或其位於香港的企業及個人投資者可獲若干稅務寬減及豁免。無法保證該等寬減及豁免或內地稅務法律及法規不會改變。倘現行寬減及豁免以及相關法律及法規有任何變更，可能會對本基金及／或其投資者產生不利影響，彼等可能因而蒙受重大損失。
- **不同市場慣例：**中國內地與香港的市場慣例可能有所不同。此外，本基金與在香港發售的其他公眾基金在操作安排上可能在若干方面有所不同。例如，本基金基金份額的認購或



贖回可能只在中國內地及香港均開市的日子方可處理，或可能於截止時間或交易日的安排上與其他證監會認可基金不同。投資者應確保其了解這些差異及相關影響。

## 2. 投資風險

- 本基金為投資基金。概不保證償還本金或支付股息或分派。此外，概不能確保本基金能達成其投資目標，亦不能保證能成功實行所述策略。
- 本基金投資於股本證券，該等證券的價值可能下跌。投資者可能因而蒙受損失。本基金並不保本，購入其基金份額並不同於直接投資於股本證券。
- 本基金亦投資於債務證券，該等證券的價值可能下跌。投資者可能因而蒙受損失。本基金並不保本，購入其基金份額並不同於直接投資於債務證券或將人民幣資金存放於銀行作為存款。

## 3. 巨額贖回風險

巨額贖回本基金中的基金份額可能需要基金管理人迅速將本基金的投資變現，這可能對基金資產淨值產生不利影響，且在最壞情況下，可能導致贖回過程暫停或延遲。根據中國內地的法規，倘若發生持續巨額贖回情況，贖回所得收益的支付可延遲不超過20個工作日。

## 4. 集中風險／中國內地市場風險

- 本基金主要投資於中國內地市場有關的證券，可能面對額外的集中風險。投資於中國內地市場可能會產生不同的風險，包括政治、政策、稅務、經濟、外匯、法律、監管及流動性風險。

## 5. 人民幣的貨幣及兌換風險

- 人民幣現時不能自由兌換並受外匯管制和限制。
- 以非人民幣為基礎的投資者需承擔外匯風險，並不保證人民幣兌換為投資者的基本貨幣（例如：港元）的價值不會貶值。人民幣的任何貶值可對投資者於本基金的投資價值構成不利影響。
- 由於外匯管制和適用於人民幣的限制，投資者於贖回投資及／或派發股息時未必能收取人民幣，或有關款項可能延遲支付。

## 6. 中國內地股票風險

- **市場風險**：本基金投資股本證券時面臨一般市場風險，投資價值或因各種因素而波動，例如投資情緒、政治和經濟環境變動及發行人的特定因素。本基金的股票投資集中於受惠於內需增長的行業。中國經濟能否持續增長及發展的不確定性可能對依賴內需增長的行業造成重大影響。這可能導致本基金資產淨值大幅波動。
- **波動風險**：中國內地股票市場的高市場波動及潛在結算難題亦可能導致在該等市場交易

的證券在價格上大幅波動，從而對本基金價值產生不利影響。

- **政策風險：**中國內地的證券交易所一般有權暫停或限制在相關交易所交易之任何證券的買賣。政府或監管部門亦可能實施可能影響金融市場的政策。上述所有因素均可能對本基金構成負面影響。
- **與小型／中型公司相關的風險：**相對於較大型的公司，一般而言，小型／中型公司股票의流通性可能較低，其價格在不利經濟發展情況下亦更為波動不定。
- **高估值風險：**在中國內地證券交易所上市的股票의市盈率可能較高；而有關高估值未必能持續。
- **流動性風險：**中國內地證券市場的流動性可能低於其他已發展市場。若本基金在有意出售投資時無法售出，則可能蒙受重大損失。
- **與存託憑證相關的風險：**本基金可投資於存託憑證。中國內地存託憑證或須承受較高波動性、存託憑證發行人的違約風險、因多地上市造成存託憑證價格差異，以及中國內地與境外法律制度及監管環境差異導致的其他風險。

## **7. 與中小企業板、創業板及/或科技創新板相關的風險**

- **股價及流動性風險的波動較高：**中小企業板、創業板及/或科技創新板的上市公司通常為新興性質，經營規模較小。尤其是相對於其他股票市場，科技創新板的上市公司的價格波動更大，且因投資者准入門檻較高而可能導致流動性受限制。因此，相對於在主板上市的公司，中小企業板公司的股價及流動性風險的波動較高，且風險及轉手率亦較高。
- **估值過高風險：**在中小企業板、創業板及/或科技創新板上市可能估值過高，而該等極高估值未必能持續。由於流通股份較少，股價可能較易被操縱。
- **監管差異：**有關創業板及科技創新板上市公司在盈利能力及股本方面的規則和法規較主板及中小企業板的相關規則和法規寬鬆。
- **摘牌風險：**在中小企業板上市的公司被除牌可能更為普遍及快速。如果本基金投資的公司被除牌，本基金可能會受到不利影響。特別是，科技創新板的摘牌準則較其他股票市場更為嚴格。在中小企業板上市的公司被除牌可能更為普遍及快速。如果本基金投資的公司被除牌，本基金可能會受到不利影響。
- **集中風險：**科技創新板為新設股票市場，初期上市公司的數量較少。於科技創新板的投資可能集中於少量股票，導致本基金的集中風險較高。

投資於中小企業板、創業板及/或科技創新板可能導致本基金及其投資者蒙受重大損失。

## **8. 中國內地債務證券風險**

- **波動性及流動性風險：**相對於發展較成熟的市場，中國內地債務證券市場可能面對較高波動性及較低流動性。於該等市場交易之證券的價格或須承受波動。
- **對手方風險：**本基金面對本基金所投資債務證券發行人的信貸／違約風險。
- **利率風險：**投資本基金將面對利率風險。一般而言，利率降，債務證券的價格則升；利率升，債務證券的價格則跌。

- **評級下調風險：**債務工具或其發行人的信用評級可能隨後遭下調。如評級遭下調，本基金價值可能會受到不利影響。基金管理人未必能出售評級遭下調的債務工具。
- **信用評級機構風險：**中國內地的信用評估制度及在中國內地所使用的評級方法可能有別於其他市場所採用者。因此，中國內地評級機構所給予的信用評級或許無法與其他國際評級機構所給予的評級進行直接比較。
- **資產支持證券的相關風險：**本基金可能投資於資產支持證券，該等證券可能非常缺乏流動性，且價格容易大幅波動。相對於其他債務證券，該等工具可能承受更高的信貸、流動性及利率風險。該等證券往往面臨延期及提前還款的風險，以及與相關資產有關的支付義務無法完成的風險，因而可能對證券的回報產生不利影響。

## 9. 回購 / 反向回購交易的相關風險

- **回購交易風險：**基金管理人可為本基金進行回購交易。就回購交易而言，在對方手違約後，本基金可能遭受重大損失，因為在收回質押於對手方的抵押品的過程中可能會出現延誤及困難，或由於抵押品估值不足及市場走勢而導致原本收取的現金可能少於質押於對手方的抵押品。
- **反向回購交易風險：**基金管理人可為本基金進行反向回購交易。在銀行間市場反向回購交易項下質押的抵押品可能不按市價計值。此外，在進行反向回購交易時，在對手方違約後，本基金可能遭受重大損失，因為在收回所存放現金或變現抵押品的過程中可能會出現延誤及困難，或由於抵押品估值不足及市場走勢而導致出售抵押品所得收益可能少於存放於對手方的現金。

## 10. 啟用側袋機制的風險

- 當本基金啟用側袋機制時，實施側袋機制期間，側袋帳戶將停止披露基金份額淨值，並不得辦理側袋帳戶基金份額的申購和贖回。因特定資產的變現時間具有不確定性，最終變現價格也具有不確定性並且有可能大幅低於啟用側袋機制時的特定資產的估值，基金份額持有人可能因此面臨損失。

## 11. 稅收風險

- 投資者應注意，投資、持有或處置本基金中的基金份額時，有關所產生的收入及收益的潛在稅項責任的稅務狀況及稅項風險存在特定不確定性。本基金的稅收法規及／或稅務撥備政策出現變動，將會影響本基金餘下的投資者。在出現有關變動前已出售或贖回其權益的投資者將不受影響。視乎出售基金份額所得收益及本基金的分派會否及最終如何被徵稅以及投資者何時投資於本基金，投資者可能得利或失利。有關於中國內地稅收制度及FATCA的若干風險，進一步詳述於下文標題為「稅收」一節。

## 12. 從資本中作出分派的風險

- 本基金可從資本中或實際上從資本中作出分派。投資者應注意，從資本中或實際上從資本中支付分派，相當於退回或提取部分其原本投資的金額或歸於該金額的任何資本收益的一部分。涉及從資本中或實際上從資本中支付股息的任何分派，均可能會導致每個基金份額的資產淨值即時減少。

## 香港的交易與結算程序

就香港投資者而言，本基金的最低首次投資額、最低其後投資額、最低贖回量及最低持有量的詳情載列如下：

最低首次投資額	最低其後投資額	最低贖回量	最低持有量
人民幣 1,000 元	人民幣 1,000 元	不適用	不適用

儘管招募說明書有所披露，就在香港透過香港代表或獲授權分銷商的基金份額交易而言，「**香港交易日**」應指(1)上海證券交易所及深圳證券交易所的正常交易日及(2)銀行於當日開門辦理一般銀行業務的香港工作日。倘由於發出8號颱風訊號、黑色暴雨警告訊號或其他類似事件，致使中國內地證券交易所或香港銀行於任何日子的營業期間縮短，則該日不應視作香港交易日，除非基金管理人另有決定，則作別論。

在香港認購及贖回基金份額於每個香港交易日進行，但下文「資產淨值」一節「估值和交易暫停」標題下所載本基金的基金份額暫停估值和交易的期間除外。

### 認購程序

香港投資者的申請可交給香港代表，香港代表則將申請轉交予基金管理人。

為購買本基金的基金份額，投資者應填妥並交回可從香港代表處取得的申請表格。香港代表將確保將不遲於香港交易日下午3時正（香港時間）收取的已填妥申請表格於同日轉交予基金管理人辦理；於下午3時正（香港時間）後或非香港交易日當日收到的申請，將於下一個香港交易日轉交予基金管理人辦理。

在香港代表酌情決定下，可由香港投資者以傳真方式或由申請表格中指定為獲授權人士的人士以電子通訊方式認購基金份額，惟須於上述交易截止時間前進行。

倘以傳真或電子通訊方式申請認購基金份額，則將會要求提供有關申請的表格正本。

香港代表將在兩個香港交易日內通知投資者認購申請情況。倘認購申請獲接納，將於有關申請後兩個香港交易日當日的收市時向基金份額持有人配發基金份額。

此外，認購申請亦可向香港獲授權分銷商提出。投資者應就適用於透過有關分銷商進行交易的交易程序諮詢分銷商。獲授權分銷商可就收取認購指示實施較早的交易截止時間。投資者應注意有關獲授權分銷商的安排。

出現市場事件後，認購及交易截止日安排亦會因此有所變動。投資者應向香港代表或獲授權分

銷商查詢有關安排。

獲配發之基金份額數目將在考慮認購費後參考收妥（不遲於下午3時正（香港時間））及接受相關認購申請之香港交易日的每個基金份額資產淨值計算。請參閱「費用及開支」一節了解進一步詳情。

香港投資者不得將本基金轉換為未獲證監會認可的任何其他投資基金。

### **贖回程序**

有意要求贖回其於本基金持有的全部或任何部分基金份額的香港基金份額持有人，可（以規定方式）向香港代表提交其贖回指示。香港代表將確保將不遲於任何香港交易日下午3時正（香港時間）收取的贖回申請於同日轉交予基金管理人辦理。於下午3時正（香港時間）之後或於非香港交易日的日子所收取的贖回申請將於隨後的香港交易日轉交予基金管理人辦理。

在香港代表酌情決定下，可由香港投資者以傳真方式或由贖回表格中指定為獲授權人士的人士以電子通訊方式贖回基金份額，惟須於上述交易截止時間前進行。

倘以傳真或電子通訊方式贖回基金份額，則將會要求提供有關贖回申請的表格正本。

香港代表將在兩個香港交易日內通知投資者贖回申請情況。倘贖回申請獲接納，基金份額將被視為於有關贖回要求後兩個香港交易日當日的收市時予以贖回。

此外，投資者可透過其獲授權分銷商進行交易以贖回基金份額。投資者應就適用於透過有關分銷商進行交易的交易程序諮詢分銷商。獲授權分銷商可就收取贖回指示實施較早的交易截止時間。投資者應注意有關獲授權分銷商的安排。

出現市場事件後，贖回及交易截止日安排亦會因此有所變動。投資者應向香港代表或獲授權分銷商查詢有關安排。

支付的贖回收益將在考慮到贖回費後參考收妥（不遲於下午3時正（香港時間））及接受相關贖回申請之香港交易日的每個基金份額資產淨值計算。請參閱「費用及開支」一節了解進一步詳情。

### **結算**

認購股款必須於申請時以人民幣支付。倘以任何其他貨幣付款，則香港代表可於認購申請於香港交易日轉交基金管理人前酌情安排必要的外匯交易（按現行市場匯率，即銀行於貨幣兌換的相關時間採用的市場匯率）。所有銀行費用將均由申請人承擔。

任何款項均不應支付予並非依據《證券及期貨條例》第V部獲發牌或註冊進行第1類（證券交易）受規管活動的任何香港中介人。

贖回所得款項通常將於香港代表收妥完成贖回所必要的文件的7個香港交易日內以電匯方式向已登記基金份額持有人以人民幣支付。

請注意，贖回所得款項的支付可能因招募說明書所載的情況而延遲。投資者請注意招募說明書“七、基金的申購與贖回”一節以及“十七、側袋機制”一節所載有關延遲支付贖回金額的披露。倘延遲支付贖回所得款項，支付贖回所得款項的延長時間應反映因特定情況而所需的額外時間，贖回所得款項將在實際可行情況下盡快支付予基金份額持有人。根據中國內地規例，如出現持續巨額贖回情況，贖回所得款項付款可延遲不多於 20 個工作日。

建議透過獲授權分銷商買賣基金份額的投資者自有關獲授權分銷商取得結算資料。

### **資料的更改及反洗黑錢查核**

倘基金份額持有人申請表格中所載資料或基金份額持有人個人資料或詳情有任何變更，基金份額持有人應以書面形式知會香港代表（其將繼而知會基金管理人）任何有關變更，並向香港代表提呈香港代表或基金管理人可能要求的有關變更的其他文件。

倘延遲或未能提呈核實身份或認購款項合法性所需的任何文件或資料，則基金管理人、基金託管人及／或香港代表可拒絕接納申請及有關該項申請的認購款項。此外，倘基金份額持有人延遲提呈或未能提呈為核實身份所需的任何文件或資料，則基金管理人、基金託管人及／或香港代表可延遲支付任何贖回所得款項，且如彼等任何一人懷疑或獲告知(i)有關付款可能導致任何人士違反或觸犯任何有關司法管轄區任何反洗黑錢法律或其他法律或法規；或(ii)有關拒絕對確保遵守任何有關司法管轄區任何有關法律或法規而言屬必要或合適，則可拒絕向基金份額持有人付款。

### **代名人安排及基金份額持有人大會**

香港投資者將透過相關獲授權分銷商或香港代表（視乎情況而定）持有本基金的基金份額。因此，獲授權分銷商或香港代表（視乎情況而定）將擔任代名人，並將獲基金註冊登記機構記錄為相關基金份額的持有人（各稱「代名人賬戶持有人」）。因此，相關投資者將不會被記錄為相關基金份額的持有人。

預期代名人賬戶持有人會記錄其代為於本基金持有基金份額的相關持有人。

由於代名人安排，代名人賬戶持有人將於本基金的名冊記錄為持有人，並將有權行使作為基金份額持有人（而非個人相關投資者）的權利，包括但不限於投票權、針對基金管理人及基金託管人採取法律行動的權利。

基金管理人將向代名人賬戶持有人傳達所有基金份額持有人大會的詳情，如大會日期、時間及有關本基金的決議案，而預期代名人賬戶持有人將繼而盡快知會香港基金份額持有人有關詳情及投票安排。香港投資者可透過向代名人賬戶持有人作出指示進行投票。代名人賬戶持有人將綜合基金份額持有人的投票指示，並將有關投票指示提呈基金管理人。該等指示將根據基金合

同條款予以處理。

投資者必須遵守相關代名人賬戶持有人規定的安排及截止日期，以參與基金份額持有人大會的投票流程。

香港投資者應考慮上述內容，並了解因以代名人安排的方式持有基金份額而造成的差異。尤其是，香港投資者將透過代名人行使其在本基金中的權利，而直接持有基金份額的中國內地投資者則有權直接行使其在本基金中的權利。

## 資產淨值

### 公佈每個基金份額的資產淨值

根據招募說明書「十六、基金的信息披露」一節，每個基金份額的資產淨值須於每個香港交易日在香港代表網站[www.dcfund.com.hk](http://www.dcfund.com.hk)公佈。投資者應注意，此網站未經證監會審閱。

### 估值和交易暫停

根據「七、基金的申購與贖回」一節及在該節所描述的情況下，有關暫停釐定基金資產淨值及暫停申購或贖回本基金的基金份額的事宜，將於實際可行情況下在香港代表網站<http://www.dcfund.com.hk>盡快公佈。有關暫停或延遲本基金交易的事宜，若須知會中國證監會，亦應相應知會證監會。上述網站未經證監會審閱。

## 分派

香港投資者應注意招募說明書「十四、基金收益與分配」一節，以了解適用於 H 類基金份額的分派政策。

請注意，基金管理人將可酌情釐定(i)作出分派的次數及時間；及(ii)會否從相關 H 類基金份額應佔資本中作出分派以及分派的程度。

倘宣派股息，將會按基金管理人酌情決定的時間支付（目前每曆年不超過 6 次，或按基金管理人酌情決定的其他次數）。

本基金可能從資本中作出分派。本基金亦可從總收入支付分派，並將其全部或部分費用及開支記入本基金的資本，或從本基金的資本中支付其全部或部分費用及開支。若從總收入中支付分派，而本基金將其全部或部分費用及開支記入資本或從資本中支付，將導致本基金可用於支付分派的可供分派收入增加，因此本基金可能實際上從資本中支付分派。

投資者應注意，從資本中或實際從資本中派付股息，相當於並構成退回或提取部分原本投資的金額或歸於該原本投資的任何資本收益。這可能會導致每個 H 類基金份額的資產淨值即時減少，且會導致有關 H 類基金份額的基金份額持有人的任何資本升值下降。請亦參閱「風險

因素」一節中「從資本中作出分派的風險」所提述的風險因素。

過去 12 個月 H 類基金份額分派（如有）的組成成分（即從可分派淨收入及資本中支付的相關金額）可向香港代表索取及在其網站 <http://www.dcfund.com.hk> 查閱。此網站未經證監會審閱。

在獲事先監管批准下，並透過向香港基金份額持有人發出不少於一個月的事先通知後，基金管理人可修改有關從 H 類基金份額資本中或實際上從資本中支付分派的分派政策。

## 費用及開支

投資者應參閱招募說明書「十三、基金的費用與稅收」一節，了解本基金適用的費用及開支。

此外，儘管招募說明書有所披露，但 H 類基金份額將繳納本節所載明的不同標準的認購費及贖回費。

認購 H 類基金份額須繳納最高為認購所得款項總額 5.00% 的認購費。認購費將由基金管理人保留，基金管理人可酌情與分銷商及中介機構分攤此費用。認購費的說明例子載於下文以供參考：

例子：假設投資者投資人民幣 40,000 元認購 H 類基金份額，適用的認購費率為 5.00%，同一香港交易日 H 類基金份額的資產淨值為人民幣 1.040 元，則基金份額的數目按下列方式計算：

$$\text{認購所得款項淨額} = \text{人民幣 } 40,000 \text{ 元} / (1 + 5.00\%) = \text{人民幣 } 38,095.24 \text{ 元}$$

$$\text{認購費} = \text{人民幣 } 40,000 \text{ 元} - \text{人民幣 } 38,095.24 \text{ 元} = \text{人民幣 } 1,904.76 \text{ 元}$$

$$\text{所認購基金份額的數目} = \text{人民幣 } 38,095.24 \text{ 元} / \text{人民幣 } 1.040 \text{ 元} = 36,630.04 \text{ 個基金份額}$$

因此，在上述例子中，投資者透過投資人民幣 40,000 元收到 36,630.04 個 H 類基金份額。

贖回 H 類基金份額須繳納贖回所得款項總額 0.13% 的贖回費。贖回費將由本基金保留。贖回費的說明例子載於下文以供參考：

例子：假設投資者從本基金中贖回 10,000 個基金份額，同一香港交易日基金份額的資產淨值為人民幣 1.050 元，則須向投資者支付的贖回所得款項按下列方式計算：

$$\text{基金份額價值總額} = \text{人民幣 } 1.050 \text{ 元} * 10,000 = \text{人民幣 } 10,500 \text{ 元}$$

$$\text{贖回費} = \text{人民幣 } 10,500 \text{ 元} * 0.13\% = \text{人民幣 } 13.65 \text{ 元}$$

$$\text{贖回所得款項淨額} = \text{人民幣 } 10,500 \text{ 元} - \text{人民幣 } 13.65 \text{ 元} = \text{人民幣 } 10,486.35 \text{ 元}$$

因此，在上述例子中，投資者就所進行的贖回收取人民幣 10,486.35 元。

有意投資者應注意招募說明書「十三、基金的費用與稅收」一節所載與本基金相關的費用及開



支的詳情。

## 稅收

有關可能稅務影響的更多資料，投資者可參閱招募說明書。投資者應自行了解及在適當時，就根據其公民身份、居住地，或居駐或註冊成立所在國家的法律認購、買入、持有、轉換、贖回或以其他方式處置基金份額的可能稅務後果，諮詢其專業顧問。

## 中國內地

### **(a) 投資者的稅務**

中國財政部、國家稅務局及中國政監會於2015年12月18日共同發表《財稅[2015]125號文》（「公告」），訂明於兩地基金互認計劃下，香港企業及個人投資者對內地證券投資基金（「獲認可內地基金」）所作投資的內地稅項，現載列如下：

企業所得稅及個人所得稅：

香港企業或個人投資者透過出售獲認可內地基金單位而變現的資本收益分別獲暫時豁免企業所得稅及個人所得稅。香港企業及個人投資者自獲認可內地基金收取的分派分別暫時無須繳納企業所得稅及個人所得稅。

增值稅（「增值稅」）：

中國內地於2016年3月23日頒佈財稅[2016]36號（「36號通知」），公佈將推出營業稅改徵增值稅的試點計劃，並涵蓋計劃的所有餘下行業，包括金融服務業，由2016年5月1日起生效。

香港投資者（企業及個人投資者）從獲認可內地基金所變現的出售收益獲豁免繳付增值稅。

印花稅：

香港企業或個人投資者認購、贖回、買賣、轉讓或繼承獲認可內地基金單位暫時無須繳付內地印花稅。

### **(b) 內地證券投資基金的稅務**

企業所得稅及個人所得稅：

根據《財稅[2008]1號文》，內地證券投資基金透過證券市場變現的收入（包括透過買賣股票及債券而變現的資本收益、股息、分派、債券票息及其他收入）暫時獲豁免繳付企業所得稅。

根據《財稅[2002]128號文》，上市公司及債券發行人向內地證券投資基金派付股息或利息時應預扣20%個人所得稅。然而，公告中訂明，內地上市公司及債券發行人向獲認可內

地基金分派的股息及利息時，須按兩地基金互認計劃下香港投資者應佔的股息及利息比例分別預扣10%及7%所得稅。內地上市公司及債券發行人應向負責的內地稅務機構呈報及結清預扣所得稅。

#### 增值稅及地方附加稅：

根據中國現行稅收法規，除非法律及法規另有明確豁免，否則在經營資產管理產品（包括中國內地證券投資基金）期間進行的增值稅應課稅活動，將暫時以簡易增值稅計算方法按3%稅率徵稅，自2018年1月1日起生效。

根據36號通知，中國內地證券投資基金（包括封閉式及開放式證券投資基金）的基金管理人自買賣股份及債券所變現的資本收益獲豁免繳付增值稅。根據36號通知及財稅[2016]70號，中國內地證券投資基金自政府債券及金融機構於銀行間或交易所市場發行的債券所得的利息獲豁免繳付增值稅。然而，該豁免嚴格上並不適用於自上文所述外的債券所得之利息。因此，自上文所述外的債券所得之利息收入將須繳付3%的增值稅。

此外，城市維護建設稅（現時稅率介乎1%至7%）、教育費附加（現時稅率為3%）及地方教育附加費（現時稅率為2%）（統稱為附加稅）乃根據增值稅責任徵收。

#### 印花稅：

此外，出售A股及B股（「內地股票」）須繳付所得款項總額0.1%的內地印花稅。然而，購買內地股份無須支付中國印花稅。

近年內地政府實施多項稅務改革措施，現行稅務法律及法規可能於將來修改或修訂。無法保證現行稅務寬減及豁免不會取消。

倘若稅務政策出現變動，本基金所投資內地公司的稅後利潤可能會減少，從而令該等投資的回報及／或基金單位的價值下降。內地現行法律、法規及慣例亦有可能於未來作出具追溯力的變動。該等變更可能影響本基金及／或投資者的稅務狀況，並對本基金的資產淨值產生重大不利影響，導致投資者蒙受重大損失。投資者出售基金單位所得收益及本基金分派最終會否被徵稅及如何被徵稅，以及何時投資本基金，將決定對投資者有利或不利。

投資者應就其獲認可內地基金的投資自行尋求有關內地稅務意見。

## **香港**

### **本基金**

#### 利得稅：

根據香港現行法例及慣例，在本基金維持獲證監會根據《證券及期貨條例》第104條認可的期間，預期無需繳納因進行招募說明書及本香港說明文件所述的活動而產生的任何香港利得稅。

#### 印花稅：

出售、購買香港股票及變更其實益擁有權均應繳納香港印花稅。「香港證券」指其轉讓須於香港登記的「證券」。倘本基金不投資香港證券，則毋須繳納香港印花稅。

### 基金份額持有人

利得稅：

倘購買及贖回基金份額屬於或構成在香港經營的貿易、專業或業務的一部分，則相關基金份額持有人所變現的收益可能須繳納香港利得稅（就法團而言，現行稅率為16.5%；就個人或非法團業務而言，稅率為15%）。

根據香港現行法例及慣例，基金份額持有人將毋須就自本基金所獲取的分派或出售任何基金份額而變現的資本收益繳納任何香港稅項。

印花稅：

轉讓香港股票須繳納香港印花稅。「香港證券」指其轉讓須於香港登記的「證券」。

倘基金份額持有人的名冊保存於香港以外，則出售、購買、轉讓、發行或贖回基金份額毋須繳納印花稅。此外，倘贖回或轉讓基金份額的方式為將基金份額重新轉讓予基金管理人而基金管理人隨後註銷有關基金份額或向另一位人士轉售基金份額，則毋須繳納香港印花稅。

倘基金份額持有人的名冊保存於香港，基金份額持有人進行其他種類的基金份額出售或購買或轉讓，須按對價或市值（以較高者為準）的0.1%繳納香港印花稅，印花稅由買賣雙方承擔。

### 海外賬戶稅收合規法

經修訂的《1986年美國國內收入法》（「**美國國內收入法**」）第1471至1474節（稱為《海外賬戶稅收合規法》或「**FATCA**」）就若干向非美國人士（如本基金）作出的付款（包括來自美國發行人的證券利息及股息，以及銷售該等證券的所得款項總額）實施規則。除非有關付款的收款人符合若干旨在令美國國家稅務局（「**美國國家稅務局**」）識別在該等付款中擁有權益的美國人士（按美國國內收入法的涵義）的規定，否則可能需就所有有關付款按30%稅率繳付預扣稅。為避免就向其作出的付款繳付預扣稅，海外金融機構（「**海外金融機構**」）如本基金（以及通常包括於美國境外組成的其他投資基金）一般將須於美國國家稅務局登記以獲取全球中介機構識別號碼（「**GIIN**」）並與美國國家稅務局訂立協議（「**海外金融機構協議**」）。根據有關協議，海外金融機構同意識別其身為美國人士的直接或間接賬戶持有人，並向美國國家稅務局申報有關該等美國賬戶持有人的若干資料。

一般而言，如海外金融機構並無訂立海外金融機構協議或並非另行獲得豁免，將須就所有源於美國的「可預扣付款」（包括於2014年7月1日或之後作出的股息、利息及若干衍生性付款）支付30%的懲罰性預扣稅。此外，由2019年1月1日起，所得款項總額，例如來自產生美國來源股

息或利息的股票及債務責任的銷售所得款項及本金返還，將被視作「可預扣付款」。

許多政府已經或將會與美國國家稅務局訂立跨政府協議（跨政府協議）。截至本香港說明文件日期，中國政府尚未與美國訂立跨政府協議，但實質上已商討此協議，並被加入被視為已訂立跨政府協議的國家名單內。

截至本香港說明文件日期，基金管理人已向美國國家稅務局登記為本基金的保薦實體，並已取得GIIN及同意（作為保薦實體）為遵守FATCA而履行一切盡職審查、預扣、申報及其他相關FATCA規定。本基金將倚賴基金管理人以遵守FATCA下的義務。

本基金及基金管理人將竭力符合根據FATCA所施加的規定，以避免任何預扣稅。如果本基金未能遵從FATCA所施加的規定，而本基金因不合規而須就其投資繳納美國預扣稅，則基金資產淨值可能受到不利影響，且本基金可能因而蒙受重大損失。

各基金份額持有人及有意投資者應就FATCA在其本身的稅務情況下的潛在影響諮詢其本身稅務顧問。

## 報告

根據招募說明書「十六、基金的信息披露」一節，本基金的經審核年度報告（載有財務報表）、未經審核中期報告及季度報告應提供予每名基金份額持有人。本基金的年度報告將於每年的最後日期後三個月內提供。本基金的中期報告將於上半年的最後日期後兩個月內提供。本基金的季度報告將於季度的最後日期後 15 個工作日內提供。

年度報告摘要及半年度報告摘要於中國內地刊發之時同時可提供予基金份額持有人（透過下文所載的香港代表的網站）。

向香港投資者提供的財務報告將根據基金互認安排項下須向香港投資者提供的額外資料（或證監會不時規定的其他資料）補充。

上述報告（包括財務報告摘要）一經備妥，基金份額持有人將獲告知。所有上述報告（包括財務報告摘要）將以電子形式於香港代表的網站<http://www.dcfund.com.hk>提供。此網站未經證監會審閱。該等報告（包括財務報告摘要）亦可在香港代表註冊辦事處查閱。

## 可提供予投資者的文件

本基金的發售文件及持續資料披露（包括通知及財務報告）須同時提供予中國內地投資者和香港投資者，惟僅就並無於香港提供及與香港投資者無關的本基金的基金份額類別而發行的致中國內地投資者的任何通知，或僅關於對香港投資者並無影響的事項的任何通知，則屬例外。

下列文件於平日（不包括星期六及公眾假期）正常辦公時間內在香港代表註冊辦事處可供免費查閱：

- i. 中國證監會批准本基金發售的文件
- ii. 經不時修訂之本基金的基金合同；
- iii. 招募說明書提述的託管協議；
- iv. 在中國證監會註冊的本基金的招募說明書、本香港說明文件及產品資料概要（經不時修訂）；
- v. 上一節「報告」中的本基金財務報告（包括財務報告摘要）；
- vi. 法律意見書（由中國內地律師發出）；
- vii. 香港代表協議；
- viii. 致香港投資者的本基金通告；
- ix. 招募說明書所載可供公眾查閱的其他文件。

(i)、(ii)、(iii)、(v)、(vi)及(ix)項僅提供簡體中文版本。(iv)及(viii)項所載文件僅提供英文及繁體中文版本。(vii)項僅提供英文版本。

投資者可藉向香港代表提交書面要求索取有關(ii)及(v)項英文及／或繁體中文版本的特定資料。香港代表將在切實可行範圍內盡快回應該要求。

(iv)及(v)項所載文件的副本亦可在香港代表的註冊辦事處免費索取。上文所載的其他文件的副本可在支付合理費用後在香港代表的註冊辦事處索取。

至於第(iv)項，本基金招募說明書應根據中國內地適用法律法規進行更新；而香港說明文件及產品資料概要將在必要時更新以反映有關更改。

與本基金有關的通知（第(viii)項）將在香港代表的網站<http://www.dcfund.com.hk>刊登。此網站未經證監會審閱。

# 大成內需增長混合型證券投資基金更新 招募說明書

此（等）報告並不構成購買組成本文件內容的任何基金份額之邀請。

只有基於現時招募說明書及香港說明文件（或同等文件）及最近之財務報告（如有）所作之認購方為有效。本招募說明書可能包含本基金若干並未獲認可在香港發售或分銷之份額類別。投資者應注意，本招募說明書內若干資料以綜合方法表述，因此當中包括並未在香港註冊的份額類別之資產。

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金託管人：中國銀行股份有限公司

二〇二四年八月

大成內需增長混合型證券投資基金（“本基金”）

更新招募說明書

向香港投資者提供的資料

本基金乃依據中港基金互認安排已獲香港證券及期貨事務監察委員會（下稱“香港證監會”）之認可在香港公開發售的內地基金。

香港證監會認可不等如對該計劃作出推介或認許，亦不是對該計劃的商業利弊或表現作出保證，更不代表該計劃適合所有投資者，或認許該計劃適合任何個別投資者或任何類別的投資者。

基金的過往業績並不代表其未來表現。投資涉及風險，投資者在作出投資決定前應仔細閱讀本基金的招募說明書及其更新。

本基金只有 H 類別份額可供香港投資者認購。

大成國際資產管理有限公司

香港代表

二〇二四年八月八日

## 重要提示

大成內需增長混合型證券投資基金（即原大成內需增長股票型證券投資基金）經中國證監會 2011 年 4 月 27 日證監許可【2011】609 號文核准募集，基金合同已於 2011 年 6 月 14 日正式生效。

基金管理人保證本招募說明書的內容真實、準確、完整。本招募說明書經中國證監會備案，但中國證監會對本基金募集的核准，並不表明中國證監會對本基金的價值和收益做出實質性判斷或保證，也不表明投資於本基金沒有風險。基金資產投資於科創板股票，會面臨科創板機制下因投資標的、市場制度以及交易規則等差異帶來的特有風險，包括但不限於流動性風險、退市風險、投資集中度風險、市場風險、系統性風險、股價波動風險、政策風險等。基金可根據投資策略需要或市場環境的變化，選擇將部分基金資產投資於科創板股票或選擇不將基金資產投資於科創板股票，基金資產並非必然投資於科創板股票。

本基金的投資範圍包括存託憑證，可能面臨存託憑證價格大幅波動甚至出現較大虧損的風險，以及與存託憑證發行機制相關的風險。

當本基金持有特定資產且存在或潛在大額贖回申請時，基金管理人履行相應程式後，可以啟動側袋機制，具體詳見基金合同和本招募說明書“側袋機制”等有關章節。側袋機制實施期間，基金管理人將對基金簡稱進行特殊標識，並不辦理側袋帳戶的申購贖回。請基金份額持有人仔細閱讀相關內容並關注本基金啟用側袋機制時的特定風險。

基金管理人依照恪盡職守、誠實信用、謹慎勤勉的原則管理和運用基金財產，但不保證基金一定盈利，也不保證最低收益。

投資有風險，投資者申購本基金時應認真閱讀本招募說明書。

基金的過往業績並不預示其未來表現。

本基金本次更新招募說明書主要對基金經理相關資料進行了更新，基金經理相關資料更新截止日為 2024 年 8 月 5 日。本招募說明書（更新）所載內容截至日為 2024 年 6 月 14 日（其中人員變動資訊以公告日為準），有關財務數據和淨值表現截止日為 2024 年 3 月 31 日，本報告中所列財務數據未經審計。



## 目錄

一、緒言.....	3
二、釋義.....	4
三、基金管理人.....	10
四、基金託管人.....	23
五、相關服務機構.....	25
六、基金合同的生效.....	61
七、基金份額的申購、贖回與轉換.....	62
八、基金的投資.....	76
九、基金業績.....	88
十、基金的融資、融券.....	91
十一、基金的財產.....	91
十二、基金資產估值.....	93
十三、基金的費用與稅收.....	96
十四、基金收益與分配.....	98
十五、基金的會計與審計.....	100
十六、基金的資訊披露.....	101
十七、側袋機制.....	105
十八、風險揭示.....	108
十九、基金合同的變更、終止與基金財產清算.....	112
二十、基金合同內容摘要.....	114
二十一、基金託管協議內容摘要.....	127
二十二、對基金份額持有人的服務.....	136
二十三、其他應披露的事項.....	138
二十四、招募說明書的存放及查閱方式.....	139
二十五、備查文件.....	140

## 一、緒言

基金管理人承諾本招募說明書不存在任何虛假記載、誤導性陳述或者重大遺漏，並對其真實性、準確性、完整性承擔法律責任。

本基金是根據本招募說明書所載明的資料申請募集的。本基金管理人沒有委託或授權任何其他人士提供未在本招募說明書中載明的資訊，或對本招募說明書作任何解釋或者說明。

本招募說明書根據《大成內需增長混合型證券投資基金基金合同》編寫，並經中國證監會備案。基金合同是約定基金當事人之間權利、義務的法律文件。投資者取得依基金合同所發行的基金份額，即成為基金份額持有人和本基金基金合同的當事人，其持有基金份額的行為本身即表明其對基金合同的承認和接受，並按照《基金法》、《運作辦法》、《資訊披露辦法》、《銷售辦法》、《基金合同》、《流動性風險管理規定》及其他有關規定享有權利、承擔義務；基金投資者欲瞭解基金份額持有人的權利和義務，應詳細查閱《大成內需增長混合型證券投資基金基金合同》。

## 二、釋義

基金合同	《大成內需增長混合型證券投資基金基金合同》及對其任何有效的修訂和補充
中國	中華人民共和國（僅為基金合同目的不包括香港特別行政區、澳門特別行政區及台灣地區）
法律法規	中國現時有效並公佈實施的法律、行政法規、部門規章及規範性文件
《基金法》	指 2003 年 10 月 28 日經第十屆全國人民代表大會常務委員會第五次會議通過，經 2012 年 12 月 28 日第十一屆全國人民代表大會常務委員會第三十次會議修訂，自 2013 年 6 月 1 日起實施，並經 2015 年 4 月 24 日第十二屆全國人民代表大會常務委員會第十四次會議《全國人民代表大會常務委員會關於修改〈中華人民共和國港口法〉等七部法律的決定》修正的《中華人民共和國證券投資基金法》及頒佈機關對其不時做出的修訂
《銷售辦法》	指中國證監會 2020 年 8 月 28 日頒佈、同年 10 月 1 日起實施的《公開募集證券投資基金銷售機構監督管理辦法》及頒佈機關對其不時做出的修訂
《運作辦法》	指 2014 年 7 月 7 日由中國證監會公佈並於 2014 年 8 月 8 日起實施的《公開募集證券投資基金運作管理辦法》及不時做出的修訂
《信息披露辦法》	指中國證監會 2019 年 7 月 26 日頒佈、同年 9 月 1 日實施並經 2020 年 3 月 20 日中國證監會《關於修改部分證券期貨規章的決定》修正的《公開募集證券投資基金信息披露管理辦法》及頒佈機關對其不時做出的修訂
《流動性風險管理規定》	指中國證監會 2017 年 8 月 31 日頒佈、同年 10 月 1 日實施的《公開募集開放式證券投資基金流動性風險管理規定》及頒佈機關對其不時做出的修訂

中港兩地基金互認	指中國證監會和香港證監會於 2015 年 5 月 22 日公佈並於 2015 年 7 月 1 日起開始實施的內地與香港公開募集證券投資基金互認工作
元	中國法定貨幣人民幣元
基金份額分類	指本基金分設三類基金份額：A 類基金份額、C 類基金份額和 H 類基金份額。三類基金份額分設不同的基金代碼，並分別公佈基金份額單位淨值
基金或本基金	依據基金合同所募集的大成內需增長混合型證券投資基金
招募說明書	《大成內需增長混合型證券投資基金招募說明書》，即用於公開披露本基金的基金管理人及基金託管人、相關服務機構、基金的募集、基金合同的生效、基金份額的交易、基金份額的申購和贖回、基金的投資、基金的業績、基金的財產、基金資產的估值、基金收益與分配、基金的費用與稅收、基金的資訊披露、風險揭示、基金的終止與清算、基金合同的內容摘要、基金託管協定的內容摘要、對基金份額持有人的服務、其他應披露事項、招募說明書的存放及查閱方式、備查文件等涉及本基金的資訊，供基金投資者選擇並決定是否提出基金認購或申購申請的要約邀請文件，及其定期的更新
託管協議	基金管理人與基金託管人簽訂的《大成內需增長混合型證券投資基金託管協定》及其任何有效修訂和補充
發售公告	《大成內需增長股票型證券投資基金基金份額發售公告》
基金產品資料概要	《大成內需增長混合型證券投資基金基金產品資料概要》及其更新
《業務規則》	《大成基金管理有限公司開放式基金註冊登記業務規則》
中國證監會	中國證券監督管理委員會
銀行保險監管機構	國家金融監督管理總局或其他經國務院授權的機構
基金管理人	大成基金管理有限公司

基金託管人	中國銀行股份有限公司
基金份額持有人	根據基金合同及相關文件合法取得本基金基金份額的投資者
基金代銷機構	符合《銷售辦法》和中國證監會規定的其他條件，取得基金代銷業務資格，並與基金管理人簽訂基金銷售與服務代理協定，代為辦理本基金發售、申購、贖回和其他基金業務的代理機構
銷售機構	基金管理人及基金代銷機構
基金銷售網站	基金管理人的直銷網點及基金代銷機構的代銷網點
註冊登記業務	基金登記、存管、清算和交收業務，具體內容包括投資者基金帳戶管理、基金份額註冊登記、清算及基金交易確認、發放紅利、建立並保管基金份額持有人名冊等
基金註冊登記機構	大成基金管理有限公司或其委託的其他符合條件的辦理基金註冊登記業務的機構
基金合同當事人	受基金合同約束，根據基金合同享受權利並承擔義務的法律主體，包括基金管理人、基金託管人和基金份額持有人
個人投資者	符合法律法規規定的條件可以投資開放式證券投資基金的自然人
機構投資者	符合法律法規規定可以投資開放式證券投資基金的在中國合法註冊登記並存續或經政府有關部門批准設立的並存續的企業法人、事業法人、社會團體和其他組織
人民幣合格境外機構投資者	指經主管部門批准，運用在境外募集的人民幣資金開展境內證券投資業務的相關主體
投資者	指個人投資者、機構投資者、合格境外機構投資者、人民幣合格境外機構投資者和法律法規或中國證監會允許購買證券投資基金的其他投資者
基金合同生效日	基金募集達到法律規定及基金合同約定的條件，基金管理人聘請法定機構驗資並辦理完畢基金備案手續，獲得中國證監會書面確認之日

募集期	自基金份額發售之日起不超過 3 個月的期限
基金存續期	基金合同生效後合法存續的不定期之期間
日/天	西曆日
月	西曆月
工作日	上海證券交易所和深圳證券交易所的正常交易日
開放日	銷售機構辦理本基金份額申購、贖回等業務的工作日
T 日	申購、贖回或辦理其他基金業務的申請日
T+n 日	自 T 日起第 n 個工作日（不包含 T 日）
認購	在本基金募集期內投資者購買本基金基金份額的行為
發售	在本基金募集期內，銷售機構向投資者銷售本基金份額的行為
申購	基金投資者根據基金銷售網站規定的手續，向基金管理人購買基金份額的行為。本基金的日常申購自基金合同生效後不超過 3 個月的時間開始辦理
贖回	基金投資者根據基金銷售網站規定的手續，向基金管理人賣出基金份額的行為。本基金的日常贖回自基金合同生效後不超過 3 個月的時間開始辦理
巨額贖回	在單個開放日，本基金的基金份額淨贖回申請（贖回申請總數加上基金轉換中轉出申請份額總數後扣除申購申請總數及基金轉換中轉入申請份額總數後的餘額）超過上一日本基金總份額的 10%時的情形
基金帳戶	基金註冊登記機構給投資者開立的用於記錄投資者持有基金管理人管理的開放式基金份額情況的帳戶
交易帳戶	各銷售機構為投資者開立的記錄投資者通過該銷售機構辦理基金交易所引起的基金份額的變動及結餘情況的帳戶
轉託管	投資者將其持有的同一基金帳戶下的基金份額從某一交易帳戶轉入另一交易帳戶的業務
基金轉換	投資者按照基金合同和基金管理人的相關公告，向基金管理人提出申請將其所持有的基金管理人管理的任一開放式

定期定額投資計劃	基金（轉出基金）的全部或部分基金份額轉換為基金管理人管理的其他開放式基金（轉入基金）的基金份額的行為 投資者通過有關銷售機構提出申請，約定每期扣款日、扣款金額及扣款方式，由銷售機構於每期約定扣款日在投資者指定銀行帳戶內自動完成扣款及基金申購申請的一種投資方式
基金收益	基金投資所得紅利、股息、債券利息、證券投資收益、證券持有期間的公允價值變動、銀行存款利息以及其他收入
基金資產總值	基金所擁有的各類證券及票據價值、銀行存款本息和本基金應收的申購基金款以及其他投資所形成的價值總和
基金資產淨值	基金資產總值扣除負債後的淨資產值
基金資產估值	計算評估基金資產和負債的價值，以確定基金資產淨值的過程
流動性受限資產	指由於法律法規、監管、合同或操作障礙等原因無法以合理價格予以變現的資產，包括但不限於到期日在 10 個交易日以上的逆回購與銀行定期存款（含協定約定有條件提前支取的銀行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公開發行股票、資產支持證券、因發行人債務違約無法進行轉讓或交易的債券等
貨幣市場工具	現金；一年以內（含一年）的銀行定期存款、大額存單；剩餘期限在三百九十七天以內（含三百九十七天）的債券；期限在一年以內（含一年）的債券回購；期限在一年以內（含一年）的中央銀行票據；中國證監會、中國人民銀行認可的其他具有良好流動性的金融工具
指定媒介	指中國證監會指定的用以進行資訊披露的全國性報刊及指定互聯網網站（包括基金管理人網站、基金託管人網站、中國證監會基金電子披露網站）等媒介
股指期貨	由中國證監會批准，在中國金融期貨交易所上市交易的以股票價格指數為標的的金融期貨合約

不可抗力	指任何無法預見、無法克服、無法避免的事件和因素，包括但不限於洪水、地震及其他自然災害、戰爭、疫情、騷亂、火災、政府徵用、沒收、法律變化、突發停電、電腦系統或資料傳輸系統非正常停止以及其他突發事件、證券交易場所非正常暫停或停止交易等
側袋機制	指將基金投資組合中的特定資產從原有帳戶分離至一個專門帳戶進行處置清算，目的在於有效隔離並化解風險，確保投資者得到公平對待，屬於流動性風險管理工具。側袋機制實施期間，原有帳戶稱為主袋帳戶，專門帳戶稱為側袋帳戶
特定資產	包括：（一）無可參考的活躍市場價格且採用估值技術仍導致公允價值存在重大不確定性的資產；（二）按攤餘成本計量且計提資產減值準備仍導致資產價值存在重大不確定性的資產；（三）其他資產價值存在重大不確定性的資產
銷售服務費	指從基金資產中計提的，用於本基金市場推廣、銷售以及基金份額持有人服務的費用



### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人概況

名稱：大成基金管理有限公司

住所：廣東省深圳市南山區海德三道 1236 號大成基金總部大廈 5 層、27-33 層

辦公地址：廣東省深圳市南山區海德三道 1236 號大成基金總部大廈 27 層

設立日期：1999 年 4 月 12 日

註冊資本：貳億元人民幣

股權結構：公司股東為中泰信託有限責任公司（持股比例 50%）、中國銀河投資管理有限公司（持股比例 25%）、光大證券股份有限公司（持股比例 25%）三家公司。

法定代表人：吳慶斌

電話：0755-83183388

傳真：0755-83199588

聯繫人：尚劍

#### （二）主要人員情況

##### 1、董事會成員

吳慶斌先生，董事長，清華大學法學及工學雙學士。先後任職於西南證券飛虎網、北京國際信託有限責任公司、廣聯（南寧）投資股份有限公司等機構。2012 年 7 月至今，任廣聯（南寧）投資股份有限公司董事長；2012 年任職於中泰信託有限責任公司，2013 年 6 月至今，任中泰信託有限責任公司董事長。2019 年 11 月 3 日起任大成基金管理有限公司董事長。

林昌先生，副董事長，北京大學經濟學碩士。1993 年進入中國光大銀行從事證券業務。1996 年光大證券有限責任公司重組設立時，林昌先生隨所在部門整體調入光大證券，先後擔任光大證券南方總部研究部總經理、光大證券南方總部副總經理、光大證券投資銀行總部總經理、光大證券助理總裁等職務。2005 年 3 月至 2020 年 11 月擔任光大保德信基金管理有限公司董事長。2020 年 12 月至 2022 年 8 月，擔任光大證券股份有限公司深化改革高級顧問、資深董事總經理，2022 年 8 月至今擔任光大證券股份有限公司董事會辦公室（監事會辦公室）資深董事總經理。2020 年 12 月 28 日起任大成基金管理有限公司副董事長。

譚曉岡先生，董事、總經理，哈佛大學公共管理碩士。曾在財政部、世界銀行、全國社保基金理事會任職。2016 年 7 月加入大成基金管理有限公司，2016 年 12 月至 2019 年 8 月任大成國際資產管理有限公司總經理，2017 年 2 月至 2019 年 6 月任大成基金管理有限公司副總經理，2019 年 7 月起任大成基金管理有限公司總經理，2019 年 8 月起任大成國際資產

管理有限公司董事長，2022 年 4 月起兼任公司首席資訊官。

楊紅女士，董事，同濟大學管理學博士。先後任職於北京總參工程兵部、招商銀行上海分行、浦發銀行上海分行、上投摩根基金管理有限公司等機構，2021 年 8 月加入中泰信託有限責任公司，現任中泰信託有限責任公司副總裁。2022 年 11 月起任大成基金管理有限公司董事。

宋立志先生，董事，中國社會科學院法學碩士。2001 年至 2003 年任職於中國石油工程建設（集團）公司，2006 年至 2007 年任北京區順義人民法院法官，2007 年至 2022 年任職於中國建銀投資有限責任公司，歷任業務經理、高級經理、部門總經理，2021 年 9 月至 2022 年 7 月兼任建投控股有限責任公司董事，2022 年 8 月加入中國銀河金融控股有限公司，現任資深總監，負責合規、風控等工作。2022 年 11 月起任大成基金管理有限公司董事。

胡維翊先生，獨立董事，波士頓大學國際銀行與金融法碩士。1991 年 7 月至 1994 年 4 月，任全國人大常委會辦公廳研究室政治組主任科員；1994 年 5 月至 1998 年 8 月，任北京乾坤律師事務所合夥人；2000 年 2 月至 2001 年 4 月任北京市中凱律師事務所律師；2001 年 5 月至今，歷任北京市天鐸律師事務所副主任、主任，現任北京市天鐸律師事務所合夥人。2019 年 11 月起任大成基金管理有限公司獨立董事。

楊曉帆先生，獨立董事，香港浸會大學工商管理學士。2006 年至 2011 年，任惠理集團有限公司高級投資分析師兼投資組合經理；2012 年至 2016 年，任 FALCON EDGE CAPITAL LP 合夥人 and 大中華區負責人；2016 年至今，任晨曦投資管理公司(ANATOLE INVESTMENT MANAGEMENT) 主要創始人。2019 年 11 月起任大成基金管理有限公司獨立董事。

盧鋒先生，獨立董事，英國 LEEDS 大學經濟學博士，北京大學國家發展研究院教授。曾赴美國哈佛大學、澳大利亞國立大學、英國發展研究院訪問研究。英文雜誌“China Economic Journal”創始主編。目前擔任財政部顧問，曾擔任人社部顧問和國際組織 AMRO 諮詢組專家成員。2022 年 11 月起任大成基金管理有限公司獨立董事。

江濤女士，獨立董事，復旦大學經濟學學士。1989 年至 1992 年任職於深圳賽格集團市場部、1992 年至 1996 年任深圳石化集團海外企業管理部副總經理（主持工作）；1996 年至 2002 年任職於招商證券投資銀行總部，任總經理助理；2002 年至 2004 年任職於招商證券北京代表處，任副主任；2004 年至 2007 年任職於中投證券董事會辦公室，任副主任（主持工作）；2007 年至 2015 年 7 月，任職於中銀國際證券，任公司執委會委員、董事會秘書兼董辦主任，2022 年 11 月起任大成基金管理有限公司獨立董事。

## 2、監事會成員

陳勇先生，監事會主席，黑龍江大學電子學與資訊系統專業學士。1992 年 7 月至 1993 年 5 月任中國人民銀行哈爾濱分行科技處技術員；1993 年 5 月至 1994 年 10 月任哈爾濱證

券公司友誼路證券營業部電腦部助理工程師；1994年10月至1997年6月任哈爾濱證券公司和平路證券營業部副總經理；1997年6月至1999年1月任聯合證券公司哈爾濱和平路證券營業部總經理；1999年1月至2000年6月任聯合證券公司投資銀行總部高級業務經理；2000年6月至2000年11月任職於中國銀河證券公司投資銀行總部；2000年11月至2004年8月任中國銀河證券有限責任公司總裁辦公處副處長（主持工作）、處長；2004年8月至2006年12月任中國銀河證券有限責任公司總裁辦副主任；2007年1月至2007年9月任中國銀河證券股份有限公司總裁辦副主任；2007年9月至2010年5月任中國銀河金融控股有限責任公司戰略發展部執行總經理；2010年5月至2021年8月16日任銀河基金管理有限公司黨委委員、副總經理。2021年9月3日任大成基金監事會主席。

鄧金煌先生，職工監事，上海財經大學管理學碩士。2001年9月至2003年9月任職於株洲電力局；2003年9月至2006年1月攻讀碩士學位；2006年4月至2010年5月任華為三康技術有限公司人力資源專員；2010年5月至2011年9月任招商證券人力資源部高級經理；2011年9月至2016年8月任融通基金管理有限公司綜合管理部總監助理；2016年8月加入大成基金管理有限公司，任人力資源部副總監；現任大成基金管理有限公司人力資源部總監。

陳煥女士，職工監事，吉林大學法學碩士。2005年8月至2008年3月任金杜律師事務所深圳分所公司證券部律師；2008年3月加入大成基金管理有限公司，歷任監察稽核部律師、總監助理、副總監，現任大成基金管理有限公司監察稽核部執行總監。

### 3、高級管理人員情況

吳慶斌先生，董事長。簡歷同上。

譚曉岡先生，總經理。簡歷同上。

尚劍先生，副總經理，哈佛大學公共管理碩士。曾任深圳市廣聚能源股份有限公司副總經理兼廣聚投資控股公司執行董事、總經理，深圳市人民政府國有資產監督管理委員會副處長、處長。2014年11月加入大成基金管理有限公司，2015年1月起任公司副總經理，2019年8月起任大成國際資產管理有限公司總經理。

姚餘棟先生，副總經理，英國劍橋大學經濟學博士。曾任職於原國家經貿委企業司、美國花旗銀行倫敦分行。曾任世界銀行諮詢顧問，國際貨幣基金組織國際資本市場部和非洲部經濟學家，原黑龍江省招商局副局長，黑龍江省商務廳副廳長，中國人民銀行貨幣政策二司副巡視員，中國人民銀行貨幣政策司副司長，中國人民銀行金融研究所所長。2016年9月加入大成基金管理有限公司，任首席經濟學家，2017年2月起任公司副總經理。

趙冰女士，副總經理，清華大學工商管理碩士。曾供職於中國證券業協會資格管理部、專業聯絡部、基金公司會員部，曾任中國證券業協會分析師委員會委員、基金銷售專業委員會委員。曾參與基金業協會籌備組的籌備工作。曾先後任中國證券投資基金業協會投教與媒

體公關部負責人、理財及服務機構部負責人。2017 年 7 月加入大成基金管理有限公司，2017 年 8 月至 2022 年 5 月任公司督察長。2022 年 6 月起任公司副總經理。

段皓靜女士，督察長，西南財經大學會計學碩士。1996 年加入深圳發展銀行工作；2000 年加入中國證券監督管理委員會深圳監管局，歷任副主任科員、主任科員、副處級調研員、副處長、處長；2019 年加入信達澳亞基金管理有限公司，任督察長；2020 年 7 月加入紅塔紅土基金管理有限公司，任督察長。2022 年 6 月起任大成基金管理有限公司督察長。

石國武先生，副總經理，北京大學工學碩士。曾就職於博時基金管理有限公司，歷任系統分析員、股票投資部投資經理助理、特定資產部投資經理。2012 年 11 月加入大成基金管理有限公司，歷任股票投資部基金經理、股票投資部價值組投資總監，大類資產配置部總監、社保及養老投資管理部總監、研究部總監、權益專戶投資部總監、總經理助理。2023 年 3 月起，任公司副總經理。

#### 4、基金經理

##### (1) 現任基金經理

張燁：上海交通大學經濟學碩士。證券從業年限 14 年。2010 年 3 月至 2011 年 9 月任鵬華基金管理有限公司研究部研究員。2011 年 9 月加入大成基金管理有限公司，曾擔任研究部研究員、基金經理助理，現任股票投資部基金經理。2017 年 9 月 26 日至 2021 年 5 月 26 日任大成國企改革靈活配置混合型證券投資基金基金經理。2019 年 9 月 29 日起任大成內需增長混合型證券投資基金基金經理。2021 年 5 月 24 日起任大成消費精選股票型證券投資基金基金經理。2021 年 12 月 10 日起任大成悅享生活混合型證券投資基金基金經理。具有基金從業資格。國籍：中國

齊煒中：英國約克大學金融學碩士。證券從業年限 12 年。2012 年 7 月加入大成基金管理有限公司，曾擔任研究部研究員、行業研究主管、大成積極成長混合型證券投資基金基金經理助理，現任股票投資部總監助理。2020 年 2 月 3 日起任大成消費主題混合型證券投資基金、大成景陽領先混合型證券投資基金基金經理。2021 年 3 月 17 日起任大成一帶一路靈活配置混合型證券投資基金基金經理。2021 年 6 月 21 日起任大成藍籌穩健證券投資基金基金經理。2022 年 11 月 18 日起任大成消費機遇混合型證券投資基金基金經理。2023 年 4 月 25 日起任大成新興活力混合型證券投資基金基金經理。2023 年 6 月 13 日起任大成至誠鑫選混合型證券投資基金基金經理。2024 年 8 月 5 日起任大成內需增長混合型證券投資基金基金經理。具備基金從業資格。國籍：中國

##### (2) 歷任基金經理

歷任基金經理姓名	管理本基金時間
楊丹	2011 年 6 月 14 日至 2013 年 7 月 17 日

李本剛	2012 年 9 月 4 日至 2020 年 1 月 13 日
李博	2015 年 8 月 26 日至 2019 年 9 月 29 日

### 5、公司投資決策委員會

公司股票投資決策委員會由 9 名成員組成，設股票投資決策委員會主席 1 名，其他委員 8 名，名單如下：

石國武，公司副總經理，權益專戶投資部總監，股票投資決策委員會主席、量化投資決策委員會主席、專戶投資決策委員會主席、FOF 投資決策委員會主席；徐彥，基金經理，董事總經理，首席權益投資官，股票投資決策委員會委員；劉旭，基金經理，股票投資部總監、董事總經理，股票投資決策委員會委員；戴軍，基金經理，研究部總監，股票投資決策委員會委員；李博，基金經理，股票投資部副總監，股票投資決策委員會委員；韓創，基金經理，股票投資部副總監、董事總經理，股票投資決策委員會委員；魏慶國，基金經理，股票投資部總監助理，股票投資決策委員會委員。齊煒中，基金經理，股票投資部總監助理，股票投資決策委員會委員。謝民，交易管理部總監，股票投資決策委員會委員，固定收益投資決策委員會委員。

上述人員之間不存在親屬關係。

### （三） 基金管理人的職責

按照《基金法》、《運作辦法》及其他有關規定，基金管理人必須履行以下職責：

1· 依法募集基金，辦理或者委託經中國證監會認定的其他機構代為辦理基金份額的發售、申購、贖回和登記事宜；如認為基金代銷機構違反基金合同、基金銷售與服務代理協議及國家有關法律規定，應呈報中國證監會和其他監管部門，並採取必要措施保護基金投資者的利益；

2· 辦理基金備案手續；

3· 自基金合同生效之日起，以誠實信用、謹慎勤勉的原則管理和運用基金財產；

4· 配備足夠的具有專業資格的人員進行基金投資分析、決策，以專業化的經營方式管理和運作基金財產；

5· 建立健全內部風險控制、監察與稽核、財務管理及人事管理等制度，保證所管理的基金財產和基金管理人的財產相互獨立，對所管理的不同基金分別管理，分別記帳，進行證券投資；

6· 除依據《基金法》、基金合同及其他有關規定外，不得利用基金財產為自己及任何第三人謀取利益，不得委託第三人運作基金財產；

7· 依法接受基金託管人的監督；

8· 採取適當合理的措施使計算基金份額認購、申購、贖回對價的方法符合基金合同等

法律文件的規定，按有關規定計算並公告基金淨值資訊，確定各類基金份額申購、贖回對價；

- 9· 進行基金會計核算並編製基金財務會計報告；
- 10· 編製定期報告；
- 11· 嚴格按照《基金法》、基金合同及其他有關規定，履行資訊披露及報告義務；
- 12· 保守基金商業秘密，不洩露基金投資計劃、投資意向等。除《基金法》、基金合同及其他有關規定另有規定外，在基金資訊公開披露前應予保密，不向他人洩露；
- 13· 按基金合同的約定確定基金收益分配方案，及時向基金份額持有人分配基金收益；
- 14· 按規定受理申購與贖回申請，及時、足額支付贖回款項；
- 15· 依據《基金法》、基金合同及其他有關規定召集基金份額持有人大會或配合基金託管人、基金份額持有人依法召集基金份額持有人大會；
- 16· 按規定保存基金財產管理業務活動的會計帳冊、報表、記錄和其他相關資料 15 年以上；
- 17· 確保需要向基金投資者提供的各項文件或資料在規定時間發出，並且保證投資者能夠按照基金合同規定的時間和方式，隨時查閱到與基金有關的公開資料，並在支付合理成本的條件下得到有關資料的影本；
- 18· 組織並參加基金財產清算小組，參與基金財產的保管、清理、估價、變現和分配；
- 19· 面臨解散、依法被撤銷或者被依法宣告破產時，及時報告中國證監會並通知基金託管人；
- 20· 因違反基金合同導致基金財產的損失或損害基金份額持有人合法權益時，應當承擔賠償責任，其賠償責任不因其退任而免除；
- 21· 監督基金託管人按法律法規和基金合同規定履行自己的義務，基金託管人違反基金合同造成基金財產損失時，基金管理人應為基金份額持有人利益向基金託管人追償；
- 22· 當基金管理人將其義務委託第三方處理時，應當對第三方處理有關基金事務的行為承擔責任；但因第三方責任導致基金財產或基金份額持有人利益受到損失，而基金管理人首先承擔了責任的情況下，基金管理人有權向第三方追償；
- 23· 以基金管理人名義，代表基金份額持有人利益行使訴訟權利或實施其他法律行為；
- 24· 基金管理人在募集期間未能達到基金的備案條件，基金合同不能生效，基金管理人承擔全部募集費用，將已募集資金並加計銀行同期存款利息在基金募集期結束後 30 日內退還基金認購人；
- 25· 執行生效的基金份額持有人大會的決定；
- 26· 建立並保存基金份額持有人名冊，定期或不定期向基金託管人提供基金份額持有人名冊；
- 27· 法律法規及中國證監會規定的和基金合同約定的其他義務。

#### （四）基金管理人承諾

1·基金管理人承諾嚴格遵守《證券法》，並建立健全的內部控制制度，採取有效措施，防止違反《證券法》行為的發生；

2·基金管理人承諾嚴格遵守《基金法》、《運作辦法》，建立健全的內部控制制度，採取有效措施，防止以下《基金法》、《運作辦法》禁止的行為發生：

- （1）將基金管理人固有財產或者他人財產混同於基金財產從事證券投資；
- （2）不公平地對待其管理的不同基金財產；
- （3）利用基金財產為基金份額持有人以外的第三人牟取利益；
- （4）向基金份額持有人違規承諾收益或者承擔損失；
- （5）法律法規和中國證監會禁止的其他行為。

3·基金管理人承諾加強人員管理，強化職業操守，督促和約束員工遵守國家有關法律法規及行業規範，誠實信用、勤勉盡責，不從事以下活動：

- （1）越權或違規經營；
- （2）違反基金合同或託管協議；
- （3）損害基金份額持有人或其他基金相關機構的合法利益；
- （4）在向中國證監會報送的資料中弄虛作假；
- （5）拒絕、干擾、阻撓或嚴重影響中國證監會依法監管；
- （6）怠忽職守、濫用職權；
- （7）洩漏在任職期間知悉的有關證券、基金的商業秘密，尚未依法公開的基金投資內容、基金投資計劃等資訊；
- （8）除按本公司制度進行基金投資外，直接或間接進行其他股票交易；
- （9）協助、接受委託或以其他任何形式為其他組織或個人進行證券交易；
- （10）違反證券交易場所業務規則，利用對敲、倒倉等手段操縱市場價格，擾亂市場秩序；
- （11）故意損害基金投資者及其他同業機構、人員的合法權益；
- （12）以不正當手段謀求業務發展；
- （13）有悖社會公德，損害證券投資基金人員形象；
- （14）資訊披露不真實，有誤導、欺詐成分；
- （15）法律法規和中國證監會禁止的其他行為。

4·本基金管理人將根據基金合同的規定，按照招募說明書列明的投資目標、策略及限制等全權處理本基金的投資。

5·本基金管理人不從事違反《基金法》的行為，並建立健全內部控制制度，採取有效措施，保證基金財產不用於下列投資或者活動：

- (1) 承銷證券；
- (2) 違反規定向他人貸款或者提供擔保；
- (3) 從事承擔無限責任的投資；
- (4) 向其基金管理人、基金託管人出資；
- (5) 從事內幕交易、操縱證券交易價格及其他不正當的證券交易活動；
- (6) 法律、行政法規和國務院證券監督管理機構規定禁止的其他活動。

運用基金財產買賣基金管理人、基金託管人及其控股股東、實際控制人或者與其有其他重大利害關係的公司發行的證券或承銷期內承銷的證券，或者從事其他重大關聯交易的，應當遵循基金份額持有人利益優先的原則，防範利益衝突，符合國務院證券監督管理機構的規定，並履行資訊披露義務。

若法律法規或監管部門取消上述禁止性規定，履行適當程式後，本基金投資可不受上述規定限制。

#### (五) 基金經理的承諾

- 1· 依照有關法律法規和基金合同的規定，本著謹慎的原則為基金份額持有人謀取最大利益；
- 2· 不利用職務之便為自己及其代理人、受僱人或任何第三人謀取利益；
- 3· 不違反現行有效的有關法律法規、基金合同和中國證監會的有關規定，洩漏在任職期間知悉的有關證券、基金的商業秘密、尚未依法公開的基金投資內容、基金投資計劃等資訊；
- 4· 不從事損害基金財產和基金份額持有人利益的證券交易及其他活動。

#### (六) 基金管理人的內部控制制度

本基金管理人為加強內部控制，促進公司誠信、合法、有效經營，保障基金份額持有人利益，維護公司及公司股東的合法權益，依據《證券法》、《證券投資基金公司管理辦法》、《證券投資基金管理公司內部控制指導意見》等法律法規，並結合公司實際情況，制定《大成基金管理有限公司內部控制大綱》。

公司內部控制是指公司為防範和化解風險，保證經營運作符合公司的發展規劃，在充分考慮內外部環境的基礎上，通過建立組織機制、運用管理方法、實施操作程式與控制措施而形成的系統。公司建立科學合理、控制嚴密、運行高效的內部控制體系，制定科學完善的內部控制制度。

公司內部控制制度由內部控制大綱、基本管理制度、部門業務規章等部分組成。

公司董事會對公司建立內部控制系統和維持其有效性承擔最終責任，公司管理層對內部控制制度的有效執行承擔責任。



### 1· 公司內部控制的總體目標

(1) 保證公司經營運作嚴格遵守國家有關法律法規和行業監管規則，自覺形成守法經營、規範運作的經營思想和經營理念。

(2) 防範和化解經營風險，提高經營管理效益，確保經營業務的穩健運行和受託資產的安全完整，實現公司的持續、穩定、健康發展。

(3) 確保基金、公司財務和其他資訊真實、準確、完整、及時。

### 2· 公司內部控制遵循以下原則

(1) 健全性原則。內部控制涵蓋公司的各項業務、各個部門或機構和各級人員，並包括決策、執行、監督、回饋等各個環節。

(2) 有效性原則。通過科學的內控手段和方法，建立合理的內控程式，維護內控制度的有效執行。

(3) 獨立性原則。公司各機構、部門和崗位職責的設置保持相對獨立，公司基金財產、自有資產與其他資產的運作相互分離。

(4) 相互制約原則。公司設置的各部門、各崗位權責分明、相互制衡。

(5) 成本效益原則。公司運用科學化的經營管理方法降低運作成本，提高經濟效益，以合理的成本控制達到最佳的內部控制效果。

### 3· 公司制定內部控制制度遵循以下原則

(1) 合法合規性原則。公司內控制度符合國家法律法規、規章和各項規定。

(2) 全面性原則。內部控制制度涵蓋公司經營管理的各個環節，不得留有制度上的空白或漏洞。

(3) 審慎性原則。制定內部控制制度以審慎經營、防範和化解風險為出發點。

(4) 適時性原則。隨著有關法律法規的調整和公司經營戰略、經營方針、經營理念等內外部環境的變化進行及時的修改或完善內部控制制度。

### 4· 內部控制的基本要素

內部控制的基本要素包括控制環境、風險評估、控制活動、資訊溝通和內部監控。

(1) 控制環境構成公司內部控制的基礎，控制環境包括經營理念和內控文化、公司治理結構、組織結構、員工道德素質等內容。

(2) 公司管理層牢固樹立內控優先和風險管理理念，培養全體員工的風險防範意識，營造一個濃厚的內控文化氛圍，保證全體員工及時瞭解國家法律法規和公司規章制度，使風險意識貫穿到公司各個部門、各個崗位和各個環節。

(3) 健全公司法人治理結構，充分發揮獨立董事和監事會的監督職能，禁止不正當關聯交易、利益輸送和內部人控制現象的發生，保護投資者利益和公司合法權益。

(4) 公司的組織結構體現職責明確、相互制約的原則，各部門有明確的授權分工，操作相互獨立。公司建立決策科學、運營規範、管理高效的運行機制，包括民主、透明的決策

程式和管理議事規則，高效、嚴謹的業務執行系統，以及健全、有效的內部監督和回饋系統。

(5) 依據公司自身經營特點設立順序遞進、權責統一、嚴密有效的內控防線：

1) 各崗位職責明確，有詳細的崗位說明書和業務流程，各崗位人員在上崗前均應知悉並以書面方式承諾遵守，在授權範圍內承擔責任。

2) 建立重要業務處理憑據傳遞和資訊溝通制度，相關部門和崗位之間相互監督制衡。

3) 公司督察長和內部監察稽核部門獨立於其他部門，對內部控制制度的執行情況實行嚴格的檢查和回饋。

4) 風險管理部主要負責對投資組合的市場風險、流動性風險和信用風險等進行風險測量，並提出風險調整的建議；對投資業績進行評價，包括整體表現分析、業績構成分析以及業績短期和長期持續性檢驗；對將要展開的新業務和創新性產品的投資做全面的風險評估，提出風險預警等工作。

(6) 建立有效的人力資源管理制度，健全激勵約束機制，確保公司各級人員具備與其崗位要求相適應的職業操守和專業勝任能力。

(7) 建立科學嚴密的風險評估體系，對公司內外部風險進行識別、評估和分析，及時防範和化解風險。

(8) 建立嚴謹、有效的授權管理制度，授權控制貫穿於公司經營活動的始終。

1) 確保股東會、董事會、監事會和管理層充分瞭解和履行各自的職權，建立健全公司授權標準和程式，保證授權制度的貫徹執行。

2) 公司各業務部門、分支機構和各級人員在規定授權範圍內行使相應的職責。

3) 公司重大業務的授權採取書面形式，明確授權書的授權內容和時效。

4) 公司適當授權，建立授權評價和回饋機制，包括已獲授權的部門和人員的回饋和評價，對已不適用的授權及時修改或取消授權。

(9) 建立完善的資產分離制度，公司資產與基金財產、不同基金的資產之間和其他委託資產，實行獨立運作，分別核算。

(10) 建立科學、嚴格的崗位分離制度，明確劃分各崗位職責，投資和交易、交易和清算、基金會計和公司會計等重要崗位不得有人員的重疊。重要業務部門和崗位進行物理隔離。

(11) 制訂切實有效的應急應變措施，建立危機處理機制和程式。

(12) 維護資訊溝通管道的暢通，建立清晰的報告系統。

(13) 建立有效的內部監控制度，設置督察長和獨立的監察稽核部門，對公司內部控制制度的執行情況進行持續的監督，保證內部控制制度落實。公司定期評價內部控制的有效性，並根據市場環境、新的金融工具、新的技術應用和新的法律法規等情況進行適時改進。

## 5. 內部控制的主要內容

(1) 公司自覺遵守國家有關法律法規，按照投資管理業務的性質和特點嚴格制定管理規章、操作流程和崗位手冊，明確揭示不同業務可能存在的風險點並採取控制措施。

(2) 研究業務控制主要內容包括：

- 1) 研究工作保持獨立、客觀。
- 2) 建立嚴密的研究工作業務流程，形成科學、有效的研究方法。
- 3) 建立投資對象備選庫制度，根據基金合同要求，在充分研究的基礎上建立和維護備選庫。
- 4) 建立研究與投資的業務交流制度，保持通暢的交流管道。
- 5) 建立研究報告品質評價體系。

(3) 投資決策業務控制主要內容包括：

- 1) 嚴格遵守法律法規的有關規定，符合基金合同所規定的投資目標、投資範圍、投資策略、投資組合和投資限制等要求。
- 2) 健全投資決策授權制度，明確界定投資許可權，嚴格遵守投資限制，防止越權決策。
- 3) 投資決策有充分的投資依據，重要投資有詳細的研究報告和風險分析支持，並有決策記錄。
- 4) 建立投資風險評估與管理制度，在設定的風險許可權額度內進行投資決策。
- 5) 建立科學的投資管理業績評價體系，包括投資組合情況、是否符合基金產品特徵和決策程式、基金績效歸屬分析等內容。

(4) 基金交易業務控制主要內容包括：

- 1) 基金交易實行集中交易制度，基金經理不得直接向交易員下達投資指令或者直接進行交易。
- 2) 建立交易監測系統、預警系統和交易回饋系統，完善相關的安全設施。
- 3) 交易管理部門審核投資指令，確認其合法、合規與完整後方可執行，如出現指令違法違規或者其他異常情況，應當及時報告相應部門與人員。
- 4) 公司執行公平的交易分配制度，確保不同投資者的利益能夠得到公平對待。
- 5) 建立完善的交易記錄制度，及時核對並存檔保管每日投資組合列表等。
- 6) 建立科學的交易績效評價體系。

根據內部控制的原則，制定場外交易、網下申購等特殊交易的流程和規則。

(5) 建立嚴格有效的制度，防止不正當關聯交易損害基金份額持有人利益。基金投資涉及關聯交易的，在相關投資研究報告中特別說明，並報公司風險控制委員會審議批准。

(6) 公司在審慎經營和合法規範的基礎上力求金融創新。在充分論證的前提下周密考慮金融創新品種或業務的法律性質、操作程式、經濟後果等，嚴格控制金融新品種、新業務的法律風險和運行風險。

(7) 建立和完善客戶服務標準、銷售管道管理、廣告宣傳行為規範，建立廣告宣傳、銷售行為法律審查制度，制定銷售人員準則，嚴格獎懲措施。

(8) 制定詳細的登記過戶工作流程，建立登記過戶電腦系統、數據定期核對、備份制

度，建立客戶資料的保密保管制度。

(9) 公司按照法律法規和中國證監會有關規定，建立完善的資訊披露制度，保證公開披露的資訊真實、準確、完整、及時。

(10) 公司配備專人負責資訊披露工作，進行資訊的組織、審核和發佈。

(11) 加強對公司及基金資訊披露的檢查和評價，對存在的問題及時提出改進辦法，對出現的失誤提出處理意見，並追究相關人員的責任。

(12) 掌握內幕資訊的人員在資訊公開披露前不得洩露其內容。

(13) 根據國家法律法規的要求，遵循安全性、實用性、可操作性原則，嚴格制定資訊系統的管理制度。

資訊技術系統的設計開發符合國家、金融行業軟體工程標準的要求，編寫完整的技術資料；在實現業務電子化時，設置保密系統和相應控制機制，並保證電腦系統的可稽性，資訊技術系統投入運行前，經過業務、運營、監察稽核等部門的聯合驗收。

(14) 通過嚴格的授權制度、崗位責任制度、門禁制度、內外網分離制度等管理措施，確保系統安全運行。

(15) 電腦機房、設備、網路等硬體要求符合有關標準，設備運行和維護整個過程實施明確的責任管理，嚴格劃分業務操作、技術維護等方面的職責。

(16) 公司軟體的使用充分考慮到軟體的安全性、可靠性、穩定性和可擴展性，具備身份驗證、訪問控制、故障恢復、安全保護、分權制約等功能。資訊技術系統設計、軟體開發等技術人員不得介入實際的業務操作。用戶使用的密碼口令定期更換，不得向他人透露。資料庫和操作系統的密碼口令分別由不同人員保管。

(17) 對資訊數據實行嚴格的管理，保證資訊數據的安全、真實和完整，並能及時、準確地傳遞到會計等各職能部門；嚴格電腦交易數據的授權修改程式，並堅持電子資訊數據的定期查驗制度。

建立電子資訊數據的即時保存和備份制度，重要數據異地備份並且長期保存。

(18) 資訊技術系統定期稽核檢查，完善業務數據保管等安全措施，進行排除故障、災難恢復的演習，確保系統可靠、穩定、安全地運行。

(19) 依據《中華人民共和國會計法》、《金融企業會計制度》、《證券投資基金會計核算業務指引》、《企業財務通則》等國家有關法律法規制訂基金會計制度、公司財務制度、會計工作操作流程和會計崗位工作手冊，並針對各個風險控制點建立嚴密的會計系統控制。

(20) 明確職責劃分，在崗位分工的基礎上明確各會計崗位職責，禁止需要相互監督的崗位由一人獨自操作全過程。

(21) 以基金為會計核算主體，獨立建帳、獨立核算，保證不同基金之間在名冊登記、帳戶設置、資金劃撥、帳簿記錄等方面相互獨立。基金會計核算與公司會計核算相互獨立。

(22) 採取適當的會計控制措施，以確保會計核算系統的正常運轉。

1) 建立憑證制度，通過憑證設計、登錄、傳遞、歸檔等一系列憑證管理制度，確保正確記載經濟業務，明確經濟責任。

2) 建立帳務組織和帳務處理體系，正確設置會計帳簿，有效控制會計記帳程式。

3) 建立覆核制度，通過會計覆核和業務覆核防止會計差錯的產生。

(23) 採取合理的估值方法和科學的估值程式，公允反映基金所投資的有價證券在估值時點的價值。

(24) 規範基金清算交割工作，在授權範圍內，及時準確地完成基金清算，確保基金財產的安全。

(25) 建立嚴格的成本控制和業績考核制度，強化會計的事前、事中和事後監督。

(26) 制訂完善的會計檔案保管和財務交接制度，財會部門妥善保管密押、業務用章、支票等重要憑據和會計檔案，嚴格會計資料的調閱手續，防止會計數據的毀損、散失和洩密。

(27) 嚴格制定財務收支審批制度和費用報銷運作管理辦法，自覺遵守國家財稅制度和財經紀律。

(28) 公司設立督察長，經董事會聘任，對董事會負責。督察長應當經中國證監會相關派出機構認可後方可任職。根據公司監察稽核工作的需要和董事會授權，督察長可以列席公司相關會議，調閱公司相關檔案，就內部控制制度的執行情況獨立地履行檢查、評價、報告、建議職能。督察長定期和不定期向董事會報告公司內部控制執行情況，董事會對督察長的報告進行審議。

(29) 公司設立監察稽核部門，對公司管理層負責，開展監察稽核工作，公司保證監察稽核部門的獨立性和權威性。

(30) 明確監察稽核部門及內部各崗位的具體職責，配備充足的監察稽核人員，嚴格監察稽核人員的專業任職條件，嚴格監察稽核的操作程式和組織紀律。

(31) 強化內部檢查制度，通過定期或不定期檢查內部控制制度的執行情況，確保公司各項經營管理活動的有效運行。

(32) 公司董事會和管理層重視和支持監察稽核工作，對違反法律法規和公司內部控制制度的，追究有關部門和人員的責任。

#### 6· 基金管理人關於內部控制制度的聲明

(1) 本公司承諾以上關於內部控制制度的披露真實、準確。

(2) 本公司承諾根據市場變化和公司業務發展不斷完善內部控制制度。

## 四、基金託管人

### （一）基本情況

名稱：中國銀行股份有限公司（簡稱“中國銀行”）

住所及辦公地址：北京市西城區復興門內大街 1 號

首次註冊登記日期：1983 年 10 月 31 日

註冊資本：人民幣貳仟玖佰肆拾三億捌仟柒佰柒拾玖萬壹仟貳佰肆拾壹元整

法定代表人：葛海蛟

基金託管業務批准文號：中國證監會證監基字【1998】24 號

託管部門資訊披露聯繫人：許俊

傳真：（010）66594942

中國銀行客服電話：95566

### （二）基金託管部門及主要人員情況

中國銀行託管業務部設立於 1998 年，現有員工 110 餘人，大部分員工具有豐富的銀行、證券、基金、信託從業經驗，且具有海外工作、學習或培訓經歷，60%以上的員工具有碩士以上學位或高級職稱。為給客戶提供專業化的託管服務，中國銀行已在境內、外分行開展託管業務。

作為國內首批開展證券投資基金託管業務的商業銀行，中國銀行擁有證券投資基金、基金（一對多、一對一）、社保基金、保險資金、QFII、RQFII、QDII、境外三類機構、券商資產管理計劃、信託計劃、企業年金、銀行理財產品、股權基金、私募基金、資金託管等門類齊全、產品豐富的託管業務體系。在國內，中國銀行首家開展績效評估、風險分析等增值服務，為各類客戶提供個性化的託管增值服務，是國內領先的大型中資託管銀行。

### （三）證券投資基金託管情況

截至 2024 年 6 月 30 日，中國銀行已託管 1111 隻證券投資基金，其中境內基金 1046 隻，QDII 基金 65 隻，覆蓋了股票型、債券型、混合型、貨幣型、指數型、FOF、REITs 等多種類型的基金，滿足了不同客戶多元化的投資理財需求，基金託管規模位居同業前列。

### （四）託管業務的內部控制制度

中國銀行託管業務部風險管理與控制工作是中國銀行全面風險控制工作的組成部分，秉承中國銀行風險控制理念，堅持“規範運作、穩健經營”的原則。中國銀行託管業務部風險控制工作貫穿業務各環節，通過風險識別與評估、風險控制措施設定及制度建設、內

外部檢查及審計等措施強化託管業務全員、全面、全程的風險管控。

2007 年起，中國銀行連續聘請外部會計會計師事務所開展託管業務內部控制審閱工作。先後獲得基於 “SAS70”、“AAF01/06” “ISAE3402” 和 “SSAE16” 等國際主流內控審閱準則的無保留意見的審閱報告。2020 年，中國銀行繼續獲得了基於 “ISAE3402” 和 “SSAE16” 雙準則的內部控制審計報告。中國銀行託管業務內控制度完善，內控措施嚴密，能夠有效保證託管資產的安全。

#### （五）託管人對管理人運作基金進行監督的方法和程式

根據《中華人民共和國證券投資基金法》、《公開募集證券投資基金運作管理辦法》的相關規定，基金託管人發現基金管理人的投資指令違反法律、行政法規和其他有關規定，或者違反基金合同約定的，應當拒絕執行，及時通知基金管理人，並及時向國務院證券監督管理機構報告。基金託管人如發現基金管理人依據交易程式已經生效的投資指令違反法律、行政法規和其他有關規定，或者違反基金合同約定的，應當及時通知基金管理人，並及時向國務院證券監督管理機構報告。

## 五、相關服務機構

### （一）銷售機構及聯繫人

#### 1、直銷機構

名稱：大成基金管理有限公司

住所：廣東省深圳市南山區海德三道 1236 號大成基金總部大廈 5 層、27-33 層

辦公地址：廣東省深圳市南山區海德三道 1236 號大成基金總部大廈 27 層

法定代表人：吳慶斌

電話：0755-83183388

傳真：0755-83199588

聯繫人：吳海靈

公司網址：[www.dcfund.com.cn](http://www.dcfund.com.cn)

大成基金客戶服務熱線：400-888-5558（免長途固話費）

#### （1）大成基金深圳投資理財中心

地址：廣東省深圳市南山區海德三道 1236 號大成基金總部大廈 27 層

聯繫人：吳海靈、關志玲、唐悅

電話：0755-22223556/22223177/22223555

傳真：0755-83195235/83195242/83195232

#### 2、代銷機構

#### （1）中國銀行股份有限公司

註冊地址：北京西城區復興門內大街 1 號

辦公地址：北京西城區復興門內大街 1 號

法定代表人：葛海蛟

聯繫人：張建偉

客服電話：95566

網址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

#### （2）中國工商銀行股份有限公司

註冊地址：北京市西城區復興門內大街 55 號

辦公地址：北京市西城區復興門內大街 55 號

法定代表人：陳四清

客服電話：95588

聯繫人：洪淵



聯繫電話：010-66105799

傳真：010-66107914

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

(3) 中國農業銀行股份有限公司

註冊地址：北京市東城區建國門內大街 69 號

辦公地址：北京市西城區復興門內大街 28 號凱晨世貿中心東座 F9

法定代表人：穀澍

聯繫人：賀倩

聯繫電話：010-66060069

傳真：010-68121816

客服電話：95599

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

(4) 中國建設銀行股份有限公司

註冊地址：北京市西城區金融大街 25 號

辦公地址：北京市西城區鬧市口大街 1 號長安興融中心 1 號樓

法定代表人：田國立

聯繫人：王嘉朔

電話：010-66275654

傳真：010-66275654

客服電話：95533

網址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

(5) 交通銀行股份有限公司

註冊地址：上海市浦東新區銀城中路 188 號

辦公地址：上海市浦東新區銀城中路 188 號

法定代表人：任德奇

聯繫人：王菁

電話：021-58781234

傳真：021-58408483

客服電話：95559

網址：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

(6) 招商銀行股份有限公司

註冊地址：深圳市福田區深南大道 7088 號

辦公地址：深圳市福田區深南大道 7088 號

法定代表人：繆建民

客服電話：95555

傳真：0755-83195049

網址：[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

(7) 上海浦東發展銀行股份有限公司

註冊地址：上海市浦東新區浦東南路 500 號

辦公地址：上海市中山東一路 12 號

法定代表人：鄭楊

聯繫人：朱瑛

客服熱線：95528

電話：021-61616886

傳真：021-63604199

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

(8) 中國光大銀行股份有限公司

註冊地址：北京市西城區太平橋大街 25 號、甲 25 號中國光大中心

辦公地址：北京市西城區太平橋大街 25 號中國光大中心

法定代表人：王江

客服電話：95595

聯繫人：石立平

電話：010-63639180

傳真：010-68560312

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

(9) 北京銀行股份有限公司

註冊地址：北京市西城區金融大街甲 17 號首層

辦公地址：北京市西城區金融大街丙 17 號

法定代表人：張東寧

聯繫人：周黎

電話：010-66224815

傳真：010-66226045

客服電話：95526

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

(10) 平安銀行股份有限公司

註冊地址：中國深圳市深南中路 1099 號

法定代表人：謝永林

電話：021-38637673

傳真：0755-22197701

聯繫人：張莉

客戶服務熱線：95511-3

網址：<http://bank.pingan.com>

（11）寧波銀行股份有限公司

註冊地址：寧波市江東區中山東路 294 號

法定代表人：陸華裕

聯繫人：胡技勳

電話：021-63586210

傳真：021-63586215

客服電話：95574

網址：[www.nbcb.com.cn](http://www.nbcb.com.cn)

（12）上海農村商業銀行股份有限公司

註冊地址：上海市浦東新區浦東大道 981 號

辦公地址：上海市黃浦區中山東二路 70 號

法定代表人：冀光恒

客戶服務電話：021-962999、4006962999

網址：[www.srcb.com](http://www.srcb.com)

（13）北京農村商業銀行股份有限公司

註冊地址：北京市西城區月壇南街 1 號院 2 號樓

辦公地址：北京市西城區月壇南街 1 號院 2 號樓

法定代表人：王金山

聯繫人：董匯

聯繫電話：010-85605588

傳真：010-66506163

客服電話：96198

網址：[www.bjrcb.com](http://www.bjrcb.com)

（14）青島銀行股份有限公司

地址：青島市市南區香港中路 68 號華普大廈

法定代表人：張廣鴻

聯繫人：滕克、李佳程

聯繫電話：0532-68629926

客服電話：96588（青島）、400-66-96588（全國）

網址：[www.qdccb.com](http://www.qdccb.com)

（15）浙商銀行股份有限公司

註冊地址：杭州市慶春路 288 號

法定代表人：沈仁康

聯繫人：唐燕

客戶服務熱線：95527

電話：0571-87659056

傳真：0571-87659188

網址：[www.czbank.com](http://www.czbank.com)

（16）東莞銀行股份有限公司

註冊地址：東莞市莞城區體育路 21 號

法定代表人：盧國鋒

聯繫人：朱傑霞

電話：0769-22865177

傳真：0769-23156406

客服電話：956033

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

（17）杭州銀行股份有限公司

辦公地址：杭州慶春路 46 號

法定代表人：吳太普

聯繫人：嚴峻

聯繫電話：0571-85108309

客服電話：95398

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

（18）溫州銀行股份有限公司

註冊地址：浙江省溫州市鹿城區會展路 1316 號

辦公地址：浙江省溫州市鹿城區會展路 1316 號

法定代表人：陳宏強

聯繫人：蔡鵬

電話：0577-88997296

客戶服務熱線：浙江地區：96699、上海地區：962699、其他地區：0577-96699

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

（19）漢口銀行股份有限公司

註冊地址：武漢市江岸區建設大道 933 號

辦公地址：武漢市江岸區建設大道 933 號

法人代表人：陳新民

聯繫人：曾武

電話：027-82656704

傳真：027-82656213

客服電話：4006-096-558

網址：<http://www.hkbchina.com>

（20）江蘇銀行股份有限公司

地址：南京市洪武北路 55 號

法定代表人：夏平

聯繫人：田春慧

客服電話：95319

電話：025-58587018

傳真：025-58588164

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

（21）渤海銀行股份有限公司

註冊地址：天津市河東區海河東路 218 號

法定代表人：李伏安

客服電話：95541

聯繫人：王宏

電話：022-58316666

傳真：022-58316259

網址：<http://www.cbhb.com.cn>

（22）張家港農村商業銀行股份有限公司

註冊地址：張家港市楊舍鎮人民中路 66 號

法定代表人：王自忠

客服電話：0512-96065

聯繫人：施圓圓

電話：0512-56968212

傳真：0512-58236370

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

（23）洛陽銀行股份有限公司

註冊地址：洛陽市洛龍區開元大道 256 號

辦公地址：洛陽市洛龍區開元大道 256 號

客服電話：0379-96699

法定代表人：王建甫

聯繫人：胡豔麗

電話：0379-65921977

傳真：0379-65921851

網址：[www.bankofluoyang.com.cn](http://www.bankofluoyang.com.cn)

（24）重慶銀行股份有限公司

註冊地址：重慶市渝中區鄒容路 153 號

辦公地址：重慶市江北區永平門街 6 號

法定代表人：林軍

傳真：023-63367205

客服電話：400-70-96901

網址：[www.cqcbank.com](http://www.cqcbank.com)

（25）江蘇江南農村商業銀行股份有限公司

註冊地址：常州市和平中路 413 號

辦公地址：常州市和平中路 413 號

法人代表：陸向陽

公告聯繫人：李仙

聯繫電話：0519-89995939

公告傳真：0519-89995170

客服電話：0519-96005

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

（26）長沙銀行股份有限公司

註冊地址：湖南長沙市芙蓉中路 1 段 433 號

法定代表人：朱玉國

電話：0731-84305627

傳真：0731-89736273

聯繫人：吳波

客服電話：0731-96511

網址：[www.cscb.cn](http://www.cscb.cn)

（27）鄭州銀行股份有限公司

註冊地址：鄭州市鄭東新區商務外環路 22 號

法定代表人：王天宇

客服電話：967585（河南地區）、4000-967585（全國）

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

## (28) 四川天府銀行股份有限公司

註冊地址：四川省南充市涪江路1號

法定代表人：邢敏

辦公地址：四川省南充市涪江路1號

客服熱線：40016-96869

公司網址：[www.tf.cn](http://www.tf.cn)

## (29) 恒豐銀行股份有限公司

註冊地址：山東省濟南市曆下區濼源大街8號

法定代表人：陳穎

聯繫人：張昊

電話：021-63890139

客服電話：95395

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

## (30) 深圳前海微眾銀行股份有限公司

註冊地址：深圳市南山區桃園路田廈國際中心A36樓

法定代表人：顧敏

客服電話：95384

聯繫人：羅曦

電話：0755 - 89462447

網址：<http://www.webank.com>

## (31) 晉城銀行股份有限公司

註冊地址：山西省晉城市文昌西街1669號

辦公地址：山西省太原市高新區高新街聯合大廈

法定代表人：賈沁林

聯繫人：朱丹

聯繫電話：18734835708

客服電話：95105757

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

## (32) 中原銀行股份有限公司

註冊地址：河南省鄭州市鄭東新區CBD商務外環路23號中科金座大廈

辦公地址：河南省鄭州市鄭東新區CBD商務外環路23號中科金座大廈

法定代表人：郭浩

聯繫人：田力源

電話：0371-61910219

客戶服務電話：95186

網址：[www.zybank.com.cn](http://www.zybank.com.cn)

（33）九江銀行股份有限公司

註冊地址：江西省九江市濂溪區長虹大道 619 號

法定代表人：劉羨庭

辦公地址：江西省九江市長虹大道 619 號

客服熱線：95316

公司網址：[www.jjccb.com](http://www.jjccb.com)

（34）貴州銀行股份有限公司

註冊地址：貴州省貴陽市觀山湖區永昌路 9 號

辦公地址：貴州省貴陽市觀山湖區永昌路 9 號

法定代表人：楊明尚

聯繫人：張敏婕

聯繫電話：0851-88606545

客戶服務電話：96655（全省）4000696655（全國）

網址：[www.bgzchina.com](http://www.bgzchina.com)

（35）中信百信銀行股份有限公司

註冊地址：北京市朝陽區安東路 5 號院 3 號樓 8 層

辦公地址：北京市朝陽區安東路 5 號院 3 號樓 6-11 層

法定代表人：李如東

聯繫人：韓曉彤

聯繫電話：010-50925699

客戶服務電話：400-818-0100

網址：[www.aibank.com](http://www.aibank.com)

（36）國泰君安證券股份有限公司

註冊地址：中國（上海）自由貿易試驗區商城路 618 號

辦公地址：上海市靜安區南京西路 768 號國泰君安大廈

法定代表人：賀青

聯繫電話：021-38676666

傳真：021-38670666

聯繫人：鍾偉鎮

客戶服務電話：95521

網址：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)



## (37) 中信建投證券股份有限公司

註冊地址：北京市朝陽區安立路 66 號 4 號樓

法定代表人：王常青

客服電話：4008888108

聯繫人：權唐

電話：010-85130577

傳真：010-65182261

網址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

## (38) 國信證券股份有限公司

註冊地址：深圳市羅湖區紅嶺中路 1012 號國信證券大廈十六層至二十六層

法定代表人：張納沙

客服電話：95536

聯繫人：李穎

電話：0755-82130833

傳真：0755-82133952

網址：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

## (39) 招商證券股份有限公司

註冊地址：深圳市福田區益田路江蘇大廈 A 座 38-45 層

法定代表人：宮少林

客服電話：95565

聯繫人：黃嬋君

電話：0755-82960167

傳真：0755-82943636

網址：[www.cmschina.com](http://www.cmschina.com)

## (40) 廣發證券股份有限公司

註冊地址：廣東省廣州市黃埔區中新廣州知識城騰飛一街 2 號 618 室

辦公地址：廣東省廣州天河區馬場路 26 號廣發證券大廈

法定代表人：林傳輝

聯繫人：黃嵐

電話：020-6633888

客戶服務電話：95575、02095575 或致電各地營業部

網址：[www.gf.com.cn](http://www.gf.com.cn)

傳真：020-87555305

網址：[www.gf.com.cn](http://www.gf.com.cn)

(41) 中信證券股份有限公司

註冊地址：廣東省深圳市福田區中心三路 8 號卓越時代廣場（二期）北座

法定代表人：張佑君

客服電話：95548

聯繫人：顧凌

電話：010-60838696

傳真：010-84865560

網址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

(42) 中國銀河證券股份有限公司

註冊地址：北京市豐台區西營街 8 號院 1 號樓 7 至 18 層 101

法定代表人：陳共炎

客服電話：4008-888-888

聯繫人：辛國政

聯繫電話：010-83574507

傳真：010-83574807

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

(43) 海通證券股份有限公司

註冊地址：上海市廣東路 689 號

法定代表人：周傑

客服電話：95553、400-888-8001

聯繫人：李笑鳴

電話：021-23219000

傳真：021-63602722

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

(44) 申萬宏源證券有限公司

通訊地址：上海市徐匯區長樂路 989 號 40 層

法定代表人：楊玉成

客服電話：95523

聯繫人：曹曄

電話：021-54033888

傳真：021-54038844

網址：[www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

(45) 興業證券股份有限公司

住所：福州市湖東路 268 號

辦公地址：上海市浦東新區長柳路 36 號

法定代表人：楊華輝

電話：021-38565547

聯繫人：喬琳雪

網址：[www.xyzq.com.cn](http://www.xyzq.com.cn)

客戶服務電話：95562

（46）長江證券股份有限公司

註冊地址：武漢市新華路特 8 號長江證券大廈

法定代表人：楊澤柱

客戶服務熱線：95579、4008-888-999

聯繫人：奚博宇

電話：027-65799999

傳真：027-85481900

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

（47）國投證券股份有限公司

註冊地址：深圳市福田區福田街道福華一路 119 號安信金融大廈

辦公地址：深圳市福田區福田街道福華一路 119 號安信金融大廈

法定代表人：段文務

聯繫人：陳劍虹

電話：0755-81682519

客戶服務電話：95517

網址：<http://www.essence.com.cn/>

（48）西南證券股份有限公司

地址：重慶市江北區金沙門路 32 號西南證券總部大樓

法定代表人：餘維佳

客服電話：95523

聯繫人：張煜

聯繫電話：023-63786633

網址：[www.swsc.com.cn](http://www.swsc.com.cn)

（49）湘財證券股份有限公司

註冊地址：湖南省長沙市天心區湘府中路 198 號新南城商務中心 A 棟 11 樓

辦公地點：湖南省長沙市天心區湘府中路 198 號新南城商務中心 A 棟 11 樓

法定代表人：高振營

電話：021-38784580-8918

傳真：021-68865680

聯繫人：李欣

郵編：410004

客服電話：95351

網址：[www.xcsc.com](http://www.xcsc.com)

（50）萬聯證券股份有限公司

註冊地址：廣東省廣州市天河區珠江東路 11 號高德置地廣場 F 座 18、19 層

辦公地址：廣東省廣州市天河區珠江東路 11 號高德置地廣場 E 座 12 層

法定代表人：羅欽城

聯繫人：丁思

聯繫電話：020-83988334

客服電話：95322

網址：[www.wlzq.cn](http://www.wlzq.cn)

（51）渤海證券股份有限公司

註冊地址：天津市經濟技術開發區第二大街 42 號寫字樓 101 室

法定代表人：王春峰

聯繫人：蔡霆

電話：022-28451991

傳真：022-28451892

客服電話：956066

網址：[WWW.EWWW.COM.CN](http://WWW.EWWW.COM.CN)

（52）華泰證券股份有限公司

註冊地址：南京市江東中路 228 號

辦公地址：南京市建鄴區江東中路 228 號華泰證券廣場

法定代表人：周易

客服電話：95597

聯繫人：龐曉芸

電話：0755-82492193

傳真：0755-82492962

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

（53）中信證券（山東）有限責任公司

註冊地址：青島市嶗山區深圳路 222 號 1 號樓 2001

辦公地址：青島市市南區東海西路 28 號龍翔廣場東座 5 層

法定代表人：肖海峰

聯繫人：趙如意

聯繫電話：0532-85725062

客戶服務電話：95548

網址：<http://sd.citics.com/>

（54）信達證券股份有限公司

地址：北京市西城區鬧市口大街9號院1號樓

法定代表人：張志剛

客服電話：95321

聯繫人：唐靜

聯繫電話：010-63081000

傳真：010-63080978

網址：[www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

（55）東方證券股份有限公司

註冊地址：上海市中山南路318號新源廣場2號樓22-29樓

法定代表人：潘鑫軍

客服電話：95503

聯繫人：胡月茹

電話：021-63325888

傳真：021-63326173

網址：[www.dfzq.com.cn](http://www.dfzq.com.cn)

（56）方正證券股份有限公司

註冊地址：湖南省長沙市芙蓉中路二段華僑國際大廈22-24層

法定代表人：雷傑

客服電話：95571

聯繫人：徐錦福

電話：010-57398062

傳真：010-57398058

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

（57）長城證券股份有限公司

註冊地址：廣東省深圳市福田區深南大道6008號特區報業大廈16-17層

法定代表人：曹宏

聯繫人：金夏

電話：0755-83516289

傳真：83515567

客戶服務熱線：400-666-6888

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

（58）光大證券股份有限公司

辦公地址：上海市靜安區新閘路 1508 號

法定代表人：劉秋明

客服電話：95525

聯繫人：龔俊濤

電話：021-22169999

傳真：021-22169134

網址：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

（59）中信證券華南股份有限公司

註冊地址：廣州市天河區珠江西路 5 號廣州國際金融中心主塔 19 層、20 層

辦公地址：廣州市天河區珠江西路 5 號廣州國際金融中心主塔 19 層、20 層

法定代表人：胡伏雲

聯繫人：陳靖

聯繫電話：020-88836999

客戶服務電話：95548

傳真：020-88836984

網址：[www.gzs.com.cn](http://www.gzs.com.cn)

（60）東北證券股份有限公司

註冊地址：長春市生態大街 6666 號

辦公地址：長春市生態大街 6666 號

法定代表人：李福春

客服電話：95360

聯繫人：安岩岩

電話：0431-85096517

傳真：0431-85096795

網址：[www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

（61）南京證券股份有限公司

辦公地址：南京市玄武區大鐘亭 8 號

法定代表人：步國旬

客服電話：95386

聯繫人：石健

電話：025-83367888

傳真：025-83364032

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

（62）國聯證券股份有限公司

註冊地址：江蘇省無錫市縣前東街 168 號

法定代表人：姚志勇

客服電話：95570

聯繫人：沈剛

電話：0510-82831662

傳真：0510-82830162

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

（63）平安證券股份有限公司

辦註冊地址：深圳市福田區益田路 5033 號平安金融中心 61 層-64 層

法定代表人：何之江

客戶服務熱線：95511-8

聯繫人：王陽

電話：021-38632136

傳真：021-58991896

網址：<http://stock.pingan.com>

（64）財信證券股份有限公司

辦公地址：湖南長沙芙蓉中路二段 80 號順天國際財富中心 26 層

法人代表：蔡一兵

客戶服務熱線：95317

聯繫人：郭磊

傳真：0731-84403439

網址：[www.cfzq.com](http://www.cfzq.com)

（65）東莞證券股份有限公司

註冊地址：東莞市莞城區可園南路一號金源中心 30 樓

法定代表人：陳照星

客服電話：95328

聯繫人：陳士銳

電話：0769-22112151

傳真：0769-22115712

網址：[www.dgzq.com.cn](http://www.dgzq.com.cn)

## (66) 中原證券股份有限公司

地址：鄭州市鄭東新區商務外環路 10 號

法定代表人：菅明軍

客服電話：95377

聯繫人：程月豔，李盼盼，黨靜

聯繫電話：0371-69099882

聯繫傳真：0371-65585899

網址：[www.ccnew.com](http://www.ccnew.com)

## (67) 國都證券股份有限公司

註冊地址：北京市東城區東直門南大街 3 號國華投資大廈 9 層 10 層

法定代表人：王少華

客服電話：400-818-8118

聯繫人：黃靜

電話：010-84183333

傳真：010-84183311-3389

網址：[www.guodu.com](http://www.guodu.com)

## (68) 東海證券股份有限公司

註冊地址：江蘇省常州延陵西路 23 號投資廣場 18 層

辦公地址：上海市浦東新區東方路 1928 號東海證券大廈

法定代表人：錢俊文

電話：021-20333333

傳真：021-50498825

聯繫人：王一彥

客服電話：95531、400-8888-588

網址：[www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

## (69) 國盛證券有限責任公司

註冊地址：江西省南昌市北京西路 88 號江信國際金融大廈

辦公地址：江西省南昌市北京西路 88 號江信國際金融大廈 4 樓

法定代表人：徐麗峰

聯繫人：周欣玲

電話：0791-86281305、13803512671

傳真：0791-86281305

客戶服務電話：956080

網址：[www.gszq.com](http://www.gszq.com)



## (70) 華西證券股份有限公司

註冊地址：四川省成都市高新區天府二街 198 號華西證券大廈

法定代表人：楊炯洋

客戶服務熱線：4008888818

聯繫人：金達勇

電話：0755-83025723

傳真：0755-83025991

網址：www.hx168.com.cn

## (71) 申萬宏源西部證券有限公司

註冊地址：新疆烏魯木齊市高新區（新市區）北京南路 358 號大成國際大廈 20 樓 2005 室

辦公地址：新疆烏魯木齊市高新區（新市區）北京南路 358 號大成國際大廈 20 樓 2005 室

法定代表人：王獻軍

電話：010-88085858

傳真：010-88085195

聯繫人：李巍

客服電話：95523

網址：www.swhysc.com

## (72) 中泰證券股份有限公司

註冊地址：濟南市經七路 86 號

法定代表人：王洪

聯繫人：吳陽

電話：0531-81283938

客服電話：95538

網址：www.zts.com.cn

## (73) 世紀證券有限責任公司

註冊地址：深圳市前海深港合作區南山街道桂灣五路 128 號前海深港基金小鎮對沖基金中心 406

辦公地址：深圳市福田區深南大道招商銀行大廈 40-42 層

法定代表人：李強

客服電話：0755-83199599

聯繫人：袁媛

電話：0755-83199511

傳真：0755-83199545

網址：[www.csc.com.cn](http://www.csc.com.cn)

（74）第一創業證券股份有限公司

地址：深圳市羅湖區筍崗路 12 號中民時代廣場 B 座 25F

法人代表：劉學民

電話：95358

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

（75）中航證券有限公司

註冊地址：南昌市紅穀灘新區紅穀中大道 1619 號國際金融大廈 A 座 41 樓

辦公地址：南昌市紅穀灘新區紅穀中大道 1619 號國際金融大廈 A 座 41 樓

法人代表：王宜四

客戶服務電話：95335

聯繫人：戴蕾

電話：0791-86768681

傳真：0791-86770178

網址：[www.avicsec.com](http://www.avicsec.com)

（76）華福證券有限責任公司

註冊地址：福州市五四路 157 號新天地大廈 7、8 層

法定代表人：黃金琳

客服電話：95547

聯繫人：張宗銳

電話：0591-87383600

傳真：0591-87841150

網址：[www.hfzq.com.cn](http://www.hfzq.com.cn)

（77）華龍證券有限責任公司

註冊地址：甘肅省蘭州市靜寧路 308 號

法定代表人：韓鵬

聯繫人：楊曉天

聯繫電話：0931-8784509

傳真：0931-4890619

甘肅省客服電話：96668

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

（78）中國國際金融股份有限公司

註冊地址：北京市朝陽區建國門外大街 1 號國貿大廈 2 座 27 層及 28 層

辦公地址：北京市建國門外大街甲 6 號 SK 大廈

法定代表人：沈如軍

聯繫人：楊涵宇

電話：010-65051166

網址：[www.ciccs.com.cn](http://www.ciccs.com.cn)

（79）甬興證券有限公司

辦公地址：浙江省寧波市鄞州區海晏北路 565、577 號 8-11 層

法定代表人：李抱

網址：[www.yongxingsec.com](http://www.yongxingsec.com)

（80）華鑫證券有限責任公司

註冊地址：深圳市福田區金田路 4018 號安聯大廈 28 層 A01、B01（b）單元

辦公地址：上海市肇嘉浜路 750 號

法定代表人：俞洋

聯繫人：陳敏

網站：[www.cfsc.com.cn](http://www.cfsc.com.cn)

客服電話：95323

（81）瑞銀證券有限責任公司

註冊地址：北京市西城區金融大街 7 號英藍國際金融中心 12 層、15 層

法定代表人：程宜蓀

電話：010-58328373

傳真：010-58328748

聯繫人：馮爽

客服電話：400-887-8827

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

（82）中國中金財富證券有限公司

註冊地址：深圳市福田區益田路與福中路交界處榮超商務中心 A 棟第 18 層-21 層及第 04 層 01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 單元

辦公地址：深圳市福田區益田路 6003 號榮超商務中心 A 棟第 04、18 層至 21 層

法定代表人：高濤

聯繫人：劉毅

客戶電話：400 600 8008

電話：0755-82023442

傳真：0755-82026539

網址：[www.china-invs.cn](http://www.china-invs.cn)

## (83) 中山證券有限責任公司

註冊地址：深圳市南山區科技中一路西華強高新發展大樓 7 層、8 層

辦公地址：深圳市南山區科技中一路西華強高新發展大樓 7 層、8 層

法定代表人：林炳城

電話：0755-82943755

傳真：0755-82960582

客戶服務電話：95329

網址：[www.zszq.com](http://www.zszq.com)

## (84) 東方財富證券股份有限公司

註冊地址：西藏自治區拉薩市柳梧新區國際總部城 10 棟樓

辦公地址：上海市徐匯區宛平南路 88 號東方財富大廈

法定代表人：徐偉琴

客服電話：95357

聯繫人：付佳

電話：021-23586603

傳真：021-23586860

網址：<http://www.18.cn>

## (85) 粵開證券股份有限公司

註冊地址：廣州經濟技術開發區科學大道 60 號開發區金控中心 21、22、23 層

辦公地址：深圳市福田區深南中路 2002 號中廣核大廈北樓 10 層

法定代表人：嚴亦斌

聯繫人：彭蓮

聯繫電話：0755-83331195

客戶服務電話：95564

公司網址：<http://www.ykzq.com>

## (86) 江海證券有限公司

辦公地址：哈爾濱市香坊區贛水路 56 號

法人代表：孫名揚

電話：0451-85863726

客服熱線：956007

聯繫人：周俊

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

## (87) 華源證券股份有限公司

註冊地址：青海省西寧市南川工業園區創業路 108 號

辦公地址：北京市朝陽區安立路 30 號仰山公園東一門 2 號樓

法人代表人：魏先鋒

電話：010-57672000

傳真：010-57672296

客戶服務電話：95305

網址：<https://www.jzsec.com/>

## (88) 國金證券股份有限公司

註冊地址：成都市東城根上街 95 號

聯繫人：劉婧漪

電話：028-86690057

傳真：028-86690126

客服電話：95310

網址：[www.gjzq.com.cn](http://www.gjzq.com.cn)

## (89) 華寶證券股份有限公司

辦公地址：中國(上海)自由貿易試驗區浦電路 370 號 2、3、4 層

註冊地址：中國(上海)自由貿易試驗區浦電路 370 號 2、3、4 層

法人：劉加海

聯繫人電話：021-20515476

客服電話：4008209898

網址：<https://www.cnhbstock.com/>

## (90) 愛建證券有限責任公司

註冊地址：中國（上海）自由貿易試驗區世紀大道 1600 號 1 幢 32 樓

法定代表人：錢華

客服電話：4001-962-502

聯繫人：陳敏

電話：021-32229888

傳真：021-62878783

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

## (91) 英大證券有限責任公司

地址：深圳市福田區深南中路華能大廈三十、三十一層

法定代表人：吳俊

聯繫人：吳爾暉

電話：0755-83007159

傳真：0755-83007034

客服電話：0755-26982993

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

（92）國新證券股份有限公司

註冊地址：北京市西城區車公莊大街4號2幢1層A2112室

辦公地址：北京市朝陽區朝陽門北大街18號中國人保壽險大廈

法人：張海文

客服電話：95390

官網地址：[www.crsec.com.cn](http://www.crsec.com.cn)

（93）天風證券股份有限公司

註冊地址：湖北省武漢市東湖新技術開發區關東園路2號高科大廈四樓

法定代表人：餘磊

聯繫人：翟璟

聯繫電話：（027）87618882/（028）86711410

傳真：（027）87618863

客戶服務電話：95391

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

（94）宏信證券有限責任公司

辦公地址：四川省成都市人民南路二段18號川信大廈10樓

法人代表人：吳玉明

客服電話：4008366366

聯繫人：劉文濤

電話：02886199765

傳真：02886199533

網址：<http://www.hx818.com>

（95）聯儲證券有限責任公司

註冊地址：深圳市福田區福田街道崗廈社區深南大道南側金地中心大廈9樓

辦公地址：北京市朝陽區安定路5號院3號樓中建財富國際中心27層聯儲證券

法定代表人：呂春衛

聯繫人：丁倩雲

聯繫電話：010-86499427、13051859661

傳真：0755-23947482

客服電話：956006

網址：<http://www.lczq.com/>

(96) 中信期貨有限公司

註冊地址：深圳市福田區中信三路 8 號卓越時代廣場（二期）北座 13 層 1301-1305 室、  
14 層

辦公地址：深圳市福田區中信三路 8 號卓越時代廣場（二期）北座 13 層 1301-1305 室、  
14 層

法定代表人：張皓

聯繫人：劉宏瑩

聯繫電話：010-60833754

傳真：0755-83217421

客服電話：400-990-8826

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

(97) 徽商期貨有限責任公司

註冊地址：合肥市蕪湖路 258 號

法人代表人：吳國華

聯繫人：蔡芳

傳真：0551-62862801

客戶服務電話：4008878707

網址：<http://www.hsqh.net>

(98) 東海期貨有限責任公司

註冊地址：江蘇省常州市延陵西路 23、25、27、29 號

辦公地址：上海市浦東新區東方路 1928 號東海證券大廈 8 樓

法定代表人：陳太康

聯繫人：李天雨

聯繫電話：021-68757102

客服電話：95531、4008888588

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

(99) 天相投資顧問有限公司

註冊地址：北京市西城區金融街 19 號富凱大廈 B 座 701

法定代表人：林義相

客服電話：010-66045678

聯繫人：尹伶

傳真：010-66045527

網址：[www.txsec.com](http://www.txsec.com)

(100) 鼎信匯金(北京)投資管理有限公司

註冊地址：北京市朝陽區霄雲路 40 號院 1 號樓 3 層 306 室

辦公地址：北京市朝陽區霄雲路 40 號院 1 號樓 3 層 306 室

法定代表人：齊凌峰

聯繫人：陳臣

聯繫方式：010-84489855-8011

客服電話：400-158-5050

網址：<http://www.tl50.com>

(101) 深圳市新蘭德證券投資諮詢有限公司

註冊地址：深圳市福田區華強北路賽格科技園 4 棟 10 層 1006 號

法定代表人：楊懿

辦公地址：深圳市福田區華強北路賽格科技園 4 棟 10 層 1006 號

聯繫人：張燕

聯繫電話：010-58325388\*1588

客戶服務電話：010-83275199

網址：[www.xinlande.com.cn](http://www.xinlande.com.cn)

(102) 和讯資訊科技有限公司

註冊地址：北京市朝陽區朝外大街 22 號泛利大廈 10 層

法定代表人：王莉

聯繫人：劉洋

聯繫電話：021-20835785

傳真：021-20835879

客服電話：400-920-0022

網址：<http://licaike.hexun.com>

(103) 上海挖財基金銷售有限公司

註冊地址：中國(上海)自由貿易試驗區楊高南路 759 號 18 層 03 單元

辦公地址：中國(上海)自由貿易試驗區楊高南路 759 號 18 層 03 單元

法定代表人：呂柳霞

聯繫人：毛善波

電話：021-50810673

傳真：021-50810687

客服電話：021-50810673

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



## (104) 騰安基金銷售(深圳)有限公司

註冊地址：深圳市前海深港合作區前灣一路1號A棟201室（入駐深圳市前海商務秘書有限公司）

辦公地址：深圳市南山區高新科技園科技中一路騰訊大廈11層

法人代表：劉明軍

公告聯繫人：譚廣峰

公告電話：4000-890-555

公告傳真：0755-86013399

客服電話：4000-890-555

網址：[www.tenganxinxi.com](http://www.tenganxinxi.com)

## (105) 北京度小滿基金銷售有限公司

註冊地址：北京市海澱區西北旺東路10號院西區4號樓1層103室

法定代表人：葛新

辦公地址：北京市海澱區西北旺東路10號院西區4號樓

機構聯繫人：孫博超

聯繫人電話：010-59403028

聯繫人傳真：010-59403027

客戶服務電話：95055-4

公司網址：<https://www.duxiaomanfund.com/>

## (106) 諾亞正行基金銷售有限公司

註冊地址：上海市虹口區飛虹路360弄9號3724室

法定代表人：汪靜波

辦公地址：上海市楊浦區昆明路508號北美廣場B座12樓

聯繫人：徐誠

聯繫電話：021-38509639

網站：[www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

客服電話：400-821-5399

## (107) 深圳眾祿基金銷售股份有限公司

註冊地址：深圳市羅湖區筍崗街道梨園路物資控股置地大廈8樓801

法定代表人：薛峰

聯繫人：童彩平

電話：0755-33227950

傳真：0755-82080798

網址：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn)

客服電話：4006-788-887

（108）上海天天基金銷售有限公司

註冊地址：上海市徐匯區龍田路 195 號 3C 座 9 樓

法人代表：其實

聯繫人：潘世友

電話：021-54509998

傳真：021-64383798

客服電話：400-1818-188

網址：www.1234567.com.cn

（109）上海好買基金銷售有限公司

註冊地址：上海市虹口區場中路 685 弄 37 號 4 號樓 449 室

辦公地址：上海市浦東新區浦東南路 1118 號鄂爾多斯國際大廈 903-906

法定代表人：楊文斌

客服電話：400-700-9665

聯繫人：張茹

聯繫電話：021-58870011

傳真：021-68596916

網址：www.howbuy.com

（110）螞蟻（杭州）基金銷售有限公司

註冊地址：浙江省杭州市餘杭區五常街道文一西路 969 號 3 幢 5 層 599 室

辦公地址：浙江省杭州市西湖區西溪路 556 號

法定代表人：王琚

聯繫人：韓愛彬

客戶服務電話：95188-8

網址：www.fund123.cn

（111）上海長量基金銷售有限公司

辦公地址：上海市浦東新區東方路 1267 號 11 層

法定代表人：張躍偉

客服電話：4008202899

聯繫人：邱燕芳

電話：021-20691931

傳真：021-20691861

網址：www.erichfund.com

## (112) 浙江同花順基金銷售有限公司

註冊地址：杭州市西湖區文二西路 1 號元茂大廈 903 室

辦公地址：浙江省杭州市西湖區翠柏路 7 號電子商務產業園 2 號樓

法人代表：凌順平

聯繫人：林海明

電話：0571-88911818-8580

傳真：0571-88911818-8002

客服電話：952555

網站地址：www.5ifund.com

## (113) 上海利得基金銷售有限公司

註冊地址：上海市寶山區蘊川路 5475 號 1033 室

辦公地址：上海市浦東新區峨山路 91 弄 61 號 1 幢 14 層

法定代表人：李興春

傳真：021-50583633

電話：021-50583533

客服電話：4000325885

網址：www.leadfund.com.cn

## (114) 嘉實財富管理有限公司

註冊地址：上海市浦東新區世紀大道 8 號上海國金中心辦公樓二期 53 層 5312-15 單元

法定代表人：趙學軍

電話：010-65215588

傳真：010-85712195

聯繫人：李雯

聯繫人郵箱：liwen@harvestwm.cn

客服電話：400-021-8850

網址：www.harvestwm.cn

## (115) 泛華普益基金銷售有限公司

註冊地址：四川省成都市成華區建設路 9 號高地中心 1101 室

辦公地址：四川省成都市金牛區西宸龍湖國際大廈 B 座 12 樓

法定代表人：於海鋒

聯繫人：隋亞方

電話：13910181936

客服電話：400-080-3388

網址：www.puyifund.com

## (116) 南京蘇寧基金銷售有限公司

註冊地址：南京市玄武區蘇寧大道 1-5 號

辦公地址：南京市玄武區蘇寧大道 1-5 號

法定代表人：王鋒

客服電話：95177

網址：<https://www.snjjin.com/>

## (117) 北京中植基金銷售有限公司

註冊地址：北京市北京經濟技術開發區宏達北路 10 號五層 5122 室

辦公地址：北京朝陽區大望路金地中心 A 座 28 層

法定代表人：武建華

傳真：(010) 56642623

聯繫人：叢瑞豐

聯繫人電話：010-59313555

客服郵箱：zzkf@zzfund.com

客服電話：400-8180-888

網址：<http://www.zzfund.com>

## (118) 北京匯成基金銷售有限公司

註冊地址：北京市海澱區中關村大街 11 號 11 層 1108

法定代表人：王偉剛

聯繫人：丁向坤

電話：010-56282140

傳真：010-62680827

客戶服務電話：400-055-5728

網址：<http://www.hcfunds.com>

## (119) 北京錢景基金銷售有限公司

註冊地址：北京市海澱區丹棱街 6 號 1 幢 9 層 1008-1012

辦公地址：北京市海澱區丹棱街 6 號中關村金融大廈（丹棱 soho）1008

法定代表人：趙榮春

聯繫人：魏爭

網站：[www.qianjing.com](http://www.qianjing.com)

客服電話：400-893-6885

## (120) 海銀基金銷售有限公司

註冊地址：中國（上海）自由貿易試驗區銀城中路 8 號 402 室

辦公地址：上海市浦東新區銀城中路 8 號 4 樓

法定代表人：鞏巧麗

聯繫人：李卓南

聯繫方式：021-80134149

客服電話：400-808-1016

網址：[www.fundhaiyin.com](http://www.fundhaiyin.com)

（121）上海大智慧基金銷售有限公司

辦公地址：中國上海市浦東新區楊高南路 428 號 1 號樓 1102 單元

註冊地址：中國（上海）自由貿易試驗區楊高南 428 號 1 號樓 1102 單元

法人：張俊

客服電話：021-20292031

網址：[www.wg.com.cn](http://www.wg.com.cn)

（122）北京新浪倉石基金銷售有限公司

註冊地址：北京市海澱區東北旺西路中關村軟體園二期（西擴）N-1、N-2 地塊新浪總部科研樓 5 層 518 室

辦公地址：北京市海澱區東北旺西路中關村軟體園二期（西擴）N-1、N-2 地塊新浪總部科研樓

法定代表人：穆飛虎

聯繫人：穆飛虎

聯繫電話：010-58982465

傳真：010-62676582

客服電話：010-62675369

網址：[www.xincai.com](http://www.xincai.com)

（123）上海萬得基金銷售有限公司

註冊地址：中國（上海）自由貿易試驗區福山路 33 號 11 樓 B 座

辦公地址：上海市浦東新區浦明路 1500 號萬得大廈 11 樓

法定代表人：黃祎

聯繫人：徐亞丹

聯繫電話：021-50712782

傳真：021-50710161

客服電話：400-799-1888

網址：[www.520fund.com.cn](http://www.520fund.com.cn)

（124）上海聯泰基金銷售有限公司

註冊地址：上海市普陀區蘭溪路 900 弄 15 號 526 室

辦公地址：上海市虹口區臨潼路 188 號

法定代表人：尹彬彬

電話：021-52822063

傳真：021-52975270

客服電話：400-118-1188

公司網址：[www.66liantai.com](http://www.66liantai.com)

（125）泰信財富基金銷售有限公司

註冊地址：北京市朝陽區建國路甲 92 號-4 至 24 層內 10 層 1012

辦公地址：北京市朝陽區建國路乙 118 號京匯大廈 10 層 1206

法定代表人：彭浩

客服電話：4000048821

網址：[www.taixincf.com](http://www.taixincf.com)

（126）上海基煜基金銷售有限公司

住所：上海市崇明縣長興鎮路潘園公路 1800 號 2 號樓 6153 室（上海泰和經濟發展區）

辦公地址：上海市楊浦區昆明路 518 號 a1002 室

法定代表人：王翔

聯繫人：安彬

客服電話：400-820-5369

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

（127）上海凱石財富基金銷售有限公司

註冊地址：上海市黃浦區西藏南路 765 號 602-115 室

法定代表人：陳繼武

客服電話：400-643-3389

聯繫人：葛佳蕊

電話：021-63333319

傳真：021-63332523

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

（128）上海中正達廣基金銷售有限公司

註冊地址：上海市徐匯區龍騰大道 2815 號 302 室

辦公地址：上海市龍蘭路 277 號 1 號樓 1203、1204 室

法定代表人：黃欣

公司電話：021-3376-8132

客服電話：400-6767-523

網址：<http://www.zzwealth.cn>

(129) 北京虹點基金銷售有限公司

註冊地址：北京市朝陽區工人體育場北路甲 2 號裙房 2 層 222 單元

辦公地址：北京市朝陽區工人體育場北路甲 2 號裙房 2 層 222 單元

法定代表人：胡偉

傳真：010-65951887

電話：010-65951887

客服電話：400-618-0707

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

(130) 武漢市伯嘉基金銷售有限公司

註冊地址：湖北省武漢市江漢區武漢中央商務區泛海國際 SOHO 城（一期）第 7 棟 23 層 1 號、4 號

法定代表人：陶捷

聯繫人：楊帆

電話：027-87006003、87006009

網站：[www.buyfunds.cn](http://www.buyfunds.cn)

公司傳真：027-87006010

客服電話：400-027-9899

(131) 上海陸金所基金銷售有限公司

註冊地址：中國（上海）自由貿易試驗區陸家嘴環路 1333 號 14 樓 09 單元

法定代表人：王之光

辦公地址：中國（上海）自由貿易試驗區陸家嘴環路 1333 號 14 樓 09 單元

聯繫人：寧博宇

客服電話：4008219031

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

(132) 珠海盈米基金銷售有限公司

註冊地址：珠海市橫琴新區寶華路 6 號 105 室-3491

法定代表人：肖雯

辦公地址：廣州市海珠區琶洲大道東 1 號保利國際廣場南塔 12 樓 B1201-1203

聯繫人：黃敏嫦

網站：[www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

客服電話：020-89629066

(133) 和耕傳承基金銷售有限公司

註冊地址：河南自貿試驗區鄭州片區（鄭東）東風南路東康寧街北 6 號樓 5 樓 503 房間

辦公地址：北京市朝陽區酒仙橋路 6 號院國際電子城 b 座

法定代表人：王旋

客服電話：4000-555-671

網址：<http://www.hgccpb.com/>

（134）奕豐基金銷售有限公司

註冊地址：深圳市前海深港合作區前灣一路 1 號 A 棟 201 室（入住深圳市前海商務秘書有限公司）

辦公地址：深圳市南山區海德三路航天科技廣場 A 座 17 樓 1704 室

法定代表人：TEO WEE HOWE

聯繫人：葉健

電話：0755-89460507

傳真：0755-21674453

客服電話：400-684-0500

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

（135）京東肯特瑞基金銷售有限公司

註冊地址：北京市海澱區中關村東路 66 號 1 號樓 22 層 2603-06

辦公地址：北京市大興區亦莊經濟技術開發區科創十一街 18 號院京東集團總部

法定代表人：鄒保威

客服電話：95118 、400-098-8511（個人業務）、400-088-8816（企業業務）

傳真：010-8919566

網址：<https://kenterui.jd.com>

（136）深圳市金斧子基金銷售有限公司

註冊地址：深圳市南山區粵海街道科技園中區科苑路 15 號科興科學園 B 棟 3 單元 11 層 1108

辦公地址：深圳市南山區粵海街道科技園中區科苑路 15 號科興科學園 B 棟 3 單元 11 層 1108

法定代表人：賴任軍

聯繫人：陳麗霞

電話：0755-84355914

傳真：0755-26920530

客戶服務電話：400-8224-888

網址：[www.jfzinv.com](http://www.jfzinv.com)

（137）北京雪球基金銷售有限公司

註冊地址：北京市朝陽區阜通東大街 1 號院 6 號樓 2 單元 21 層 222507



法定代表人：李楠

客服電話：4001599288

聯繫人：袁永嬌

電話：010-61840688

傳真：010-61840699

網址：<https://danjuanapp.com>

（138）上海中歐財富基金銷售有限公司

註冊地址：中國（上海）自由貿易試驗區陸家嘴環路 479 號 1008-1 室

辦公地址：中國（上海）自由貿易試驗區陸家嘴環路 479 號 1008-1 室

法定代表人：許欣

客服電話：400-100-2666

網址：[www.zocaifu.com](http://www.zocaifu.com)

（139）上海華夏財富投資管理有限公司

註冊地址：上海市虹口區東大名路 687 號 1 幢 2 樓 268 室

法定代表人：毛淮平

辦公地址：北京市西城區金融大街 33 號通泰大廈 B8 層

客服熱線：400-817-5666

公司網址：[www.amcfortune.com](http://www.amcfortune.com)

（140）華瑞保險銷售有限公司

註冊地址：上海市嘉定區南翔鎮眾仁路 399 號運通星財富廣場 1 號樓 B 座 13、14 層

辦公地址：上海市浦東新區向城路 288 號國華人壽金融大廈 8 層 806

法定代表人：路昊

聯繫人：茆勇強

聯繫電話：021-68595698

傳真：021-68595766

客服電話：52303

網址：<http://www.huaruisales.com/>

（141）玄元保險代理有限公司

辦公地址：中國（上海）自由貿易試驗區張楊路 707 號 1105 室

法定代表人：馬永諳

聯繫人：盧亞博

聯繫電話：021-50701003

傳真：021-50701053

客服電話：400-080-8208

網址：[www.licaimofang.cn](http://www.licaimofang.cn)

（142）陽光人壽保險股份有限公司

註冊地址：海南省三亞市迎賓路 360-1 號三亞陽光金融廣場 16 層

辦公地址：北京市朝陽區景輝街 33 號院 1 號樓陽光金融中心

法定代表人：李科

電話：010-85632771

傳真：010-85632773

聯繫人：王超

客戶服務電話：95510

公司網站：<http://fund.sinosig.com/>

（143）方德保險代理有限公司

註冊地址：北京市東城區崇文門外 16 號 1 幢 8 層 802

辦公地址：北京市東城區崇文門外 16 號 1 幢 8 層 802

法定代表人：邢耀

客戶服務電話：400-1007679

網址：<http://www.fundsure.cn>

（144）中國人壽保險股份有限公司

註冊地址：北京市西城區金融大街 16 號

辦公地址：北京市西城區金融大街 16 號

法定代表人：王濱

客服電話：95519

聯繫人：秦澤偉

電話：010-63631539

傳真：010-66222276

網址：[www.e-chinalife.com](http://www.e-chinalife.com)

基金管理人可根據有關法律、法規的要求，選擇其他符合要求的機構代理銷售本基金，並在基金管理人網站公示。

## （二）註冊登記機構

名稱：大成基金管理有限公司

住所：廣東省深圳市南山區海德三道 1236 號大成基金總部大廈 5 層、27-33 層

辦公地址：廣東省深圳市南山區海德三道 1236 號大成基金總部大廈 27 層

法定代表人：吳慶斌

電話：0755-83183388

傳真：0755-83195239

聯繫人：黃慕平

（三） 律師事務所和經辦律師

名稱：北京市金杜律師事務所

註冊地址：北京市朝陽區東三環中路 7 號財富中心寫字樓 A 座 40 層

辦公地址：北京市朝陽區東三環中路 7 號財富中心寫字樓 A 座 40 層

負責人：王玲

電話：0755-22163333

傳真：0755-22163390

經辦律師：沈娜、馮艾

聯繫人：馮艾

（四） 會計師事務所和經辦註冊會計師

名稱：普華永道中天會計師事務所(特殊普通合夥)

住所：中國(上海)自由貿易試驗區陸家嘴環路 1318 號星展銀行大廈 507 單元 01 室

辦公地址：上海市浦東新區東育路 588 號前灘中心 42 樓

執行事務合夥人：李丹

電話：021-23238888

傳真：021-23238800

聯繫人：徐翹楚

經辦註冊會計師：陳熹、徐翹楚

## 六、基金合同的生效

### （一）基金合同的生效

根據相關法規和《大成內需增長股票型證券投資基金基金合同》的有關規定，基金合同已於 2011 年 6 月 14 日正式生效，自基金合同生效之日起，本基金管理人大成基金管理有限公司正式開始管理本基金。

### （二）基金存續期內基金份額持有人數量和資金額的限制

《基金合同》生效後，連續 20 個工作日出現基金份額持有人數量不滿 200 人或者基金資產淨值低於 5000 萬元情形的，基金管理人應當在定期報告中予以披露；連續 60 個工作日出現前述情形的，基金管理人應當向中國證監會報告並提出解決方案，如轉換運作方式或與其他基金合併等，並召開基金份額持有人大會進行表決。

法律法規或監管部門另有規定的，按其規定辦理。

### （三）基金類型及存續期限

基金類型：混合型

基金運作方式：契約型開放式

基金存續期限：不定期

### （四）基金份額分類

本基金根據申購費用、銷售服務費收取方式等不同和銷售地區的不同設置 A 類份額、C 類份額和 H 類份額，三類基金份額單獨設置基金代碼，並分別公佈基金份額單位淨值。A 類、C 類份額在中國大陸地區進行銷售，H 類份額根據中港兩地基金互認安排在香港地區進行銷售，三類份額之間不能相互轉換。

基金管理人可以根據基金實際運作情況，在不違反法律法規且對基金份額持有人利益無實質不利影響的前提下，履行適當程序後，對基金份額分類規則和辦法進行調整並公告。

## 七、基金份額的申購、贖回與轉換

### （一）申購與贖回辦理的場所

本基金的申購與贖回將通過基金管理人的直銷中心及代銷機構的代銷網點進行。具體的銷售網站將由基金管理人在本招募說明書或其他公告中列明。基金管理人可根據情況變更或增減代銷機構，並在基金管理人網站公示。銷售機構可以酌情增加或減少其銷售網站、變更營業場所。

### （二）申購、贖回開放日及時間

本基金已於2011年8月15日起開始辦理日常申購、贖回、轉換及定投業務。

本基金A類、C類份額的開放日為上海證券交易所、深圳證券交易所的正常交易日。本基金H類份額的開放日為上海證券交易所、深圳證券交易所和香港聯交所同時交易的正常交易日。三類份額開放日具體辦理時間為上海證券交易所、深圳證券交易所正常交易日的交易時間，但基金管理人根據法律法規、中國證監會的要求或本基金合同的規定公告暫停申購、贖回時除外。

基金合同生效後，若出現新的證券交易市場、證券交易所交易時間變更或其他特殊情況，基金管理人將視情況對前述開放日及開放時間進行相應的調整並公告。

基金管理人不得在基金合同約定之外的日期或者時間辦理基金份額的申購、贖回或者轉換。基金投資者在基金合同約定之外的日期和時間提出申購、贖回或轉換申請的，其基金份額申購、贖回價格為下次辦理基金份額申購、贖回時間所在開放日的價格。

### （三）申購與贖回的原則

1· “未知價”原則，即基金的申購與贖回價格以受理申請當日各類基金份額淨值為基準進行計算，其中C類基金份額申購首日的申購價格為當日A類基金份額的基金份額淨值；

2· 基金採用金額申購和份額贖回的方式，即申購以金額申請，贖回以份額申請；

3· 基金份額持有人在贖回基金份額時，基金管理人按先進先出的原則，即對該基金份額持有人在該銷售機構託管的基金份額進行處理時，份額確認日期在先的基金份額先贖回，份額確認日期在後的基金份額後贖回，以確定所適用的贖回費率；

4· 當日的申購與贖回申請可以在當日業務辦理時間結束前撤銷，在當日的業務辦理時間結束後不得撤銷；

5· 基金管理人在不損害基金份額持有人權益的情況下可更改上述原則，但應在新的原則實施前按照《資訊披露辦法》的有關規定在至少一種指定媒介上公告。

#### （四）申購與贖回的程式

##### 1、申購與贖回申請的提出

基金投資者須按銷售機構規定的手續，在開放日的業務辦理時間內提出申購或贖回的申請。

投資者申購本基金，須按銷售機構規定的方式全額交付申購款項。

投資者提交贖回申請時，其在銷售機構（網點）必須有足夠的基金份額餘額。

##### 2、申購與贖回申請的確認

基金管理人應自身或要求註冊登記機構在T+1日對基金投資者申購、贖回申請的有效性進行確認。投資者應在T+2日到銷售網站櫃檯或以銷售機構規定的其他方式查詢申請的確認情況。

基金銷售機構申購申請的受理並不代表該申請一定成功，而僅代表銷售機構確實接收到申購申請。申購的確認以基金註冊登記機構或基金管理人的確認結果為準。

如基金管理人接受某筆或者某些申購申請有可能導致單一投資者持有基金份額的比例達到或者超過50%，或者基金管理人認為可能存在變相規避50%集中度限制的情形時，基金管理人有权對該單一投資者的申請全部或部分確認失敗。由此，給投資者造成的損失，有投資人自行承擔。

##### 3、申購與贖回申請的款項支付

申購採用全額交款方式，若資金在規定時間內未全額到帳則申購不成功，申購款項將退回投資者帳戶。

投資者贖回申請成交後，基金管理人應通過註冊登記機構按規定向投資者支付贖回款項，贖回款項在自受理基金投資者有效贖回申請之日起不超過7個工作日的時間內劃往投資者銀行帳戶。在發生巨額贖回時，贖回款項的支付辦法按本基金合同和有關法律法規規定處理。

#### （五）申購與贖回的數額限制

1· 投資者申購A類、C類基金份額時，每次申購金額不得低於1元（A類基金份額含申購費，定期定額不受此限制）。投資者可以多次申購，累計申購金額不設上限。投資者申購本基金H類份額時，每次申購金額不得低於1000元。

2· 投資者贖回本基金份額時，可申請將其持有的部分或全部基金份額贖回；本基金可以對投資者每個交易帳戶的最低基金份額餘額以及每次贖回的最低份額做出規定，具體業務規則請見有關公告。

3· 基金管理人可以根據市場情況，在法律法規允許的情況下，調整上述規定的數量或

比例限制。基金管理人必須在調整前依照有關規定在指定媒介和基金管理人網站上公告。

4、單一投資者持有基金份額的比例不得達到或者超過50%，或者以其他方式變相規避50%集中度限制。

5、當接受申購申請對存量基金份額持有人利益構成潛在重大不利影響時，基金管理人應當採取設定單一投資者申購金額上限或基金單日淨申購比例上限、拒絕大額申購、暫停基金申購等措施，切實保護存量基金份額持有人的合法權益。具體請參見相關公告。

#### （六）申購份額與贖回金額的計算方式及費率

1、申購份額的計算方式：申購的有效份額為按實際確認的申購金額在扣除申購費用後，以申請當日各類基金份額淨值為基準計算，各計算結果均按照四捨五入方法，保留小數點後兩位，由此誤差產生的損失由基金資產承擔，產生的收益歸基金資產所有。本基金申購份額具體的計算方法在招募說明書中列示。

2、贖回金額的計算方式：贖回金額為按實際確認的有效贖回份額乘以申請當日各類基金份額淨值的金額，淨贖回金額為贖回金額扣除贖回費用的金額，各計算結果均按照四捨五入方法，保留小數點後兩位，由此誤差產生的損失由基金資產承擔，產生的收益歸基金資產所有。

##### （1）基金申購份額的計算：

###### 1) A 類基金份額：

淨申購金額=申購金額/(1+申購費率)

申購費用=申購金額－淨申購金額

申購份額=淨申購金額/T 日 A 類基金份額淨值

例：某投資人於開放期投資 4 萬元申購本基金 A 類基金份額，申購費率為 1.5%，假設申購當日 A 類基金份額淨值為 1.040 元，則其可得到的申購份額為：

淨申購金額=40,000/(1+1.5%)= 39,408.87 元

申購費用=40,000- 39,408.87 =591.13 元

申購份額=39,408.87/1.04= 37,893.14 份

###### 2) C 類基金份額：

申購份額=申購金額/T 日 C 類基金份額淨值

例：某投資人投資 10 萬元申購本基金 C 類基金份額，假設申購當日 C 類基金份額淨值為 1.016 元。則其可得到的申購份額為：

申購份額=100,000/1.016 = 98,425.20 份

(2) 基金淨贖回金額的計算：

贖回總額 = 贖回份數 × T 日該類基金份額淨值

贖回費用 = 贖回總額 × 贖回費率

贖回金額 = 贖回總額 - 贖回費用

例：某投資者在持有基金份額時間為 6 個月時贖回本基金 10,000 份 A 類基金份額，對應的贖回費率為 0.5%，假設贖回當日 A 類基金份額淨值是 1.050 元，則其可得到的贖回金額為：

贖回總金額 =  $10,000 \times 1.050 = 10,500.00$  元

贖回費用 =  $10,500.00 \times 0.5\% = 52.5$  元

淨贖回金額 =  $10,500.00 - 52.5 = 10447.50$  元

例：某投資人申購本基金 C 類基金份額，持續持有 3 個月後贖回 10 萬份，贖回費率為 0，假設贖回當日 C 類基金份額淨值是 1.017 元，則其可得到的贖回金額為：

贖回費用 = 0 元

贖回金額 =  $100,000 \times 1.017 - 0 = 101,700.00$  元

(3) 基金份額淨值的計算：

T 日各類基金份額淨值 = T 日各類基金份額的基金資產淨值 / T 日該類基金份額總數

T 日的各類基金份額淨值在當天收市後計算，並在 T+1 日內公告。遇特殊情況，經中國證監會同意，可以適當延遲計算或公告。本基金各類基金份額淨值的計算，均保留到小數點後 3 位，小數點後第 4 位四捨五入，由此產生的誤差計入基金財產。

(4) 基金份額、餘額的處理：

申購的有效份額為按實際確認的申購金額在扣除相應的費用後，以當日各類基金份額淨值為基準計算，申購份額計算結果保留到小數點後 2 位，小數點後兩位元以後的部分四捨五入，由此產生的誤差計入基金財產。

(5) 贖回金額的處理方式：

贖回金額為按實際確認的有效贖回份額以當日各類基金份額淨值為基準並扣除相應的費用，贖回金額計算結果保留到小數點後 2 位，小數點後兩位元以後的部分四捨五入，由此產生的誤差計入基金財產。

### 3、申購與贖回的費率

本基金目前開通前端收費模式，將來根據市場發展狀況和法律法規、監管機構的規定，可能增加新的收費模式，也可能相應增加新的基金份額種類，並可能需計算新基金份額類別



的基金份額淨值。增加新的收費模式，應當按照法律法規、監管機構的規定，履行適當的程式，並及時公告。新的收費模式的具體業務規則，請見有關公告、通知。養老金帳戶在基金管理人直銷中心辦理帳戶認證手續後，可享受申購費率優惠，具體情況可詳見公司相關公告。

### （1）申購費率

本基金A類基金份額的申購費用由申購該類基金份額的投資人承擔，不列入基金財產，主要用於本基金的市場推廣、銷售、註冊登記等各項費用。C類基金份額不收取申購費用。

養老金客戶包括基本養老基金與依法成立的養老計劃籌集的資金及其投資運營收益形成的補充養老基金等，包括但不限於：

- 1、全國社會保障基金；
- 2、可以投資基金的地方社會保障基金；
- 3、企業年金單一計劃以及集合計劃；
- 4、企業年金理事會委託的特定客戶資產管理計劃；
- 5、企業年金養老金產品；
- 6、職業年金計劃；
- 7、個人稅收遞延型商業養老保險等產品；
- 8、養老目標證券投資基金。

如將來出現經養老基金監管部門認可的新的養老基金類型，基金管理人可在招募說明書更新時或發佈臨時公告將其納入養老金客戶範圍。

普通客戶指除直銷櫃檯申購的養老金客戶以外的其他客戶。

養老金客戶在基金管理人直銷中心辦理帳戶認證手續後，可享受申購費率一折優惠，申購費為固定金額的，則按原費率執行，不再享有費率折扣。

### 1) 前端收費

A類份額：

申購金額	申購費率
$M < 50$ 萬元	1.50%
$50 \text{ 萬元} \leq M < 200 \text{ 萬元}$	1.00%
$200 \text{ 萬元} \leq M < 500 \text{ 萬元}$	0.60%

M $\geq$ 500 萬元	每筆 1000 元
-----------------	-----------

H類份額：

最高5%，申購費率具體水準由銷售機構確定

## 2) 後端收費

本基金未開通後端收費模式。

## (2) 贖回費率

本基金 A 類份額對持續持有基金份額少於 7 日的投資人收取的贖回費，將全額計入基金財產；對持續持有基金份額長於 7 日（含 7 日）的投資人收取的贖回費，將不低於贖回費總額的 25%歸入基金財產。

本基金 C 類份額的贖回費用由基金份額持有人承擔，贖回費用全部歸入基金資產。

本基金 H 類份額的贖回費用由基金份額持有人承擔，贖回費用全部歸入基金資產。

## A 類份額贖回費率

持有基金時間 T	贖回費率
T < 7 日	1.5%
7 日 $\leq$ T < 1 年	0.5%
1 年 $\leq$ T < 2 年	0.25%
T $\geq$ 2 年	0

## C 類份額贖回費率

持有基金時間 T	贖回費率
T < 7 日	1.5%
7 日 $\leq$ T < 30 日	0.5%
T $\geq$ 30 日	0

H類份額贖回費率為0.13%，贖回費用全部歸入基金資產

#### 4·其他與申購相關的事項

(1) 投資者通過日常申購所得的基金份額，持有期限自註冊登記機構確認登記之日起計算。

(2) 基金管理人可以在履行相關手續後，在基金合同約定的範圍內調整申購費率、調低贖回費率或調整收費方式，基金管理人依照有關規定最遲應於新的費率或收費方式實施日前在指定媒介和基金管理人網站上公告。

(3) 對特定交易方式（如網上交易、電話交易等），基金管理人可以採用低於櫃檯交易方式的基金申購費率和基金贖回費率並依法公告。

(4) 基金管理人可以在不違背法律法規規定及基金合同約定的情況下根據市場情況制定基金促銷計劃，針對基金投資者定期和不定期地開展基金促銷活動。在基金促銷活動期間，基金管理人可以按中國證監會要求履行必要手續後，對基金投資者適當調整基金申購費率、轉換費率和調低贖回費率。

(5) 基金管理人可以在不違背法律法規規定和基金合同約定的情形下對已在本公司直銷中心辦理帳戶認證手續並通過本公司直銷中心申購基金的養老金帳戶進行申購費率優惠。養老金帳戶，包括養老基金與依法成立的養老計劃籌集的資金及其投資運營收益形成的補充養老基金，包括全國社會保障基金、可以投資基金的地方社會保障基金、企業年金單一計劃以及集合計劃。如將來出現經養老基金監管部門認可的新的養老基金類型，本公司將依據規定將其納入養老金帳戶範圍。養老金帳戶申購費率優惠的詳細實施情況，請見基金管理人發佈的相關業務公告。

#### (七) 申購與贖回的註冊登記

1、經基金銷售機構同意，基金投資者提出的申購和贖回申請，在基金管理人規定的時間之前可以撤銷。

2、投資者T日申購基金成功後，基金註冊登記機構在T+1日為投資者增加權益並辦理註冊登記手續，投資者自T+2日起有權贖回該部分基金份額。

3、投資者T日贖回基金成功後，基金註冊登記機構在T+1日為投資者扣除權益並辦理相應的註冊登記手續。

4、基金管理人可在法律法規允許的範圍內，對上述註冊登記辦理時間進行調整，並於開始實施前依照《資訊披露辦法》的有關規定在指定媒介上公告。

## （八）巨額贖回的認定及處理方式

### 1、巨額贖回的認定

單個開放日中，本基金的基金份額淨贖回申請（贖回申請總份額扣除申購總份額後的餘額）與淨轉出申請（轉出申請總份額扣除轉入申請總份額後的餘額）之和超過上一日基金總份額的10%，為巨額贖回。

### 2、巨額贖回的處理方式

出現巨額贖回時，基金管理人可以根據本基金當時的資產組合狀況決定接受全額贖回或部分延期贖回。

（1）接受全額贖回：當基金管理人認為有能力兌付投資者的全部贖回申請時，按正常贖回程式執行。

（2）部分延期贖回：當基金管理人認為兌付投資者的贖回申請有困難，或認為兌付投資者的贖回申請進行的資產變現可能使基金資產淨值發生較大波動時，基金管理人在當日接受贖回比例不低於上一日基金總份額10%的前提下，對其餘贖回申請延期辦理。對於當日的贖回申請，應當按單個基金份額持有人申請贖回份額佔當日申請贖回總份額的比例，確定該基金份額持有人當日受理的贖回份額；未受理部分除投資者在提交贖回申請時選擇將當日未獲受理部分予以撤銷者外，延遲至下一開放日辦理，贖回價格為下一個開放日的價格。轉入下一開放日的贖回申請不享有贖回優先權，以此類推，直到全部贖回為止。部分延期贖回不受單筆贖回最低份額的限制。

若本基金發生巨額贖回且發生單個開放日內單個基金份額持有人申請贖回的基金份額佔前一開放日基金總份額的比例超過10%時，本基金管理人有權對該單個基金份額持有人超過前一開放日基金總份額10%的贖回申請實施延期贖回；對該單個基金份額持有人佔前一開放日基金總份額10%的贖回申請，與當日其他贖回申請一起，按上述（1）或（2）方式處理。如下一開放日，該單一基金份額持有人剩餘未贖回部分仍舊超出前一開放日基金總份額10%的，繼續按前述規則處理，直至該單一基金份額持有人單個開放日內申請贖回的基金份額佔前一開放日基金總份額的比例低於10%。

基金管理人在履行適當程式後，有權根據當時市場環境調整前述比例和辦理措施，並在指定媒介上進行公告。

（3）當發生巨額贖回並延期辦理時，基金管理人應當通過郵寄、傳真或招募說明書規定的其他方式，在3個工作日內通知基金份額持有人，說明有關處理方法，並在2日內在指定媒介上刊登公告。

(4) 暫停接受和延緩支付：本基金連續2個開放日以上發生巨額贖回，如基金管理人認為有必要，可暫停接受贖回申請；已經接受的贖回申請可以延緩支付贖回款項，但延緩期限不得超過20個工作日，並應當在至少一種會指定媒介上公告。

(九) 拒絕或暫停申購、暫停贖回的情形及處理

1、在如下情況下，基金管理人可以拒絕或暫停接受投資者的申購申請：

(1) 因不可抗力導致基金管理人無法受理投資者的申購申請；

(2) 證券交易所交易時間非正常停市，導致基金管理人無法計算當日基金資產淨值；

(3) 發生本基金合同規定的暫停基金資產估值情況；

(4) 基金資產規模過大，使基金管理人無法找到合適的投資品種，或其他可能對基金業績產生負面影響，從而損害現有基金份額持有人的利益的情形；

(5) 中港兩地基金互認剩餘額度不足時基金管理人可以拒絕或暫停H類份額的申購；

(6) 在香港的銷售規模佔基金總資產的比例高於50%時基金管理人可以拒絕或暫停H類份額的申購；

(7) 基金管理人接受某筆或者某些申購申請有可能導致單一投資者持有基金份額的比例達到或者超過50%，或者變相規避50%集中度的情形時；

(8) 當前一估值日基金資產淨值50%以上的資產出現無可參考的活躍市場價格且採用估值技術仍導致公允價值存在重大不確定性時，經與基金託管人協商確認後，基金管理人應當採取暫停接受基金申購申請的措施；

(9) 申請超過基金管理人設定的基金總規模、單日淨申購比例上限、單個投資者單日或單筆申購金額上限的；

(10) 法律法規規定或經中國證監會認定的其他情形；

(11) 基金管理人認為會有損於現有基金份額持有人利益的某筆申購。

基金管理人決定拒絕或暫停接受某些投資者的申購申請時，申購款項將退回投資者帳戶。當發生上述(1)、(2)、(3)、(4)、(5)、(6)、(8)、(10)項情形且基金管理人決定暫停接受申購申請時，基金管理人應當依法在規定期限內在指定媒介上刊登暫停公告。在暫停申購的情形消除時，基金管理人應及時恢復申購業務的辦理並依法公告。發生上述第7、9項情形時，基金管理人可以採取比例確認等方式對該投資人的申購申請進行限制，基金管理人有权拒絕該等全部或者部分申購申請。如果法律法規、監管要求調整導致上述第7項內容取消或變更的，基金管理人在履行適當程式後，可修改上述內容，不需召開基金份額持有人大會。

2、在以下情況下，基金管理人可以暫停接受投資者的贖回申請：

- (1) 因不可抗力導致基金管理人無法支付贖回款項；
- (2) 證券交易場所交易時間非正常停市，導致基金管理人無法計算當日基金資產淨值；
- (3) 基金連續發生巨額贖回，根據本基金合同規定，可以暫停接受贖回申請的情況；
- (4) 當前一估值日基金資產淨值50%以上的資產出現無可參考的活躍市場價格且採用估值技術仍導致公允價值存在重大不確定性時，經與基金託管人協商確認後，基金管理人應當採取延緩支付贖回款項或暫停接受基金贖回申請的措施。
- (5) 發生本基金合同規定的暫停基金資產估值的情況；
- (6) 法律法規規定或經中國證監會認定的其他情形。

發生上述情形之一且基金管理人決定暫停贖回或者延緩支付贖回款項的，基金管理人應當在當日向中國證監會備案，並及時公告。已接受的贖回申請，基金管理人將足額支付；如暫時不能足額支付的，可延期支付部分贖回款項，按每個贖回申請人已被接受的贖回申請量佔已接受贖回申請總量的比例分配給贖回申請人，未支付部分由基金管理人按照發生的情況制定相應的處理辦法在後續開放日予以支付。

在暫停贖回的情況消除時，基金管理人應及時恢復贖回業務的辦理並依法公告。

3、暫停基金的申購、贖回，基金管理人應按規定公告。

4、暫停申購或贖回期間結束，基金重新開放時，基金管理人應依法公告。

(1) 如果發生暫停的時間為一天，基金管理人將於重新開放日，在至少一種指定媒介，刊登基金重新開放申購或贖回的公告，並公告最近一個開放日的各類基金份額淨值。

(2) 如果發生暫停的時間超過一天但少於兩周，暫停結束，基金重新開放申購或贖回時，基金管理人將依照《資訊披露辦法》的有關規定，在至少一種指定媒介，刊登基金重新開放申購或贖回的公告，並在重新開放申購或贖回日公告最近一個開放日的各類基金份額淨值。

(3) 如果發生暫停的時間超過兩周，暫停期間，基金管理人應每兩周至少重複刊登暫停公告一次；當連續暫停時間超過兩個月時，可對重複刊登暫停公告的頻率進行調整。暫停結束，基金重新開放申購或贖回時，基金管理人應依照《資訊披露辦法》的有關規定，在至少一種指定媒介連續刊登基金重新開放申購或贖回的公告，並在重新開放申購或贖回日公告最近一個開放日的各類基金份額淨值。

## （十）基金轉換

### 1、業務規則

（1）基金轉換是指開放式基金份額持有人將其持有某檔基金的部分或全部份額轉換為同一基金管理人管理的另一隻開放式基金的份額，同一檔基金的不同份額類別之間不能轉換；

（2）基金轉換只能在同一銷售機構已開通代銷和轉換業務的大成基金管理有限公司管理的開放式基金之間進行；

（3）基金轉換以基金份額為單位進行申請；

（4）基金轉換採取未知價法，即基金的轉換價格以轉換申請受理當日各轉出、轉入基金的份額資產淨值為基準進行計算；

（5）基金份額在轉換後，持有時間將重新計算；

（6）基金份額持有人可將其全部或部分基金份額轉換成另一檔基金，轉出基金最低轉出份額為 100 份；

（7）單個開放日基金淨贖回份額及淨轉換轉出申請份額之和超出上一開放日基金總份額的 10%時，為巨額贖回。發生巨額贖回時，基金轉出與基金贖回具有相同的優先順序，基金管理人可根據基金資產組合情況，對基金份額持有人提交的轉出申請決定全額確認轉出或部分確認轉出，並且對於基金轉出和基金贖回，將採取相同的比例確認；在轉出申請得到部分確認的情況下，未確認的轉出申請將不予以順延；

（8）投資者辦理基金轉換業務時，轉出方的基金必須處於可贖回狀態，轉入方的基金必須處於可申購狀態；

（9）投資者只能在前端收費模式下進行基金轉換。

### 2、基金轉換費用

本公司旗下基金間的轉換費用由贖回費和申購補差費組成，轉出時收取贖回費，轉入時收取申購補差費。

基金轉出時贖回費的計算：

由非貨幣基金轉出時：

轉出總額＝轉出份額×轉出基金當日基金份額淨值

由貨幣基金轉出時：

轉出總額＝轉出份額×轉出基金當日基金份額淨值+待結轉收益（全額轉出時）

贖回費用＝轉出總額×轉出基金贖回費率

轉出淨額＝轉出總額－贖回費用

轉出份額若含多筆明細時，轉出時將按先進先出法(保本型基金按後進先出法)根據各筆明細對應持有期分別計算贖回費用，贖回費用計入基金財產比例遵循轉出基金招募說明書約定。

基金轉入時申購補差費的計算：

淨轉入金額＝轉出淨額－申購補差費

其中，申購補差費＝MAX【轉出淨額在轉入基金中對應的申購費用－轉出淨額在轉出基金中對應的申購費用，0】

轉入份額＝淨轉入金額/轉入基金當日基金份額淨值

例：投資者申請將持有的大成債券投資基金 3,822.59 份轉換為大成精選增值混合型證券投資基金，假設轉換當日大成債券投資基金的基金份額淨值為 1.0101 元，投資者持有該基金 9 個月，對應贖回費為 0.25%，申購費為 0.8%，大成精選增值混合型證券投資基金的基金份額淨值為 0.760 元，申購費為 1.5%，則投資者轉換後可得到的大成精選增值混合型基金份額為：

轉出總額＝3,822.59×1.0101＝3,861.20 元

贖回費用＝3,861.20×0.25%＝9.65 元

轉出淨額＝3,861.20－9.65＝3,851.55 元

轉出淨額在轉入基金中對應的淨申購金額＝3,851.55/1.015＝3,794.63 元

轉出淨額在轉入基金中對應的申購費用＝3,851.55-3,794.63＝56.92 元

轉出淨額在轉出基金中對應的淨申購金額＝3,851.55/1.008＝3,820.98 元

轉出淨額在轉出基金中對應的申購費用＝3,851.55-3,820.98＝30.57 元

淨轉入金額＝3,851.55－MAX【56.92－30.57，0】＝3,825.20 元

轉入份額＝3,825.20/0.760＝5,033.16 份

### 3、基金轉換的註冊登記

投資者 T 日申請基金轉換成功後，註冊登記機構將在 T+1 工作日為投資者辦理減少轉出基金份額、增加轉入基金份額的權益登記手續。一般情況下，投資者自 T+2 工作日起有權贖回轉入部分的基金份額。

### 4、暫停基金轉換的情形及處理

出現下列情況之一時，本公司可以暫停接受基金持有人的基金轉換申請：

(1) 不可抗力原因導致轉出或轉入基金無法正常運作。



(2) 證券交易場所在交易時間非正常停市，導致本公司無法計算當日轉出或轉入基金資產淨值。

(3) 因市場劇烈波動或其他原因而出現連續巨額贖回，本公司認為有必要暫停接受該基金份額的轉出申請。

(4) 法律、法規、規章規定的其他情形或其他在《基金合同》、《招募說明書》已載明並獲中國證監會批准的特殊情形。

發生上述情形之一的，本公司將立即向中國證監會備案並於規定期限內在至少一種中國證監會指定媒介上刊登暫停公告。重新開放基金轉換時，本公司將按規定予以公告。

## 5、聲明

本公司可以根據市場情況制定或調整上述轉換業務規則及有關限制，但應最遲在調整生效前3個工作日在至少一種中國證監會指定的資訊披露媒介公告。

### (十一) 基金的轉託管

本基金目前實行份額託管的交易制度。投資者可將所持有的基金份額從一個交易帳戶轉入另一個交易帳戶進行交易。具體辦理方法參照《業務規則》的有關規定以及基金代銷機構的業務規則，基金銷售機構可以按照規定的標準收取轉託管費。

### (十二) 定期定額投資計劃

銷售機構將按照與投資申請時所約定的每月固定扣款日、扣款金額扣款，若遇非基金交易日時，扣款是否順延以銷售機構的具體規定為準。具體辦理程式請遵循各銷售機構的有關規定，具體扣款方式以各銷售機構的相關業務規則為準。

### (十三) 基金的非交易過戶

非交易過戶是指不採用申購、贖回等基金交易方式，將一定數量的基金份額按照一定規則從某一投資者基金帳戶轉移到另一投資者基金帳戶的行為。

基金註冊登記機構只受理繼承、捐贈、司法強制執行和經註冊登記機構認可的其他情況下的非交易過戶。其中，“繼承”指基金份額持有人死亡，其持有的基金份額由其合法的繼承人繼承；“捐贈”指基金份額持有人將其合法持有的基金份額捐贈給福利性質的基金會或社會團體的情形；“司法執行”是指司法機構依據生效司法文書將基金份額持有人持有的基金份額強制劃轉給其他自然人、法人、社會團體或其他組織。無論在上述何種情況下，接受劃轉的主體應符合相關法律法規和基金合同規定的持有本基金份額的投資者的條件。辦理非交易過戶必須提供基金註冊登記機構要求提供的相關資料。

基金註冊登記機構受理上述情況下的非交易過戶，其他銷售機構不得辦理該項業務。

對於符合條件的非交易過戶申請按《業務規則》的有關規定辦理，並按基金註冊登記機構規定的標準收費。

#### （十四）基金的凍結與解凍

基金註冊登記機構只受理國家有權機關依法要求的基金份額的凍結與解凍以及註冊登記機構認可的其他情況下的凍結與解凍。基金份額被凍結的，被凍結部分產生的權益按照我國法律法規、監管規章以及國家有權機關的要求來決定是否凍結。在國家有權機關作出決定之前，被凍結部分產生的權益（包括現金分紅和紅利再投資）先行一併凍結。被凍結部分份額仍然參與收益分配與支付。

#### （十五）實施側袋機制期間本基金的申購與贖回

本基金實施側袋機制的，本基金的申購和贖回安排本招募說明書“側袋機制”章節或屆時發佈的相關公告。

## 八、基金的投資

### （一）投資目標

本基金主要投資於受益於內需增長的行業中的優質上市公司，力爭充分分享中國經濟增長以及經濟結構轉型帶來的投資收益，追求基金資產的長期穩健增值。

### （二）投資範圍

本基金的投資對象為具有較好流動性的金融工具，包括國內依法發行交易的股票（含中小板、創業板及其他經中國證監會核准上市的股票）、存託憑證、債券、權證、股指期貨及法律、法規或監管機構允許基金投資的其他金融工具（但須符合中國證監會的相關規定）。

本基金股票資產、存託憑證佔基金資產淨值的比例範圍為 60%-95%；債券、資產支持證券、債券逆回購等固定收益類資產和現金投資比例範圍為基金資產淨值的 5%-40%；現金（不包括結算備付金、存出保證金、應收申購款等）或到期日在一年以內的政府債券的比例不低於基金資產淨值的 5%；權證、股指期貨及其他金融工具的投資比例依照法律法規或監管機構的規定執行；本基金將 80% 以上的股票資產、存託憑證投資於受益於內需增長的行業中的優質企業。

如法律法規或監管機構以後允許基金投資其他品種，基金管理人在履行適當程式後，可以將其納入投資範圍。

### （三）投資理念

為中國經濟持續發展而進行的經濟增長模式轉變過程中，內需增長正在成為重要的推動力。在宏觀政策引導和經濟結構的自我演進中，受益於內需增長推動力的行業與上市公司的投資價值將獲得提升。本基金通過對宏觀經濟與政策的全面分析，挖掘內需增長投資主題，精選相關行業的優質上市公司股票，在有效控制投資風險的前提下，追求超額收益。

### （四）投資策略

本基金採用積極主動的投資策略。以宏觀經濟和政策研究為基礎，通過影響證券市場整體運行的內外部因素分析，實施大類資產配置；分析以內需增長為重要推動力的中國經濟轉型進程中的政策導向與經濟結構調整的特點，研究國內消費需求以及與之緊密關聯的投資需求的增長規律，結合經濟週期與產業變遷路徑的分析，實施行業配置；以相關的投資主題和內需增長受益行業為線索，通過公司基本面的考量，精選優質上市公司股票，力求實現基金資產的長期穩健增值。

為有效控制投資風險，本基金將根據風險管理的原則適度進行股指期貨投資，股指期貨

投資將根據風險管理的原則，以套期保值為目的，並按照中國金融期貨交易所套期保值管理的有關規定執行，對沖系統性風險和某些特殊情況下的流動性風險等。

### 1·大類資產配置

本基金以股票投資為主，但為規避市場系統性風險，保障基金資產的長期穩健增值，本基金實施適度的戰略或戰術性類別資產配置。本基金根據各類資產的市場趨勢和預期收益風險的比較判別，對股票、債券及現金等大類資產的配置比例進行動態調整，以期在投資中達到風險和收益的優化平衡。在大類資產調整過程中，本基金將在法律法規和基金合同規定範圍內，適度運用股指期貨的套期保值功能，控制投資組合的系統性風險暴露。

本基金採用多因素分析框架，從宏觀經濟環境、政策因素、市場利率水準、市場投資價值、資金供求因素、證券市場運行內在動量等方面，採取定量與定性相結合的分析方法，對證券市場投資機會與風險進行綜合研判。宏觀經濟環境方面，主要是對證券市場基本面產生普遍影響的宏觀經濟環境進行分析，研判宏觀經濟運行趨勢以及對證券市場的影響。政策因素方面，主要是對影響經濟結構、金融和證券市場的政策進行前瞻性分析，研究政策對不同類別資產的影響。市場利率水準方面，主要分析市場利率水準的變化趨勢及對固定收益證券的影響。資金供求因素方面，主要分析證券市場供求的平衡關係。投資價值方面，主要研究各類證券市場的整體內在價值的變化和估值水準的相對變化。市場運行內在動量方面，主要分析證券市場自身的內在運行慣性與回歸（規律），發現驅動證券市場向上或向下的市場因素。

通過上述因素的綜合分析，結合公司研究開發的定量模型工具，判斷市場時機，進行積極的資產配置，合理確定基金在股票、債券、現金等各類資產類別上的投資比例。

此外，本基金還將利用基金管理人在長期投資管理過程中所積累的經驗，根據市場突發事件、市場非有效例外效應等所形成的市場波動做戰術性資產配置調整。

### 2·股票投資策略

本基金的股票投資決策是：採取自上而下為主、自下而上為輔的積極管理策略，深入分析作為中國經濟轉型重要推動力的內需增長的外部環境條件、政策導向、實現路徑與推動作用，發掘與之相關的投資主題，結合行業受益敏感性與投資主題進行行業選擇；運用細緻的公司基本面分析，結合估值模型，挖掘重點行業中的優質上市公司股票。

#### （1）行業配置策略

本基金主要投資於受益於內需增長的行業，以分享國內經濟增長以及經濟結構轉型所帶來的行業利潤的增長。

受益於內需增長的行業主要包括以下兩類：

一類是受益於國內消費需求增長的行業，即為消費水準提升中的國內消費者提供消費品和消費服務的行業，根據申銀萬國行業分類標準，主要包括食品飲料、商業貿易、醫藥生物、紡織服裝、金融服務、房地產、餐飲旅遊、家用電器、資訊服務等行業。

另一類是受益於國內城市化建設和國內消費增長驅動的投資需求的行業，即為國內城市化建設、消費增長所需投資提供原材料、設備、建造服務和物流服務的行業，根據申銀萬國行業分類標準，主要包括化工、黑色金屬、有色金屬、建築建材、電子元器件、資訊設備、交運設備、交通運輸等行業。

本基金基於行業研究小組的研究成果，通過分析宏觀經濟環境、國家財政政策和貨幣政策、區域及產業發展規劃、城市化進程、基礎設施建設、居民消費升級、消費文化、社會保障體系建設等內需影響因素，研究內需增長的區域特徵、梯度演進、實現路徑以及在內需增長、技術變遷推動下的行業發展特點，評估各個內需增長受益行業對內需增長的盈利敏感程度，並結合證券市場的投資主題和經濟週期中的行業景氣輪動特點，比較不同行業的相對投資價值，確定行業配置方案。

本基金將 80% 以上的股票資產投資於受益於內需增長的行業中的優質企業。

## （2）股票組合構建策略

本基金將剔除最近一期年報中有明確數據顯示其主營業務收入 60% 以上來源於海外的上市公司（除非有充分的研究成果表明其主營業務收入來源正在發生由境外到境內的根本性轉變），並在行業配置策略的基礎上，深入研究公司基本面，精選受益於內需增長的上市公司，並結合風險管理，對股票組合構建進行動態調整。

公司基本面研究主要包括公司在內需增長背景下的成長性評估和投資價值評估。成長性評估將首先研究基於內需增長背景下產業政策、消費趨勢、供應商力量、行業壁壘、商業模式與技術變遷等因素對行業競爭格局演變的影響，然後分析公司戰略、資源與能力等方面的優勢，評判公司的行業競爭地位以及業績驅動因素，最後運用主營業務收入、EBITDA、淨利潤等的預期增長率指標，結合公司營運指標（如固定資產周轉率等）以及經營槓桿指標（如權益乘數等），對公司盈利的持續增長前景進行綜合評價。投資價值評估是根據一系列歷史和預期的財務指標，結合定性考慮，分析公司盈利穩固性，判斷相對投資價值，主要指標包括：EV/EBITDA、EV/Sales、P/E、P/B、P/RNAV、股息率、ROE、經營利潤率和淨利潤率等。分析師將根據行業特點選擇合適的指標進行估值。

根據公司基本面考量結果，本基金將精選受益於內需增長而具有較好的盈利增長前景且估值合理的上市公司，結合行業配置策略，構建股票組合。

在股票組合構建與調整過程中，本基金將運用風險績效評估及歸因分析方法，控制組合風險。

## 3．債券投資策略

主要通過利率預測分析、收益率曲線變動分析、債券信用分析、收益率利差分析等策略配置債券資產，力求在保證資產總體的安全性、流動性的基礎上獲取穩定收益。

### 1) 利率預測分析

準確預測未來利率走勢能為債券投資帶來超額收益。當預期利率下調時，適當加大組合

中長久期債券的投資比例，為債券組合獲取價差收益；當預期利率上升時，減少長久期債券的投資，降低債券組合的久期，以控制利率風險。

## 2) 收益率曲線變動分析

收益率曲線會隨著時間、市場情況、市場主體的預期變化而改變。通過預測收益率曲線形狀的變化，調整債券組合內部品種的比例，獲得投資收益。

## 3) 債券信用分析

通過對債券的發行者、流動性、所處行業等因素進行深入、細緻的調研，準確評價債券的違約概率，提早預測債券評級的改變，捕捉價格優勢或套利機會。

## 4) 收益率利差分析

在預測和分析同一市場不同板塊之間、不同市場的同一品種之間、不同市場不同板塊之間的收益率利差的基礎上，採取積極投資策略，選擇適當品種，獲取投資收益。

## 4· 權證投資

在控制投資風險和保障基金資產安全的前提下，對權證進行投資，爭取獲得較高的回報。權證投資策略主要為：採用市場公認的多種期權定價模型對權證進行定價，作為權證投資的價值基準，並根據權證標的股票基本面的研究估值，結合權證理論價值進行權證趨勢投資。

## 5· 股指期貨投資策略

本基金投資股指期貨將以投資組合避險和有效管理為目的，通過套期保值策略，對沖系統性風險，應對組合構建與調整中的流動性風險，力求風險收益的優化。

套期保值實質上是利用股指期貨多空雙向和槓桿放大的交易功能，改變投資組合的  $\beta$ ，以達到適度增強收益或控制風險的目的。為此，套期保值策略分為多頭套期保值和空頭套期保值。多頭保值策略是指基於股市將要上漲的預期或建倉要求，需要在未來買入現貨股票，為了控制股票買入成本而預先買入股指期貨合約的操作；空頭套期保值是指賣出期貨合約來對沖股市系統性風險，控制與回避持有股票的風險的操作。

基金管理人依據對股市未來趨勢的研判、本基金的風險收益目標以及投資組合的構成，決定是否對現有股票組合進行套期保值以及採用何種套期保值策略。

在構建套期保值組合過程中，基金管理人通過對股票組合的結構分析，分離組合的系統性風險（ $\beta$ ）及非系統性風險。基金管理人將關注股票組合  $\beta$  值的易變性以及股指期貨與指數之間基差波動對套期保值策略的干擾，通過大量數據分析與量化建模，確立最優套保比率。

在套期保值過程中，基金管理人將不斷精細和不斷修正套保策略，動態管理套期保值組合。主要工作包括，基於合理的保證金管理策略嚴格進行保證金管理；對投資組合  $\beta$  係數的即時監控，全程評估套期保值的效果和基差風險，當組合  $\beta$  值超過事先設定的  $\beta$  容忍度時，需要對套期保值組合進行及時調整；進行股指期貨合約的提前平倉或展期決策管理。

## 6·存託憑證投資策略

在控制風險的前提下，本基金將根據本基金的投資目標和股票投資策略，基於對基礎證券投資價值的深入研究判斷，進行存託憑證的投資。

### （五）投資決策流程

本基金採用投資決策委員會領導下的基金經理負責制。本基金的投資決策流程如下：

#### 1·大類資產配置和股票資產類別配置的決策程式

##### （1）大類資產配置

宏觀研究員就政治形勢、政策趨勢、宏觀經濟形勢、利率走勢以及證券市場發展趨勢等進行分析，向投資決策委員會和基金經理提交研究報告。

投資決策委員會根據相關報告，對市場中長期發展趨勢做出判斷，向基金經理提出大類資產配置指導性意見。

基金經理根據投資決策委員會的指導性意見並結合自己的研究分析結果，擬定基金大類資產配置建議，提交投資決策委員會審議。

投資決策委員會對基金大類資產配置建議的可行性進行分析，形成投資決議並授權基金經理執行。

##### （2）股票資產類別配置

基金經理綜合各研究員的研究成果，依據本基金投資策略，向投資決策委員會提交股票資產類別配置建議。經投資決策委員會批准後，基金經理制定詳細的股票資產類別配置計劃並經授權後執行。

#### 2·投資品種選擇的決策程式

##### （1）股票投資的決策程式

本基金所投資的上市公司必須已經進入本基金股票投資備選庫，進入備選庫的股票必須經過股票投資基本庫、股票投資初選庫和股票投資備選庫的篩選程式，具體過程如下：

1) 研究員根據法律法規和基金合同規定，判斷股票是否存在明顯風險，確定股票投資基本庫；

2) 研究員通過大量研讀證券公司研究報告，經過綜合分析判斷，在股票投資基本庫的基礎上確定股票投資初選庫；

3) 研究員選擇初選庫中的股票，進行深入分析和實地調研後，提交投資研究聯席會議討論。投資研究聯席會議經過充分討論和論證，確定該股票是否進入股票投資備選庫；

4) 基金經理從股票投資備選庫中選擇股票構建投資組合。

##### （2）債券投資的決策程式

本基金投資的債券包括國債、央票、金融債、公司債、企業債（含可轉換債券）等債券品種。

基金經理根據經投資決策委員會審批的大類資產配置計劃，向債券投資研究員提出債券投資需求，債券投資研究員在對利率變動趨勢、債券市場發展方向和各債券品種的流動性、安全性和收益性等因素進行綜合分析的基礎上，提出債券投資建議。基金經理根據債券投資研究員的債券投資建議，制定債券投資方案。

### （3）股指期貨的決策程式

1）投資決策委員會依據研究部提供的宏觀分析報告、投資策略報告，結合風險管理部提供的風險評價和股指期貨市場分析報告等資料，對證券市場形勢進行研判，提出下一階段基金的股指期貨投資策略及參與比例意見，審批基金經理提交的具體的股指期貨投資建議；

2）金融衍生品投資研究會議定期回顧和研究股指期貨投資的情況以及市場狀況，並提出基金進行指期貨投資的調整建議。同時，不定期就突發事件進行分析評估，形成股指期貨的調整意見，供基金經理及投資決策委員會決策參考；

3）基金經理依據投資決策委員會的決議和金融衍生品投資研究會議的調整建議，確定其投資組合，制定具體的股指期貨投資計劃，並在獲得投資決策委員會的批准後，負責計劃執行；

4）風險管理部對股指期貨投資潛在的異常風險進行監控並及時揭示；

5）風險管理部定期對投資組合進行事後的風險與績效評估，並就投資組合的績效進行評估和歸因分析，以供基金經理和投資決策委員會使用；

6）基金經理對市場變化、投資組合調整、組合風險監控、業績評估等事項進行匯總和分析，形成下一階段的投資策略建議，並提交投資部負責人審批或投資決策委員會會議使用。

### （六）業績比較基準

本基金業績比較基準： $80\% \times \text{滬深 300 指數} + 20\% \times \text{中證綜合債券指數}$

本基金作混合型基金，股票資產佔基金資產的比例範圍為 60%-95%，固定收益類證券和現金投資比例範圍為基金資產的 5%-40%，所以採用股票指數和債券指數加權複合的方法構建業績比較基準。由於滬深 300 指數是反映滬深兩市 A 股綜合表現的跨市場成份指數，中證綜合債券指數是綜合反映銀行間和交易所市場國債、金融債、企業債、央票及短融整體走勢的跨市場債券指數，兩者均具有良好的市場代表性，因此，選擇滬深 300 指數作為股票投資部分的業績比較基準，同時，選取中證綜合債券指數作為債券投資部分的比較基準。參考股票投資比例上下限的均值，確定股票指數加權比例為 80%；參考債券投資比例上下限的均值，確定債券指數加權比例為 20%。

如果今後法律法規發生變化，或者有更權威的、更能為市場普遍接受的業績比較基準推出，或者是市場上出現更加適合用於本基金的業績基準的股票指數時，本基金可以與基金託管人協商一致並報中國證監會備案後變更業績比較基準並及時公告。



### （七）風險收益特徵

本基金為混合型基金，其預期風險和預期收益低於股票型基金，高於債券型基金和貨幣市場基金。

### （八）禁止行為和投資限制

#### 1．禁止行為

為維護基金份額持有人的合法權益，本基金禁止從事下列行為：

- （1）承銷證券；
- （2）違反規定向他人貸款或者提供擔保；
- （3）從事承擔無限責任的投資；
- （4）向其基金管理人、基金託管人出資；
- （5）從事內幕交易、操縱證券交易價格及其他不正當的證券交易活動；
- （6）依照法律、行政法規有關法律法規規定，由國務院證券監督管理機構規定禁止的其他活動。

運用基金財產買賣基金管理人、基金託管人及其控股股東、實際控制人或者與其有其他重大利害關係的公司發行的證券或承銷期內承銷的證券，或者從事其他重大關聯交易的，應當遵循基金份額持有人利益優先的原則，防範利益衝突，符合國務院證券監督管理機構的規定，並履行資訊披露義務。

如法律法規或監管部門取消上述禁止性規定，本基金管理人在履行適當程式後可不受上述規定的限制。

#### 2．投資限制

本基金的投資組合將遵循以下限制：

- （1）本基金持有一家公司發行的證券，其市值不得超過基金資產淨值的 10%；
- （2）本基金與由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司發行的證券，不得超過該證券的 10%；
- （3）本基金管理人管理的全部開放式基金(包括開放式基金以及處於開放期的定期開放基金)持有一家上市公司發行的可流通股票，不得超過該上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投資組合持有一家上市公司發行的可流通股票，不得超過該上市公司可流通股票的 30%；
- （4）本基金主動投資於流動性受限資產的市值合計不得超過基金資產淨值的 15%；因證券市場波動、上市公司股票停牌、基金規模變動等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所規定比例限制的，基金管理人不得主動新增流動性受限資產的投資；
- （5）本基金進入全國銀行間同業市場進行債券回購的資金餘額不得超過基金資產淨值

的 40%；

(6) 本基金在任何交易日買入權證的總金額，不超過上一交易日基金資產淨值的 0.5%，基金持有的全部權證的市值不超過基金資產淨值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一權證的比例不超過該權證的 10%。法律法規或中國證監會另有規定的，遵從其規定；

(7) 每個交易日日終在扣除股指期貨合約需繳納的交易保證金後，本基金持有的現金（不包括結算備付金、存出保證金、應收申購款等）和到期日不超過 1 年的政府債券不低於基金資產淨值的 5%；

(8) 本基金持有的全部資產支持證券，其市值不得超過基金資產淨值的 20%；

(9) 本基金持有的同一（指同一信用級別）資產支持證券的比例，不得超過該資產支持證券規模的 10%；

(10) 本基金管理人管理的全部基金投資於同一原始權益人的各類資產支持證券，不得超過其各類資產支持證券合計規模的 10%；

(11) 本基金資產參與股票發行申購，所申報的金額不得超過本基金的總資產，所申報的股票數量不得超過擬發行股票公司本次發行股票的總量；

(12) 本基金持有的同一流通受限證券，其公允價值不得超過本基金資產淨值的 10%。

(13) 本基金與私募類證券資管產品及中國證監會認定的其他主體為交易對手開展逆回購交易的，可接受質押品的資質要求應當與本基金合同約定的投資範圍保持一致；

(14) 在任何交易日日終，持有的買入股指期貨合約價值，不得超過基金資產淨值的 10%；在任何交易日日終，持有的買入期貨合約價值與有價證券市值之和，不得超過基金資產淨值的 95%，其中，有價證券指股票、債券（不含到期日在一年以內的政府債券）、權證、資產支持證券、買入返售金融資產（不含質押式回購）等；在任何交易日日終，持有的賣出期貨合約價值不得超過基金持有的股票總市值的 20%；在任何交易日內交易（不包括平倉）的股指期貨合約的成交金額不得超過上一交易日基金資產淨值的 20%；基金所持有的股票市值和買入、賣出股指期貨合約價值，合計（軋差計算）應當符合基金合同關於股票投資比例的有關約定；

(15) 本基金股票資產、存託憑證佔基金資產淨值的比例範圍為 60%-95%；債券、資產支持證券、債券逆回購等固定收益類資產和現金投資比例範圍為基金資產淨值的 5%-40%；

(16) 本基金資產總值不超過基金資產淨值的 140%；

(17) 本基金投資存託憑證的比例限制依照境內上市交易的股票執行，與境內上市交易的股票合併計算；

(18) 相關法律法規以及監管部門規定的其他投資限制。

基金管理人應當自基金合同生效之日起 6 個月內使基金的投資組合比例符合基金合同的約定。除上述“2、基金投資組合比例限制”中第（4）、（7）、（13）項外，因證券市場波動、上市公司合併、基金規模變動等基金管理人之外的因素致使基金投資不符合基金合

同約定的投資比例規定的，基金管理人應當在 10 個交易日內進行調整。法律法規或監管機構另有規定時，從其規定。

3、若將來法律法規或中國證監會的相關規定發生修改或變更，致使本款前述約定的投資禁止行為和投資組合比例限制被修改或取消，基金管理人在依法履行相應程式後，本基金可相應調整禁止行為和投資限制規定。

#### （九）基金管理人代表基金行使債權人權利的處理原則及方法

- 1· 不謀求對上市公司的控股，不參與所投資上市公司的經營管理；
- 2· 有利於基金資產的安全與增值；
- 3· 基金管理人按照國家有關規定代表基金獨立行使股東權利，保護基金份額持有人的利益。
- 4· 基金管理人按照國家有關規定代表基金獨立行使債權人權利，保護基金份額持有人的利益。

#### （十）側袋機制的實施和投資運作安排

當基金持有特定資產且存在或潛在大額贖回申請時，根據最大限度保護基金份額持有人利益的原則，基金管理人經與基金託管人協商一致，並諮詢會計師事務所意見後，可以依照法律法規及基金合同的約定啟用側袋機制，無需召開基金份額持有人大會審議。

側袋機制實施期間，本部分約定的投資組合比例、投資策略、組合限制、業績比較基準、風險收益特徵等約定僅適用於主袋帳戶。

側袋帳戶的實施條件、實施程式、運作安排、投資安排、特定資產的處置變現和支付等對投資者權益有重大影響的事項詳見本招募說明書“側袋機制”章節的規定。

#### （十一）基金的投資組合報告

基金管理人的董事會及董事保證本報告所載資料不存在虛假記載、誤導性陳述或重大遺漏，並對其內容的真實性、準確性和完整性承擔個別及連帶責任。

基金託管人中國銀行股份有限公司根據基金合同規定，複核了本報告中的財務指標、淨值表現和投資組合報告等內容，保證複核內容不存在虛假記載、誤導性陳述或者重大遺漏。

本投資組合報告所載數據取自本基金 2024 年第 1 季度報告。

##### 1、報告期末基金資產組合情況

序號	項目	金額（元）	佔基金總資產的比例（%）
1	權益投資	195,944,972.17	83.12

	其中：股票	195,944,972.17	83.12
2	基金投資	-	-
3	固定收益投資	-	-
	其中：債券	-	-
	資產支持證券	-	-
4	貴金屬投資	-	-
5	金融衍生品投資	-	-
6	買入返售金融資產	-	-
	其中：買斷式回購的 買入返售金融資產	-	-
7	銀行存款和結算備付 金合計	39,690,607.57	16.84
8	其他資產	101,702.52	0.04
9	合計	235,737,282.26	100.00

## 2、報告期末按行業分類的股票投資組合

### 2.1、報告期末按行業分類的境內股票投資組合

代碼	行業類別	公允價值（元）	佔基金資產淨值比例 （%）
A	農、林、牧、漁業	1,453,500.00	0.62
B	採礦業	-	-
C	製造業	175,728,482.78	74.78
D	電力、熱力、燃氣及 水生產和供應業	-	-
E	建築業	-	-
F	批發和零售業	8,338,844.20	3.55
G	交通運輸、倉儲和郵 政業	10,407,201.75	4.43
H	住宿和餐飲業	-	-
I	資訊傳輸、軟體和資 訊技術服務業	9,936.74	0.00
J	金融業	-	-
K	房地產業	-	-
L	租賃和商務服務業	3,097.60	0.00
M	科學研究和技術服務 業	-	-
N	水利、環境和公共設 施管理業	3,909.10	0.00
O	居民服務、修理和其 他服務業	-	-
P	教育	-	-

Q	衛生和社會工作	-	-
R	文化、體育和娛樂業	-	-
S	綜合	-	-
	合計	195,944,972.17	83.38

## 2.2、報告期末按行業分類的港股通投資股票投資組合

無。

## 3、報告期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的前十名股票投資明細

序號	股票代碼	股票名稱	數量 (股)	公允價值(元)	佔基金資產 淨值比例 (%)
1	600519	貴州茅台	13,400	22,818,860.00	9.71
2	600276	恒瑞醫藥	312,600	14,370,222.00	6.12
3	603056	德邦股份	661,800	10,403,496.00	4.43
4	300122	智飛生物	220,300	9,900,282.00	4.21
5	600690	海爾智家	393,500	9,817,825.00	4.18
6	002422	科倫藥業	285,400	8,718,970.00	3.71
7	301015	百洋醫藥	250,600	8,327,438.00	3.54
8	300573	興齊眼藥	38,300	8,196,200.00	3.49
9	688677	海泰新光	139,912	7,807,089.60	3.32
10	600660	福耀玻璃	177,100	7,661,346.00	3.26

## 4、報告期末按債券品種分類的債券投資組合

無。

## 5、報告期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排名的前五名債券投資明細

無。

## 6、報告期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排名的前十名資產支持證券投資明細

無。

## 7、報告期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排序的前五名貴金屬投資明細

無。

## 8、報告期末按公允價值佔基金資產淨值比例大小排名的前五名權證投資明細

無。

## 9、報告期末本基金投資的股指期貨交易情況說明

## 9.1、報告期末本基金投資的股指期貨持倉和損益明細

無。

## 9.2、本基金投資股指期貨的投資政策

無。

## 10、報告期末本基金投資的國債期貨交易情況說明

## 10.1、本期國債期貨投資政策

無。

## 10.2、報告期末本基金投資的國債期貨持倉和損益明細

無。

## 10.3、本期國債期貨投資評價

無。

## 11、投資組合報告附注

11.1、本基金投資的前十名證券的發行主體本期是否出現被監管部門立案調查，或在報告編製日前一年內受到公開譴責、處罰的情形

本基金投資的前十名證券的發行主體本期沒有出現被監管部門立案調查，或在報告編製日前一年內受到公開譴責、處罰的情形。

## 11.2、聲明基金投資的前十名股票是否超出基金合同規定的備選股票庫

本基金投資的前十名股票未超出基金合同規定的備選股票庫。

## 11.3、其他資產構成

序號	名稱	金額（元）
1	存出保證金	57,628.57
2	應收證券清算款	-
3	應收股利	-
4	應收利息	-
5	應收申購款	44,073.95
6	其他應收款	-
7	其他	-

8	合計	101,702.52
---	----	------------

## 11.4、報告期末持有的處於轉股期的可轉換債券明細

無。

## 11.5、報告期末前十名股票中存在流通受限情況的說明

無。

## 11.6、投資組合報告附注的其他文字描述部分

由於四捨五入原因，分項之和與合計可能有尾差。

## 九、基金業績

基金管理人依照恪盡職守、誠實信用、謹慎勤勉的原則管理和運用基金財產，但不保證基金一定盈利，也不保證最低收益。基金的過往業績並不代表其未來表現。投資有風險，投資者在做出投資決策前應仔細閱讀本基金的招募說明書。

### （一） 基金份額淨值增長率及其與同期業績比較基準收益率的比較

#### 大成內需增長混合 A

階段	淨值增長率①	淨值增長率標準差②	業績比較基準收益率③	業績比較基準收益率標準差④	①-③	②-④
2011.06.14-2011.12.31	-17.30%	1.01%	-15.95%	1.08%	-1.35%	-0.07%
2012.01.01-2012.12.31	8.10%	1.17%	7.09%	1.02%	1.01%	0.15%
2013.01.01-2013.12.31	25.73%	1.49%	-5.90%	1.12%	31.63%	0.37%
2014.01.01-2014.12.31	36.03%	1.30%	42.57%	0.97%	-6.54%	0.33%
2015.01.01-2015.12.31	73.25%	2.89%	7.37%	1.99%	65.88%	0.90%
2016.01.01-2016.12.31	-15.86%	1.84%	-8.39%	1.12%	-7.47%	0.72%
2017.01.01-2017.12.31	21.85%	0.96%	17.23%	0.51%	4.62%	0.45%
2018.01.01-2018.12.31	-24.04%	1.41%	-19.28%	1.07%	-4.76%	0.34%
2019.01.01-2019.12.31	49.01%	1.31%	29.52%	0.99%	19.49%	0.32%
2020.01.01-2020.12.31	66.07%	1.47%	22.46%	1.14%	43.61%	0.33%
2021.01.01-2021.12.31	-2.90%	1.62%	-2.94%	0.94%	0.04%	0.68%
2022.01.01-2022.12.31	-12.55%	1.29%	-16.91%	1.02%	4.36%	0.27%
2023.01.01-2023.12.31	-12.60%	0.77%	-8.22%	0.68%	-4.38%	0.09%

2024.01.01-2024.03.31	-2.03%	1.34%	2.95%	0.82%	-4.98%	0.52%
2011.06.14-2024.03.31	271.20%	1.52%	35.84%	1.09%	235.36%	0.43%

## 大成內需增長混合 H

階段	淨值增長率①	淨值增長率標準差②	業績比較基準收益率③	業績比較基準收益率標準差④	①-③	②-④
2016.03.03-2016.12.31	11.84%	1.27%	7.18%	0.71%	4.66%	0.56%
2017.01.01-2017.12.31	21.79%	0.96%	17.23%	0.51%	4.56%	0.45%
2018.01.01-2018.12.31	-24.04%	1.41%	-19.28%	1.07%	-4.76%	0.34%
2019.01.01-2019.12.31	49.01%	1.31%	29.52%	0.99%	19.49%	0.32%
2020.01.01-2020.12.31	66.04%	1.47%	22.46%	1.14%	43.58%	0.33%
2021.01.01-2021.12.31	-2.90%	1.62%	-2.94%	0.94%	0.04%	0.68%
2022.01.01-2022.12.31	-12.59%	1.30%	-16.91%	1.02%	4.32%	0.28%
2023.01.01-2023.12.31	-12.58%	0.77%	-8.22%	0.68%	-4.36%	0.09%
2024.01.01-2024.03.31	-2.03%	1.34%	2.95%	0.82%	-4.98%	0.52%
2016.03.03-2024.03.31	86.06%	1.29%	22.58%	0.91%	63.48%	0.38%

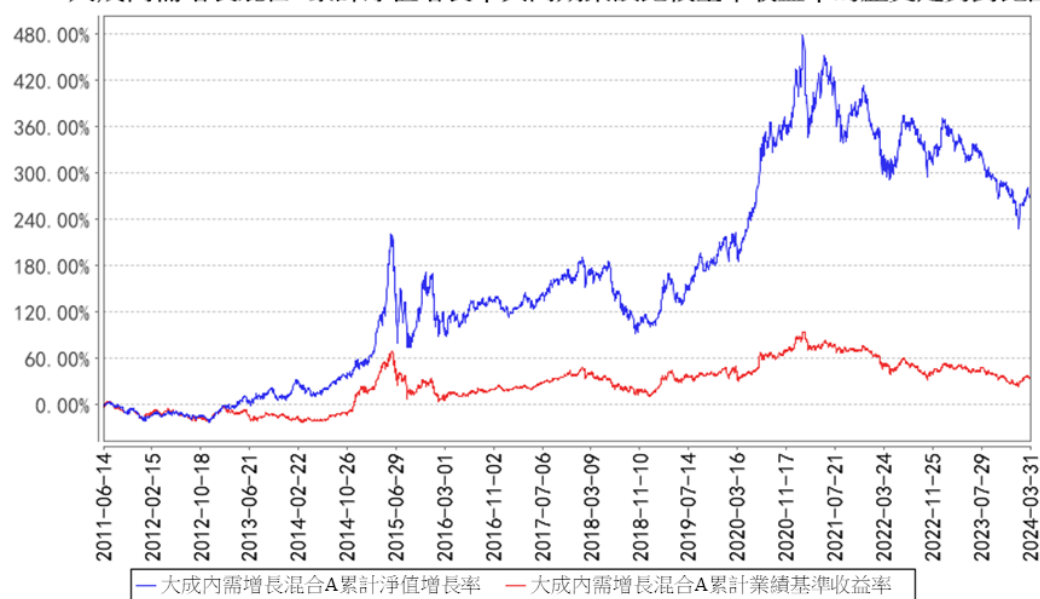
## 大成內需增長混合 C

階段	淨值增長率①	淨值增長率標準差②	業績比較基準收益率③	業績比較基準收益率標準差④	①-③	②-④
2023.09.27 - 2023.12.31	-4.69%	0.74%	-5.57%	0.62%	0.88%	0.12%
2024.01.01 - 2024.03.31	-2.17%	1.34%	2.95%	0.82%	-5.12%	0.52%
2023.09.27 - 2024.03.31	-6.75%	1.07%	-2.78%	0.72%	-3.97%	0.35%

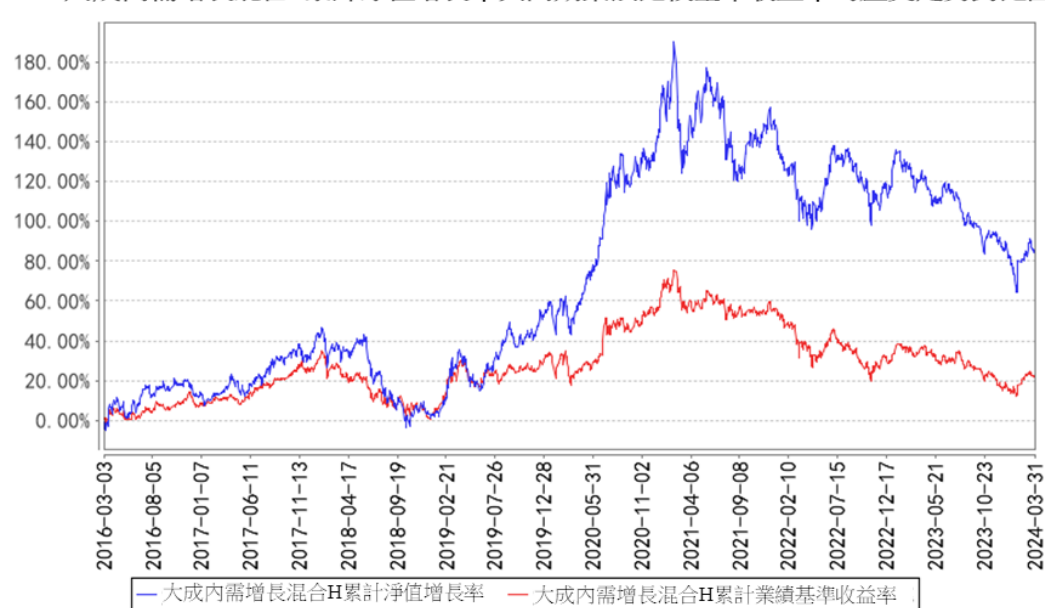
(二) 自基金合同生效以來基金份額累計淨值增長率變動及其與同期業績比較基準收益率變動的比較



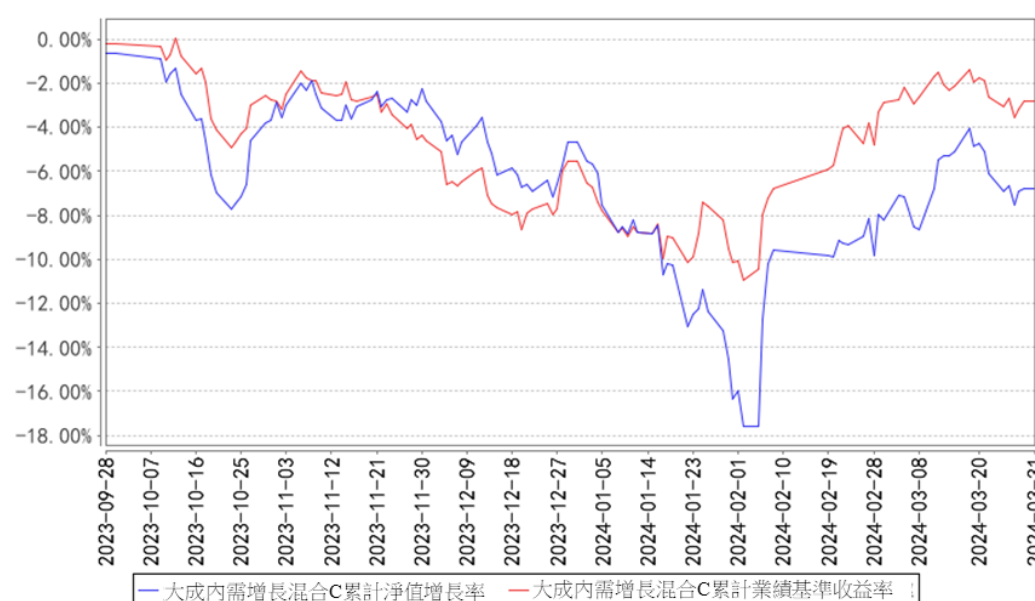
大成內需增長混合A累計淨值增長率與同期業績比較基準收益率的歷史走勢對比圖



大成內需增長混合H累計淨值增長率與同期業績比較基準收益率的歷史走勢對比圖



大成內需增長混合C累計淨值增長率與同期業績比較基準收益率的歷史走勢對比圖



註：1、本基金合同規定，基金管理人應當自基金合同生效之日起六個月內使基金的投資組合比例符合基金合同的有關約定。建倉期結束時，本基金的投資組合比例符合基金合同的約定。

2、本基金於 2015 年 7 月 2 日基金名稱由“大成內需增長股票型證券投資基金”變更為“大成內需增長混合型證券投資基金”。

3、本基金自 2016 年 2 月 22 日起增設 H 類基金份額類別，H 類的淨值增長率和業績比較基準收益率自 2016 年 3 月 3 日有份額之日開始計算。

4、本基金自 2023 年 9 月 27 日起增設 C 類基金份額類別，C 類的淨值增長率和業績比較基準收益率自 2023 年 9 月 28 日有份額之日開始計算。

## 十、基金的融資、融券

本基金可以根據有關法律法規和政策的規定進行融資、融券。

## 十一、基金的財產

### （一）基金資產總值

本基金的基金資產總值包括基金所持有的各類有價證券、銀行存款本息、基金的應收款項和其他投資所形成的價值總和。

### （二）基金資產淨值

本基金的基金資產淨值是指基金資產總值減去負債後的價值。

### （三）基金財產的帳戶

本基金根據相關法律法規、規範性文件開立基金資金帳戶以及證券帳戶，與基金管理人、基金託管人自有的財產帳戶以及其他基金財產帳戶獨立。

### （四）基金財產的保管及處分

- 1· 本基金財產獨立於基金管理人及基金託管人的固有財產，並由基金託管人保管。
- 2· 基金管理人、基金託管人因基金財產的管理、運用或者其他情形而取得的財產和收益，歸基金財產。
- 3· 基金管理人、基金託管人因依法解散、被依法撤銷或者被依法宣告破產等原因進行清算的，基金財產不屬於其清算範圍。
- 4· 基金管理人和基金託管人以其自有的財產承擔其自身的法律責任，其債權人不得對本基金財產行使請求凍結、扣押或其他權利。除依法律法規、基金合同和託管協議的規定處分外，基金財產不得被處分。
- 5· 基金財產的債權不得與基金管理人、基金託管人固有財產的債務相抵銷；不同基金財產的債權債務，不得相互抵銷。非因基金財產本身承擔的債務，不得對基金財產強制執行。

## 十二、基金資產估值

### （一）估值目的

基金估值的目的是為了準確、真實地反映基金相關金融資產和金融負債的公允價值。本基金各類基金份額申購、贖回價格應按基金估值後確定的各類基金份額淨值計算。

### （二）估值日

本基金的估值日為相關的證券交易場所的正常營業日以及國家法律法規規定需要對外披露基金淨值的非營業日。

### （三）估值對象

基金所持有的金融資產和金融負債。

### （四）估值方法

#### 1．股票估值方法

##### （1）上市流通股票的估值

上市流通股票按估值日其所在證券交易所的收盤價估值；估值日無交易的，且最近交易日後經濟環境未發生重大變化，以最近交易日的收盤價估值；如最近交易日後經濟環境發生了重大變化的，可參考類似投資品種的現行市價及重大變化因素，調整最近交易市價，確定公允價格。

##### （2）未上市股票的估值

送股、轉增股、配股和公開增發新股等發行未上市的股票，按估值日在交易所掛牌的同一股票的收盤價估值；估值日無交易的，且最近交易日後經濟環境未發生重大變化，以最近交易日的收盤價估值；如最近交易日後經濟環境發生了重大變化的，可參考類似投資品種的現行市價及重大變化因素，調整最近交易市價，確定公允價格。

首次發行未上市的股票，採用估值技術確定公允價值，在估值技術難以可靠計量的情況下，按成本估值。

##### （3）有明確鎖定期股票的估值

首次公開發行有明確鎖定期的股票，同一股票在交易所上市後，按交易所上市的同一股票的收盤價估值；非公開發行且處於明確鎖定期的股票，按監管機構或行業協會的有關規定確定公允價值。

#### 2．固定收益證券的估值辦法

（1）在交易所市場上市交易或掛牌轉讓的固定收益品種（另有規定的除外），選取第三方估值機構提供的相應品種當日的估值淨價估值。

（2）對在交易所市場上市交易的可轉換債券，按照每日收盤價作為估值全價。

（3）未上市債券採用估值技術確定公允價值，在估值技術難以可靠計量的情況下，按成本估值。

(4) 在銀行間債券市場交易的債券、資產支持證券等固定收益品種，採用估值技術確定公允價值。

(5) 交易所以大宗交易方式轉讓的資產支持證券，採用估值技術確定公允價值，在估值技術難以可靠計量公允價值的情況下，按成本進行後續計量。

(6) 同一債券同時在兩個或兩個以上市場交易的，按債券所處的市場分別估值。

### 3· 權證估值：

(1) 配股權證的估值：

因持有股票而享有的配股權，類同權證處理方式的，採用估值技術進行估值。

(2) 認沽/認購權證的估值：

從持有確認日起到賣出日或行權日止，上市交易的認沽/認購權證按估值日的收盤價估值，估值日沒有交易的，且最近交易日後經濟環境未發生重大變化，按最近交易日的收盤價估值；如最近交易日後經濟環境發生了重大變化的，可參考類似投資品種的現行市價及重大變化因素，調整最近交易市價，確定公允價格；未上市交易的認沽/認購權證採用估值技術確定公允價值，在估值技術難以可靠計量的情況下，按成本估值。

4· 本基金持有的回購以成本列示，按合同利率在回購期間內逐日計提應收或應付利息。

5· 本基金持有的銀行存款和備付金餘額以本金列示，按相應利率逐日計提利息。

### 6· 金融衍生品的估值

(1) 上市流通金融衍生品按估值日其結算價估值；估值日無交易的，以最近交易日的結算價估值。

(2) 未上市金融衍生品按成本價估值，如成本價不能反映公允價值，則採用估值模型確定公允價值。

7· 本基金投資存託憑證的估值核算，依照境內上市交易的股票執行。

8· 在任何情況下，基金管理人採用上述 1-7 項規定的方法對基金資產進行估值，均應被認為採用了適當的估值方法。但是，如果基金管理人有充足的理由認為按上述方法對基金資產進行估值不能客觀反映其公允價值的，基金管理人可在綜合考慮市場成交價、市場報價、流動性、收益率曲線等多種因素的基礎上與基金託管人商定後，按最能反映公允價值的價格估值。

9· 國家有最新規定的，按國家最新規定進行估值。

### (五) 估值程式

基金日常估值由基金管理人同基金託管人一同進行。各類基金份額淨值由基金管理人完成估值後，將估值結果報給基金託管人，基金託管人按基金合同規定的估值方法、時間、程式進行覆核，基金託管人覆核無誤後由基金管理人對外公佈。月末、年中和年末估值覆核與基金會計帳目的核對同時進行。

#### （六）暫停估值的情形

- 1· 基金投資所涉及的證券交易所遇法定節假日或因其他原因暫停營業時；
- 2· 因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金託管人無法準確評估基金資產價值時；
- 3· 當特定資產佔前一估值日基金資產淨值 50%以上的，經與基金託管人協商一致的；
- 4· 中國證監會認定的其他情形。

#### （七）基金份額淨值的確認

用於基金資訊披露的各類基金份額淨值由基金管理人負責計算，基金託管人進行覆核。基金管理人應於每個工作日交易結束後計算當日的各類基金份額淨值併發送給基金託管人。基金託管人對淨值計算結果覆核確認後發送給基金管理人，由基金管理人對各類基金份額淨值予以公佈。

各類基金份額淨值的計算精確到 0.001 元，小數點後第 4 位四捨五入。國家另有規定的，從其規定。

#### （八）估值錯誤的處理

1· 當基金資產的估值導致任一類基金份額淨值小數點後 3 位（含第 3 位）內發生差錯時，視為該類基金份額淨值估值錯誤。

2· 基金管理人和基金託管人將採取必要、適當合理的措施確保基金資產估值的準確性、及時性。當基金份額淨值出現錯誤時，基金管理人和基金託管人應當立即予以糾正，並採取合理的措施防止損失進一步擴大；當計價錯誤達到或超過該類基金份額淨值的 0.25%時，基金管理人應當報中國證監會備案；當計價錯誤達到或超過該類基金份額淨值的 0.5%時，基金管理人應當公告，並同時報中國證監會備案。

3· 前述內容如法律法規或監管機構另有規定的，按其規定處理。

#### （九）特殊情形的處理

1· 基金管理人按本條第（四）款有關估值方法規定的第 8 項條款進行估值時，所造成的誤差不作為基金份額淨值錯誤處理。

2· 由於不可抗力原因，或由於證券交易所及登記結算公司發送的數據錯誤，基金管理人和基金託管人雖然已經採取必要、適當、合理的措施進行檢查，但未能發現錯誤的，由此造成的基金資產估值錯誤，基金管理人和基金託管人可以免除賠償責任。但基金管理人和基金託管人應當積極採取必要的措施消除由此造成的影響。

#### （十）實施側袋機制期間的基金資產估值

本基金實施側袋機制的，應根據本部分的約定對主袋帳戶資產進行估值並披露主袋帳戶的各類基金份額淨值和基金份額累計淨值，暫停披露側袋帳戶的基金淨值資訊。

## 十三、基金的費用與稅收

### （一）基金費用的種類

- 1、基金管理人的管理費；
- 2、基金託管人的託管費；
- 3、C 類基金份額的銷售服務費；
- 4、因基金的證券交易或結算而產生的費用（包括但不限於經手費、印花稅、證管費、過戶費、手續費、券商傭金、權證交易的結算費及其他類似性質的費用等）；
- 5、基金合同生效以後的資訊披露費用；
- 6、基金份額持有人大會費用；
- 7、基金合同生效以後的會計師費、律師費和訴訟費；
- 8、基金資產的資金匯劃費用及證券帳戶等的開戶費用；
- 9、H 類份額需要承擔因申購贖回產生的資金跨境劃撥費用；
- 10、按照國家有關法律法規規定可以列入的其他費用。

本基金終止清算時所發生的費用，按實際支出額從基金財產總值中扣除。

### （二）基金費用計提方法、計提標準和支付方式

#### 1、基金管理人的管理費

基金管理人的基金管理費按基金資產淨值的 1.20% 年費率計提。

在通常情況下，基金管理費按前一日基金資產淨值的 1.20% 年費率計提。計算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{當年天數}$$

H 為每日應計提的基金管理費

E 為前一日基金資產淨值

基金管理費每日計提，按月支付。經基金管理人與基金託管人核對一致後，由基金託管人於次月首日起 2 個工作日內從基金資產中一次性支付給基金管理人。

#### 2、基金託管人的基金託管費

基金託管人的基金託管費按基金資產淨值的 0.20% 年費率計提。

在通常情況下，基金託管費按前一日基金資產淨值的 0.20% 年費率計提。計算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{當年天數}$$

H 為每日應計提的基金託管費

E 為前一日的基金資產淨值

基金託管費每日計提，按月支付。經基金管理人與基金託管人核對一致後，由基金託管人於次月首日起 2 個工作日內從基金資產中一次性支付給基金託管人。

### 3、C 類基金份額的銷售服務費

C 類基金份額的銷售服務費按基金資產淨值的 0.60% 年費率計提。

在通常情況下，銷售服務費按前一日 C 類基金份額基金資產淨值的 0.60% 年費率計提。

計算方法如下：

$$H=E \times 0.60\% \div \text{當年天數}$$

H 為 C 類基金份額每日應計提的銷售服務費

E 為 C 類基金份額前一日的基金資產淨值

銷售服務費每日計提，按月支付。經基金管理人與基金託管人核對一致後，由基金託管人於次月首日起 2 個工作日內從基金資產中一次性支付給基金管理人，由基金管理人代付給銷售機構。

4、本條第（一）款第 4 至第 10 項費用由基金管理人和基金託管人根據有關法規及相應協議的規定，列入當期基金費用。

#### （三）不列入基金費用的專案

下列費用不列入基金費用：

1、本條第（一）款約定以外的其他費用，以及基金管理人和基金託管人因未履行或未完成履行義務導致的費用支出或基金資產的損失；

2、基金管理人和基金託管人處理與基金運作無關的事項發生的費用；

3、《基金合同》生效前的相關費用，包括但不限於驗資費、會計師和律師費、資訊披露費用等費用。

#### （四）實施側袋機制期間的基金費用

本基金實施側袋機制的，與側袋帳戶有關的費用可以從側袋帳戶中列支，但應待側袋帳戶資產變現後方可列支，有關費用可酌情收取或減免，但不得收取管理費，詳見本招募說明書“側袋機制”章節或相關公告。

#### （五）基金管理費、基金託管費和銷售服務費的調整

基金管理人和基金託管人可協商酌情調低基金管理費、基金託管費和銷售服務費，無須召開基金份額持有人大會。

#### （六）稅收

本基金運作過程中涉及的各納稅主體，依照國家法律法規的規定履行納稅義務。



## 十四、基金收益與分配

### （一）收益的構成

基金利潤是指基金利息收入、投資收益、公允價值變動收益和其他收入扣除相關費用後的餘額。基金已實現收益指基金利潤減去公允價值變動收益後的餘額。

基金可供分配利潤，指截至收益分配基準日基金未分配利潤與未分配利潤中已實現收益的孰低數。

### （二）收益分配原則

1·基金收益分配採用現金方式或紅利再投資方式，基金份額持有人可自行選擇收益分配方式；基金份額持有人事先未做出選擇的，默認的分紅方式為現金紅利；選擇紅利再投資的，分紅資金將按除息日各類基金份額淨值轉成相應類別的基金份額；

2·由於本基金 A 類基金份額和 H 類基金份額不收取銷售服務費，C 類基金份額收取銷售服務費，各基金份額類別對應的可供分配利潤將有所不同。本基金同一類別每一基金份額享有同等分配權；

3·基金收益分配基準日的基金份額淨值減去每單位基金份額收益分配金額後不能低於面值，基金收益分配基準日即可供分配利潤計算截止日；

4·在符合有關基金分紅條件的前提下，基金收益分配每年至多 6 次；每次基金收益分配比例不得低於收益分配基準日可供分配利潤的 20%。基金合同生效不滿三個月，收益可不分配；

5·基金紅利發放日距離收益分配基準日的時間不超過 15 個工作日；

6·投資者的現金紅利和分紅再投資形成的基金份額均保留到小數點後第 2 位，小數點後第 3 位開始舍去，舍去部分歸基金資產；

7·法律法規或監管機構另有規定的，從其規定。

### （三）收益分配方案

基金收益分配方案中應載明基金收益分配基準日可供分配利潤、基金收益分配對象、分配原則、分配時間、分配數額及比例、分配方式及有關手續費等內容。

### （四）收益分配方案的確定與公告

基金收益分配方案由基金管理人擬定，並由基金託管人覆核後確定，依照《資訊披露辦法》的有關規定在指定媒介公告。

### （五）收益分配中發生的費用

1·收益分配採用紅利再投資方式免收再投資的費用。

2·收益分配時發生的銀行轉帳等手續費用由基金份額持有人自行承擔。如果基金份額

持有人所獲現金紅利不足支付前述銀行轉帳等手續費用，註冊登記機構自動將該基金份額持有人的現金紅利按除息日的各類基金份額淨值轉為相應類別的基金份額。

（六）實施側袋機制期間的收益分配

本基金實施側袋機制的，側袋帳戶不進行收益分配，詳見本招募說明書“側袋機制”章節的規定。

## 十五、基金的會計與審計

### （一）基金的會計政策

- 1· 基金的會計年度為西曆每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。
- 2· 基金核算以人民幣為記帳本位幣，以人民幣元為記帳單位。
- 3· 會計核算制度按國家有關的會計核算制度執行。
- 4· 本基金獨立建帳、獨立核算。
- 5· 本基金會計責任人為基金管理人。
- 6· 基金管理人應保留完整的會計帳目、憑證並進行日常的會計核算，按照有關法律法規規定編製基金會計報表，基金託管人定期與基金管理人就基金的會計核算、報表編製等進行核對並以書面方式確認。

### （二）基金審計

- 1· 基金管理人聘請與基金管理人、基金託管人相獨立的、具有從事證券、期貨相關業務資格的會計師事務所及其註冊會計師等對基金年度財務報表及其他規定事項進行審計；
- 2· 基金管理人認為有充足理由更換會計師事務所，須通報基金託管人。更換會計師事務所需按照《資訊披露辦法》的有關規定在指定媒介公告。
- 3· 會計師事務所更換經辦註冊會計師，應事先征得基金管理人同意；

## 十六、基金的資訊披露

基金資訊披露義務人應當在中國證監會規定時間內，將應予披露的基金資訊通過至少一種指定媒介和基金管理人的互聯網網站等媒介披露，並保證投資者能夠按照基金合同約定的時間和方式查閱或者複製公開披露的資訊資料。

### （一）基金招募說明書、基金合同、基金託管協議、基金產品資料概要

基金募集申請經中國證監會註冊後，基金管理人應當在基金份額發售的三 3 日前，將基金份額發售公告、基金招募說明書提示性公告和《基金合同》提示性公告登載在指定報刊上，將基金份額發售公告、基金招募說明書、基金產品資料概要、《基金合同》和基金託管協議登載在指定網站上，並將基金產品資料概要登載在基金銷售機構網站或營業網點；基金託管人應當同時將基金合同、基金託管協議登載在網站上。基金招募說明書、《基金合同》摘要登載在指定媒介上；基金管理人、基金託管人應當將《基金合同》、基金託管協議登載在網站上。

基金招募說明書應當最大限度地披露影響基金投資者決策的全部事項，說明基金認購、申購和贖回安排、基金投資、基金產品特性、風險揭示、資訊披露及基金份額持有人服務等內容。《基金合同》生效後，基金招募說明書的資訊發生重大變更的，基金管理人應當在三個工作日內，更新基金招募說明書並登載在指定網站上；基金招募說明書其他資訊發生變更的，基金管理人至少每年更新一次。基金終止運作的，基金管理人不再更新基金招募說明書。

基金合同生效後，基金管理人應當在每 6 個月結束之日起 45 日內，更新招募說明書並登載在網站上，將更新後的招募說明書摘要登載在指定報刊上。基金管理人應當在公告的 15 日前向中國證監會報送更新的招募說明書，並就有關更新內容提供書面說明。

### （二）基金份額發售公告

基金管理人應當就基金份額發售的具體事宜編製基金份額發售公告，並在披露招募說明書的當日登載於指定報刊和網站上。

### （三）基金合同生效公告

基金管理人應當在基金合同生效的次日在指定媒介和網站上登載基金合同生效公告。

### （四）基金淨值資訊

基金合同生效後，在開始辦理基金份額申購或者贖回前，基金管理人應當至少每週在指定網站披露一次各類基金份額的基金份額淨值和基金份額累計淨值。

在開始辦理基金份額申購或者贖回之後，基金管理人應當在不晚於每個開放日的次日，通過指定網站、基金銷售機構網站或者營業網點以及其他媒介，披露開放日的各類基金份額的基金份額淨值和基金份額累計淨值。

基金管理人應當在不晚於半年度和年度最後一日的次日，在指定網站披露半年度和年度最後一日各類基金份額的基金份額淨值和基金份額累計淨值。

### （五）定期報告

基金定期報告由基金管理人按照法律法規和中國證監會頒佈的有關證券投資基金資訊披露內容與格式的相關文件的規定單獨編製，由基金託管人按照法律法規的規定對相關內容進行覆核。基金定期報告，包括基金年度報告、基金中期報告和基金季度報告及更新的招募說明書。

1、基金年度報告：基金管理人應當在每年結束之日起三個月內，編製完成基金年度報告，將年度報告登載在指定網站上，並將年度報告提示性公告登載在指定報刊上。基金年度報告中的財務會計報告應當經過具有證券、期貨相關業務資格的會計師事務所審計。

2、基金中期報告：基金管理人應當在上半年結束之日起兩個月內，編製完成基金中期報告，將中期報告登載在指定網站上，並將中期報告提示性公告登載在指定報刊上。

3、基金季度報告：基金管理人應當在每個季度結束之日起 15 個工作日內，編製完成基金季度報告，將季度報告登載在指定網站上，並將季度報告提示性公告登載在指定報刊上。

基金合同生效不足 2 個月的，基金管理人可以不編製當期季度報告、中期報告或者年度報告。

如報告期內出現單一投資者持有基金份額達到或超過基金總份額 20% 的情形，為保障其他投資者利益，基金管理人至少應當在定期報告“影響投資者決策的其他重要資訊”項下披露該投資者的類別、報告期末持有份額及佔比、報告期內持有份額變化情況及本基金的特有風險，中國證監會認定的特殊情形除外。

本基金持續運作過程中，應當在基金年度報告和中期報告中披露基金組合資產情況及其流動性風險分析等。

法律法規或中國證監會另有規定的，從其規定。

### （六）股指期貨投資

基金管理人應在季度報告、中期報告、年度報告等定期報告和招募說明書（更新）等文件中披露股指期貨投資情況，包括投資政策、持倉情況、損益情況、風險指標等，並充分揭示股指期貨投資對基金總體風險的影響以及是否符合既定的投資政策和投資目標。

### （七）臨時報告與公告

基金發生重大事件，有關資訊披露義務人應當在 2 日內編製臨時報告書，並登載在指定報刊和指定網站上。

前款所稱重大事件，是指可能對基金份額持有人權益或者基金份額的價格產生重大影響的事件，包括：

- 1、基金份額持有人大會的召開及決定的事項；
- 2、基金合同終止、基金清算；
- 3、轉換基金運作方式、基金合併；
- 4、更換基金管理人、基金託管人；

5、基金管理人委託基金服務機構代為辦理基金的份額登記、核算、估值等事項，基金託管人委託基金服務機構代為辦理基金的核算、估值、覆核等事項；

6、基金管理人、基金託管人的法定名稱、住所發生變更；

7、基金管理人變更持有百分之五以上股權的股東、基金管理人的實際控制人變更；

8、基金募集期延長或提前結束募集；

9、基金管理人的高級管理人員、基金經理和基金託管人專門基金託管部門負責人發生變動；

10、基金管理人的董事在最近 12 個月內變更超過百分之五十，基金管理人、基金託管人專門基金託管部門的主要業務人員在最近 12 個月內變動超過百分之三十；

11、涉及基金財產、基金管理業務、基金託管業務的訴訟或仲裁；

12、基金管理人或其高級管理人員、基金經理因基金管理業務相關行為受到重大行政處罰、刑事處罰，基金託管人或其專門基金託管部門負責人因基金託管業務相關行為受到重大行政處罰、刑事處罰；

13、基金管理人運用基金財產買賣基金管理人、基金託管人及其控股股東、實際控制人或者與其有重大利害關係的公司發行的證券或者承銷期內承銷的證券，或者從事其他重大關聯交易事項，中國證監會另有規定的情形除外；

14、基金收益分配事項；

15、管理費、託管費、銷售服務費、申購費、贖回費等費用計提標準、計提方式和費率發生變更；

16、任一類基金份額淨值計價錯誤達該類基金份額淨值 0.5%；

17、基金改聘會計師事務所；

18、基金更換基金註冊登記機構；

19、基金開始辦理申購、贖回；

20、基金申購、贖回費率及其收費方式發生變更；

21、基金發生巨額贖回並延期支付；

22、基金連續發生巨額贖回並暫停接受贖回申請；

23、基金暫停接受申購、贖回申請後重新接受申購、贖回；

24、發生涉及基金申購、贖回事項調整或潛在影響投資者贖回等其他重大事項；

25、基金份額上市交易；

26、基金份額持有人大會的決議

27、基金資訊披露義務人認為可能對基金份額持有人權益或者基金份額的價格產生重大影響的其他事項或中國證監會規定的其他事項。

28、本基金公開披露的資訊應採用中文文本。同時採用外文文本的，基金資訊披露義務人應保證不同文本的內容一致。不同文本之間發生歧義的，以中文文本為準；

29、基金管理人採用擺動定價機制進行估值。

（八）公開澄清

在基金合同期限內，任何公共媒介中出現的或者在市場上流傳的消息可能對基金份額價格產生誤導性影響或者引起較大波動，以及可能損害基金份額持有人權益的，相關資訊披露義務人知悉後應當立即對該消息進行公開澄清，並將有關情況立即報告中國證監會。

（九）清算報告

基金合同終止的，基金管理人應當依法組織基金財產清算小組對基金財產進行清算並作出清算報告。基金財產清算小組應當將清算報告登載在指定網站上，並將清算報告提示性公告登載在指定報刊上。

（十）資訊披露文件的存放與查閱

依法必須披露的資訊發佈後，基金管理人、基金託管人應當按照相關法律法規規定將資訊置備於公司住所，供社會公眾查閱、複製。

（十一）本基金投資存託憑證的資訊披露依照境內上市交易的股票執行。

（十二）實施側袋機制期間的資訊披露

本基金實施側袋機制的，相關資訊披露義務人應當根據法律法規、基金合同和招募說明書的規定進行資訊披露，詳見本招募說明書“側袋機制”章節的規定。

（十三）中國證監會規定的其他資訊。

（十四）資訊披露事務管理

基金管理人、基金託管人應當建立健全資訊披露管理制度，指定專門部門及高級管理人員負責管理資訊披露事務。

基金資訊披露義務人公開披露基金資訊，應當符合中國證監會相關基金資訊披露內容與格式準則等法律法規規定。

基金託管人應當按照相關法律法規、中國證監會的規定和《基金合同》的約定，對基金管理人編製的基金資產淨值、各類基金份額淨值、基金份額申購贖回價格、基金定期報告、更新的招募說明書、基金產品資料概要、基金清算報告等公開披露的相關基金資訊進行覆核、審查，並向基金管理人進行書面或電子確認。

基金管理人、基金託管人應當在指定報刊中選擇一家報刊披露本基金資訊。基金管理人、基金託管人應當向中國證監會基金電子披露網站報送擬披露的基金資訊，並保證相關報送資訊的真實、準確、完整、及時。

基金管理人、基金託管人除依法在指定媒介上披露資訊外，還可以根據需要在其他公共媒介披露資訊，但是其他公共媒介不得早於指定媒介披露資訊，並且在不同媒介上披露同一資訊的內容應當一致。

## 十七、側袋機制

### （一）側袋機制的實施條件、實施程式

當基金持有特定資產且存在或潛在大額贖回申請時，根據最大限度保護基金份額持有人利益的原則，基金管理人經與基金託管人協商一致，並諮詢會計師事務所意見後，可以依照法律法規及基金合同的約定啟用側袋機制，無需召開基金份額持有人大會。基金管理人應當在啟用側袋機制當日報中國證監會及公司所在地中國證監會派出機構備案。

啟用側袋機制當日，基金管理人和基金服務機構應以基金份額持有人的原有帳戶份額為基礎，確認相應側袋帳戶持有人名冊和份額。

### （二）側袋機制實施期間的基金運作安排

#### 1．基金份額的申購與贖回

##### （1）側袋帳戶

側袋機制實施期間，基金管理人不得辦理側袋帳戶的申購、贖回和轉換。基金份額持有人申請申購、贖回或轉換側袋帳戶基金份額的，該申購、贖回或轉換申請將被拒絕。

##### （2）主袋帳戶

基金管理人將依法保障主袋帳戶份額持有人享有基金合同約定的贖回權利，並根據主袋帳戶運作情況合理確定申購事項，具體事項屆時將由基金管理人在相關公告中規定。

對於啟用側袋機制當日收到的贖回申請，基金管理人僅辦理主袋帳戶的贖回申請並支付贖回款項。在啟用側袋機制當日收到的申購申請，視為投資者對側袋機制啟用後的主袋帳戶提交的申購申請。基金管理人應依法向投資者進行充分披露。

#### 2．基金的投資

側袋機制實施期間，本基金的各項投資運作指標和基金業績指標應當以主袋帳戶資產為基準。

基金管理人原則上應當在側袋機制啟用後 20 個交易日內完成對主袋帳戶投資組合的調整，但因資產流動性受限等中國證監會規定的情形除外。

基金管理人不得在側袋帳戶中進行除特定資產處置變現以外的其他投資操作。

#### 3．基金的費用

側袋機制實施期間，側袋帳戶資產不收取管理費。

基金管理人可以將與處置側袋帳戶資產相關的費用從側袋帳戶資產中列支，但應待特定資產變現後方可列支。因啟用側袋機制產生的諮詢、審計費用等由基金管理人承擔。

#### 4．基金的收益分配

側袋機制實施期間，在主袋帳戶份額滿足基金合同收益分配條件的情形下，基金管理人可對主袋帳戶份額進行收益分配。側袋帳戶不進行收益分配。



## 5· 基金的資訊披露

### (1) 基金淨值資訊

側袋機制實施期間，基金管理人應當暫停披露側袋帳戶的各類基金份額的基金份額淨值和基金份額累計淨值。

### (2) 定期報告

側袋機制實施期間，基金定期報告中的基金會計報表僅需針對主袋帳戶進行編製。側袋帳戶相關資訊在定期報告中單獨進行披露，包括但不限於：報告期內的特定資產處置進展情況；特定資產可變現淨值或淨值區間，該淨值或淨值區間並不代表特定資產最終的變現價格，不作為基金管理人對特定資產最終變現價格的承諾。

### (3) 臨時報告

基金管理人在啟用側袋機制、處置特定資產、終止側袋機制以及發生其他可能對投資者利益產生重大影響的事項後應及時發佈臨時公告。

啟用側袋機制的臨時公告內容應當包括啟用原因及程式、特定資產流動性和估值情況、對投資者申購贖回的影響、風險提示等重要資訊。

處置特定資產的臨時公告內容應當包括特定資產處置價格和時間、向側袋帳戶份額持有人支付的款項、相關費用發生情況等重要資訊。

側袋機制實施期間，若側袋帳戶資產無法一次性完成處置變現，基金管理人將在每次處置變現後按規定及時發佈臨時公告。

## 6· 特定資產處置清算

基金管理人將按照基金份額持有人利益最大化原則制定變現方案，將側袋帳戶資產處置變現。無論側袋帳戶資產是否全部完成變現，基金管理人都應及時向側袋帳戶對應的基金份額持有人支付已變現部分對應的款項。

## 7· 側袋的審計

基金管理人應當在啟用側袋機制和終止側袋機制後，及時聘請符合《中華人民共和國證券法》規定的會計師事務所進行審計並披露專項審計意見，具體如下：

基金管理人應當在啟用側袋機制時，就特定資產認定的相關事宜取得符合《證券法》規定的會計師事務所的專業意見。

基金管理人應當在啟用側袋機制後五個工作日內，聘請於側袋機制啟用日發表意見的會計師事務所針對側袋機制啟用日本基金持有的特定資產情況出具專項審計意見，內容應包含側袋帳戶的初始資產、份額、淨資產等資訊。

會計師事務所對基金年度報告進行審計時，應對報告期間基金側袋機制運行相關的會計核算和年報披露，執行適當程式併發表審計意見。

當側袋帳戶資產全部完成變現後，基金管理人應參照基金清算報告的相關要求，聘請符合《證券法》規定的會計師事務所對側袋帳戶進行審計並披露專項審計意見。

（三）本部分關於側袋機制的相關規定，凡是直接引用法律法規或監管規則的部分，如將來法律法規或監管規則修改導致相關內容被取消或變更的，基金管理人經與基金託管人協商一致並履行適當程式後，在對基金份額持有人利益無實質性不利影響的前提下，可直接對本部分內容進行修改和調整，無需召開基金份額持有人大會審議。

## 十八、風險揭示

### （一）市場風險

本基金主要投資於證券市場，而證券市場價格受政治、經濟、投資心理和交易制度等各種因素的影響會產生波動，從而對本基金投資產生潛在風險，導致基金收益水準發生波動。

#### 1· 政策風險

貨幣政策、財政政策、產業政策等國家宏觀經濟政策的變化對證券市場產生一定影響，從而導致投資對象價格波動，影響基金收益而產生的風險。

#### 2· 經濟週期風險

證券市場是國民經濟的晴雨錶，而經濟運行則具有週期性的特點。隨宏觀經濟運行的週期性變化，基金所投資於證券的收益水準也會隨之變化，從而產生風險。本基金利用“積極進取策略”和“超額收益策略”進行積極的資產配置，能夠一定程度上降低基金面臨的經濟週期風險，但不能完全避免。

#### 3· 利率風險

金融市場利率的變化直接影響著債券的價格和收益率，也會影響企業的融資成本和利潤，進而影響基金持倉證券的收益水準。

#### 4· 購買力風險

基金收益的一部分將通過現金形式來分配，而現金可能因為通貨膨脹的影響而使購買力下降，從而使基金的實際投資收益下降。

#### 5· 國際競爭風險

隨著中國市場開放程度的提高，上市公司的發展必然要受到國際市場同類技術或同類產品公司的強有力競爭，部分上市公司有可能不能適用新的行業形勢而業績下滑。尤其是中國加入 WTO 以後，中國境內公司將面臨前所未有的市場競爭，上市公司在這些因素的影響下將存在更大不確定性。

#### 6· 上市公司經營風險

上市公司的經營狀況受多種因素的影響，如管理能力、行業競爭、市場前景、技術更新、財務狀況、新產品研究開發等都會導致公司盈利發生變化。如果基金所投資的上市公司經營不善，其股票價格可能下跌，或者能夠用於分配的利潤減少，使基金投資收益下降。上市公司還可能出現難以預見的變化。雖然基金可以通過投資多樣化來分散這種非系統風險，但不能完全避免。

### （二）流動性風險

流動性風險是指基金管理人未能以合理價格及時變現基金資產以支付投資者贖回款項的風險，流動性風險管理的目標則是確保基金組合資產的變現能力與投資者贖回需求的匹配與平衡。

### （1）基金申購、贖回安排

本基金的申購、贖回安排詳見本招募說明書“七、基金份額的申購與贖回”章節。

### （2）擬投資市場、行業及資產的流動性風險評估

本基金的投資市場主要為證券交易所、全國銀行間債券市場等流動性較好的規範交易場所，主要投資於具有良好流動性的金融工具，同時本基金基於分散投資的原則在行業和個券方面進行合理配置，綜合評估在正常市場環境下本基金的流動性風險適中。

### （3）巨額贖回情形下的流動性風險管理措施

基金出現巨額贖回情形下，基金管理人可以根據基金當時的資產組合狀況或巨額贖回份額佔比情況決定全額贖回或部分延期贖回。同時，如本基金單個基金份額持有人在單個開放日申請贖回基金份額超過基金總份額一定比例以上的，基金管理人有权對其採取延期辦理贖回申請的措施。

### （4）實施備用的流動性風險管理工具的情形、程式及對投資者的潛在影響

在市場大幅波動、流動性枯竭等極端情況下發生無法應對投資者巨額贖回的情形時，基金管理人將以保障投資者合法權益為前提，嚴格按照法律法規及基金合同的規定，謹慎選取延期辦理巨額贖回申請、暫停接受贖回申請、延緩支付贖回款項、收取短期贖回費、暫停基金估值等流動性風險管理工具作為輔助措施。對於各類流動性風險管理工具的使用，基金管理人將依照嚴格審批、審慎決策的原則，及時有效地對風險進行監測和評估，使用前經過內部審批程式並與基金託管人協商一致。在實際運用各類流動性風險管理工具時，投資者的贖回申請、贖回款項支付等可能受到相應影響，基金管理人將嚴格依照法律法規及基金合同的約定進行操作，全面保障投資者的合法權益。

### （三）信用風險

基金交易對手方發生交易違約或者基金持倉債券的發行人出現違約、拒絕支付債券本息，或者債券發行人信用品質下降導致債券價格下降，造成基金財產損失的風險。

### （四）本基金特有風險

本基金重視股票投資風險的防範，但是基於投資範圍的規定，正常情況下，本基金股票、存託憑證投資比例最低將保持在 60% 以上，無法完全規避股票市場的下跌風險。

本基金股票投資部分主要投資於受益於內需增長的行業中的優質企業。中國經濟持續增長的不確定性和經濟協調發展模式實現路徑的複雜性可能對以內需增長為推動力的行業與公司的業績產生重大影響，進而導致基金資產淨值的波動風險。

本基金參與股指期貨交易。股指期貨交易採用保證金交易制度，由於保證金交易具有槓桿性，當出現不利行情時，股指期貨標的指數微小的變動就可能使投資者權益遭受較大損失。股指期貨採用每日無負債結算制度，如果沒有在規定的時間內補足保證金，按規定將被強制平倉，可能給投資帶來重大損失。此外，交易所對股指期貨的交易限制與規定會對基金投資股指期貨的策略執行產生影響，從而對基金收益產生不利影響。

### 單一投資者集中度較高的風險

由於投資者的申購贖回行為可能導致本基金的單一投資者持有的份額佔本基金總份額的比例較高，該單一投資者的申購贖回行為可能影響本基金的投資運作，從而對基金收益產生不利影響。

基金管理人將控制單一投資者持有基金份額的比例低於 50%，並防止投資者以其他方式變相規避 50%集中度限制的情形發生（運作過程中，因基金份額贖回等情形導致被動超標的除外）。如基金管理人認為接受某筆或者某些申購申請有可能導致單一投資者持有基金份額的比例達到或者超過 50%，或者基金管理人認為可能存在變相規避 50%集中度限制的情形時，基金管理人有权拒絕該單一投資者的全部或部分的認/申購申請或確認失敗。

### （五）操作或技術風險

相關當事人在業務各環節操作過程中，因內部控制存在缺陷或者人為因素造成操作失誤或違反操作規程等原因可能引致風險，例如，越權違規交易、會計部門欺詐、交易錯誤、IT 系統故障等風險。

在開放式基金的各種交易行為或者後台運作中，可能因為技術系統的故障或者差錯而影響交易的正常進行或者導致投資者的利益受到影響。這種技術風險可能來自基金管理人、基金託管人、註冊登記機構、銷售機構、證券交易所、證券登記結算機構等。

### （六）科創板股票投資及相關風險揭示

基金資產投資於科創板股票，會面臨科創板機制下因投資標的、市場制度以及交易規則等差異帶來的特有風險，包括但不限於流動性風險、退市風險、投資集中度風險、市場風險、系統性風險、股價波動風險、政策風險等。基金可根據投資策略需要或市場環境的變化，選擇將部分基金資產投資於科創板股票或選擇不將基金資產投資於科創板股票，基金資產並非必然投資於科創板股票。

#### 1、流動性風險

科創板投資者門檻較高，流動性可能弱於 A 股其他板塊，且機構投資者可能在特定階段對科創板個股形成一致性預期，存在基金持有股票不能正常成交的風險。

#### 2、退市風險

科創板執行比 A 股其他板塊更嚴格的退市標準，且不再設置暫停上市、恢復上市和重新上市環節，科創板上市公司退市風險更大，可能對基金淨值造成不利影響。

#### 3、投資集中度風險

因科創板上市企業均為科技創新成長型，其商業模式、盈利風險及業績波動等特徵較為相似，基金較難通過分散投資降低投資風險，若股票價格同向波動，將引起基金淨值波動。

#### 4、科創板上市公司股價波動較大的風險

科創板股票競價交易設置較寬的漲跌幅限制，首次公開發行上市的股票，上市後的前 5 個交易日不設漲跌幅限制，科創板股票其後漲跌幅限制為 20%，科創板股票投資者應當關注

可能產生的股價波動的風險。

#### 5、系統性風險

科創板企業為市場認可度較高的科技創新企業，在企業經營及盈利模式上存在趨同，所以科創板股票相關性較高，市場表現不佳時，系統性風險將更為顯著。

#### 6、股價波動風險

科創板新股發行價格、規模、節奏等堅持市場化導向，詢價、定價、配售等環節由機構投資者主導。科創板新股發行全部採用詢價定價方式，詢價對象限定在證券公司等七類專業機構投資者，而個人投資者無法直接參與發行定價。同時，因科創板企業普遍具有技術新、前景不確定、業績波動大、風險高等特徵，市場可比公司較少，傳統估值方法可能不適用，發行定價難度較大，科創板股票上市後可能存在股價波動的風險。

#### 7、政策風險

國家對高新技術產業扶持力度及重視程度的變化會對科創板企業帶來較大影響，國際經濟形勢變化對戰略新興產業及科創板股票也會帶來政策影響。

（七）本基金的投資範圍包括存託憑證，除與其他僅投資於滬深市場股票的基金所面臨的共同風險外，本基金還可能面臨存託憑證價格大幅波動甚至出現較大虧損的風險，以及與存託憑證發行機制相關的風險，包括存託憑證持有人與境外基礎證券發行人的股東在法律地位、享有權利等方面存在差異可能引發的風險；存託憑證持有人在分紅派息、行使表決權等方面的特殊安排可能引發的風險；存託協議自動約束存託憑證持有人的風險；因多地上市造成存託憑證價格差異以及波動的風險；存託憑證持有人權益被攤薄的風險；存託憑證退市的風險；已在境外上市的基礎證券發行人，在持續資訊披露監管方面與境內可能存在差異的風險；境內外法律制度、監管環境差異可能導致的其他風險。

#### （八）啟用側袋機制的風險

當本基金啟用側袋機制時，實施側袋機制期間，側袋帳戶份額將停止披露各類基金份額淨值，並不得辦理申購、贖回和轉換。因特定資產的變現時間具有不確定性，最終變現價格也具有不確定性並且有可能大幅低於啟用側袋機制時的特定資產的估值，基金份額持有人可能因此面臨損失。

#### （九）不可抗力風險

戰爭、自然災害等不可抗力因素的出現，將會嚴重影響證券市場的運行，可能導致基金資產遭受損失。基金管理人、基金託管人、證券交易所、註冊登記機構和銷售代理機構等可能因不可抗力無法正常工作，從而影響基金的各項業務按正常時限完成；金融市場危機、行業競爭、代理機構違約等超出基金管理人自身直接控制能力之外的風險，可能導致基金或者基金份額持有人利益受損。

## 十九、基金合同的變更、終止與基金財產清算

### （一）基金合同的變更

1·變更基金合同涉及法律法規規定或基金合同約定應經基金份額持有人大會決議通過的事項的，應召開基金份額持有人大會決議通過。

2·變更基金合同的基金份額持有人大會決議應報中國證監會備案，並自表決通過之日起生效。

3·但如因以下情況對基金合同進行修改，可不經基金份額持有人大會決議，而經基金管理人和基金託管人同意修改後公佈，並報中國證監會備案：

（1）調低基金管理費率、基金託管費率或銷售服務費率；

（2）在法律法規和基金合同規定的範圍內變更本基金的申購費率、調低贖回費率或變更收費方式；

（3）因相應的法律法規發生變動而應當對基金合同進行修改；

（4）對基金合同的修改不涉及基金合同當事人權利義務關係發生變化；

（5）對基金合同的修改對基金份額持有人利益無實質性不利影響；

（6）按照法律法規或基金合同規定不需召開基金份額持有人大會的其他情形。

### （二）基金合同的終止

有下列情形之一的，基金合同應當終止：

1·基金份額持有人大會決定終止；

2·因重大違法、違規行為，被中國證監會責令終止的；

3·基金管理人、基金託管人職責終止，在 6 個月內沒有新基金管理人、基金託管人承接的；

4·法律法規和基金合同規定的其他情形。

### （三）基金財產的清算

1·基金合同終止，基金管理人應當按法律法規和基金合同的有關規定組織清算組對基金財產進行清算。

#### 2·基金財產清算組

（1）自基金合同終止事由之日起 30 個工作日內由基金管理人組織成立基金財產清算組，基金管理人組織基金財產清算小組並在中國證監會的監督下進行基金清算。在基金財產清算組接管基金財產之前，基金管理人和基金託管人應按照基金合同和託管協議的規定繼續履行保護基金財產安全的職責。

（2）基金財產清算組成員由基金管理人、基金託管人、具有從事證券、期貨相關業務資格的註冊會計師、律師以及中國證監會指定的人員組成。基金財產清算組可以聘用必要的工作人員。

(3) 基金財產清算組負責基金財產的保管、清理、估價、變現和分配。基金財產清算組可以依法進行必要的民事活動。

### 3· 清算程式

- (1) 基金合同終止情形發生後，由基金財產清算組統一接管基金財產；
- (2) 基金財產清算組根據基金財產的情況確定清算期限；
- (3) 基金財產清算組對基金資產進行清理和確認；
- (4) 對基金財產進行評估和變現；
- (5) 製作清算報告；
- (6) 聘請會計師事務所對清算報告進行外部審計，聘請律師事務所對清算報告出具法律意見書；
- (7) 將清算報告報中國證監會備案並公告；
- (8) 對基金財產進行分配。

### 4· 清算費用

清算費用是指基金財產清算組在進行基金清算過程中發生的所有合理費用，清算費用由基金財產清算組優先從基金財產中支付。

### 5· 基金剩餘財產的分配

基金財產按下列順序清償：

- (1) 支付清算費用；
- (2) 交納所欠稅款；
- (3) 清償基金債務；
- (4) 按基金份額持有人持有的基金份額比例進行分配。

基金財產未按前款(1)、(2)、(3)項規定清償前，不分配給基金份額持有人。

對於基金繳存於中國證券登記結算有限責任公司的最低結算備付金和交易席位保證金等，在中國證券登記結算有限責任公司對其進行調整後方可收回。

### 6· 基金財產清算的公告

清算過程中的有關重大事項須及時公告；基金財產清算報告經具有證券、期貨相關業務資格的會計師事務所審計並由律師事務所出具法律意見書後報中國證監會備案並公告。基金財產清算公告於基金財產清算報告報中國證監會備案後 5 個工作日內由基金財產清算小組進行公告，基金財產清算小組應當將清算報告登載在指定網站上，並將清算報告提示性公告登載在指定報刊上。

### 7· 基金財產清算帳冊及文件由基金託管人保存 15 年以上。



## 二十、基金合同內容摘要

### （一）基金管理人的權利與義務

#### 1、基金管理人的權利

- （1）依法募集基金，辦理基金備案手續；
- （2）依照法律法規和基金合同獨立管理運用基金財產；
- （3）根據法律法規和基金合同的規定，制訂、修改並公佈有關基金認購、申購、贖回、轉託管、基金轉換、非交易過戶、凍結、收益分配等方面的業務規則；
- （4）根據法律法規和基金合同的規定決定本基金的相關費率結構和收費方式，獲得基金管理費，收取認購費、申購費、贖回費及其他事先核准或公告的合理費用以及法律法規規定的其他費用；
- （5）根據法律法規和基金合同的規定銷售基金份額；
- （6）在本合同的有效期內，在不違反公平、合理原則以及不妨礙基金託管人遵守相關法律法規及其行業監管要求的基礎上，基金管理人有权對基金託管人履行本合同的情況進行必要的監督。如認為基金託管人違反了法律法規或基金合同規定對基金財產、其他基金合同當事人的利益造成重大損失的，應及時呈報中國證監會和中國銀監會，以及採取其他必要措施以保護本基金及相關基金合同當事人的利益；
- （7）根據基金合同的規定選擇適當的基金代銷機構並有權依照代銷協議和有關法律法規對基金代銷機構行為進行必要的監督和檢查；
- （8）自行擔任基金註冊登記機構或選擇、更換基金註冊登記代理機構，辦理基金註冊登記業務，並按照基金合同規定對基金註冊登記代理機構進行必要的監督和檢查；
- （9）在基金合同約定的範圍內，拒絕或暫停受理申購和贖回的申請；
- （10）在法律法規允許的前提下，為基金份額持有人的利益依法為基金進行融資、融券；
- （11）依據法律法規和基金合同的規定，制訂基金收益分配方案；
- （12）按照法律法規，代表基金對被投資企業行使股東權利，代表基金行使因投資於其他證券所產生的權利；
- （13）以基金管理人的名義，代表基金份額持有人的利益行使訴訟權利或者實施其他法律行為；
- （14）在基金託管人職責終止時，提名新的基金託管人；
- （15）依據法律法規和基金合同的規定，召集基金份額持有人大會；
- （16）選擇、更換律師、審計師、證券經紀商或其他為基金提供服務的外部機構並確定有關費率；
- （17）法律法規、基金合同規定的其他權利。

## 2、基金管理人的義務

(1) 依法申請並募集基金，辦理或者委託經國務院證券監督管理機構認定的其他機構代為辦理基金份額的發售、申購、贖回和登記事宜；

(2) 辦理基金備案手續；

(3) 自基金合同生效之日起，以誠實信用、勤勉盡責的原則管理和運用基金財產；

(4) 配備足夠的具有專業資格的人員進行基金投資分析、決策，以專業化的經營方式管理和運作基金財產；

(5) 建立健全內部風險控制、監察與稽核、財務管理及人事管理等制度，保證所管理的基金財產和基金管理人的財產相互獨立，對所管理的不同基金分別管理、分別記帳，進行證券投資；

(6) 按基金合同的約定確定基金收益分配方案，及時向基金份額持有人分配基金收益；

(7) 除依據《基金法》、基金合同及其他有關規定外，不得為自己及任何第三人謀取利益，不得委託第三人運作基金財產；

(8) 進行基金會計核算並編製基金的財務會計報告；

(9) 依法接受基金託管人的監督；

(10) 編製季度報告、中期報告和年度報告；

(11) 採取適當合理的措施使計算開放式基金份額認購、申購、贖回對價的方法符合基金合同等法律文件的規定；

(12) 計算並公告基金淨值資訊，確定各類基金份額申購、贖回對價；

(13) 嚴格按照《基金法》、基金合同及其他有關規定，履行資訊披露及報告義務；

(14) 保守基金商業秘密，不洩露基金投資計劃、投資意向等。除基金法、基金合同及其他有關規定另有規定外，在基金資訊公開披露前應予以保密，不得向他人洩露；

(15) 按規定受理申購和贖回申請，及時、足額支付贖回款項；

(16) 保存基金財產管理業務活動的記錄、帳冊、報表、代表基金簽訂的重大合同及其他相關資料；

(17) 依據《基金法》、基金合同及其他有關規定召集基金份額持有人大會或配合基金託管人、基金份額持有人依法召集基金份額持有人大會；

(18) 以基金管理人名義，代表基金份額持有人利益行使訴訟權利或實施其他法律行為；

(19) 組織並參加基金財產清算小組，參與基金財產的保管、清理、估價、變現和分配；

(20) 因違反基金合同導致基金財產的損失或損害基金份額持有人的合法權益，應承擔賠償責任，其賠償責任不因其退任而免除；

(21) 基金託管人違反基金合同造成基金財產損失時，應為基金份額持有人利益向基金託管人追償；

(22) 法律法規、基金合同及中國證監會規定的其他義務。

## （二）基金託管人的權利與義務

### 1、基金託管人的權利

- （1）依據法律法規和基金合同的規定安全保管基金財產；
- （2）依照基金合同的約定獲得基金託管費；
- （3）監督基金管理人對本基金的投資運作；
- （4）在基金管理人職責終止時，提名新的基金管理人；
- （5）依據法律法規和基金合同的規定召集基金份額持有人大會；
- （6）法律法規、基金合同規定的其他權利。

### 2、基金託管人的義務

- （1）安全保管基金財產；
- （2）設立專門的基金託管部，具有符合要求的營業場所，配備足夠的、合格的熟悉基金託管業務的專職人員，負責基金財產託管事宜；
- （3）按規定開設基金財產的資金帳戶和證券帳戶；
- （4）除依據《基金法》、基金合同及其他有關規定外，不得以基金財產為自己及任何第三人謀取利益，不得委託第三人託管基金財產；
- （5）對所託管的不同基金財產分別設置帳戶，確保基金財產的完整和獨立；
- （6）保管由基金管理人代表基金簽訂的與基金有關的重大合同及有關憑證；
- （7）保存基金託管業務活動的記錄、帳冊、報表和其他相關資料；
- （8）按照基金合同的約定，根據基金管理人的指令，及時辦理清算、交割事宜；
- （9）保守基金商業秘密。除《基金法》、基金合同及其他有關規定另有規定外，在基金資訊公開披露前應予以保密，不得向他人洩露；
- （10）根據法律法規及本合同的約定，辦理與基金託管業務活動有關的資訊披露事項；
- （11）對基金財務會計報告、季度報告、中期報告和年度報告的相關內容出具意見，說明基金管理人在各重要方面的運作是否嚴格按照《基金合同》及《託管協議》的規定進行；如果基金管理人未執行《基金合同》及《託管協議》規定的行為，還應當說明基金託管人是否採取了適當的措施《基金合同》的規定進行；如果基金管理人未執行《基金合同》規定的行為，還應當說明基金託管人是否採取了適當的措施；
- （12）建立並保存基金份額持有人名冊；
- （13）覆核基金管理人計算的基金資產淨值、各類基金份額淨值和基金份額申購、贖回價格；
- （14）按規定製作相關帳冊並與基金管理人核對；
- （15）依據基金管理人的指令或有關規定向基金份額持有人支付基金收益和贖回款項；
- （16）按照規定召集基金份額持有人大會或配合基金份額持有人依法自行召集基金份額持有人大會；

- (17) 按照法律法規監督基金管理人的投資運作；
- (18) 違反基金合同導致基金財產損失，應承擔賠償責任，其責任不因其退任而免除；
- (19) 因基金管理人違反基金合同造成基金財產損失時，應為基金向基金管理人追償，除法律法規另有規定外，基金託管人不承擔連帶責任；
- (20) 法律法規、基金合同及中國證監會規定的其他義務。

### (三) 基金份額持有人的權利與義務

1、基金投資者購買本基金基金份額的行為即視為對基金合同的承認和接受，基金投資者自依據基金合同取得基金份額，即成為基金份額持有人和基金合同當事人。基金份額持有人作為當事人並不以在基金合同上書面簽章為必要條件。除法律法規另有規定或基金合同另有約定外，同一類別每份基金份額具有同等的合法權益。

#### 2、基金份額持有人的權利

- (1) 分享基金財產收益；
- (2) 參與分配清算後的剩餘基金財產；
- (3) 依法轉讓或者申請贖回其持有的基金份額；
- (4) 按照規定要求召開基金份額持有人大會；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份額持有人大會，對基金份額持有人大會審議事項行使表決權；
- (6) 查閱或者複製公開披露的基金資訊資料；
- (7) 監督基金管理人的投資運作；
- (8) 對基金管理人、基金託管人、基金份額銷售機構損害其合法權益的行為依法提起訴訟；
- (9) 法律法規、基金合同規定的其他權利。

#### 3、基金份額持有人的義務

- (1) 遵守法律法規、基金合同及其他有關規定；
- (2) 瞭解所投資基金產品，瞭解自身風險承受能力，自主判斷基金的投資價值，自主做出投資決策，自行承擔投資風險；
- (3) 繳納基金認購、申購款項及基金合同規定的費用；
- (4) 在持有的基金份額範圍內，承擔基金虧損或者基金合同終止的有限責任；
- (5) 不從事任何有損基金、其他基金份額持有人及其他基金合同當事人合法利益的活動；
- (6) 執行基金份額持有人大會的決議；
- (7) 返還在基金交易過程中因任何原因獲得的不當得利；
- (8) 法律法規及基金合同規定的其他義務。

#### （四）基金份額持有人大會

1、本基金的基金份額持有人大會，由本基金的基金份額持有人或其合法的代理人組成。本基金份額持有人大會未設日常機構。

2、有以下情形之一時，應召開基金份額持有人大會：

- （1）終止基金合同；
- （2）轉換基金運作方式；
- （3）提高基金管理人、基金託管人的報酬標準或提高銷售服務費，但根據法律法規的要求提高的除外；
- （4）更換基金管理人、基金託管人；
- （5）變更基金類別；
- （6）變更基金投資目標、範圍或策略；
- （7）變更基金份額持有人大會議事程式、表決方式和表決程式；
- （8）本基金與其他基金合併；
- （9）對基金合同當事人權利、義務產生重大影響，需召開基金份額持有人大會的變更基金合同等其他事項；
- （10）基金管理人或基金託管人要求召開基金份額持有人大會；
- （11）單獨或合計持有本基金總份額 10%以上（含 10%）基金份額的基金份額持有人（以基金管理人收到提議當日的基金份額計算）就同一事項書面要求召開基金份額持有人大會；
- （12）法律法規或中國證監會規定的其他應當召開基金份額持有人大會的事項。

3、有以下情形之一的，不需召開基金份額持有人大會：

- （1）調低基金管理費率、基金託管費率或銷售服務費率；
- （2）在法律法規和基金合同規定的範圍內變更本基金的申購費率、調低贖回費率或變更收費方式；
- （3）因相應的法律法規發生變動而應當對基金合同進行修改；
- （4）對基金合同的修改不涉及基金合同當事人權利義務關係發生變化；
- （5）對基金合同的修改對基金份額持有人利益無實質性不利影響；
- （6）按照法律法規或基金合同規定不需召開基金份額持有人大會的其他情形。

4、召集方式：

- （1）除法律法規或基金合同另有約定外，基金份額持有人大會由基金管理人召集。
- （2）基金託管人認為有必要召開基金份額持有人大會的，應當向基金管理人提出書面提議。基金管理人應當自收到書面提議之日起 10 日內決定是否召集，並書面告知基金託管人。基金管理人決定召集的，應當自出具書面決定之日起 60 日內召開；基金管理人決定不召集，基金託管人仍認為有必要召開的，應當自行召集，並自出具書面決定之日起 60 日內

召開並告知基金管理人，基金管理人應當配合。

(3) 代表基金份額 10% 以上的基金份額持有人認為有必要召開基金份額持有人大會的，應當向基金管理人提出書面提議。基金管理人應當自收到書面提議之日起 10 日內決定是否召集，並書面告知提出提議的基金份額持有人代表和基金託管人。

基金管理人決定召集的，應當自出具書面決定之日起 60 日內召開；基金管理人決定不召集，代表基金份額 10% 以上的基金份額持有人仍認為有必要召開的，應當向基金託管人提出書面提議。

基金託管人應當自收到書面提議之日起 10 日內決定是否召集，並書面告知提出提議的基金份額持有人代表和基金管理人；基金託管人決定召集的，應當自出具書面決定之日起 60 日內召開並告知基金管理人，基金管理人應當配合。

(4) 代表基金份額 10% 的基金份額持有人就同一事項書面要求召開基金份額持有人大會，而基金管理人、基金託管人都不召集的，代表基金份額 10% 以上的基金份額持有人有權自行召集，並至少提前 30 日報中國證監會備案。

(5) 基金份額持有人依法自行召集基金份額持有人大會的，基金管理人、基金託管人應當配合，不得阻礙、干擾。

(6) 基金份額持有人大會的召集人負責選擇確定開會時間、地點、方式和權益登記日。

## 5、通知

召開基金份額持有人大會，召集人應當於會議召開前 30 天在至少一種指定媒介上公告。基金份額持有人大會不得就未經公告的事項進行表決。基金份額持有人大會通知將至少載明以下內容：

- (1) 會議召開的時間、地點、方式；
- (2) 會議擬審議的主要事項、議事程式和表決方式；
- (3) 代理投票授權委託書送達時間和地點；
- (4) 會務常設聯繫人姓名、電話；
- (5) 權益登記日；

(6) 如採用通訊表決方式，還應載明具體通訊方式、委託的公證機關及其聯繫方式和聯繫人、書面表達意見的寄交和收取方式、投票表決的截止日以及表決票的送達地址等內容。

## 6、開會方式

基金份額持有人大會的召開方式包括現場開會和通訊方式開會。現場開會由基金份額持有人本人出席或通過授權委派其代理人出席，現場開會時基金管理人和基金託管人的授權代表應當出席；通訊方式開會指按照基金合同的相關規定以通訊的書面方式進行表決。會議的召開方式由召集人確定，但決定基金管理人更換或基金託管人的更換、轉換基金運作方式和終止基金合同事宜必須以現場開會方式召開基金份額持有人大會。

現場開會同時符合以下條件時，可以進行基金份額持有人大會議程：

(1) 親自出席會議者持有基金份額的憑證和受託出席會議者出具的委託人持有基金份額的憑證和授權委託書等文件符合法律法規、本基金合同和會議通知的規定；

(2) 經核對，匯總到會者出示的在權益登記日持有基金份額的憑證顯示，全部有效憑證所代表的基金份額佔權益登記日基金總份額的 50% 以上。

在同時符合以下條件時，通訊開會的方式視為有效：

(1) 召集人按基金合同規定公佈會議通知後，在表決截止日前公佈 2 次相關提示性公告；

(2) 召集人按照會議通知規定的方式收取基金份額持有人的書面表決意見；

(3) 本人直接出具書面意見或授權他人代表出具書面意見的基金份額持有人所代表的基金份額佔權益登記日基金總份額的 50% 以上；

(4) 直接出具書面意見的基金份額持有人或受託代表他人出具書面意見的其他代表，同時提交的持有基金份額的憑證和受託出席會議者出具的委託人持有基金份額的憑證和授權委託書等文件符合法律法規、基金合同和會議通知的規定；

(5) 會議通知公佈前已報中國證監會備案。

如參加基金份額持有人大會的持有人的基金份額低於相關規定比例的，召集人可以在原公告的基金份額持有人大會召開時間的三個月以後、六個月以內，就原定審議事項重新召集基金份額持有人大會。重新召集的基金份額持有人大會應當有代表三分之一以上基金份額的持有人參加，方可召開。

## 7、議事內容與程式

### (1) 議事內容及提案權

1) 議事內容限為本條前述第(二)款規定的基金份額持有人大會召開事由範圍內的事項。

2) 基金管理人、基金託管人、代表基金份額 10% 以上的基金份額持有人可以在大會召集人發出會議通知前向大會召集人提交需由基金份額持有人大會審議表決的提案。

3) 對於基金份額持有人提交的提案，大會召集人應當按照以下原則對提案進行審核：

a、關聯性。大會召集人對於基金份額持有人提案涉及事項與基金有直接關係，並且不超出法律法規和基金合同規定的基金份額持有人大會職權範圍的，應提交大會審議；對於不符合上述要求的，不提交基金份額持有人大會審議。如果召集人決定不將基金份額持有人提案提交大會表決，應當在該次基金份額持有人大會上進行解釋和說明。

b、程式性。大會召集人可以對基金份額持有人的提案涉及的程式性問題做出決定。如將其提案進行分拆或合併表決，需征得原提案人同意；原提案人不同意變更的，大會主持人可以就程式性問題提請基金份額持有人大會做出決定，並按照基金份額持有人大會決定的程式進行審議。

4) 代表基金份額 10% 以上的基金份額持有人提交基金份額持有人大會審議表決的提案，

或基金管理人或基金託管人提交基金份額持有人大會審議表決的提案，未獲得基金份額持有人大會審議通過，就同一提案再次提請基金份額持有人大會審議，其時間間隔不少於 6 個月。法律法規另有規定的除外。

5) 基金份額持有人大會不得對未事先公告的議事內容進行表決。

## (2) 議事程式

在現場開會的方式下，首先由召集人宣讀提案，經討論後進行表決，並形成大會決議，報經中國證監會備案。在通訊表決開會的方式下，首先由召集人在會議通知中公佈提案，在所通知的表決截止日期後 2 個工作日內由大會聘請的公證機關的公證員統計全部有效表決並形成決議，報中國證監會備案。

## 8、表決

(1) 基金份額持有人所持每份基金份額享有平等的表決權。

(2) 基金份額持有人大會決議分為一般決議和特別決議：

### 1) 特別決議

對於特別決議應當經參加大會的基金份額持有人所持表決權的三分之二以上(含三分之二)通過。

### 2) 一般決議

對於一般決議應當經參加大會的基金份額持有人所持表決權的 50% 以上通過。

更換基金管理人或者基金託管人、轉換基金運作方式或終止基金合同應當以特別決議通過方為有效。

基金份額持有人大會採取記名方式進行投票表決。

採取通訊方式進行表決時，符合法律法規、基金合同和會議通知規定的書面表決意見即視為有效的表決；表決意見模糊不清或相互矛盾的視為棄權表決，但應當計入出具書面意見的基金份額持有人所代表的基金份額總數。

基金份額持有人大會的各項提案或同一項提案內並列的各項議題應當分開審議、逐項表決。

## 9、計票

### (1) 現場開會

1) 基金份額持有人大會的主持人為召集人授權出席大會的代表，如大會由基金管理人或基金託管人召集，基金份額持有人大會的主持人應當在會議開始後宣佈在出席會議的基金份額持有人中推舉兩名基金份額持有人代表與大會召集人授權的一名監督員(如果基金管理人為召集人，則監督員由基金託管人擔任；如基金託管人為召集人，則監督員由基金託管人在出席會議的基金份額持有人中指定)共同擔任監票人；如大會由基金份額持有人自行召集，基金份額持有人大會的主持人應當在會議開始後宣佈在出席會議的基金份額持有人中推舉三名基金份額持有人代表擔任監票人。



2) 監票人應當在基金份額持有人表決後立即進行清點並由大會主持人當場公佈計票結果。

3) 如果大會主持人對於提交的表決結果有懷疑，可以對所投票數進行重新清點；如果大會主持人未進行重新清點，而出席大會的基金份額持有人或者基金份額持有人代理人對大會主持人宣佈的表決結果有異議，其有權在宣佈表決結果後立即要求重新清點，大會主持人應當立即重新清點並公佈重新清點結果。重新清點僅限一次。

4) 在基金管理人或基金託管人擔任召集人的情形下，如果在計票過程中基金管理人或者基金託管人拒不配合的，則參加會議的基金份額持有人有權推舉三名基金份額持有人代表共同擔任監票人進行計票。

## (2) 通訊方式開會

在通訊方式開會的情況下，計票方式可採取如下方式：

由大會召集人授權的兩名監督員在基金託管人授權代表（若由基金託管人召集，則為基金管理人授權代表）的監督下進行計票，並由公證機關對其計票過程予以公證。基金管理人或基金託管人拒派代表對書面表決意見的計票進行監督的，不影響計票和表決結果。

## 10、生效與公告

(1) 基金份額持有人大會按照《基金法》有關法律法規規定表決通過的事項，召集人應當自通過之日起 5 日內報中國證監會備案。基金份額持有人大會決定的事項自表決通過之日起生效。

(2) 生效的基金份額持有人大會決議對全體基金份額持有人、基金管理人、基金託管人均有法律約束力。基金管理人、基金託管人和基金份額持有人應當執行生效的基金份額持有人大會的決定。

(3) 基金份額持有人大會決議應當自生效後 2 日內，由基金份額持有人大會召集人在至少一種指定媒介上公告。

(4) 如果採用通訊方式進行表決，在公告基金份額持有人大會決議時，必須將公證書全文、公證機關、公證員姓名等一同公告。

## 11、實施側袋機制期間基金份額持有人大會的特殊約定

若本基金實施側袋機制，則相關基金份額或表決權的比例指主袋份額持有人和側袋份額持有人分別持有或代表的基金份額或表決權符合該等比例，但若相關基金份額持有人大會召集和審議事項不涉及側袋帳戶的，則僅指主袋份額持有人持有或代表的基金份額或表決權符合該等比例：

(1) 基金份額持有人行使提議權、召集權、提名權所需單獨或合計代表相關基金份額 10% 以上（含 10%）；

(2) 現場開會的到會者在權益登記日代表的基金份額不少於本基金在權益登記日相關基金份額的二分之一（含二分之一）；

(3) 通訊開會的直接出具表決意見或授權他人代表出具表決意見的基金份額持有人所持有的基金份額不小於在權益登記日相關基金份額的二分之一（含二分之一）；

(4) 當參與基金份額持有人大會投票的基金份額持有人所持有的基金份額小於在權益登記日相關基金份額的二分之一，召集人在原公告的基金份額持有人大會召開時間的 3 個月以後、6 個月以內就原定審議事項重新召集的基金份額持有人大會應當有代表三分之一以上（含三分之一）相關基金份額的持有人參與或授權他人參與基金份額持有人大會投票；

(5) 現場開會由出席大會的基金份額持有人和代理人所持表決權的 50% 以上（含 50%）選舉產生一名基金份額持有人作為該次基金份額持有人大會的主持人；

(6) 一般決議須經參加大會的基金份額持有人或其代理人所持表決權的二分之一以上（含二分之一）通過；

(7) 特別決議應當經參加大會的基金份額持有人或其代理人所持表決權的三分之二以上（含三分之二）通過。

側袋機制實施期間，基金份額持有人大會審議事項涉及主袋帳戶和側袋帳戶的，應分別由主袋帳戶、側袋帳戶的基金份額持有人進行表決，同一主側袋帳戶內的每份基金份額具有平等的表決權。表決事項未涉及側袋帳戶的，側袋帳戶份額無表決權。

側袋機制實施期間，關於基金份額持有人大會的相關規定以本節特殊約定內容為準，本節沒有規定的適用上文相關約定。

12、法律法規或監管機關對基金份額持有人大會另有規定的，從其規定。

#### （五）基金收益分配原則與執行方式

##### 1、收益分配原則

(1) 基金收益分配採用現金方式或紅利再投資方式，基金份額持有人可自行選擇收益分配方式；基金份額持有人事先未做出選擇的，默認的分紅方式為現金紅利；選擇紅利再投資的，分紅資金將按除息日各類基金份額淨值轉成相應類別的基金份額；

(2) 由於本基金 A 類基金份額和 H 類基金份額不收取銷售服務費，C 類基金份額收取銷售服務費，各基金份額類別對應的可供分配利潤將有所不同。本基金同一類別每一基金份額享有同等分配權；

(3) 基金收益分配基準日的基金份額淨值減去每單位基金份額收益分配金額後不能低於面值，基金收益分配基準日即可供分配利潤計算截止日；

(4) 在符合有關基金分紅條件的前提下，基金收益分配每年至多 6 次；每次基金收益分配比例不得低於收益分配基準日可供分配利潤的 20%。基金合同生效不滿三個月，收益可不分配；

(5) 基金紅利發放日距離收益分配基準日的時間不超過 15 個工作日；

(6) 投資者的現金紅利和分紅再投資形成的基金份額均保留到小數點後第 2 位，小數點後第 3 位開始舍去，舍去部分歸基金資產；

(7) 法律法規或監管機構另有規定的，從其規定。

## 2、收益分配方案

基金收益分配方案中應載明基金收益分配基準日可供分配利潤、基金收益分配對象、分配原則、分配時間、分配數額及比例、分配方式及有關手續費等內容。

## 3、收益分配方案的確定與公告

基金收益分配方案由基金管理人擬定，並由基金託管人覆核後確定，依照《資訊披露辦法》的有關規定在指定媒介公告。

## 4、收益分配中發生的費用

(1) 收益分配採用紅利再投資方式免收再投資的費用。

(2) 收益分配時發生的銀行轉帳等手續費用由基金份額持有人自行承擔。如果基金份額持有人所獲現金紅利不足支付前述銀行轉帳等手續費用，註冊登記機構自動將該基金份額持有人的現金紅利按除息日的各類基金份額淨值轉為相應類別的基金份額。

## 5、實施側袋機制期間的收益分配

本基金實施側袋機制的，側袋帳戶不進行收益分配，詳見招募說明書的規定。

(六) 與基金財產管理、運用有關費用的提取、支付方式與比例

## 1、基金費用的種類

(1) 基金管理人的管理費；

(2) 基金託管人的託管費；

(3) C 類基金份額的銷售服務費；

(4) 因基金的證券交易或結算而產生的費用（包括但不限於經手費、印花稅、證管費、過戶費、手續費、券商傭金、權證交易的結算費及其他類似性質的費用等）；

(5) 基金合同生效以後的資訊披露費用；

(6) 基金份額持有人大會費用；

(7) 基金合同生效以後的會計師費、律師費和訴訟費；

(8) 基金資產的資金匯劃費用及證券帳戶等的開戶費用；

(9) H 類份額需要承擔因申購贖回產生的資金跨境劃撥費用；

(10) 按照國家有關法律法規規定可以列入的其他費用。

本基金終止清算時所發生的費用，按實際支出額從基金財產總值中扣除。

## 2、基金費用計提方法、計提標準和支付方式

(1) 基金管理人的管理費

基金管理人的基金管理費按基金資產淨值的 1.20% 年費率計提。

在通常情況下，基金管理費按前一日基金資產淨值的 1.20% 年費率計提。計算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{當年天數}$$

H 為每日應計提的基金管理費

E 為前一日基金資產淨值

基金管理費每日計提，按月支付。經基金管理人與基金託管人核對一致後，由基金託管人於次月首日起 2 個工作日內從基金資產中一次性支付給基金管理人。

(2) 基金託管人的基金託管費

基金託管人的基金託管費按基金資產淨值的 0.20% 年費率計提。

在通常情況下，基金託管費按前一日基金資產淨值的 0.20% 年費率計提。計算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{當年天數}$$

H 為每日應計提的基金託管費

E 為前一日的基金資產淨值

基金託管費每日計提，按月支付。經基金管理人與基金託管人核對一致後，由基金託管人於次月首日起 2 個工作日內從基金資產中一次性支付給基金託管人。

(3) C 類基金份額的銷售服務費

C 類基金份額的銷售服務費按基金資產淨值的 0.60% 年費率計提。

在通常情況下，銷售服務費按前一日 C 類基金份額基金資產淨值的 0.60% 年費率計提。

計算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{當年天數}$$

H 為 C 類基金份額每日應計提的銷售服務費

E 為 C 類基金份額前一日的基金資產淨值

銷售服務費每日計提，按月支付。經基金管理人與基金託管人核對一致後，由基金託管人於次月首日起 2 個工作日內從基金資產中一次性支付給基金管理人，由基金管理人代付給銷售機構。

(4) 本條第 1 款第 (4) 至第 (10) 項費用由基金管理人和基金託管人根據有關法規及相應協議的規定，列入當期基金費用。

3、不列入基金費用的專案

下列費用不列入基金費用：

(1) 本條第 1 款約定以外的其他費用，以及基金管理人和基金託管人因未履行或未完成履行義務導致的費用支出或基金資產的損失；

(2) 基金管理人和基金託管人處理與基金運作無關的事項發生的費用；

(3) 《基金合同》生效前的相關費用，包括但不限於驗資費、會計師和律師費、資訊披露費用等費用。

4、實施側袋機制期間的基金費用

本基金實施側袋機制的，與側袋帳戶有關的費用可以從側袋帳戶中列支，但應待側袋帳

戶資產變現後方可列支，有關費用可酌情收取或減免，但不得收取管理費，詳見招募說明書的規定或相關公告。

#### 5、基金管理費、基金託管費和銷售服務費的調整

基金管理人和基金託管人可協商酌情調低基金管理費、基金託管費和銷售服務費，無須召開基金份額持有人大會。

#### 6、稅收

本基金運作過程中涉及的各納稅主體，依照國家法律法規的規定履行納稅義務。

## 二十一、基金託管協議內容摘要

### 一、基金託管協議當事人

#### （一）基金管理人

名稱：大成基金管理有限公司

住所：廣東省深圳市南山區海德三道 1236 號大成基金總部大廈 5 層、27-33 層

法定代表人：吳慶斌

成立時間：1999 年 4 月 12 日

批准設立機關：中國證券監督管理委員會

批准設立文號：中國證監會證監基金字[1999]10 號

組織形式：有限責任公司

註冊資本：貳億元人民幣

經營範圍：發起設立基金、基金管理及中國證監會批准的其他業務

存續期間：持續經營

#### （二）基金託管人

基金託管人：中國銀行

住所：北京市西城區復興門內大街 1 號

法定代表人：葛海蛟

企業類型：股份有限公司

註冊資本：人民幣貳仟玖佰肆拾叁億捌仟柒佰柒拾玖萬壹仟貳佰肆拾壹元整

存續期間：持續經營

基金託管業務批准文號：中國證監會證監基字【1998】24 號

經營範圍：吸收人民幣存款；發放短期、中期和長期貸款；辦理結算；辦理票據貼現；發行金融債券；代理發行、代理兌付、承銷政府債券；買賣政府債券；從事同業拆借；提供信用證服務及擔保；代理收付款項及代理保險業務；提供保險箱服務；外匯存款；外匯貸款；外匯匯款；外匯兌換；國際結算；同業外匯拆借；外匯票據的承兌和貼現；外匯借款；外匯擔保；結匯、售匯；發行和代理發行股票以外的外幣有價證券；買賣和代理買賣股票以外的外幣有價證券；自營外匯買賣；代客外匯買賣；外匯信用卡的發行和代理國外信用卡的發行及付款；資信調查、諮詢、見證業務；組織或參加銀團貸款；國際貴金屬買賣；海外分支機構經營與當地法律許可的一切銀行業務；在港澳地區的分行依據當地法令可發行或參與代理發行當地貨幣；經中國人民銀行批准的其他業務。

存續期間：持續經營

### 二、基金託管人對基金管理人的業務監督和核查

#### （一）基金託管人根據有關法律法規的規定及《基金合同》的約定，建立相關的技術系

統，對基金管理人的投資運作進行監督。主要包括以下方面：

1·對基金的投資範圍、投資對象進行監督。本基金股票資產、存託憑證佔基金資產淨值的比例範圍為 60%-95%；債券、資產支持證券、債券逆回購等固定收益類資產和現金投資比例範圍為基金資產淨值的 5%-40%；現金（不包括結算備付金、存出保證金、應收申購款等）或到期日在一年以內的政府債券的比例不低於基金資產淨值的 5%；權證、股指期貨及其他金融工具的投資比例依照法律法規或監管機構的規定執行。基金管理人應將擬投資的股票庫、債券庫等各投資品種的具體範圍提供給基金託管人。基金管理人可以根據實際情況的變化，對各投資品種的具體範圍予以更新和調整，並通知基金託管人。基金託管人根據上述投資範圍對基金的投資進行監督。本基金將 80%以上的股票資產、存託憑證投資於受益於內需增長的行業中的優質企業，基金管理人於每月將本基金的股票庫及受益於內需增長行業的股票庫提供給基金託管人；

2·對基金投融資比例進行監督：

1) 本基金持有一家公司發行的證券，其市值不得超過基金資產淨值的 10%；

2) 本基金與由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司發行的證券，不得超過該證券的 10%；

3) 本基金管理人管理的全部開放式基金(包括開放式基金以及處於開放期的定期開放基金)持有一家上市公司發行的可流通股票，不得超過該上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投資組合持有一家上市公司發行的可流通股票，不得超過該上市公司可流通股票的 30%；

4) 本基金主動投資於流動性受限資產的市值合計不得超過基金資產淨值的 15%；因證券市場波動、上市公司股票停牌、基金規模變動等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所規定比例限制的，基金管理人不得主動新增流動性受限資產的投資；

5) 本基金進入全國銀行間同業市場進行債券回購的資金餘額不得超過基金資產淨值的 40%；

6) 本基金在任何交易日買入權證的總金額，不超過上一交易日基金資產淨值的 0.5%，基金持有的全部權證的市值不超過基金資產淨值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一權證的比例不超過該權證的 10%。法律法規或中國證監會另有規定的，遵從其規定；

7) 本基金持有的現金（不包括結算備付金、存出保證金、應收申購款等）和到期日不超過 1 年的政府債券不低於 5%；

8) 本基金持有的全部資產支持證券，其市值不得超過基金資產淨值的 20%；

9) 本基金持有的同一（指同一信用級別）資產支持證券的比例，不得超過該資產支持證券規模的 10%；

10) 本基金管理人管理的全部基金投資於同一原始權益人的各類資產支持證券，不得超過其各類資產支持證券合計規模的 10%；

11) 本基金資產參與股票發行申購，所申報的金額不得超過本基金的總資產，所申報的股票數量不得超過擬發行股票公司本次發行股票的總量；

12) 本基金持有的同一流通受限證券，其公允價值不得超過本基金資產淨值的 10%。

13) 本基金與私募類證券資管產品及中國證監會認定的其他主體為交易對手開展逆回購交易的，可接受質押品的資質要求應當與本基金合同約定的投資範圍保持一致；

14) 在任何交易日日終，持有的買入股指期貨合約價值，不得超過基金資產淨值的 10%；在任何交易日日終，持有的買入期貨合約價值與有價證券市值之和，不得超過基金資產淨值的 95%，其中，有價證券指股票、債券（不含到期日在一年以內的政府債券）、權證、資產支持證券、買入返售金融資產（不含質押式回購）等；在任何交易日日終，持有的賣出期貨合約價值不得超過基金持有的股票總市值的 20%；在任何交易日內交易（不包括平倉）的股指期貨合約的成交金額不得超過上一交易日基金資產淨值的 20%；基金所持有的股票市值和買入、賣出股指期貨合約價值，合計（軋差計算）應當符合基金合同關於股票投資比例的有關約定；每個交易日日終在扣除股指期貨合約需繳納的交易保證金後，應當保持不低於基金資產淨值 5% 的現金或到期日在一年以內的政府債券；

15) 相關法律法規以及監管部門規定的其他投資限制；

16) 本基金資產總值不得超過基金資產淨值的 140%；

17) 本基金投資存託憑證的比例限制依照境內上市交易的股票執行，與境內上市交易的股票合併計算；

18) 相關法律法規以及監管部門規定的其他投資限制。

基金管理人應當自基金合同生效之日起 6 個月內使基金的投資組合比例符合基金合同的約定。除上述“2、基金投資組合比例限制”中第（4）、（7）、（13）項外，因證券市場波動、上市公司合併、基金規模變動等基金管理人之外的因素致使基金投資不符合基金合同約定的投資比例規定的，基金管理人應當在 10 個交易日內進行調整。法律法規或監管機構另有規定時，從其規定。

3. 若將來法律法規或中國證監會的相關規定發生修改或變更，致使本款前述約定的投資禁止行為和投資組合比例限制被修改或取消，基金管理人在依法履行相應程式後，本基金可相應調整禁止行為和投資限制規定。

基金託管人對基金的投資的監督和檢查自本基金合同生效之日起開始。

（二）基金託管人應根據有關法律法規的規定及《基金合同》的約定，對基金資產淨值計算、各類基金份額淨值計算、應收資金到帳、基金費用開支及收入確定、基金收益分配、相關資訊披露、基金宣傳推介材料中登載基金業績表現數據等進行覆核。

（三）基金託管人在上述第（一）、（二）款的監督和核查中發現基金管理人違反法律法規的規定、《基金合同》及本協議的約定，應及時通知基金管理人限期糾正，基金管理人收到通知後應及時核對確認並以書面形式對基金託管人發出回函並改正。在限期內，基金託



管人有權隨時對通知事項進行復查。基金管理人對基金託管人通知的違規事項未能在限期內糾正的，基金託管人應及時向中國證監會報告。

（四）基金託管人發現基金管理人的投資指令違反法律法規、《基金合同》及本協議的規定，應當拒絕執行，立即通知基金管理人，並依照法律法規的規定及時向中國證監會報告。基金託管人發現基金管理人依據交易程式已經生效的指令違反法律法規和其他有關規定，或者違反《基金合同》、本協議約定的，應當立即通知基金管理人，並依照法律法規的規定及時向中國證監會報告。

（五）基金管理人應積極配合和協助基金託管人的監督和核查，包括但不限於：在規定時間內答復基金託管人並改正，就基金託管人的疑義進行解釋或舉證，對基金託管人按照法規要求需向中國證監會報送基金監督報告的，基金管理人應積極配合提供相關數據資料和制度等。

### 三、基金管理人對基金託管人的業務核查

（一）在本協議的有效期內，在不違反公平、合理原則以及不妨礙基金託管人遵守相關法律法規及其行業監管要求的基礎上，基金管理人對基金託管人履行本協議的情況進行必要的核查，核查事項包括但不限於基金託管人安全保管基金財產、開設基金財產的資金帳戶和證券帳戶、覆核基金管理人計算的基金資產淨值和各類基金份額淨值、根據基金管理人指令辦理清算交收、相關資訊披露和監督基金投資運作等行為。

（二）基金管理人發現基金託管人擅自挪用基金財產、未對基金財產實行分帳管理、無正當理由未執行或延遲執行基金管理人資金劃撥指令、洩露基金投資資訊等違反法律法規、《基金合同》及本協議有關規定時，應及時以書面形式通知基金託管人限期糾正，基金託管人收到通知後應及時核對並以書面形式對基金管理人發出回函。在限期內，基金管理人對基金託管人通知的違規事項未能在限期內糾正的，基金管理人應依照法律法規的規定報告中國證監會。

（三）基金託管人應積極配合基金管理人的核查行為，包括但不限於：提交相關資料以供基金管理人核查託管財產的完整性和真實性，在規定時間內答復基金管理人並改正。

### 四、基金財產保管

#### （一）基金財產保管的原則

- 1· 基金財產應獨立於基金管理人、基金託管人的固有財產。
- 2· 基金託管人應安全保管基金財產，未經基金管理人的合法合規指令或法律法規、《基金合同》及本協議另有規定，不得自行運用、處分、分配基金的任何財產。
- 3· 基金託管人按照規定開設基金財產的資金帳戶（含期貨結算帳戶）和證券帳戶。
- 4· 基金託管人對所託管的不同基金財產分別設置帳戶，確保基金財產的完整與獨立。
- 5· 除依據《基金法》、《運作辦法》、《基金合同》及其他有關法律法規規定外，基金託管人不得委託第三人託管基金財產。

## （二）基金合同生效前募集資金的驗資和入帳

1·基金募集期滿或基金管理人宣佈停止募集時，募集的基金份額總額、基金募集金額、基金份額持有人人數符合《基金法》、《運作辦法》等有關規定的，由基金管理人在法定期限內聘請具有從事相關業務資格的會計師事務所對基金進行驗資，並出具驗資報告，出具的驗資報告應由參加驗資的 2 名以上（含 2 名）中國註冊會計師簽字方為有效。

2·基金管理人應將屬於本基金財產的全部資金劃入在基金託管人處為本基金開立的基金銀行帳戶中，並確保劃入的資金與驗資確認金額相一致。

## （三）基金的銀行帳戶的開設和管理

1·基金託管人應負責本基金的銀行帳戶的開設和管理。

2·基金託管人以本基金的名義開設本基金的銀行帳戶。本基金的銀行預留印鑒由基金託管人保管和使用。本基金的一切貨幣收支活動，包括但不限於投資、支付贖回金額、支付基金收益、收取申購款，均需通過本基金的銀行帳戶進行。

3·本基金銀行帳戶的開立和使用，限於滿足開展本基金業務的需要。基金託管人和基金管理人不得假借本基金的名義開立其他任何銀行帳戶；亦不得使用本基金的銀行帳戶進行本基金業務以外的活動。

4·基金銀行帳戶的管理應符合法律法規的有關規定。

## （四）基金進行定期存款投資的帳戶開設和管理

基金託管人根據基金管理人的指令以基金名義在基金託管人認可的存款銀行的指定營業網點開立存款帳戶，並負責該帳戶的日常管理以及銀行預留印鑒的保管和使用。基金管理人應派專人協助辦理開戶事宜。在上述帳戶開立和帳戶相關資訊變更過程中，基金管理人應提前向基金託管人提供開戶或帳戶變更所需的相關資料，並對基金託管人給予積極配合和協助。

## （五）基金證券帳戶和資金帳戶的開設和管理

1·基金託管人應當代表本基金，以基金託管人和本基金聯名的方式在中國證券登記結算有限責任公司開設證券帳戶。

2·本基金證券帳戶的開立和使用，限於滿足開展本基金業務的需要。基金託管人和基金管理人不得出借或轉讓本基金的證券帳戶，亦不得使用本基金的證券帳戶進行本基金業務以外的活動。

3·基金託管人以自身法人名義在中國證券登記結算有限責任公司開立結算備付金帳戶，用於辦理基金託管人所託管的包括本基金在內的全部基金在證券交易所進行證券投資所涉及的資金結算業務。結算備付金的收取按照中國證券登記結算有限責任公司的規定執行。

4·在本託管協議生效日之後，本基金被允許從事其他投資品種的投資業務的，涉及相關帳戶的開設、使用的，若無相關規定，則基金託管人應當比照並遵守上述關於帳戶開設、使用的規定。

#### （六）債券託管專戶的開設和管理

基金合同生效後，基金管理人負責以基金的名義申請並取得進入全國銀行間同業拆借市場的交易資格，並代表基金進行交易；基金託管人負責以基金的名義在中央國債登記結算有限責任公司開設銀行間債券市場債券託管帳戶，並代表基金進行銀行間債券市場債券和資金的清算。在上述手續辦理完畢之後，由基金託管人負責向中國人民銀行報備。

#### （七）基金財產投資的有關有價憑證的保管

基金財產投資的實物證券等有價憑證由基金託管人負責妥善保管。基金託管人對其以外機構實際有效控制的有價憑證不承擔責任。

#### （八）與基金財產有關的重大合同及有關憑證的保管

基金託管人按照法律法規保管由基金管理人代表基金簽署的與基金有關的重大合同及有關憑證。基金管理人代表基金簽署有關重大合同後應在收到合同正本後 30 日內將一份正本的原件提交給基金託管人。除本協議另有規定外，基金管理人在代表基金簽署與基金有關的重大合同時應保證基金一方持有兩份以上的正本，以便基金管理人和基金託管人至少各持有一份正本的原件。重大合同由基金管理人與基金託管人按規定各自保管至少 15 年。

### 五、基金資產淨值計算和會計核算

#### （一）基金資產淨值的計算和覆核

1· 基金資產淨值是指基金資產總值減去負債後的價值。各類基金份額淨值是指計算日各類基金資產淨值除以計算日該類基金份額總數後的價值。各類基金份額淨值的計算均保留到小數點後 3 位（含第 3 位），小數點後第 4 位四捨五入，由此產生的誤差計入基金財產。

2· 基金管理人應每開放日對基金財產估值。估值原則應符合《基金合同》、《證券投資基金會計核算業務指引》及其他法律法規的規定。用於基金資訊披露的基金淨值資訊由基金管理人負責計算，基金託管人覆核。基金管理人應於每個開放日結束後計算得出當日的各類基金份額淨值，並在蓋章後以傳真方式發送給基金託管人。基金託管人應在收到上述傳真後對淨值計算結果進行覆核，並在蓋章後以傳真方式將覆核結果傳送給基金管理人，由基金管理人對外公佈。月末、年中和年末估值覆核與基金會計帳目的核對同時進行。

3· 當相關法律法規或《基金合同》規定的估值方法不能客觀反映基金財產公允價值時，基金管理人可根據具體情況，並與基金託管人商定後，按最能反映公允價值的價格估值。

4· 基金管理人、基金託管人發現基金估值違反《基金合同》訂明的估值方法、程式以及相關法律法規的規定或者未能充分維護基金份額持有人利益時，雙方應及時進行協商和糾正。

5· 當基金資產的估值導致任一類基金份額淨值小數點後 3 位（含第 3 位）內發生差錯時，視為該類基金份額淨值估值錯誤。當基金份額淨值出現錯誤時，基金管理人應當立即予以糾正，並採取合理的措施防止損失進一步擴大；當計價錯誤達到該類基金份額淨值的 0.25% 時，基金管理人應當報中國證監會備案；當計價錯誤達到該類基金份額淨值的 0.5% 時，

基金管理人應當在報中國證監會備案的同時並及時進行公告。如法律法規或監管機關對前述內容另有規定的，按其規定處理。

6· 由於基金管理人對外公佈的任何基金淨值數據錯誤，導致該基金財產或基金份額持有人的實際損失，基金管理人應對此承擔責任。若基金託管人計算的淨值數據正確，則基金託管人對該損失不承擔責任；若基金託管人計算的淨值數據也不正確，則基金託管人也應承擔部分未正確履行覆核義務的責任。如果上述錯誤造成了基金財產或基金份額持有人的不當得利，且基金管理人及基金託管人已各自承擔了賠償責任，則基金管理人應負責向不當得利之主體主張返還不當得利。如果返還金額不足以彌補基金管理人和基金託管人已承擔的賠償金額，則雙方按照各自賠償金額的比例對返還金額進行分配。

7· 由於證券交易所及其登記結算公司發送的數據錯誤，或由於其他不可抗力原因，基金管理人和基金託管人雖然已經採取必要、適當、合理的措施進行檢查，但是未能發現該錯誤的，由此造成的基金資產估值錯誤，基金管理人和基金託管人可以免除賠償責任。但基金管理人和基金託管人應當積極採取必要的措施消除由此造成的影響。

8· 如果基金託管人的覆核結果與基金管理人的計算結果存在差異，且雙方經協商未能達成一致，基金管理人可以按照其對各類基金份額淨值的計算結果對外予以公佈，基金託管人可以將相關情況報中國證監會備案。

## （二）基金會計核算

### 1· 基金帳冊的建立

基金管理人和基金託管人在《基金合同》生效後，應按照雙方約定的同一記帳方法和會計處理原則，分別獨立地設置、登記和保管基金的全套帳冊，對雙方各自的帳冊定期進行核對，互相監督，以保證基金財產的安全。若雙方對會計處理方法存在分歧，應以基金管理人的處理方法為準。

### 2· 會計數據和財務指標的核對

基金管理人和基金託管人應定期就會計數據和財務指標進行核對。如發現存在不符，雙方應及時查明原因並糾正。

### 3· 基金財務報表和定期報告的編製和覆核

基金財務報表由基金管理人和基金託管人每月分別獨立編製。月度報表的編製，應於每月終了後 5 個工作日內完成。

《基金合同》生效後，基金招募說明書的資訊發生重大變更的，基金管理人應當在三個工作日內，更新基金招募說明書並登載在指定網站上；基金招募說明書其他資訊發生變更的，基金管理人至少每年更新一次。基金產品資料概要的資訊發生重大變更的，基金管理人應當在三個工作日內，更新基金產品資料概要並登載在指定網站及基金銷售機構網站或營業網點。基金產品資料概要其他資訊發生變更的，基金管理人至少每年更新一次。基金終止運作的，基金管理人不再更新基金招募說明書。

基金管理人應當在每年結束之日起三個月內，編製完成基金年度報告，將年度報告登載在指定網站上，並將年度報告提示性公告登載在指定報刊上。基金管理人應當在上半年結束之日起兩個月內，編製完成基金中期報告，將中期報告登載在指定網站上，並將中期報告提示性公告登載在指定報刊上。基金管理人應當在季度結束之日起 15 個工作日內，編製完成基金季度報告，將季度報告登載在指定網站上，並將季度報告提示性公告登載在指定報刊上。基金合同生效不足兩個月的，基金管理人可以不編製當期季度報告、中期報告或者年度報告。

基金管理人在月度報表完成當日，將報表蓋章後提供給基金託管人覆核；基金託管人在收到後應 3 個工作日內進行覆核，並將覆核結果書面通知基金管理人。基金管理人在季度報告完成當日，將有關報告提供給基金託管人覆核，基金託管人應在收到後 5 個工作日內完成覆核，並將覆核結果書面通知基金管理人。基金管理人在中期報告完成當日，將有關報告提供給基金託管人覆核，基金託管人應在收到後 10 個工作日內完成覆核，並將覆核結果書面通知基金管理人。基金管理人在年度報告完成當日，將有關報告提供給基金託管人覆核，基金託管人應在收到後 15 個工作日內完成覆核，並將覆核結果書面通知基金管理人。基金管理人與基金託管人之間的上述文件往來均以加密傳真的方式或雙方商定的其他方式進行。

基金託管人在覆核過程中，發現雙方的報表存在不符時，基金管理人和基金託管人應共同查明原因，進行調整，調整以雙方認可的帳務處理方式為準；若雙方無法達成一致以基金管理人的帳務處理為準。核對無誤後，基金託管人在基金管理人提供的報告上加蓋託管業務部門公章或者出具加蓋託管業務部門公章的覆核意見書或進行電子確認，雙方各自留存一份。如果基金管理人與基金託管人不能於應當發佈公告之日之前就相關報表達成一致，基金管理人有权按照其編製的報表對外發佈公告，基金託管人有權就相關情況報證監會備案。

## 六、基金份額持有人名冊的登記與保管

### （一）基金份額持有人名冊的內容

基金份額持有人名冊的內容包括但不限於基金份額持有人的名稱和持有的基金份額。

基金份額持有人名冊包括以下幾類：

1. 基金募集期結束時的基金份額持有人名冊；
2. 基金權益登記日的基金份額持有人名冊；
3. 基金份額持有人大會登記日的基金份額持有人名冊；
4. 每半年度最後一個交易日的基金份額持有人名冊。

### （二）基金份額持有人名冊的提供

對於每半年度最後一個交易日的基金份額持有人名冊，基金管理人應在每半年度結束後 5 個工作日內定期向基金託管人提供。對於基金募集期結束時的基金份額持有人名冊、基金權益登記日的基金份額持有人名冊以及基金份額持有人大會登記日的基金份額持有人名冊，基金管理人應在相關的名冊生成後 5 個工作日內向基金託管人提供。

### （三）基金份額持有人名冊的保管

基金託管人應妥善保管基金份額持有人名冊。如基金託管人無法妥善保存持有人名冊，基金管理人應及時向中國證監會報告，並代為履行保管基金份額持有人名冊的職責。基金託管人應對基金管理人由此產生的保管費給予補償。

## 七、爭議解決方式

（一）本協議適用中華人民共和國法律並從其解釋。

（二）基金管理人與基金託管人之間因本協議產生的或與本協議有關的爭議可通過友好協商解決。但若自一方書面提出協商解決爭議之日起 60 日內爭議未能以協商方式解決的，則任何一方有權將爭議提交位於北京的中國國際經濟貿易仲裁委員會，並按其時有效的仲裁規則進行仲裁。仲裁裁決是終局的，對仲裁各方當事人均具有約束力。

（三）除爭議所涉的內容之外，本協議的當事人仍應履行本協議的其他規定。

## 八、託管協議的變更、終止與基金財產的清算

### （一）託管協議的變更

本協議雙方當事人經協商一致，可以對協議進行變更。變更後的新協議，其內容不得與《基金合同》的規定有任何衝突。變更後的新協議應當報中國證監會備案。

### （二）託管協議的終止

發生以下情況，本託管協議應當終止：

- 1·《基金合同》終止；
- 2·本基金更換基金託管人；
- 3·本基金更換基金管理人；
- 4·發生《基金法》、《運作辦法》或其他法律法規規定的終止事項。

### （三）基金財產的清算

基金管理人和基金託管人應按照《基金合同》及有關法律法規的規定對本基金的財產進行清算。

## 二十二、對基金份額持有人的服務

對於基金份額持有人基金管理人將根據具體情況提供一系列的服務。同時基金管理人依據基金份額持有人的需要和市場的變化，有權增減或變更服務專案。主要服務內容如下：

### （一）客服中心電話服務

投資者撥打基金管理人客服熱線 400-888-5558（國內免長途話費）可享有如下服務：A、自助語音服務：提供 7x24 小時電話自助語音的服務，可進行帳戶查詢、基金淨值、基金產品等自助查詢服務。B、人工坐席服務：提供每週五天，每天不少於 8 小時的人工坐席服務（法定節假日除外）。投資者可以通過該熱線獲得業務諮詢、基金帳戶查詢、交易情況查詢、服務投訴及建議、資訊定制、資料修改等專項服務。

### （二）綜合對帳服務

大成基金為持有人提供綜合對帳服務，每年度以電子郵件、短信或其他方式向本公司直銷持有人提供基金保有情況資訊。本公司帳單服務類型有月度、季度、年度對帳單，服務形式由持有人自主選擇定制。具體包括：電子郵件帳單、手機短信帳單、直銷平台自助查詢、客服熱線查詢等。為回應國家雙碳戰略，宣導綠色環保對帳方式，本基金管理人歡迎持有人使用電子方式對帳單，同時為更好的服務老年持有人客戶，仍將保留自主訂閱紙質對帳單的服務措施（訂閱紙質對帳單的持有人需確保郵寄地址準確可送達）。

### （三）官方平台自助查詢及資訊服務

基金管理人官方網站（[www.dcfund.com.cn](http://www.dcfund.com.cn)）和官方移動平台均可為投資者提供基金帳戶及交易情況查詢、個人資料修改、手機短信和電子郵件資訊定制等自助服務，提供基金文件查閱、公司公告、熱點問答、市場點評等資訊資訊服務。同時，也提供電子郵箱服務（客戶服務郵箱：[callcenter@dcfund.com.cn](mailto:callcenter@dcfund.com.cn)）和線上答疑服務。

### （四）網上交易服務

本基金管理人已開通個人投資者網上交易業務。個人投資者通過基金管理人官方網站以及官方移動平台辦理基金認購、申購、贖回、轉換、撤單、基金定投、分紅方式修改、帳戶資料修改、交易密碼修改、交易情況查詢和帳戶資訊查詢等各類業務。其中，基金定投、轉換等業務的開通時間以另行公告為準。

### （五）定期定額投資計劃

基金管理人通過非直銷銷售機構網點和本公司網上交易系統為投資者提供定期定額投資服務（本公司網上交易系統的定期定額投資服務目前僅對個人投資者開通）。通過定期定額投資計劃，投資者可依託固定的管道，定期定額申購基金份額，具體實施方法見有關公告或諮詢客服熱線。

### （六）客戶投訴建議受理服務

投資者可以通過基金管理人或銷售機構的櫃檯、投資理財中心、客服熱線、網站線上欄

目、電子郵件及信函等管道進行投訴或提出建議。



## 二十三、其他應披露的事項

（一）本基金管理人、基金託管人的託管業務部門目前無重大訴訟事項。

（二）最近 3 年本基金管理人、基金託管人的託管業務部門及高級管理人員沒有受到任何處罰。

（三）2023 年 12 月 15 日至 2024 年 6 月 14 日發布的公告：

1. 2024 年 1 月 19 日《大成內需增長混合型證券投資基金 2023 年第 4 季度報告》。
2. 2024 年 3 月 29 日《大成內需增長混合型證券投資基金 2023 年年度報告》。
3. 2024 年 4 月 19 日《大成內需增長混合型證券投資基金 2024 年第 1 季度報告》。
4. 2024 年 6 月 13 日《關於旗下部分基金增加上海萬得基金銷售有限公司為銷售機構的公告》。

（四）在此之前公告的招募說明書及更新的招募說明書與本更新的招募說明書內容若有不一致之處，以本更新的招募說明書為準。

## 二十四、招募說明書的存放及查閱方式

### （一）招募說明書的存放地點

本招募說明書存放在基金管理人、基金託管人、代銷機構和註冊登記機構的辦公場所，並刊登在基金管理人、基金託管人的網站上。

### （二）招募說明書的查閱方式

投資者可在辦公時間免費查閱本基金的招募說明書，也可按工本費購買本招募說明書的影本，但應以本基金招募說明書的正本為準。

## 二十五、備查文件

備查文件等文本存放在基金管理人、基金託管人和銷售機構的辦公場所和營業場所，在辦公時間內可供免費查閱。

- 1、中國證監會准予大成內需增長混合型證券投資基金募集註冊的文件；
- 2、《大成內需增長混合型證券投資基金基金合同》；
- 3、《大成內需增長混合型證券投資基金託管協議》；
- 4、《大成基金管理有限公司開放式基金註冊登記業務規則》；
- 5、法律意見書；
- 6、基金管理人業務資格批件和營業執照；
- 7、基金託管人業務資格批件和營業執照；
- 8、中國證監會要求的其他文件。

大成基金管理有限公司  
2024年8月8日