

大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）

更新招募说明书

2008 年第 2 期

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行

二〇〇九年一月

重要提示

大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）由景博证券投资基金转型而来。基金转型经2007年5月15日景博证券投资基金基金份额持有人大会决议通过，并获中国证监会2007年6月4日证监基金字[2007]155号文核准。自2007年6月12日起，由《景博证券投资基金基金合同》修订而成的《大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）基金合同》生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，并不表明中国证监会对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资者申购基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书更新已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2008年12月12日，有关财务数据和净值表现截止日为2008年9月30日（财务数据未经审计）。

目 录

重 要 提 示.....	1
一、绪 言.....	3
二、释 义.....	3
三、基金管理人.....	7
四、基金托管人.....	20
五、相关服务机构.....	23
六、基金的沿革.....	40
七、基金的存续.....	41
八、基金份额补偿.....	41
九、基金份额的申购、赎回.....	42
十、基金份额的上市交易.....	50
十一、基金份额的非交易过户.....	51
十二、基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转托管.....	51
十三、基金的投资.....	52
十四、基金的业绩.....	61
十五、基金的融资、融券.....	62
十六、基金财产.....	62
十七、基金资产估值.....	63
十八、基金的费用与税收.....	68
十九、基金收益与分配.....	70
二十、基金的会计与审计.....	71
二十一、基金的信息披露.....	72
二十二、风险揭示.....	74
二十三、基金合同的变更、终止与基金财产清算.....	76
二十四、基金合同内容摘要.....	77
二十五、基金托管协议的内容摘要.....	90
二十六、对基金份额持有人的服务.....	99
二十七、其他应披露的事项.....	100
二十八、招募说明书更新部分的说明.....	102
二十九、招募说明书的存放及查阅方式.....	102
三十、备查文件.....	103

一、绪 言

《大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售管理办法》”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规与《大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）基金合同》（以下称“基金合同”）编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

二、释 义

在本招募说明书中除非文义另有所指，下列词语具有以下含义：

基金或本基金：	指大成创新成长混合型证券投资基金（LOF），本基金由景博证券投资基金转型而成；
景博基金：	指景博证券投资基金，运作方式为契约型封闭式；
基金合同或本基金合同：	指《大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充，基金合同由《景博证券投资基金基金合同》修订而成；
招募说明书：	指《大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》及其定期更新；
集中申购公告：	指《大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）集中申购期基金份额发售公告》；
托管协议：	指《大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）托管协议》及其任何有效修订和补充，托管协议由《景博证券投资基金

	托管协议》修订而成；
中国证监会：	指中国证券监督管理委员会；
中国银监会：	指中国银行业监督管理委员会；
交易所或证券交易所：	指上海证券交易所和/或深圳证券交易所；
《基金法》：	指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过的自 2004 年 6 月 1 日起施行的《中华人民共和国证券投资基金法》及不时做出的修订；
《运作办法》：	指《证券投资基金运作管理办法》；
《销售管理办法》：	指《证券投资基金销售管理办法》；
《信息披露管理办法》：	指《证券投资基金信息披露管理办法》；
《业务规则》：	指《深圳证券交易所上市开放式基金业务规则》；
元：	指人民币元；
基金合同当事人：	指受本基金合同约定，根据本基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人；
基金管理人：	指大成基金管理有限公司；
基金托管人：	指中国农业银行；
基金份额持有人：	指依照法律法规或基金合同合法取得基金份额的投资者；
基金转型：	指景博基金由封闭式基金转为开放式基金，调整存续期限，终止上市，调整投资目标、范围和策略，修订基金合同和更名为“大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）”等一系列事项；
注册登记业务：	指本基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等；
注册登记机构：	指办理本基金注册登记业务的机构。本基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司；
注册登记系统：	指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金注册登记系统；

- 证券登记结算系统：指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统；
- 投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者；
- 个人投资者：指依据中华人民共和国有关法律法规及其他有关规定可以投资于证券投资基金的自然人；
- 机构投资者：指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资于证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；
- 合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》规定的条件，可以投资于在中国境内合法设立的证券投资基金的中国境外的机构投资者；
- 基金份额持有人大会：指按照本基金合同规定召集、召开并由基金份额持有人进行表决的会议；
- 基金合同生效日：指《大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）基金合同》生效起始日，本基金合同自景博基金终止上市之日起生效，《景博证券投资基金基金合同》自同日起失效；
- 基金合同终止日：指本基金合同规定的合同终止事由出现后，按照本基金合同规定的程序终止本基金合同的日期；
- 基金存续期：指自《景博证券投资基金基金合同》生效之日起至《大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）基金合同》终止且基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止的不定期期限；
- 集中申购期：指本基金合同生效后仅开放申购、不开放赎回的一段时间，最长不超过 1 个月；
- 工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日；
- 申购：指在本基金合同生效后的存续期间，投资者向基金管理人申请购买本基金基金份额的行为；
- 赎回：指在本基金合同生效后的存续期间，基金份额持有人要求基

	金管理人购回本基金份额的行为；
上市交易：	指在本基金合同生效后的存续期间，投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖基金份额的行为；
转换：	指基金份额持有人按基金管理人规定的条件，申请将其持有的基金管理人管理的某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的另一只基金的基金份额的行为；
系统内转托管：	指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为；
跨系统转登记：	指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为；
证券账户：	指注册登记机构为投资者开立的用于记录投资者持有证券的账户，包括人民币普通股票账户（A 股账户）和证券投资基金账户，记录在该账户下的基金份额登记在注册登记机构的证券登记结算系统；
投资指令：	指基金管理人在运用基金财产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令；
销售机构：	指基金管理人及本基金代销机构；
代销机构：	指接受基金管理人委托代为办理本基金申购、赎回和其他基金业务的机构；
直销机构：	指基金管理人，即大成基金管理有限公司；
会员单位：	指具有开放式基金代销资格的深圳证券交易所会员单位；
销售场所：	指场外销售场所和场内销售场所，分别简称场外和场内；
场外：	指通过深圳证券交易所外的销售机构进行基金份额申购和赎回等的场所；
场内：	指通过深圳证券交易所内的会员单位进行基金份额申购、赎回和上市交易等的场所；
基金销售网点：	指基金管理人的直销中心及基金代销机构的代销网点；
指定媒体：	指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网

	站；
基金账户：	指注册登记机构为基金投资者开立的记录其持有的由该注册 登记机构办理注册登记的基金份额余额及其变动情况的账 户；
交易账户：	指销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理 申购、赎回、转换及转托管等业务的基金份额的变动及结余 情况的账户；
开放日：	指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日；
T 日：	指销售机构受理投资者申购、赎回或其他业务申请的日期；
T+n 日：	指 T 日后（不包括 T 日）第 n 个工作日，n 指自然数；
基金收益：	指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银 行存款利息及其他合法收入；
基金资产总值：	指基金持有的各类有价证券、银行存款本息、应收申购款以 及其他资产等形式存在的基金财产的价值总和；
基金资产净值：	指基金资产总值减去基金负债后的价值；
基金份额净值：	指基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数所得的 基金份额的价值；
基金资产估值：	指计算、评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值 和基金份额净值的过程；
法律法规：	指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、 地方法规、地方规章、部门规章及其他规范性文件以及对于 该等法律法规的不时修改和补充；
不可抗力：	指任何无法预见、无法克服、无法避免的事件和因素，包括 但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、 政府征用、没收、法律变化、突发停电或其他突发事件、证 券交易所非正常暂停或停止交易等。

三、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：大成基金管理有限公司

住所：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层

办公地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层

设立日期：1999年4月12日

注册资本：贰亿元人民币

股权结构：公司股东为中泰信托投资有限责任公司（持股48%）、中国银河投资管理有限公司（持股25%）、光大证券股份有限公司（持股25%）、广东证券股份有限公司（持股2%）。

法定代表人：张树忠（相关工商变更登记手续尚在办理中，下同）

总经理：王颢

电话：0755-83183388

传真：0755-83199588

联系人：肖冰

大成基金管理有限公司设有股东会、董事会、监事会，下设十一个部门，分别是投资部、交易部、金融工程部、规划发展部、委托投资部、市场部、监察稽核部、信息技术部、基金运营部、国际业务部和综合管理部；此外，还设立了投资决策委员会和风险控制委员会。

公司拥有一支充满活力的高素质、高学历、具备丰富市场经验的专业队伍，所有人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。公司以“诚信、稳健、创新、服务”为经营理念，坚持“诚实信用、勤勉尽责”的企业精神，致力于开拓基金及证券市场业务，力求为投资者获得更大投资回报。

（二）证券投资基金管理情况

截至2008年12月12日，本基金管理人共管理3只封闭式证券投资基金：基金景宏、基金景福、大成优选股票型证券投资基金及12只开放式证券投资基金：大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成货币市场证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、大成财富管理2020生命周期证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成强化收益债券型证券投资基金及大成策略回报股票型证券投资基金等。

（三）主要人员情况

1、公司高级管理人员

董事会：

张树忠先生，董事长，经济学博士。1989年7月—1993年2月，任中央财经大学财政系讲师；1993年2月—1997年3月，任华夏证券股份有限公司投资银行总部总经理、研究发展部总经理；1997年3月—2003年7月，任光大证券股份有限公司总裁助理兼北方总部总经理、资产管理总监；2003年7月—2004年6月，任光大保德信基金管理公司董事、副总经理；2004年6月—2006年12月，任大通证券股份有限公司副总经理；2007年1月—2008年1月，任大通证券股份有限公司总经理；2008年1月—2008年4月，任职中国人保资产管理股份有限公司；2008年4月起任中国人保资产管理股份有限公司副总裁、党委委员；2008年11月起同时担任大成基金管理有限公司董事长。

王颢先生，董事总经理，国际工商管理专业博士。2000年12月—2002年9月，任招商证券股份有限公司深圳管理总部副总经理、机构管理部副总经理；2002年9月加入大成基金管理有限公司，历任助理总经理、副总经理；2008年11月起担任大成基金管理有限公司总经理。

王长林先生，董事，研究生，高级经济师。曾任中国农业银行天津分行计划处副处长、信息中心副总经理，中国长城信托投资公司计划财务部总经理。现任中国银河投资管理有限公司办公室主任。

曾北川先生，董事，博士。1989年8月—1992年6月，任建设部中国城乡建设发展总公司项目经理；1992年6月—1994年3月，任中国建设银行总行房地产信贷部房地产信贷项目经理；1994年4月—1998年5月，任国家开发银行国际金融局信贷一处信贷项目经理、国家开发银行国际金融局综合计划处副处长；1998年5月—2001年10月，任华夏银行北京管理部副总经理、华夏银行北京管理部副总经理（主持工作）；2001年10月—2006年10月，任华夏银行总行营业部常务副总经理（党组副书记）、华夏银行总行稽核部总经理（监事会监事、审计委员会委员）；2006年10月—2008年4月，任中国人寿保险股份有限公司市场拓展部总经理；2008年4月，任人保金控投资有限公司筹备组成员；2008年7月起任中国华闻投资控股有限公司总裁、党委书记。

杨赤忠先生，董事，大学本科。历任深圳蓝天基金管理公司投资与研究部经理；长盛基金管理有限公司研究部副总监、基金经理；大成基金管理有限公司研究总监；光大证券证券投资部总经理。现任光大证券助理总裁。

蔺春林先生，独立董事，大学本科。1970—1971年，解放军信阳坦克师锻炼；1971—1987年，任兵器部5107、5137厂生产会计员、财务处长；1987年—1998年，任湖北省财政厅中央企业处副处长、财政部驻湖北省专员助理；1998年—2005年，任财政部驻江西专

员办专员助理、副专员、专员、党组书记；2005年8月，任中央纪委、中组部金融巡视组组长；2007年1月退休。

于绪刚先生，独立董事，法学博士，环太平洋律师协会会员、全国律协金融证券委员会委员、华中科技大学兼职教授及研究生导师、北京工商大学客座教授、华北电力大学客座教授。1990年—1995年，任河北省保定市中级人民法院助理审判员；1995年—1998年，北京大学法学硕士学习；1999年，香港大学法律学院访问学者、香港法律教育信托基金访问学者；1999年—2001年，北京大学法学博士学习；2001年起任大成律师事务所律师、高级合伙人、管委会委员。

万曾炜先生，独立董事，经济学博士，研究员，曾任上海市政府发展研究中心处长，上海市浦东新区综合规划土地局党组书记、局长，浦东新区发展计划局党组书记，上海浦东发展集团和上海浦东投资建设有限公司筹建负责人和法人代表，现任上海市公积金管理中心党委书记、主任，上海市政府特聘决策咨询专家。

刘大为先生，独立董事，国家开发银行总会计师，高级经济师，享受政府特殊津贴专家。中国人民银行研究生部硕士生指导老师，首都经济贸易大学兼职教授，清华大学中国经济研究中心高级研究员。先后在北京市人民政府研究室（副处长、处长），北京市第一商业局（副局长），中国建设银行信托投资公司（总经理），中国投资银行（行长），国家开发银行（总会计师）工作。

监事会：

胡学光先生，监事长，硕士，高级经济师，广东省高级经济师评审委员会委员。曾在湖北金融高等专科学校任教，广州金融高等专科学校任金融系副主任；1992年—2003年4月，在广东证券股份有限公司先后任“广证基金”、“广证受益”经理、部门总经理、总裁助理、副总裁，兼任中山大学岭南学院兼职教授、中天证券研究院副院长，广东证券博士后科研工作站指导导师；2003年5月至2008年8月任大成基金管理有限公司董事长。

宁加岭先生，监事，大学本科。1983年2月—1987年6月，任财政部人教司副处长、处长；1987年6月—1994年6月，任财政部行政司副司长、司长；1994年6月—1999年6月，任财政部德宝实业总公司总经理、法人代表；1999年6月起，任职于财政部离退休老干部局。

黄建农先生，监事，大学本科。曾任中国银河证券有限责任公司上海江苏北路营业部总经理，中国银河证券有限责任公司资产管理总部副总经理，总经理，中国银河投资管理公司投资管理部总经理。现任中国银河投资管理公司上海投资部董事总经理。

其他高级管理人员：

刘彩晖女士，副总经理，管理学硕士。1999年—2002年，历任江南信托投资有限公司投资银行部副总经理、总经理；2002年—2006年，历任江南证券有限公司总裁助理、投资银行部总经理、机构管理部总经理，期间还任江南宏富基金管理公司筹备组副组长；2006年1月—7月任深圳中航集团公司人力资源部副总经理；2006年8月—2008年5月，任大成基金管理有限公司助理总经理；2008年5月起任大成基金管理有限公司副总经理。

杜鹏女士，督察长，研究生学历。1992年—1994年，历任原中国银行陕西省信托咨询公司证券部驻上交所上市代表、上海业务部负责人；1994年—1998年，历任广东省南方金融服务总公司投资基金管理部证券投资部副经理、广东华侨信托投资公司证券总部资产管理部经理；1998年9月参与大成基金管理有限公司的筹建；1999年3月起，任大成基金管理有限公司督察长兼监察稽核部总监。

2、基金经理

（1）现任基金经理

倪明先生，基金经理，厦门大学金融系博士研究生，澳门大学工商管理硕士，四年证券从业经验。2004年加入大成基金管理有限公司后先后任投资部固定收益小组信用分析师、大成债券基金基金经理助理、大成精选增值混合型基金基金经理助理、金融行业研究员。现任大成创新成长混合型证券投资基金基金经理。

（2）历任基金经理

历任基金经理姓名	管理本基金时间
王维钢	2007年6月12日—2008年8月23日

3、公司投资决策委员会

公司投资决策委员会由9名成员组成，设主任委员1名，其他委员8名。名单如下：

刘明，投资总监，大成优选股票型证券投资基金基金经理，投资决策委员会主任委员；杨建华，投资部执行总监，负责公司股票投资业务，大成景阳领先股票型证券投资基金基金经理，投资决策委员会委员；陈尚前，投资部执行总监，负责公司固定收益证券投资业务，大成债券投资基金、大成强化收益债券型证券投资基金基金经理，投资决策委员会委员；邓韶勇，交易部总监，投资决策委员会委员；姚榕，投资部研究副总监，投资决策委员会委员；施永辉，大成蓝筹稳健证券投资基金基金经理，投资决策委员会委员；杨丹，金融工程部总监助理，大成沪深300指数证券投资基金基金经理、景福证券投资基金基金经理，投资决策

委员会委员；王立，大成货币市场证券投资基金基金经理，投资决策委员会委员；孙蓓琳，资深研究员，投资决策委员会委员。

上述人员之间不存在亲属关系。

（四）基金管理人的职责

按照《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人必须履行以下职责：

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

2、办理基金备案登记手续；

3、自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

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

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

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

7、接受基金托管人依法进行的监督；

8、采取适当合理的措施使计算基金份额申购、赎回价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，按规定计算并公告基金份额净值，确定基金份额申购、赎回价格；

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

10、保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等。除法律法规、本基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；

11、按基金合同规定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

12、不谋求对上市公司的控制和直接经营管理；

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

14、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

15、编制中期和年度基金报告；

16、保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

- 17、组织并参加基金财产清算组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- 18、面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
- 19、因违反《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他法律法规，导致基金财产损失或损害基金份额持有人合法权益的，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- 20、按照法律法规和本基金合同的规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- 21、确保向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间内发出；保证投资者能够按照基金合同规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并得到有关资料的复印件；
- 22、不从事任何有损基金及本基金其他当事人利益的活动；
- 23、负责为基金聘请注册会计师和律师；
- 24、由于基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
- 25、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 26、法律法规及基金合同规定的其他职责。

（五）基金管理人承诺

- 1、基金管理人承诺严格遵守《证券法》，并建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生；
- 2、基金管理人承诺严格遵守《基金法》、《运作办法》，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止以下《基金法》、《运作办法》禁止的行为发生：
 - （1）将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
 - （2）不公平地对待其管理的不同基金财产；
 - （3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
 - （4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
 - （5）法律法规和中国证监会禁止的其他行为。
- 3、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：
 - （1）越权或违规经营；
 - （2）违反基金合同或托管协议；
 - （3）损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益；
 - （4）在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；

- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权；
- (7) 泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- (8) 除按本公司制度进行基金投资外，直接或间接进行其他股票交易；
- (9) 协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；
- (10) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (11) 故意损害基金投资者及其他同业机构、人员的合法权益；
- (12) 以不正当手段谋求业务发展；
- (13) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (14) 信息披露不真实，有误导、欺诈成分；
- (15) 法律法规和中国证监会禁止的其他行为。

4、本基金管理人将根据基金合同的规定，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制等全权处理本基金的投资。

5、本基金管理人不得从事违反《基金法》的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，保证基金财产不用于下列投资或者活动：

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

（六）基金经理的承诺

1、依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

- 2、不利用职务之便为自己及其被代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；
- 3、不违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- 4、不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

（七）基金管理人的内部控制制度

本基金管理人为加强内部控制，促进公司诚信、合法、有效经营，保障基金份额持有人利益，维护公司及公司股东的合法权益，依据《证券法》、《证券投资基金公司管理办法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》等法律法规，并结合公司实际情况，制定《大成基金管理有限公司内部控制大纲》。

公司内部控制是指公司为防范和化解风险，保证经营运作符合公司的发展规划，在充分考虑内外部环境的基础上，通过建立组织机制、运用管理方法、实施操作程序与控制措施而形成的系统。公司建立科学合理、控制严密、运行高效的内部控制体系，制定科学完善的内部控制制度。

公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等部分组成。

公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任，公司管理层对内部控制制度的有效执行承担责任。

1、公司内部控制的总体目标

（1）保证公司经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念。

（2）防范和化解经营风险，提高经营管理效益，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，实现公司的持续、稳定、健康发展。

（3）确保基金、公司财务和其他信息真实、准确、完整、及时。

2、公司内部控制遵循以下原则

（1）健全性原则。内部控制涵盖公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并包括决策、执行、监督、反馈等各个环节。

（2）有效性原则。通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行。

（3）独立性原则。公司各机构、部门和岗位职责的设置保持相对独立，公司基金财产、自有资产与其他资产的运作相互分离。

(4) 相互制约原则。公司设置的各部门、各岗位权责分明、相互制衡。

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

3、公司制定内部控制制度遵循以下原则

(1) 合法合规性原则。公司内控制度符合国家法律、法规、规章和各项规定。

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

(3) 审慎性原则。制定内部控制制度以审慎经营、防范和化解风险为出发点。

(4) 适时性原则。随着有关法律法规的调整和公司经营战略、经营方针、经营理念等内外部环境的变化进行及时的修订或完善内部控制制度。

4、内部控制的基本要素

内部控制的基本要素包括控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通和内部监控。

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

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

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

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

(5) 依据公司自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的内控防线：

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

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

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

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

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

(8) 建立严谨、有效的授权管理制度，授权控制贯穿于公司经营活动的始终。

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

② 公司各业务部门、分支机构和各级人员在规定授权范围内行使相应的职责。

③ 公司重大业务的授权采取书面形式，明确授权书的授权内容和时效。

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

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

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

(11) 制订切实有效的应急应变措施，建立危机处理机制和程序。

(12) 维护信息沟通渠道的畅通，建立清晰的报告系统。

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

5、内部控制的主要内容

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

(2) 研究业务控制主要包括：

① 研究工作保持独立、客观。

② 建立严密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法。

③ 建立投资对象备选库制度，根据基金合同要求，在充分研究的基础上建立和维护备选库。

④ 建立研究与投资的业务交流制度，保持通畅的交流渠道。

⑤ 建立研究报告质量评价体系。

(3) 投资决策业务控制主要包括：

① 严格遵守法律法规的有关规定，符合基金合同所规定的投资目标、投资范围、投资

策略、投资组合和投资限制等要求。

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

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

④ 建立投资风险评估与管理制度，在设定的风险权限额度内进行投资决策。

⑤ 建立科学的投资管理业绩评价体系，包括投资组合情况、是否符合基金产品特征和决策程序、基金绩效归属分析等内容。

（4）基金交易业务控制主要内容包括：

① 基金交易实行集中交易制度，基金经理不得直接向交易员下达投资指令或者直接进行交易。

② 建立交易监测系统、预警系统和交易反馈系统，完善相关的安全设施。

③ 交易管理部门审核投资指令，确认其合法、合规与完整后方可执行，如出现指令违法违规或者其他异常情况，应当及时报告相应部门与人员。

④ 公司执行公平的交易分配制度，确保不同投资者的利益能够得到公平对待。

⑤ 建立完善的交易记录制度，及时核对并存档保管每日投资组合列表等。

⑥ 建立科学的交易绩效评价体系。

根据内部控制的原则，制定场外交易、网下申购等特殊交易的流程和规则。

（5）建立严格有效的制度，防止不正当关联交易损害基金份额持有人利益。基金投资涉及关联交易的，在相关投资研究报告中特别说明，并报公司风险控制委员会审议批准。

（6）公司在审慎经营和合法规范的基础上力求金融创新。在充分论证的前提下周密考虑金融创新品种或业务的法律性质、操作程序、经济后果等，严格控制金融新品种、新业务的法律风险和运行风险。

（7）建立和完善客户服务标准、销售渠道管理、广告宣传行为规范，建立广告宣传、销售行为法律审查制度，制定销售人员准则，严格奖惩措施。

（8）制定详细的登记过户工作流程，建立登记过户电脑系统、数据定期核对、备份制度，建立客户资料的保密保管制度。

（9）公司按照法律、法规和中国证监会有关规定，建立完善的信息披露制度，保证公开披露的信息真实、准确、完整、及时。

（10）公司配备专人负责信息披露工作，进行信息的组织、审核和发布。

（11）加强对公司及基金信息披露的检查和评价，对存在的问题及时提出改进办法，对

出现的失误提出处理意见，并追究相关人员的责任。

（12）掌握内幕信息的人员在信息公开披露前不得泄露其内容。

（13）根据国家法律法规的要求，遵循安全性、实用性、可操作性原则，严格制定信息系统的管理制度。

信息技术系统的设计开发符合国家、金融行业软件工程标准的要求，编写完整的技术资料；在实现业务电子化时，设置保密系统和相应控制机制，并保证计算机系统的可稽性，信息技术系统投入运行前，经过业务、运营、监察稽核等部门的联合验收。

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

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

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

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

建立电子信息数据的即时保存和备份制度，重要数据异地备份并且长期保存。

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

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

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

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

（22）采取适当的会计控制措施，以确保会计核算系统的正常运转。

① 建立凭证制度，通过凭证设计、登录、传递、归档等一系列凭证管理制度，确保正

确记载经济业务，明确经济责任。

② 建立账务组织和账务处理体系，正确设置会计账簿，有效控制会计记账程序。

③ 建立复核制度，通过会计复核和业务复核防止会计差错的产生。

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

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

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

(26) 制订完善的会计档案保管和财务交接制度，财会部门妥善保管密押、业务用章、支票等重要凭据和会计档案，严格会计资料的调阅手续，防止会计数据的毁损、散失和泄密。

(27) 严格制定财务收支审批制度和费用报销运作管理办法，自觉遵守国家财税制度和财经纪律。

(28) 公司设立督察长，对董事会负责，经董事会聘任，报中国证监会核准。根据公司监察稽核工作的需要和董事会授权，督察长可以列席公司相关会议，调阅公司相关档案，就内部控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能。督察长定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况，董事会对督察长的报告进行审议。

(29) 公司设立监察稽核部门，对公司管理层负责，开展监察稽核工作，公司保证监察稽核部门的独立性和权威性。

(30) 明确监察稽核部门及内部各岗位的具体职责，配备充足的监察稽核人员，严格监察稽核人员的专业任职条件，严格监察稽核的操作程序和组织纪律。

(31) 强化内部检查制度，通过定期或不定期检查内部控制制度的执行情况，确保公司各项经营管理活动的有效运行。

(32) 公司董事会和管理层重视和支持监察稽核工作，对违反法律、法规和内部控制制度的，追究有关部门和人员的责任。

6、基金管理人关于内部控制制度的声明

(1) 本公司承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确。

(2) 本公司承诺根据市场变化和公司业务发展不断完善内部控制制度。

四、基金托管人

(一) 基本情况

名称：中国农业银行

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市海淀区西三环北路 100 号金玉大厦

法定代表人：项俊波

成立时间：1979 年 2 月 23 日

注册资金：361 亿元人民币

存续期间：持续经营

电话：010-68424199

联系人：李芳菲

中国农业银行是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。在国内,中国农业银行网点遍布城乡,资金实力雄厚,服务功能齐全,不仅为广大客户所信赖,而且与他们一道取得了长足的共同进步,已成为中国最大的银行之一。在海外,农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉,被《财富》评为世界 500 强企业之一。中国农业银行网点遍布中国城乡,成为国内网点最多、业务辐射范围最广,服务领域最广,服务对象最多,业务功能齐全的大型国有商业银行之一。中国农业银行自 1979 年恢复成立以来,在社会各界的大力支持下,全行员工开拓创新,奋力拼搏,在建设现代商业银行的征途上,积极探索,勇于实践,资金实力显著增强,业务领域不断拓宽,经营结构逐年优化,财务收益大幅跃升,管理水平不断提高,在支持国民经济发展、为客户提供优质服务的同时,自身不断成长壮大。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行,经验丰富,服务优质,业绩突出,2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计,并获得无保留意见的 SAS70 审计报告,表明了独立公正第三方对农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立,2004 年 9 月更名为托管业务部,内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、综合管理处、风险管理处、境外资产托管处,拥有先进的安全防范设施和基金清算、核算、交易监督快捷处理系统。

（二）主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工 87 名,其中高级会计师、高级经济师、高级工程师 10 余名,服务团队成员都具有高素质高学历的托管业务能力,高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称。

（三）基金托管业务经营情况

截止 2008 年 9 月 30 日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 60 只，包括基金裕阳、基金裕隆、基金汉盛、基金景福、基金天华、基金鸿阳、基金丰和、基金久嘉、富国动态平衡开放式基金、长盛成长价值开放式基金、宝盈鸿利收益开放式基金、大成价值增长开放式基金、大成债券开放式基金、银河稳健开放式基金、银河收益开放式基金、长盛债券开放式基金、长信利息收益开放式基金、长盛动态精选开放式基金、景顺长城内需增长开放式基金、万家增强收益债券型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式基金、富国天瑞强势开放式基金、鹏华货币市场基金、国联分红增利开放式基金、国泰货币市场基金、新世纪优选分红证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达荷银货币市场基金、交银施罗德货币市场基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金（LOF）、信诚四季红混合型证券投资基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金、富国天时货币市场基金、益民货币市场基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心精选股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、长盛中证 100 指数证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、泰达荷银首选企业股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金，国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、益民创新优势混合型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、华夏复兴基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、新世纪优选成长股票型证券投资基金、金元比联成长动力灵活配置混合型证券投资基金。

（四）基金托管部门的设置

1998年5月，中国农业银行证券投资基金托管部经中国证监会和中国人民银行批准成立，2004年9月更名为托管业务部，内设养老金管理中心、营运中心、技术保障处、风险管理处、证券投资基金托管处、委托资产托管处、境外资产托管处和综合管理处，拥有先进的安全防范设施和基金清算、核算、交易监督快捷处理系统。

（五）基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

风险与内控管理委员会直接负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。托管业务部专门设置了风险管理处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理实行严格的复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

（六）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将法律法规、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统，每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作，并通过基金资金账户，基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为，同时记录工作日志。

当基金出现异常交易行为时，基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理：

- 1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题，电话提示基金管理人；
- 2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题，以书面方式对基金管理人进行提示；
- 3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

五、相关服务机构

（一）销售机构及联系人

1、直销机构

名称：大成基金管理有限公司

住所：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层

办公地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层

法定代表人：张树忠

电话：0755-83183388

传真：0755-83199588

联系人：杨春明

公司网址：www.dcfund.com.cn

大成基金客户服务热线：021—53599588，400-888-5558（免长途固话费）

大成基金管理有限公司现分别在深圳、北京、上海设有投资理财中心：

（1）大成基金深圳投资理财中心

地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层

联系人：梁靖、瞿宗怡

电话：0755—83195090，83195236

传真：0755—83195091

（2）大成基金北京投资理财中心

地址：北京市朝阳区朝阳门外大街16号中国人寿大厦1201室

联系人：廖红军、李宁

电话：010—85252345/46

传真：010—85252273/2274/2275

（3）大成基金上海投资理财中心

地址：上海市广东路689号海通证券大厦19层

联系人：徐聆、朱君

电话：021—63513925/26

传真：021—63513928

2、场外代销机构

（1）中国农业银行

注册地址：北京市东城区建国门内大街69号

法定代表人：项俊波

客服电话：95599

联系人：蒋浩

电话：010-85109219

传真：010-85109219

网址：www.abchina.com

（2）中国银行股份有限公司

注册地址：北京西城区复兴门内大街1号

法定代表人：肖钢

客服电话：95566

传真：010-66594946

电话：010-66594977

网址：www.boc.cn

（3）中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号长安兴融中心1号楼

法定代表人：郭树清

联系人：王琳

电话：010-67596084

传真：010-66275654

客服电话：95533

网址：www.ccb.com

（4）中国工商银行股份有限公司

注册地址：中国北京复兴门内大街55号

法定代表人：姜建清

客服电话：95588

联系人：田耕

电话：010-66107900

传真：010-66108013

网址：www.icbc.com.cn

（11）中国邮政储蓄银行

注册地址：北京市西城区宣武门西大街131号

法定代表人：陶礼明

客户服务电话：11185

传真：010—66415194

网址：www.cpsrb.com

（5）深圳市平安银行股份有限公司

注册地址：中国深圳市深南中路1099号

法定代表人：黄立哲

电话：0755-25859591

传真：0755-25878304

联系人：霍兆龙

客户服务热线：0755-961202、4006699999

公司网站：www.18ebank.com

（6）深圳发展银行股份有限公司

办公地址：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦

法定代表人：法兰克纽曼（Frank N.Newman）

客服电话：95501

联系人：周勤

电话：0755-82088888-8811

传真：0755-82080714

网址：www.sdb.com.cn

（7）交通银行股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路188号

法定代表人：胡怀邦

客服电话：95559

联系人：曹榕

电话：021-58781234

传真：021-58408842

网址：www.bankcomm.com

（8）招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行股份有限公司大厦

法定代表人：秦晓

客服电话：95555

联系人：刘薇

电话：0755-83195915

传真：0755-83195061

网址：www.cmbchina.com

（9）中国光大银行

注册地址：北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦

法定代表人：唐双宁

客服电话：95595

联系人：李伟

电话：010-68560675

传真：010-68560661

网址：www.cebbank.com

（10）中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区正义路4号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人：董文标

客服电话：95568

联系人：董云巍

电话：010-58351666-8155

传真：010-83914283

网址：www.cmbc.com.cn

（11）上海浦东发展银行股份有限公司

办公地址：上海市北京东路689号17楼

法定代表人：吉晓辉

联系人：倪苏云

客服热线：95528

电话：021-61618888

传真：021-63602431

网址：www.spdb.com.cn

（12）广东发展银行股份有限公司

注册地址：广州市农林下路83号

法定代表人：李若虹

客服电话：95508

电话：020-87310888

网址：www.gdb.com.cn

（13）齐鲁证券有限公司

办公地址：山东省济南市经十路128号

法定代表人：李玮

联系人：傅咏梅

电话：0531-82024184、0531-82024147

传真：0531-82024197

网址：www.qlzq.com.cn

（14）东方证券股份有限公司

住所：上海市中山南路318号新源广场2号楼21-29楼

法定代表人：王益民

客户电话：95503

联系人：吴宇

电话：021-63325888

传真：021-63327888

网址：www.dfzq.com.cn

（15）长江证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

联系人：李良

联系电话：021-63219781

客服电话：4008-888-999

委托电话：4008-888-318

传真：027-85481900

网址：www.cjsc.com.cn

（16）国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路618号

通讯地址：上海浦东新区银城中路168号上海银行大厦

法定代表人：祝幼一

客服电话：400-8888-666

联系人：芮敏祺

电话：021-62580818-213

传真：021-62583439

网址：www.gtja.com

（17）中信建投证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

通讯地址：北京市朝阳区门内大街188号

法定代表人：张佑君

客服电话：400-8888-108

联系人：魏明

电话：010-85130579

网址：www.csc108.com

（18）国信证券有限责任公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26

法定代表人：何如

客服电话：800-810-8868

联系人：林建闽

电话：0755-82130833-2181

传真：0755-82133302

网址：www.guosen.com.cn

（19）招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

法定代表人：宫少林

客服电话：4008881111、95565

联系人：黄健

电话：0755-82943511

传真：0755-83734343

网址：www.newone.com.cn

（20）广发证券股份有限公司

注册地址：广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心26楼2611室

法定代表人：王志伟

客服电话：020-87555888转各营业网点

联系人：肖中梅

电话：020-87555888-875

传真：020-87557985

网址：www.gf.com.cn

（21）中国银河证券股份有限公司

通讯地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人：肖时庆

客服电话：4008-888-888

联系人：李洋

联系电话：010-66568047

传真：010-66568536

网址：www.chinastock.com.cn

（22）联合证券有限责任公司

办公地址：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层

法定代表人：马韶明

客服电话：400-8888-555

联系人：盛宗凌

电话：0755-82492000

传真：0755-82492962

网址：www.lhzq.com

（23）申银万国证券股份有限公司

通讯地址：上海市常熟路171号

法定代表人：丁国荣

客服电话：021-962505

联系人：曹晔

电话：021-54033888

传真：021-54038844

网址：www.sw2000.com.cn

（24）海通证券股份有限公司

通讯地址：上海市淮海中路98号

法定代表人：王开国

客服电话：021-962503、400-888-8001

联系人：金芸

电话：021-23219278 021-53594566-4125

传真：021-63602722

网址：www.htsec.com

（25）中信证券股份有限公司

办公地址：北京朝阳区新源南路6号京城大厦

法定代表人：王东明

客服电话：010-84588888各地营业部咨询电话

联系人：陈忠

电话：010-84683893

传真：010-84865560

网址：www.cs.ecitic.com

（26）安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元

法定代表人：牛冠兴

客服电话：4008001001

联系人：张茜萍

电话：0755-82558335

传真：0755-82558335

网址：www.axzq.com.cn

（27）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路1508号

法定代表人：徐浩明

客服电话：10108998

联系人：刘晨

电话：021-68816000

传真：021-68815009

网址：www.ebscn.com

（28）华林证券有限责任公司

办公地址：珠海市拱北夏湾华平路96号二层202-203房

法定代表人：段文清

客服电话：0750—3160388各地营业部客户服务电话

联系人：杨玲

电话：0755-82707855

传真：0755-82707850

网址：www.chinalions.com

（29）中信万通证券有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层（1507-1510室）

办公地址：青岛市东海西路28号

法定代表人：史洁民

客服电话：0532-96577

联系人：丁韶燕

电话：0532-85022026

传真：0532-85022026

网址：www.zxwt.com.cn

（30）东海证券有限责任公司

注册地址：常州延陵西路59号常信大厦18、19楼

办公地址：上海市浦东区东方路989号中达广场17楼

法定代表人：朱科敏

客服电话：0519-88166222、0379-64902266、021—52574550

联系人：李涛

电话：021-50586660

传真：021-50586660-8880

网址：www.longone.com.cn

（31）江南证券有限责任公司

注册地址：南昌市抚河北路291号

办公地址：南昌市抚河北路291号六楼

法定代表人：姚江涛

客服电话：0791-6768763

联系人：余雅娜

电话：0791-6768763

传真：0791-6789414

网址：www.scstock.com

（32）中信金通证券有限责任公司

注册地址：杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座

办公地址：杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座

法定代表人：刘军

电话：0571-96598

传真：0571-85783771

联系人：王勤

联系电话：0571-85783715

网址：www.bigsun.com.cn

（33）广州证券有限责任公司

注册地址：广州市先烈中路69号主楼五楼

办公地址：广州市先烈中路69号东山广场主楼五楼

法定代表人：吴志明

客服电话：020-961303

联系人：江欣

联系电话：020-87320991

传真：020-87325036

网址：www.gzs.com.cn

（34）平安证券有限责任公司

办公地址：深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦三楼

法定代表人：陈敬达

客服电话：95511

联系人：袁月

电话：0755-22627802

传真：0755-83433794

网址：www.pa18.com

（35）华泰证券有限责任公司

地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

客服电话：4008-888-168、95597

联系人：李金龙、张小波

电话：025-84457777-950、248

网址：www.htsc.com.cn

（36）湘财证券股份有限公司

住所：长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼

办公地址：上海陆家嘴环路958号华能联合大厦5层

法定代表人：陈学荣

客服电话：400-888-1551

联系人：钟康莺

电话：021-68634518

传真：021-68865680

网址：www.xcsc.com

（38）上海证券有限责任公司

注册地址：上海市西藏中路336号

办公地址：上海市西藏中路336号

法定代表人：蒋元真

客服电话：021-962518

联系人：谢秀峰

电话：021-51539888

传真：021-65081063

网址：www.962518.com

（39）华安证券有限责任公司

住所：安徽省合肥市长江中路357号

法定代表人：李工

客服电话：0551-5161671

联系人：甘霖

电话：0551-5161671

传真：0551-5161672

网址：www.hazq.com.cn

（40）兴业证券股份有限公司

住所：福建省福州市湖东路99号标力大厦

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴东路166号中国保险大厦18楼

法定代表人：兰荣

电话：021-68419974

传真：021-68419867

联系人：杨盛芳

网址：www.xyzq.com.cn

客服电话：400888123

（41）财通证券经纪有限责任公司

注册地址：杭州市解放路111号金钱大厦

办公地址：杭州市解放路111号金钱大厦

法定代表人：沈继宁

联系人：乔骏

电话：0571-87925129

传真：0571-87925129

网址：www.ctsec.com

客户服务电话：0571-96336

（42）信泰证券有限责任公司

办公地址：江苏省南京市长江路88号国信大厦18、19楼（邮政编码：210005）

法定代表人：钱凯法

客服电话：400-8888-918

联系人：舒萌菲

电话：025-84784765

传真：025-84784830

网址：www.thope.com

（43）浙商证券有限责任公司

地址：浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼

法定代表人：吴承根

联系人：吴颖

电话：0571-87901963

传真：0571-87902081

网址：www.stocke.com

（44）渤海证券有限责任公司

注册地址：天津市经济技术开发区第一大街29号

办公地址：天津市河西区宾水道3号

法定代表人：张志军

客服电话：4006515988

联系人：王兆权

电话：022-28451861

传真：022-28451892

客服电话：28455588

网址：www.ewww.com.cn

（45）山西证券有限责任公司

注册地址：山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

客服电话：400-666-1618

联系人：张治国

电话：0351-8686703

传真：0351-8686619

网址：www.i618.com.cn

（46）上海农村商业银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东大道981号

法定代表人：李秀仑

电话：021-62126969

传真：021-62521689

联系人：吴海平，翁敏芬

客服电话：021-962999

网址：www.shrcb.com

（47）方正证券有限责任公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

办公地址：湖南省长沙市建湘路479号

法定代表人：雷杰

客服电话：0571-95571、0731-95571、13258915782

电话：0731-2882340 0571-87782047

传真：0731-2882332

网址：www.foundersc.com

（48）东莞证券有限责任公司

办公地址：东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼

法定代表人：游锦辉

客服电话：0769-961130

联系人：张建平

电话：0769-22119426

传真：0769-22119423

网址：www.dgzq.com.cn

（49）东北证券股份有限公司

注册地址：长春市自由大路1138号

办公地址：长春市自由大路1138号

法定代表人：矫正中

联系人：潘锴

电话:85096709

客户服务电话:0431-96688-0 0431-85096733

网址: www.nesc.cn

(50) 国海证券有限责任公司

注册地址: 广西南宁市滨湖路46号

办公地址: 广西南宁市滨湖路46号

客服电话: 400-888-8100 (全国)、96100 (广西)

法定代表人: 张雅锋

电话: 0771-5539262

传真: 0771-5539033

网址: www.ghzq.com.cn

(51) 恒泰证券有限责任公司

注册地址: 内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号

法人代表: 刘汝军

客户服务电话: 0471-4961259

联系人: 常向东

电话: 0471-4913998

传真: 0471-4930707

网址: www.cnht.com.cn

(52) 瑞银证券有限责任公司

注册地址: 北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层

办公地址: 北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层

法定代表人: 刘弘

电话: 010-59226788

传真: 010-59226840

联系人: 谢亚凡

客户服务电话: 400-887-8827

网址: www.ubssecurities.com

(53) 宏源证券股份有限公司

注册地址: 新疆乌鲁木齐市建设路2号

办公地址：北京市海淀区西直门北大街甲43号金运大厦B座6层

法定代表人：汤世生

联系人：李茂俊

电话：010-62294608-6240

传真：010-62296854

客户服务电话：010-62294600

网址：www.hysec.com

（54）长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人：黄耀华

联系人：匡婷

电话：0755-83516289

传真：0755-83516199

客户服务热线：0755-33680000、400 6666 888

长城证券网站：www.cc168.com.cn

（55）中银国际证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39F

法定代表人：平岳

联系人：张静

电话：021-68604866-8309

网址：www.bocichina.com.cn

3、场内代销机构

指具有基金代销业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位，具体名单详见深圳证券交易所网站（www.szse.cn）。

（二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融大街27号投资广场23层

办公地址：北京市西城区金融大街27号投资广场23层

法定代表人：陈耀先

电话：010-58598839

传真：010-58598907

联系人：朱立元

（三）律师事务所和经办律师

名称：北京市金杜律师事务所

住所：北京市朝阳区东三环中路7号财富中心写字楼A座40层

办公地址：北京市朝阳区东三环中路7号财富中心写字楼A座40层

负责人：王玲

电话：0755-22163333

传真：0755-22163390

经办律师：靳庆军、宋萍萍

联系人：宋萍萍

（四）会计师事务所和经办注册会计师

会计师事务所名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦1604-1608室

办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

法人代表：杨绍信

经办注册会计师：薛竞、金毅

电话：021-61238888

传真：021-61238800

联系人：金毅

六、基金的沿革

本基金由景博证券投资基金（以下简称“景博基金”）转型而来。

自2007年6月12日景博基金终止上市之日起，原《景博证券投资基金基金合同》失效，《大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）基金合同》生效，基金正式转型为开放式基金，存续期限调整为无限期，基金投资目标、范围和策略调整，同时基金更名为“大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）”。

七、基金的存续

（一）基金份额的变更登记

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

（二）基金类型和存续期限

- 1、基金类型：混合型基金
- 2、基金运作方式：契约型上市开放式
- 3、存续期限：不定期限

（三）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

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

八、基金份额补偿

对于原景博基金份额持有人，为鼓励其长期持有，基金管理人承诺以自有资金提供份额补偿，具体安排如下。

（一）补偿对象：限于持有由原景博基金基金份额转型而来的基金份额的投资者。

（二）补偿安排：

在基金开放日常申购、赎回满3个月之日（如该日为节假日，则顺延至最近一个开放日），注册登记机构根据各个基金份额持有人持有的由原景博基金基金份额转型而来的基金份额数量，加上当日尚未赎回的在此期间基金份额持有人持有该基金份额通过红利再投资获得的基金份额（若有），按0.5%的比例增加其基金份额（按四舍五入保留至整数位），同时扣减基金管理人持有的基金份额。

基金管理人已根据上述补偿安排，对截至2007年10月18日在中国证券登记结算有限责任公司登记在册的原景博基金份额持有人实施了一次性份额补偿，于2007年10月22日进行了份额变更登记。具体情况详见相关公告。

九、基金份额的申购、赎回

（一）申购和赎回的场所

投资者应当在销售机构办理基金申购、赎回业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购与赎回。本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。销售机构的名单和联系方式见本招募说明书第五条第（一）款。

基金管理人可根据具体情况变更或增减代销机构，并予以公告。

（二）申购和赎回的对象

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

（三）申购和赎回的开始时间

本基金已于 2007 年 7 月 18 日开始办理日常申购、赎回等业务。

（四）申购和赎回的方式

投资者可以使用中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的深圳证券账户通过具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位进行申购和赎回（称为“场内申购和赎回”）；也可以使用中国证券登记结算有限责任公司的深圳开放式基金账户通过本基金直销机构和场外代销机构进行申购和赎回（称为“场外申购和赎回”）。已购买过本公司其他开放式基金的投资者，其持有的由本公司开立的普通开放式基金账户不能用于本基金的申购和赎回，需通过直销网点或代销机构办理深圳开放式基金账户。

账户的开立和使用详见相关公告。

（五）场内申购和赎回

1、开放日及开放时间

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

2、申购与赎回的原则

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

（2）“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请。申购和赎回

申报单位以深圳证券交易所的规定为准；

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

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

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

3、申购和赎回的程序

（1）申购和赎回的申请方式

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

（2）申购和赎回申请的确认

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

（3）申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，申购款项本金将退回投资者账户，由此产生的利息等损失由投资者自行承担。

投资者赎回申请成功后，基金托管人按有关规定将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法按本基金合同有关规定处理。

4、申购和赎回的数额限制

（1）单个基金账户单笔场内申购的最低金额为 1,000 元，最高不超过 99,999,999.99 元。投资者可多次申购，累计申购金额不设上限。

（2）本基金不对投资者每个交易账户的最低基金份额余额进行限制，亦不对单个投资者累计持有的基金份额上限进行限制。

（3）基金管理人、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司可根据市场情况，在不违反相关法律法规规定的前提下，调整上述限制。基金管理人要求予以调整的，最迟应于调整前 2 日在至少在一种指定媒体上公告并报中国证监会备案。

（4）申购份额、余额的处理方式：本基金的申购份额由申购金额扣除申购费用后除以

申购申请当日的基金份额净值确定。基金份额份数保留到整数位，小数点后部分将以现金形式直接退还给投资者。

（5）赎回金额的处理方式：本基金的赎回金额由赎回份额乘以赎回申请当日的基金份额净值扣除赎回费用后确定。赎回金额计量单位为人民币元，赎回金额保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

5、申购份额和赎回金额的计算

（1）基金申购份额的计算

净申购金额 = 申购金额 ÷ (1 + 申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 ÷ T 日基金份额净值

申购份额保留到整数位，计算所得整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资者资金账户。

例：某投资者通过场内投资 10,000 元申购本基金，假设对应的申购费率为 1.5%，且申购当日基金份额净值为 1.025 元，则其申购手续费、可得到的申购份额及返还的资金余额为：

净申购金额 = $10,000 \div (1 + 1.5\%) = 9,852.22$ 元

申购手续费 = $10,000 - 9,852.22 = 147.78$ 元

申购份额 = $9,852.22 \div 1.025 = 9,611.92$ 份

因场内申购份额保留至整数份，故投资者申购所得份额为 9,611 份，整数位后小数部分的申购份额对应的资金返还给投资者。具体计算公式为：

实际净申购金额 = $9,611 \times 1.025 = 9,851.28$ 元

退款金额 = $10,000 - 9,851.28 - 147.78 = 0.94$ 元

即：投资者投资 10,000 元从场内申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.025 元，则其可得到基金份额 9,611 份，退款 0.94 元。

（2）基金赎回金额的计算

赎回总金额 = 赎回份额 × T 日基金份额净值

赎回费用 = 赎回总金额 × 赎回费率

净赎回金额 = 赎回总金额 - 赎回费用

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

例：某投资者从深交所场内赎回本基金 10,000 份基金份额，假设赎回费率为 0.5%，且

赎回当日基金份额净值为 1.148 元，则其可得净赎回金额为：

$$\text{赎回总金额} = 10,000 \times 1.148 = 11,480 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 11,480 \times 0.5\% = 57.40 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 11,480 - 57.40 = 11,422.60 \text{ 元}$$

即：投资者从深交所场内赎回本基金 10,000 份基金份额，假设赎回当日基金份额净值为 1.148 元，则可得到的净赎回金额为 11,422.60 元。

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

(4) 基金份额净值的计算公式

$$T \text{ 基金份额净值} = T \text{ 日基金资产净值} \div T \text{ 日发行在外的基金份额总数}$$

基金份额净值保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入。

6、申购与赎回的登记结算

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

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

(六) 场外申购和赎回

1、开放日及开放时间

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

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

2、申购与赎回的原则

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

(2) “金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

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

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

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

3、申购和赎回的程序

（1）申购和赎回的申请方式

投资者须按销售机构规定的手续，在开放日的业务办理时间提出申购、赎回的申请。投资者申购本基金时，须按销售机构规定的方式全额交付申购款项。投资者提交赎回申请时，其在销售机构（网点）必须有足够的基金份额余额。

（2）申购和赎回申请的确认

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

（3）申购和赎回的款项支付

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

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

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

4、申购与赎回的数额限制

（1）单个基金账户单笔场外申购的最低金额为1,000元。

（2）本基金不对投资者每个交易账户的最低基金份额余额进行限制，亦不对单个投资者累计持有的基金份额上限进行限制。

（3）同一基金账户自最近一次申购之日起，如在3个月内赎回规模过大，基金管理人有权要求提前预约或采取相应限制措施。

（4）基金管理人在不损害基金份额持有人实质权益的情况下可以根据市场情况对以上

限制进行调整，最迟于调整前 2 日在至少一种指定媒体上予以公告并报中国证监会备案。

5、申购份额和赎回金额的计算

（1）基金申购份额的计算

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

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

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

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

例：某投资者投资 5,000 元申购本基金，假设对应费率为 1.5%，且申购当日基金份额净值为 1.128 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 5,000 \div (1 + 1.5\%) = 4,926.11 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 5,000 - 4,926.11 = 73.89 \text{ 元}$$

$$\text{申购份数} = 4,926.11 \div 1.128 = 4,367.12 \text{ 份}$$

即：某投资者投资 5,000 元申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.128 元，则可得到 4,367.12 份基金份额。

（2）基金赎回金额的计算

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

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总额} \times \text{赎回费率}$$

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

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

例：某基金份额持有人持有本基金 10,000 份基金份额一年后决定赎回，假设对应的赎回费率为 0.25%，且赎回当日基金份额净值是 1.148 元，则可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回总额} = 10,000 \times 1.148 = 11,480 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 11,480 \times 0.25\% = 28.70 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 11,480 - 28.70 = 11,451.30 \text{ 元}$$

即：某基金份额持有人持有 10,000 份本基金基金份额一年后（未满 2 年）赎回，假设赎回当日基金份额净值是 1.148 元，则可得到的净赎回金额为 11,451.30 元。

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

（4）基金份额净值的计算公式

T基金份额净值=T日基金资产净值÷T日发行在外的基金份额总数

基金份额净值保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入。

6、申购与赎回的注册登记

投资者申购基金成功后，注册登记机构在 T+1 日为投资者增加权益并办理注册登记手续，投资者自 T+2 日起（含该日）有权赎回该部分基金份额。投资者赎回基金成功后，注册登记机构在 T+1 日为投资者办理扣除权益的注册登记手续。

注册登记机构可以在法律法规允许的范围内，对上述注册登记业务规则进行调整，并最迟于实施日前2日在至少一种指定媒体上公告。

（七）巨额赎回的认定及处理方式

1、巨额赎回的认定

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

2、巨额赎回的处理方式

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

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

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一工作日基金总份额10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。

对于当日的赎回申请，应当按单个基金份额持有人申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该单个基金份额持有人当日办理的赎回份额；未受理部分除投资者在提交赎回申请时选择将当日未获受理部分予以撤销外，延迟至下一开放日办理，以下一个开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额，转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权，以此类推，直到办理完毕全部赎回申请为止。

（3）当发生巨额赎回并部分延期赎回时，基金管理人应立即向中国证监会备案并在3个工作日内在至少一种指定媒体上公告，说明有关处理办法。

（4）暂停接受和延缓支付：本基金连续2个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认

为有必要，可暂停接受赎回申请；已经确认的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过20个工作日，并应当在至少一种指定媒体上予以公告。

（八）拒绝或暂停申购的情形及处理

1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

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

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

（九）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形及处理

1、在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项：

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

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

2、在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并及时公告。

3、暂停基金的申购、赎回，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

（十）申购和赎回暂停期间与重新开放的公告

暂停期间结束，基金重新开放时，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

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

2、如果发生暂停的时间超过1天但少于2周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前1个工作日，在至少一种指定媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近1个工作日的基金份额净值。

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

十、基金份额的上市交易

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

（一）上市交易的地点：深圳证券交易所。

（二）上市交易的时间：在确定上市交易的时间后，基金管理人最迟于上市前2个工作日在至少一种指定媒体上予以公告。本基金于2007年10月25日上市交易。

（三）上市交易的规则

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

（四）上市交易的费用

本基金上市交易的费用遵循《深圳证券交易所交易规则》及其他相关规定。

（五）上市交易的行情揭示

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

（六）上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市

本基金的停复牌、暂停上市、恢复上市按照深圳证券交易所的相关规定执行。

（七）终止上市的情形和处理方式

发生下列情况之一时，本基金应终止上市交易：

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

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

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

十一、基金份额的非交易过户

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

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指受理基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或其他具有社会公益性质的社会团体；强制执行是指国家有权机关依据生效的法律文书将基金份额持有人持有的基金份额强制执行划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。办理非交易过户必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请自申请受理日起2个月内办理，并按基金注册登记机构规定的标准收费。具体条件、程序及收费标准以《中国证券登记结算有限责任公司开放式证券投资基金登记结算业务指南》为准。

十二、基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转托管

（一）基金份额的登记

- 1、本基金的份额采用分系统登记的原则。原景博基金份额变更登记为本基金的份额以

及本基金场内申购或上市交易买入的基金份额登记在证券登记结算系统持有人证券账户下；场外申购买入的基金份额登记在注册登记系统持有人开放式基金账户下。

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

3、登记在注册登记系统中的基金份额可以申请场外赎回。

（二）系统内转托管

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

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

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

（三）跨系统转登记

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

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

十三、基金的投资

（一）投资目标

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

（二）投资范围

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

本基金股票投资比例范围为基金资产的40%—95%；现金和固定收益类证券投资比例范围为基金资产的5%—60%，其中资产支持证券投资比例范围为0—20%，现金和到期日在一年以内的政府债券等短期金融工具的投资比例不低于基金资产净值的5%。

如法律法规或中国证监会修改基金投资品种的规定，基金管理人在履行相应程序后，可以依据新的规定修订基金的投资范围；如法律法规或中国证监会变更对权证或资产支持证券

等投资的比例限制，基金管理人可相应调整基金的投资比例规定，不需经基金份额持有人大会审议。

（三）投资理念

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

（四）投资策略

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

1、资产配置策略

本基金在经济因素分析、经济周期分析、经济政策分析的基础上完成战略资产配置（SAA）。其中：经济因素分析主要包括利率分析、汇率分析和通货膨胀率分析；经济周期分析主要通过通过对国民生产总值、工业生产总产值、消费总量、投资总量等宏观统计数据的周期性波动的定量分析完成；经济政策分析包括存款准备金率、再贴现率和公开市场操作等货币政策分析以及政府购买水平、政府转移支付水平和税率变动情况等财政政策分析。

本基金在通过战略资产配置确定各类别资产权重后，根据对投资组合中各类资产短期收益率变化的预测，确定资产类别定价差异，实现从相对较高估值资产到相对较低估值资产的再配置，即战术资产配置（TAA），以获得更高的投资收益。

2、股票投资策略

本基金的股票投资策略包获取超额收益和控制风险两个层面。

（1）收益层面

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

① 行业分析

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

A. 行业发展现状分析，主要包括：

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

- B. 行业竞争结构分析，主要包括：
- （A）行业价值链分析及行业内主导竞争作用力分析；
 - （B）行业内主要竞争者财务状况及其竞争策略分析；
 - （C）行业所处周期及需求状况分析等。

- C. 行业未来发展趋势分析，主要包括：
- （A）行业未来需求趋势及行业演变规律分析；
 - （B）行业内购并整合的可能性分析等。

② 企业研究

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

- A. 利润增长水平分析，主要包括：

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

- B. 企业创新能力分析，主要包括：

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

- C. 企业管理水平分析，主要包括：

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

（2）风险层面

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

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

本基金将根据宏观经济状况、收益实现情况合理分配收益层面和风险层面的权重，做到

可攻可守、进退有度，以期在合理控制风险的前提下，实现基金财产的长期稳健增值。

3、固定收益品种投资策略

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

4、其他金融工具投资策略

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

（五）投资组合管理

1、投资组合管理原则

（1）积极成长原则

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

（2）重点投资和分散投资相结合原则

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

（3）长期稳定增值原则

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

2、资产配置和行业配置的决策程序

（1）资产配置

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

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

基金经理根据投资决策委员会的指导性意见并结合自己的研究分析结果，拟定基金资产

配置建议书，提交投资决策委员会审议。

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

（2）行业配置

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

3、投资品种选择的决策程序

（1）股票投资的决策程序

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

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

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

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

④ 基金经理从股票投资备选库中选择股票构建投资组合。

（2）债券投资的决策程序

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

4、交易指令的下达和执行

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

5、投资风险的监控和管理

（1）监察稽核部对投资风险的日常监管

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

投资权限等交易情况。

（2）基金绩效评估和风险管理

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

（六）投资限制和禁止行为

1、投资限制

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

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

（2）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；

（3）本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券总和，不超过该证券的 10%；

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

（5）本基金持有的全部权证市值不得超过基金资产净值的 3%；

（6）本基金与本基金管理人管理的其他基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

（7）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

（8）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

（9）本基金与本基金管理人管理的其他基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

（10）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

（11）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

（12）遵守法律法规及中国证监会规定的其他限制。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 3 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人以外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

2、禁止行为

依据《基金法》，基金财产不得用于下列投资或活动：

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

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

（七）证券交易席位选用的原则

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

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

选用交易席位的证券经营机构由基金管理人根据上述标准考察后确定。

（八）业绩比较基准

沪深 300 指数×70%+中国债券总指数×30%

在本基金的运作过程中，如果由于外部投资环境或法律法规的变化而使得调整业绩比较

基准更符合基金份额持有人的利益，则基金管理人可以对业绩比较基准进行适当调整，在报中国证监会核准后，公告并予以实施。

（九）风险收益特征

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

（十）基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

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

（十一）投资组合报告（该部分内容未定）

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，保证本报告所载内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金托管人中国农业银行根据本基金合同规定，于 2008 年 12 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合数据截止到 2008 年 9 月 30 日，其中的财务资料未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

项目	金额（元）	占基金资产总值比例
银行存款和结算备付金合计	1,715,132,309.37	17.58%
股票	6,331,373,802.53	64.90%
债券	1,670,611,842.73	17.13%
权证	0.00	0.00%
买入返售金融资产	0.00	0.00%
其他资产	38,062,475.06	0.39%
合计	9,755,180,429.69	100.00%

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	公允价值（元）	占资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	0.00	0.00%
B 采掘业	653,612,390.06	6.75%
C 制造业	2,114,888,063.29	21.83%
C0 食品、饮料	470,837,614.90	4.86%
C1 纺织、服装、皮毛	0.00	0.00%
C2 木材、家具	0.00	0.00%
C3 造纸、印刷	0.00	0.00%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	243,494,068.61	2.51%
C5 电子	30,176,454.84	0.31%

C6 金属、非金属	232,556,693.96	2.40%
C7 机械、设备、仪表	716,082,556.42	7.39%
C8 医药、生物制品	421,740,674.56	4.35%
C99 其他制造业	0.00	0.00%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	414,822,682.08	4.28%
E 建筑业	114,169,428.00	1.18%
F 交通运输、仓储业	482,505,407.37	4.98%
G 信息技术业	105,455,416.06	1.09%
H 批发和零售贸易	431,880,799.02	4.46%
I 金融、保险业	1,636,222,523.80	16.89%
J 房地产业	246,013,549.82	2.54%
K 社会服务业	71,775,000.00	0.74%
L 传播与文化产业	50,278,543.03	0.52%
M 综合类	9,750,000.00	0.10%
合计	6,331,373,802.53	65.34%

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例
1	600036	招商银行	22,988,143	405,051,079.66	4.18%
2	601318	中国平安	7,395,278	246,040,899.06	2.54%
3	600030	中信证券	9,344,374	231,366,700.24	2.39%
4	601766	中国南车	64,509,219	225,782,266.50	2.33%
5	601628	中国人寿	8,199,759	207,125,912.34	2.14%
6	600028	中国石化	19,200,000	205,056,000.00	2.12%
7	600009	上海机场	11,679,292	203,219,680.80	2.10%
8	601939	建设银行	35,000,000	165,550,000.00	1.71%
9	600000	浦发银行	10,000,000	156,200,000.00	1.61%
10	600995	文山电力	13,610,392	134,878,984.72	1.39%

4、报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例
1	国 债	0.00	0.00%
2	金 融 债	597,400,000.00	6.17%
3	央行票据	1,057,795,000.00	10.92%
4	企 业 债	693,856.73	0.01%
5	可 转 债	14,722,986.00	0.15%
6	其 他	0.00	0.00%
	合 计	1,670,611,842.73	17.24%

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例
1	08 进出 08	397,280,000.00	4.10%
2	08 央行票据 84	384,640,000.00	3.97%
3	08 农发 15	200,120,000.00	2.07%

4	08 央行票据 46	192,300,000.00	1.98%
5	08 央行票据 89	144,240,000.00	1.49%

6、投资组合报告附注

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

(2) 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

(3) 基金的其他资产构成

项目	金额（元）
存出保证金	3,445,823.48
应收证券清算款	19,276,941.81
应收利息	14,665,800.54
应收股利	0.00
应收申购款	673,909.23
合计	38,062,475.06

(4) 报告期末基金持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

(5) 本报告期内获得的权证明细

无。

(6) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券明细

无。

(7) 本报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金情况

项目名称	基金份额（份）
报告期初持有基金份额	70,687,989.47
报告期间买入基金份额	0.00
报告期间卖出基金份额	0.00
报告期末持有基金份额	70,687,989.47

(8) 由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

十四、基金的业绩

(一) 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差 ②	业绩比较基 准收益率 ③	业绩比较基准收 益率标准差 ④	①—③	②—④
2007.6.12— 2007.12.31	25.71%	1.89%	24.67%	1.51%	1.04%	0.38%
2008.1.01—	-52.56%	2.25%	-43.31%	2.14%	-9.25%	0.11%

2008.9.30						
2007.6.12— 2008.9.30	-40.36%	2.11%	-29.33	1.90%	-11.03%	0.21%

（二）自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动的比较

大成创新基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2007年6月12日至2008年9月30日）



注：

1、按基金合同规定，大成创新成长股票型证券投资基金自基金合同生效之日起3个月内为建仓期。截至本报告期末基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例要求。

2、因工作需要，王维钢先生自2008年8月23日起不再担任本基金基金经理，该变更事项已于2008年8月23日公开披露。

十五、基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关法律法规规定进行融资、融券。

十六、基金财产

（一）基金资产总值

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

（二）基金资产净值

本基金基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

（三）基金财产的账户

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

（四）基金财产的保管和处分

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

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

除依据《基金法》、本基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。

十七、基金资产估值

（一）估值目的

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

（二）估值日

本基金的估值日为相关的证券交易所的正常营业日。

（三）估值对象

基金依法拥有的各类有价证券，以及应收应付款等项目。

（四）估值原则

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

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

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

（五）估值方法

1、股票估值方法：

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

（2）未上市股票的估值：

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

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

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

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

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

（4）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

2、债券估值方法：

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

（2）在证券交易所市场挂牌交易未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易，且最近交易日后经济环境

未发生重大变化的，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

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

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

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

（6）同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值；

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

（8）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

3、权证估值办法：

（1）基金持有的权证，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；估值日没有交易，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

（2）首次发行未上市的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

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

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

（5）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

4、其他有价证券等资产按国家有关规定进行估值。

（六）估值程序

基金日常估值由基金管理人和基金托管人同时进行。基金资产净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核；基金托管人复核无误后签字返回给基金管理人；月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

（七）暂停估值的情形

在下列情形中，暂停基金财产估值：

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

（八）基金份额净值的确认

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

（九）估值错误的处理

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

基金管理人和基金托管人应采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。

2、差错类型

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

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

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

3、差错处理原则

因基金估值错误给投资者造成损失的应由基金管理人和基金托管人依照法律法规及托

管协议的规定予以承担。本基金合同的当事人应将按照以下约定的原则处理基金估值差错。

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

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

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

（4）差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

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

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

（7）按法律法规规定的其他原则处理差错。

4、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

0.25%时，基金管理人应当及时通知基金托管人并报中国证监会；错误偏差达到基金资产净值 0.5%时，基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案。

（十）特殊情形的处理

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

由于本基金所投资的各个市场及其登记结算机构发送的数据错误，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

十八、基金的费用与税收

（一）与基金运作有关的费用

1、基金费用的种类

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

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

（1）基金管理人的管理费

在通常情况下，该项费用按前一日的基金资产净值 1.5%的年费率计提，即本基金的管理费率为 1.5%。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

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

（2）基金托管人的托管费

在通常情况下，该项费用按前一日的基金资产净值 0.25%的年费率计提，即本基金的年

托管费率为 0.25%。计算方法如下：

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

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

(3) 上述“1、基金费用的种类”第 3 至 7 项费用根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额，由基金托管人从基金财产中支付。

(二) 与基金销售有关的费用

1、申购费用

集中申购期申购费率与日常申购费率一致。

(1) 场外申购费率

申购金额 M	费率
M < 50 万	1.50%
50 万 ≤ M < 200 万	1.00%
200 万 ≤ M < 500 万	0.60%
M ≥ 500 万	1000 元/笔

投资者多次申购，须按每次申购所对应的费率档次分别计费。当需要采取比例确认方式对有效申购金额进行部分确认时，投资者申购费率按照申购申请确认金额所对应的费率计算。

(2) 场内申购费率

深圳证券交易所会员单位应按照本基金招募说明书约定的场外集中申购费率设定投资者的场内集中申购费率。

(3) 本基金申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，在投资者申购基金份额时缴纳，用于市场推广、销售、登记结算等各项费用。

2、赎回费用

(1) 场外赎回费率

持有期限	赎回费率
1 年以内（不含 1 年）	0.50%
1 年到 2 年（不含 2 年）	0.25%
2 年（含 2 年）以上	0

通过跨市场转登记由场内转至场外的基金份额，其持有期限自转登记至场外的份额确认日起计算。

(2) 场内赎回费率

场内赎回费率为固定比例 0.5%。

(3) 赎回费的 25% 归入基金财产，其余用于支付注册登记费、销售手续费等各项费用。

(三) 不列入基金费用的项目

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

(四) 费率的调整

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

将来法律法规许可的情况下，本基金可以依法提取业绩报酬和/或业绩风险准备金。

基金管理人最迟应于新的费率或收费模式实施前 2 日在至少一种指定媒体上予以公告，并报中国证监会备案。

(五) 基金税收

本基金及基金份额持有人应依据国家有关规定依法纳税。

十九、基金收益与分配

(一) 基金收益的构成

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

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

(二) 基金净收益

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

(三) 基金收益分配原则

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

的分红方式为现金红利。

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

7、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

（四）基金收益分配方案

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

（五）基金收益分配方案的确定与公告

本基金收益分配方案由基金管理人拟定、由基金托管人核实后确定，基金管理人按法律法规的规定向中国证监会备案并公告。

（六）收益分配中发生的费用

1、收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用。

2、收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担；如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，注册登记机构自动将该基金份额持有人的现金红利按除权日的基金份额净值转为基金份额。

二十、基金的会计与审计

（一）基金会计政策

- 1、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；
- 2、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 3、会计制度执行国家有关会计制度；
- 4、本基金独立建账、独立核算；
- 5、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 6、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

（二）基金审计

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

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

3、基金管理人（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，须经基金托管人

（或基金管理人）同意，并报中国证监会备案后可以更换。更换会计师事务所在 2 日内公告。

二十一、基金的信息披露

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

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。

本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过至少一种指定媒体和基金管理人、基金托管人的互联网网站（以下简称“网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

（一）基金合同、基金托管协议、基金招募说明书

本基金合同、托管协议经中国证监会核准之后，基金管理人应当将基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应当将本基金合同、托管协议登载在各自公司网站上。

基金管理人应当在集中申购开始 3 日前，将招募说明书登载在指定报刊和网站上。

自本基金合同生效后，基金管理人应当在每 6 个月结束之日起 45 日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人应当在公告的 15 日前向中国证监会报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

（二）集中申购公告

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

（三）基金份额上市交易公告

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

（四）基金资产净值、基金份额净值公告

本基金合同生效后，在开始办理申购或赎回之前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

自开始办理申购或赎回之日起，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前述最后一个市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

（五）基金份额申购、赎回价格

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

（六）定期报告

基金定期报告由基金管理人按照法律法规和中国证监会颁布的有关证券投资基金信息披露内容与格式的相关文件的规定单独编制，由基金托管人按照法律法规的规定对相关内容进行复核。基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告。

1、基金年度报告：基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

2、基金半年度报告：基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定报刊上。

3、基金季度报告：基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定报刊和网站上。

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

（七）临时报告与公告

基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

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

- 1、基金份额持有人大会的召开；
- 2、终止基金合同；
- 3、转换基金运作方式；
- 4、更换基金管理人、基金托管人；
- 5、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 6、基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- 7、基金集中申购期延长或提前终止；
- 8、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- 9、基金管理人的董事在一年内变更超过 50%；
- 10、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过 30%；
- 11、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；

- 12、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- 13、基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
- 14、重大关联交易事项；
- 15、基金收益分配事项；
- 16、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 17、基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；
- 18、基金改聘会计师事务所；
- 19、基金变更、增加、减少基金代销机构；
- 20、基金更换基金注册登记机构；
- 21、基金开始办理申购、赎回；
- 22、基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- 23、基金发生巨额赎回并延期支付；
- 24、基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- 25、基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 26、中国证监会规定的其他事项。

（八）公开澄清

在基金合同期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

（九）中国证监会规定的其他信息

（十）本基金在条件成熟的情况下，为方便投资者，可增加信息披露的范围

（十一）信息披露文件的存放与查阅

本基金合同、托管协议、招募说明书、定期报告存放在基金管理人、基金托管人的住所，投资者可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复印件或复印件。

上市交易公告书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人的住所以及本基金上市交易的证券交易所，投资者可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上市交易公告书的复印件。

基金管理人和基金托管人保证上述存放文本的内容与所公告的内容完全一致。

二十二、风险揭示

（一）市场风险

本基金主要投资于证券市场，而证券市场价格受政治、经济、投资心理和交易制度等各种因素的影响会产生波动，从而对本基金投资产生潜在风险，导致基金收益水平发生波动。

1、政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家宏观经济政策的变化对证券市场产生一定影响，从而导致投资对象价格波动，影响基金收益而产生的风险。

2、经济周期风险

证券市场是国民经济的晴雨表，而经济运行则具有周期性的特点。随宏观经济运行的周期性变化，基金所投资于证券的收益水平也会随之变化，从而产生风险。

3、利率风险

金融市场利率的变化直接影响着债券的价格和收益率，也会影响企业的融资成本和利润，进而影响基金持仓证券的收益水平。

4、购买力风险

基金收益的一部分将通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而使购买力下降，从而使基金的实际投资收益下降。

5、国际竞争风险

随着中国市场开放程度的提高，上市公司的发展必然要受到国际市场同类技术或同类产品公司的强有力竞争，部分上市公司有可能不能适用新的行业形势而业绩下滑。尤其是中国加入 WTO 以后，中国境内公司将面临前所未有的市场竞争，上市公司在这些因素的影响下将存在更大不确定性。

6、上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素的影响，如管理能力、行业竞争、市场前景、技术更新、财务状况、新产品研究开发等都会导致公司盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。上市公司还可能出现难以预见的变化。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全避免。

（二）信用风险

基金交易对手方发生交易违约或者基金持仓债券的发行人拒绝支付债券本息，导致基金财产损失。

（三）管理风险

1、在基金管理运作过程中，基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等会影响其对信息的占有以及对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。

2、基金管理人和基金托管人的管理手段和管理技术等因素的变化也会影响基金收益水平。

（四）流动性风险

本基金为契约型开放式基金，资产规模将随着投资者对基金份额的申购和赎回而不断波动，若由于基金投资者的连续大量赎回，导致基金管理人的现金支付出现困难，或被迫在不

适当的价格大量抛售证券，使基金资产净值受到不利影响，从而产生流动性风险。

（五）本基金特有的风险

本基金坚持价值和成长相结合的投资理念，重视股票投资风险的防范。但是基于投资范围的规定，正常情况下，本基金股票投资比例最低将保持在 40%以上，无法完全规避股票市场的下跌风险。

（六）其他风险

- 1、因技术因素而产生的风险，如电脑系统不可靠产生的风险；
- 2、因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；
- 3、因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈等行为产生的风险；
- 4、对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；
- 5、因业务竞争压力可能产生的风险；
- 6、其他风险。

二十三、基金合同的变更、终止与基金财产清算

（一）基金合同的变更

变更基金合同应召开基金份额持有人大会，基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

但如属于基金合同第十二条第（一）款规定的不需召开基金份额持有人大会的情形，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案。

（二）基金的终止

有下列情形之一的，基金应当终止

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

（三）基金财产的清算

- 1、基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。

2、基金财产清算组

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

（2）基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的

注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

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

3、清算程序

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

4、清算费用

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

5、基金财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

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

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

6、基金财产清算的公告

基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告。

7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

二十四、基金合同内容摘要

（一）基金管理人的权利和义务

1、基金管理人的权利

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

信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

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

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

(4) 根据本基金合同规定销售基金份额；

(5) 提议召开基金份额持有人大会；

(6) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

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

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

(9) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；

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

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

(12) 《基金法》、《运作办法》、本基金合同以及其他法律法规规定的权利。

2、基金管理人的义务

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

(2) 办理基金备案登记手续；

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

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

(5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理

的基金财产和管理人的资产相互独立，保证不同基金在资产运作、财务管理等方面相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

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

（7）接受基金托管人依法进行的监督；

（8）采取适当合理的措施使计算基金份额申购、赎回价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，按规定计算并公告基金份额净值，确定基金份额申购、赎回价格；

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

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

（11）按基金合同规定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

（12）不谋求对上市公司的控制和直接经营管理；

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

（14）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（15）编制中期和年度基金报告；

（16）保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

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

（18）面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

（19）因违反《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他法律法规，导致基金财产损失或损害基金份额持有人合法权益的，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

（20）按照法律法规和本基金合同的规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

（21）确保向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间内发出；保证投资者能够按照基金合同规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并得到有关资料的复印件；

（22）不从事任何有损基金及本基金其他当事人利益的活动；

（23）负责为基金聘请注册会计师和律师；

(24) 由于基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金托管人追偿；

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

(26) 法律法规规定的其他义务。

(二) 基金托管人的权利和义务

1、基金托管人的权利

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

2、基金托管人的义务

(1) 基金托管人将遵守《基金法》、《运作办法》、本基金合同及其他相关法律法规，为基金份额持有人的最大利益处理基金事务；基金托管人保证恪尽职守，依照诚实信用、勤勉尽责的原则，谨慎、有效地持有并安全保管基金财产；

(2) 设有专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备有足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人固有资产以及不同的基金财产相互独立；对不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

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

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户，负责基金投资于证券的清算交割，执行基金管理人的投资指令，并负责办理基金名下的资金往来；

(7) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

（8）保守基金商业秘密，除《基金法》、本基金合同及其他法律法规另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；但因遵守和服从司法机构、中国证监会或其他监管机构的判决、裁决、决定、命令而做出的披露不应视为基金托管人违反本基金合同规定的保密义务；

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

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

（11）建立并保存基金份额持有人名册；

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

（13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

（14）负责基金的申购、赎回和基金转换的资金保管和清算；

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

（16）对基金财务会计报告、中期和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照本基金合同的规定进行，如果基金管理人未执行本基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

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

（18）按规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

（19）参加基金财产清算组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

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

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

（23）不从事任何有损基金及基金其他当事人利益的活动；

（24）法律法规规定的其他义务。

（三）基金份额持有人的权利和义务

1、基金份额持有人权利

每份基金份额具有同等的合法权益。

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

(2) 按本基金合同的规定取得基金收益；

(3) 监督基金经营情况，查询或获取公开的基金业务及财务状况的资料；

(4) 依法转让或申请赎回其持有的基金份额；

(5) 参与分配基金清算后的剩余基金财产；

(6) 要求基金管理人或基金托管人按法律法规、本基金合同以及依据本基金合同制定的其他法律文件的规定履行其义务；

(7) 依照本基金合同的规定，要求召开基金份额持有人大会；

(8) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

(9) 监督基金管理人的投资运作；

(10) 对基金管理人、基金托管人、基金份额销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；

(11) 《基金法》、《运作办法》、本基金合同以及其他法律法规规定的权利。

2、基金份额持有人义务

(1) 遵守本基金合同；

(2) 交纳基金申购款项等，并承担基金合同规定的其他费用；

(3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者终止的有限责任；

(4) 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人利益的活动；

(5) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

(四) 基金份额持有人大会

1、召开事由

(1) 有以下情形之一的，应召开基金份额持有人大会：

① 修改基金合同（基金合同中约定可由基金管理人和基金托管人协商后修改而无需召开基金份额持有人大会的情形除外）；

② 变更基金类别；

③ 变更基金的投资目标、投资范围和投资策略；

④ 变更基金份额持有人大会程序；

⑤ 更换基金管理人、基金托管人；

- ⑥ 终止基金合同；
- ⑦ 与其他基金合并；
- ⑧ 转换基金运作方式；
- ⑨ 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- ⑩ 法律法规及中国证监会规定的其他情形。

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

- ① 调低基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- ② 在基金合同约定的范围内变更本基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
- ③ 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- ④ 对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- ⑤ 对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- ⑥ 按照法律法规或基金合同规定不需要召开基金份额持有人大会的其他情形。

2、召集方式

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

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

（3）基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

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

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

的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

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

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

3、通知

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

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

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

4、会议召开方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会与通讯方式开会。

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

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

- （1）现场开会。

由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席，基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席；

现场开会并符合下列条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

① 本人出席会议者持有本基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有本基金份额的凭证及委托人的授权委托书应符合法律法规、本基金合同和会议通知的规定；

② 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额为本基金在权益登记日基金总份额的 50% 以上。

（2）通讯方式开会

通讯方式开会应以书面方式进行表决。符合以下条件的通讯开会有效：

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

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

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

④ 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人提交的持有本基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有本基金份额的凭证及委托人的授权委托书应符合法律法规、本基金合同和会议通知的规定；

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

⑥ 会议通知已报中国证监会备案。

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

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

5、议事内容与程序

（1）议事内容及提案权

议事内容限为本条前述第（一）款规定的基金份额持有人大会召开事由范围内的事项。

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日基金总份额 10% 以上基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议

表决的提案。

大会召集人在会议通知公告前应当按照以下原则对提案进行审核：

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

② 程序性。大会召集人可以对提案涉及的程序性问题做出决定。如将提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，召集人可就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

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

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

（2）议事程序

① 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第（七）款规定的程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人未能主持大会的情况下，由基金托管人授权出席会议的代表主持；如果基金管理人和基金托管人均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人以所代表的基金份额 50%以上多数选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。

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

② 通讯方式开会

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

6、表决

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

（2）基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

① 一般决议

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

② 特别决议

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

（3）基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

（5）基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

（6）基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。

7、计票

（1）现场开会

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

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

③ 如果会议主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果会议主持人未进行重新清点，而出席会议的基金份额持有人或者基金份额持有人的代理人对

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

④ 计票过程应由公证机关予以公证。

（2）通讯方式开会

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

8、生效与公告

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

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决定。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在至少一种指定媒体上公告。

（五）基金合同的变更、终止与基金财产的清算

1、基金合同的变更

变更基金合同应召开基金份额持有人大会，基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

但如属于本基金合同第十二条第（一）款规定的不需召开基金份额持有人大会的情形，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案。

2、基金的终止

有下列情形之一，基金应当终止

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

3、基金财产的清算

（1）基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。

（2）基金财产清算组

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

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

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

（3）清算程序

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

（4）清算费用

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

（5）基金财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

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

基金财产未按前款①、②、③小项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

（6）基金财产清算的公告

基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告。

（7）基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

（六）争议的处理

1、本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

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

力。

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

（七）基金合同存放地及投资者取得基金合同的方式

本基金合同、托管协议、招募说明书、定期报告存放在基金管理人、基金托管人的住所，投资者可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复印件或复印件。

基金管理人和基金托管人保证上述存放文本的内容与所公告的内容完全一致。

二十五、基金托管协议的内容摘要

（一）托管协议当事人

1、基金管理人（或简称“管理人”）

名称：大成基金管理有限公司
住所：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层
法定代表人：张树忠
成立时间：1999 年 4 月 12 日
批准设立机关：中国证券监督管理委员会
批准设立文号：中国证监会证监基金字【1999】10 号
组织形式：有限责任公司
注册资本：贰亿元人民币
经营范围：基金管理业务、发起设立基金；及中国证监会批准的其他业务
存续期间：持续经营

2、基金托管人（或简称“托管人”）

名称：中国农业银行
住所：北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址：北京市海淀区西三环北路 100 号金玉大厦
法定代表人：项俊波
成立时间：1979 年 2 月 23 日
注册资金：361 亿元人民币
批准设立机关及批准设立文号：国发（1979）056 号
组织形式：国有独资企业
注册资金：361 亿元人民币
存续期间：持续经营

（二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

1、基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：

（1）对基金的投资范围、投资对象进行监督。

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

本基金股票投资比例范围为基金资产的 40%—95%；现金和固定收益类证券投资比例范围为基金资产的 5%—60%，其中资产支持证券投资比例范围为 0—20%，现金和到期日在一年以内的政府债券等短期金融工具的投资比例不低于基金资产净值的 5%。

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

（2）对基金投融资比例进行监督，基金托管人按下述比例和调整期限进行监督。

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

② 本基金持有一家上市公司的股票，不超过基金资产净值的 10%；

③ 本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券总和，不超过该证券的 10%；

④ 本基金投资于股权分置改革中发行的权证，在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

⑤ 本基金持有的全部权证市值不得超过基金资产净值的 3%；

⑥ 本基金与本基金管理人管理的其他基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

⑦ 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

⑧ 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

⑨ 本基金与本基金管理人管理的其他基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

⑩ 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

(11) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

(12) 遵守法律法规及中国证监会规定的其他限制。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 3 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人以外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

如果法律法规或监管机构变更或取消上述强制性规定的，本基金将相应变更或取消上述强制性规定，不需经基金份额持有人大会审议。

(3) 对基金投资禁止行为进行监督。为对基金禁止从事的关联交易进行监督，基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单；

(4) 基金托管人根据有关法律法规的规定和基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应向基金托管人提供其银行间债券市场交易的交易对手库，基金托管人对基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手是否符合交易对手库进行监督；基金托管人对银行间债券市场交易的交易方式（如见券付款、见款付券）的控制是否符合基金合同的约定进行监督；

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

(6) 对法律法规规定及基金合同约定的基金投资的其他方面进行监督。

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

如果基金管理人未经基金托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推介材料上，则基金托管人不承担任何责任，并将在发现后立即报告中国证监会。

3、基金托管人在上述第 1、2 项的监督和核查中发现基金管理人违反法律法规的规定及基金合同的约定，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应及时向中国证监会报告。

4、基金托管人发现基金管理人的投资指令违反《基金法》、基金合同、本托管协议及其他有关规定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

5、基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，包括但不限于：在规定时间内答复基金托管人并改正，就基金托管人的疑义进行解释或举证，对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

（三）基金管理人对于基金托管人的业务核查

1、基金管理人对于基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、变更和管理基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

2、基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本托管协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。

3、基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

（四）基金财产的保管

1、基金财产保管的原则

（1）基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

（2）基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人的合法合规指令或法律法规、基金合同及本托管协议另有规定，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。

（3）基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。

（4）除依据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关法律法规规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

2、基金银行账户的变更和管理

（1）基金托管人应负责本基金银行账户的变更和管理。

(2) 基金托管人以本基金的名义变更原封闭式基金的银行账户资料。本基金的银行预留印鉴，由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的银行账户进行。

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

(4) 基金银行账户的管理应符合《中华人民共和国票据法》、《人民币结算银行账户管理办法》、《现金管理条例》、《人民币利率管理规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及其他有关规定。

3、基金进行定期存款投资的账户开设和管理

基金托管人可根据基金管理人的指令以基金名义在基金托管人认可的本托管协议第三条所述存款银行名单中的银行的指定营业网点开设存款账户，并负责该账户的日常管理以及银行预留印鉴的保管和使用。基金管理人应派专人协助办理开户事宜。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中，基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料，并对基金托管人给予积极配合和协助。

4、基金证券账户和资金账户的变更和管理

(1) 基金托管人应当代表本基金，以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司变更证券账户的资料。

(2) 本基金证券账户的使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经另一方同意擅自转让本基金的证券账户；亦不得使用本基金的证券账户进行本基金业务以外的活动。

(3) 基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的全部基金在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

(4) 在本托管协议生效日之后，本基金被允许从事其他投资品种的投资业务的，涉及相关账户的开设、使用的，若无相关规定，则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

(5) 法律法规对基金证券账户和资金账户的变更和管理另有规定的，本基金从其规定。

5、债券交易账户和托管专户的变更和管理

基金合同生效后，基金管理人负责以基金的名义在全国银行间同业拆借中心变更银行间

债券市场债券交易账户的资料，并代表基金进行交易；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司变更银行间债券市场债券托管账户，并代表基金进行债券和资金的清算。在上述手续办理完毕之后，由基金托管人负责向中国人民银行报备。

6、基金财产投资的有关有价凭证的保管

实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人存放于托管银行的保管库，但要与非基金的其他有价凭证分开保管。保管凭证由基金托管人持有。

7、与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

基金托管人按照法律法规保管由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同及有关凭证，但相关业务程序另有限制的除外。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应及时将合同正本提交给基金托管人。除本托管协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时一般应保证基金一方持有 2 份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有 1 份正本的原件。上述合同的保管期限按照国家有关规定执行。

（五）基金资产净值计算和会计核算

1、基金资产净值的计算和复核

（1）基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日发售在外的该基金份额总数后的价值。

（2）基金管理人应在每个相关的证券交易场所的正常营业日对基金财产估值。估值原则应符合基金合同、《证券投资基金会计核算办法》及其他法律法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个开放日结束后计算得出当日的该基金份额净值，并在盖章后以传真方式发送给基金托管人。基金托管人应在收到上述传真后对净值计算结果进行复核，并在盖章后以传真方式将复核结果传送给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

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

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

（5）当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后 3 位内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的

措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。

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

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

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

2、基金会计核算

（1）基金账册的建立

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

（2）会计数据和财务指标的核对

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

（3）基金财务报表和定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月独立编制。月度报表的编制，基金管理人应于每月终了后 5 日内完成；招募说明书在基金合同生效后每 6 个月更新并公告一次，于该等期间届满后 45 日内公告。季度报告应在每个季度结束之日起 10 个工作日内编制完毕并于

每个季度结束之日起 15 个工作日内予以公告；半年度报告在会计年度半年终了后 40 日内编制完毕并于会计年度半年终了后 60 日内予以公告；年度报告在会计年度结束后 60 日内编制完毕并于会计年度终了后 90 日内予以公告。基金合同生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

基金管理人在月度报表完成当日，将报表盖章后提供给基金托管人复核；基金托管人在收到后应在 2 日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 7 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在半年度报告完成当日，将有关报告提供给基金托管人复核，基金托管人应在收到后 30 日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人应在收到后 45 日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人和基金托管人之间的上述文件往来均以加密传真的方式或双方商定的其他方式进行。

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

（六）基金份额持有人名册的保管

1、基金份额持有人名册的内容

基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册包括以下几类：

- （1）基金权益登记日的基金份额持有人名册
- （2）基金份额持有人大会权益登记日的基金份额持有人名册
- （3）每个交易日的基金份额持有人名册。

2、基金份额持有人名册的保管

基金管理人有权利并有义务持续保管基金份额持有人名册，保管期限不少于 15 年。基金管理人委托其他合格机构担任注册登记机构时，可委托该注册登记机构承担基金份额持有人名册的持续保管义务。注册登记机构对基金份额持有人名册的保管，按国家法律法规及相关监管机构的要求执行。

基金管理人或基金管理人委托的注册登记机构在本基金续存期内，应采用电子或者书面的形式按时向基金托管人提供基金年中持有人名册和年度持有人名册。当年的年中持有人名册应于当年 6 月 30 日后的 10 个工作日内提供；当年的年度持有人名册应于当年 12 月 31 日后的 10 个工作日内提供。对于基金权益登记日的基金份额持有人名册以及基金份额持有人大会权益登记日的基金份额持有人名册，基金管理人或其委托的注册登记机构应采用电子或者书面的形式在相关名册生成后的 5 个工作日内向基金托管人提供。除上述约定时间外，如果确因业务需要，基金托管人与基金管理人商议一致后，由基金管理人或其委托的注册登记机构向基金托管人提供由注册登记机构编制的基金份额持有人名册。

基金托管人应根据基金管理人提供的持有人名册建立基金持有人名册档案并妥善保管，保管期限不少于 15 年。基金管理人和基金托管人未能妥善保存基金份额持有人名册给基金份额持有人造成损失的，应当按照有关法律法规的规定，承担相应责任。基金托管人只能将基金份额持有人名册用于履行本托管协议约定的目的，不得为其他任何目的使用基金份额持有人名册。

（七）适用法律与争议解决方式

- 1、本托管协议适用中华人民共和国法律并从其解释。
- 2、基金管理人与基金托管人之间因本托管协议产生的或与本托管协议有关的争议可通过友好协商解决。但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，根据提交仲裁时该会的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。
- 3、除争议所涉的内容之外，本托管协议的当事人仍应履行本托管协议的其他规定。

（八）托管协议的效力和文本

- 1、本托管协议由《景博证券投资基金托管协议》修订而成。本托管协议经基金管理人和基金托管人盖章以及双方法定代表人或其授权代表签字，报中国证监会核准后，自基金合同生效之日起生效，《景博证券投资基金托管协议》自同一日起失效。
- 2、本托管协议的有效期自其生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。
- 3、本托管协议自生效之日对双方当事人具有同等的法律约束力。
- 4、本托管协议正本一式 6 份，协议双方各执 2 份，上报中国证监会和中国银监会各 1 份，每份具有同等法律效力。

（九）托管协议的变更与终止

1、托管协议的变更

本托管协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行变更。变更后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。变更后的新协议，应当报中国证监会核准。

2、托管协议的终止

发生以下情况，本托管协议终止：

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

二十六、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务，并将根据基金份额持有人的需要和市场的变化增加、修订这些服务项目。

（一）服务内容

1、基金份额持有人注册登记服务

基金管理人委托注册登记机构为基金份额持有人提供注册登记服务。基金注册登记机构配备安全、完善的电脑系统及通讯系统，准确、及时地为基金投资者办理基金账户、基金份额的登记、管理、托管与转托管，持有人名册的管理，权益分配时红利的登记、派发，基金交易份额的清算过户和基金交易资金的交收等服务。

2、红利再投资服务

若基金份额持有人选择红利再投资形式进行基金收益分配，该持有人当期分配所得基金收益将按除权日的基金份额净值自动转基金份额，且不收取任何申购费用。

3、定期定额投资计划

基金管理人已开通部分代销网点为投资者提供定期定额投资的服务。通过定期定额投资计划，投资者可以通过固定的渠道，定期定额申购基金单位，该定期申购计划不受最低申购金额的限制，以另行公告为准。

4、持有人专项理财服务

基金管理人通过 4 个平台为基金份额持有人提供专项理财服务，包括满意理财热线、

大成绿色通道、基金 E 点通和财富俱乐部。

“满意理财热线”为基金份额持有人提供专业化的人工服务和 7×24 小时自助语音查询服务。基金份额持有人可在工作时间选择人工查询、咨询、信息定制、投诉建议服务，也可选择基金管理人客服热线自助语音系统查询基金净值、账户情况、公司介绍等服务。

“大成绿色通道”为基金份额持有人定期邮寄对账单服务。每季度结束后 20 个工作日内，基金管理人将向在最近一季度内发生交易的基金份额持有人邮寄该份额持有人最近一季度基金交易对账单，记录该份额持有人最近一季度内所有申购、赎回、非交易过户等交易发生的时间、金额、数量、价格以及当前账户的余额等。每年度结束后 30 个工作日内，基金管理人将向所有基金份额持有人寄送账户状况对账单。“大成绿色通道”同时提供理财期刊定期送阅服务，基金管理人出版《大成理财》等专业理财刊物供基金份额持有人订阅。

“基金 E 点通”为基金份额持有人开通了短信服务定制平台、电子对账单及电子刊物订阅平台、网站留言互动平台和网上交易平台等。通过先进的网络通讯技术，为基金份额持有人提供高效安全的基金交易服务、及时迅捷的基金信息和理财服务。

“财富俱乐部”是为基金份额持有人中的高端客户专门设立的服务体系，将为优质客户提供专项的个性化服务。

（二）联系方式

1、大成基金管理有限公司客服热线：400-888-5558、021-53599588-#

2、大成基金管理有限公司网址：www.dcfund.com.cn

3、大成基金管理有限公司投资理财中心电话：

深圳：0755-83195090/5236

北京：010-85252345/46

上海：021-63513925/26

二十七、其他应披露的事项

（一）本基金管理人、基金托管人的托管业务部门目前无重大诉讼事项。

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

（三）2008 年 6 月 13 日至 2008 年 12 月 12 日发布的公告：

- 1、2008年6月17日《大成基金管理有限公司通过中国银行开办定投及网上银行交易费率优惠的公告》。
- 2、2008年7月9日《大成基金管理有限公司关于在民生银行开通基金定期定额投资计划的公告》。
- 3、2008年7月18日《大成创新成长混合型证券投资基金2008年第二季度报告》。
- 4、2008年7月22日《大成基金管理有限公司增加广东发展银行为代销机构的公告》。
- 5、2008年7月26日《大成创新成长混合型证券投资基金更新的招募说明书》。
- 6、2008年8月2日《大成基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告》。
- 7、2008年8月23日《大成基金管理有限公司关于变更基金经理的公告》。
- 8、2008年8月25日《大成创新成长混合型证券投资基金2008年半年度报告》。
- 9、2008年8月29日《大成基金管理有限公司关于调整中国农业银行借记卡网上直销申购费率的公告》。
- 10、2008年9月16日《大成基金管理有限公司调整持有长期停牌股票估值方法的公告》。
- 11、2008年9月17日《大成基金管理有限公司关于旗下基金估值方法调整后的净值变动情况公告》。
- 12、2008年10月24日《大成创新成长混合型证券投资基金_LOF_2008年第三季度报告》。
- 13、2008年10月30日《大成基金管理有限公司关于增加方正证券有限责任公司为代销机构的公告》。
- 14、2008年10月31日《大成基金管理有限公司增加长城证券有限责任公司为基金代销机构的公告》、《大成基金管理有限公司参加上海浦东发展银行基金定投申购优惠活动的公告》。
- 15、2008年11月13日《大成基金管理有限公司关于增加恒泰证券股份有限公司为基金代销机构的公告》、《大成基金管理有限公司关于增加宏源证券股份有限公司为基金代销机构的公告》。
- 16、2008年11月20日《大成基金管理有限公司旗下基金持有的停牌股票复牌后估值方法的公告》。
- 17、2008年12月3日《大成基金管理有限公司关于增加瑞银证券有限责任公司为基金代销机构的公告》。
- 18、2008年12月11日《大成基金管理有限公司关于增加中国国际金融有限公司为基

金代销机构的公告》、《大成基金管理有限公司关于增加国都证券有限责任公司为基金代销机构的公告》。

（四）在此之前公告的招募说明书及更新的招募说明书与本更新的招募说明书内容若有不一致之处，以本更新的招募说明书为准。

二十八、招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求,对 2008 年 7 月 26 日公布的《大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）更新的招募说明书（2008 年第 1 期）》进行了更新,并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新,主要更新的内容如下:

- 1、根据最新情况，对“三、基金管理人”部分内容进行了更新。
- 2、根据最新情况，对“四、基金托管人”部分内容进行了更新。
- 3、根据相关公告，对“五、相关服务机构”等相关信息进行了更新。
- 4、根据相关财务数据，对“十三、基金的投资”的“（十一）投资组合报告”进行了更新。
- 5、根据相关财务数据，对“十四、基金的业绩”进行了更新。
- 6、根据最新情况，对“十七、基金资产估值”的“（四）估值原则”进行了更新。
- 7、根据相关公告，对“二十五、基金托管协议的内容摘要”部分内容进行了更新。
- 8、根据相关公告，对“二十七、其他应披露的事项”进行了更新，补充了 2008 年 6 月 13 日至 2008 年 12 月 12 日发布的公告。

二十九、招募说明书的存放及查阅方式

（一）招募说明书的存放地点

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

（二）招募说明书的查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅本基金的招募说明书，也可按工本费购买本招募说明书的复印件，但应以本基金招募说明书的正本为准。

三十、备查文件

备查文件等文本存放在基金管理人、基金托管人和销售机构的办公场所和营业场所，在办公时间内可供免费查阅。

- （一）景博证券投资基金基金份额持有人大会决议公告
- （二）中国证监会《关于核准景博证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》
- （三）《大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）基金合同》
- （四）《大成创新成长混合型证券投资基金（LOF）托管协议》
- （五）法律意见书
- （六）基金管理人业务资格批件、营业执照
- （七）基金托管人业务资格批件、营业执照
- （八）中国证监会要求的其他文件

大成基金管理有限公司

2009年2月2日