
大成蓝筹稳健证券投资基金

基金合同

基金发起人：大成基金管理有限公司

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

二〇〇九年六月更新

目 录

一、前 言.....	1
二、释 义.....	1
三、基金合同当事人及权利义务.....	3
四、基金份额持有人大会.....	10
五、基金管理人、基金托管人的更换条件与程序.....	16
六、基金的基本情况.....	17
七、基金的设立募集.....	18
八、基金的成立.....	18
九、基金的申购与赎回.....	19
十、基金的非交易过户与转托管.....	24
十一、基金资产的托管.....	26
十二、基金的销售与注册登记.....	26
十三、基金的投资.....	27
十四、基金资产与基金资产估值.....	31
十五、基金费用与税收.....	35
十六、基金收益与分配.....	36
十七、基金的会计与审计.....	37
十八、基金的信息披露.....	37
十九、基金的终止与清算.....	39
二十、业务规则.....	40
二十一、违约责任与争议处理.....	40
二十二、基金合同的效力.....	41
二十三、基金合同的修改与终止.....	42
二十四、其他事项.....	42
二十五、基金合同当事人盖章及法定代表人或授权代表签字、签约地、签订日	43

一、前言

为保护基金投资者合法权益，明确基金合同当事人的权利与义务，规范基金运作，依照《证券投资基金管理暂行办法》（以下简称“《暂行办法》”）、《开放式证券投资基金试点办法》（以下简称“《试点办法》”）和其他有关规定，在平等自愿、诚实信用、充分保护基金投资者合法权益的原则基础上，订立《大成蓝筹稳健证券投资基金基金合同》（以下简称“本基金合同”）。

本基金合同是规定本基金合同当事人之间基本权利义务的法律文件。本基金合同的当事人包括基金发起人、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金发起人、基金管理人和基金托管人自本基金合同签订并生效之日起成为本基金合同的当事人。基金投资者自取得依据本基金合同发行的基金单位时起，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人。本基金合同的当事人按照《暂行办法》、《试点办法》、本基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

大成蓝筹稳健证券投资基金（以下简称“本基金”）由基金发起人按照《暂行办法》、《试点办法》、本基金合同及其他有关规定设立，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）批准。

中国证监会对本基金设立的批准，并不表明其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。

基金管理人保证依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但由于证券投资具有一定的风险，因此不保证本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益。

二、释义

本基金合同中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- | | |
|--------------------|--|
| 基金或本基金： | 指大成蓝筹稳健证券投资基金； |
| 基金合同或本基金合同： | 指本《大成蓝筹稳健证券投资基金基金合同》及基金合同当事人对其不时做出的修订； |
| 招募说明书： | 指《大成蓝筹稳健证券投资基金招募说明书》； |
| 托管协议： | 指《大成蓝筹稳健证券投资基金托管协议》； |
| 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； |

《信托法》:	指《中华人民共和国信托法》;
《暂行办法》:	指 1997 年 11 月 14 日经国务院批准发布实施的《证券投资基金管理暂行办法》及颁布机关对其不时作出的修订;
《试点办法》:	指 2000 年 10 月 8 日由中国证监会发布并实施的《开放式证券投资基金试点办法》及颁布机关对其不时作出的修订;
基金合同当事人:	指受基金合同约束,根据本基金合同享有权利并承担义务的基金发起人、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人;
基金发起人:	指大成基金管理有限公司;
基金管理人:	指大成基金管理有限公司;
基金托管人:	指中国银行股份有限公司;
个人投资人:	指合法持有现时有效的中华人民共和国居民身份证、军官证、士兵证、警官证的中国居民
机构投资者:	指在中国境内合法注册登记或经相关政府部门批准设立、并依据有关法律法规及其他有关规定可以投资于基金的企业法人、事业法人、社会团体或其它组织以及合资格境外机构投资者
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,经中国证监会批准投资于中国证券市场,并取得国家外汇管理局额度批准的中国境外基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构;
注册登记业务:	指本基金登记、存管、清算和交收业务,具体内容包括持有人基金账户管理、基金单位注册登记、清算及基金交易确认、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等;
注册登记代理机构:	指接受基金管理人委托代为办理本基金注册登记业务的机构;
注册登记人:	指办理本基金注册登记业务的机构,本基金的注册登记机构为大成基金管理有限公司或注册登记代理机构;
基金成立日:	指基金达到成立条件后,基金发起人宣告基金成立的日期;
设立募集期:	指自招募说明书公告之日起到基金成立日的时间段,最长不超过 3 个月;
认购:	指在本基金设立募集期内,投资者申请购买本基金基金单位的行为;
申购:	指在本基金成立后,投资者申请购买本基金基金单位的行为;
赎回:	指基金份额持有人按本基金合同规定的条件,要求基金管理人购回本基金基金单位的行为;
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某一基金(包括本基金)的基金单位转为基金管理人管理的、由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金(包括本基金)的基金单位的行为;
销售代理人:	指接受基金管理人委托代为办理本基金的认购、申购、赎回、转换及转托管等业务的机构;

销售机构：	指基金管理人及销售代理人；
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单位余额及其变动情况的账户；
交易账户：	指销售机构为基金投资者开立的记录其持有的由该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务的基金单位余额及其变动情况的账户；
转托管：	指基金份额持有人申请将其在某一销售机构交易账户持有的基金单位全部或部分转出并转入另一销售机构交易账户的行为；
存续期：	指基金成立并存续的不定期期限；
工作日：	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日；
开放日：	指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日；
天/月	指公历天/月
T 日：	指销售机构在规定时间受理投资者申购、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
元：	指人民币元；
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：	指基金购买的各类证券、银行存款本息及其他投资等的价值总和；
基金资产净值：	指基金资产总值减去负债后的价值；
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单位净值的过程；
公开说明书：	指本基金成立后每 6 个月公告一次的有关基金概要、基金投资组合、基金经营业绩、重要变更事项和其他按法律规定应披露事项的说明书。公开说明书是对招募说明书的定期更新。

三、基金合同当事人及权利义务

（一）基金发起人

1、基金发起人简况

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

法定代表人：张树忠

成立时间：1999 年 4 月 12 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1999]10 号

经营范围：发起设立基金；基金管理及中国证监会批准的其他业务

组织形式：有限责任公司

注册资本：2 亿元人民币

存续期间：持续经营

2、基金发起人的权利义务

（1）基金发起人的权利

- ①申请设立基金；
- ②在基金设立时认购并在存续期间持有基金单位；
- ③法律、法规和基金合同规定的其他权利。

（2）基金发起人的义务

- ①遵守基金合同；
- ②公告招募说明书；
- ③不从事任何有损基金及本基金其他当事人利益的活动；
- ④基金不能成立时按规定退还所募集资金本息、承担发行费用；
- ⑤法律、法规和基金合同规定的其他义务。

（二）基金管理人

1、基金管理人简况

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

法定代表人：张树忠

成立时间：1999 年 4 月 12 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1999]10 号

经营范围：发起设立基金；基金管理及中国证监会批准的其他业务

组织形式：有限责任公司

注册资本：2 亿元人民币

存续期间：持续经营

2、基金管理人的权利

（1）自基金成立之日起，基金管理人依照诚实信用、勤勉尽责的原则，谨慎、有效管理和运用基金资产；

（2）根据本《基金合同》的规定，制订并公布有关基金募集、认购、申购、赎回、转托管、非交易过户、冻结、质押、收益分配等方面的业务规则；

（3）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认购费、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；

（4）根据本《基金合同》规定销售基金单位；

(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) 依据本《基金合同》及有关法律规定的监督基金托管人，如认为基金托管人违反了本《基金合同》或国家有关法律规定，并对基金资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，或采取其它必要措施保护基金投资者的利益；

(8) 选择、更换基金销售代理人，对基金销售代理人行为进行必要的监督和检查；如果基金管理人认为基金销售代理人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，以保护基金资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) 以基金的名义依法为基金进行融资，并以相应基金财产履行偿还融资和支付利息的义务；

(11) 依据本《基金合同》的规定，决定基金收益的分配方案；

(12) 按照《暂行办法》、《试点办法》，代表基金对被投资公司行使股东权利；

(13) 法律、法规、本《基金合同》以及依据本《基金合同》制订的其他法律文件所规定的其他权利。

3、基金管理人的义务

(1) 遵守基金合同；

(2) 自基金成立之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产；

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

(4) 不谋求对上市公司的控制和直接管理；

(5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金资产和基金管理人的资产相互独立，保证不同基金在资产运作、财务管理等方面相互独立；

(6) 除依据《暂行办法》、《试点办法》、基金合同及其他有关规定外，不得委托其他人运作基金资产；

(7) 接受基金托管人依法进行的监督；

(8) 按照规定计算并公告基金单位净值；

(9) 严格按照《暂行办法》、《试点办法》、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，不泄露基金投资计划、投资意向等。除法律法规、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，不向他人泄露；

(11) 按基金合同规定向基金份额持有人分配基金收益；

(12) 依据《暂行办法》、《试点办法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会；

(13) 负责基金注册登记。基金管理人应严格按照有关法律法规及本基金合同，办理或委托其他机构办理本基金的注册登记业务；

(14) 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、足额支付赎回和分红款项；

(15) 保管基金的会计账册、报表、记录 15 年以上；

(16) 参加基金清算小组，参与基金资产保管、清理、估价、变现和分配；

(17) 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；

(18) 因过错导致基金资产的损失，承担赔偿责任，其过错责任不因其退任而免除；

(19) 基金托管人因过错造成基金资产损失时，基金管理人应为基金向基金托管人追偿；

(20) 确保向基金投资人提供的各项文件或资料在规定时间内发出；保证投资人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；

(21) 不从事任何有损基金及本基金其他当事人利益的活动；

(22) 负责为基金聘请注册会计师和律师；

(23) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

(三) 基金托管人

1、基金托管人简况

名称：中国银行股份有限公司

注册地址：北京西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：北京西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：肖钢

成立日期：1983 年 10 月 31 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；

从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；居民储蓄业务；外汇存款；外汇汇款；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经批准的其他业务。

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元

存续期间：持续经营

2、基金托管人的权利

- (1) 依法持有并保管基金的资产；
- (2) 依照《基金合同》的约定获得基金托管费；
- (3) 监督基金的投资运作；
- (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《基金合同》的有关规定，应呈报中国证监会和中国银监会，并采取必要措施保护基金投资人的利益。除非法律法规、《基金合同》及《托管协议》规定，否则，基金托管人对基金管理人的行为不承担任何责任；

(6) 有权对基金管理人的违法、违规投资指令不予执行，并向中国证监会报告；

(7) 法律、法规、《基金合同》以及依据本《基金合同》制定的其他法律文件所规定的其他权利。

3、基金托管人的义务

(1) 基金托管人将遵守《信托法》、《暂行办法》、《试点办法》、《基金合同》及其他有关规定，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、有效地持有并保管基金资产；

(2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金资产托管事宜；建立健全内部风险监控制度，对负责基金资产托管的部门和人员的行为进行事先控制和事后监督，防范和减少风险；

(3) 购置并保持对于基金资产的托管所必要的设备和设施（包括硬件和软件），并对设备和设施进行维修、维护和更换，以保持设备和设施的正常运行；

(4) 建立健全内部控制制度, 确保基金资产的安全, 保证其托管的基金资产与基金托管人自有资产相互独立, 保证其托管的基金资产与其托管的其他基金资产相互独立; 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;

(5) 除依据《信托法》、《暂行办法》、《试点办法》、本《基金合同》及其他有关规定外, 不为自己及任何第三人谋取利益, 基金托管人违反此义务, 利用基金资产为自己及任何第三方谋取利益, 所得利益归于基金资产, 造成基金资产损失的, 承担赔偿责任;

基金托管人不得将任何基金资产转为其自有财产, 违背此款规定的, 将承担相应的责任, 包括但不限于恢复所涉及的基金资产的原状、承担赔偿责任;

(6) 除依据《信托法》、《暂行办法》、《试点办法》、本《基金合同》及其他有关规定外, 基金托管人不得委托第三人托管基金资产;

(7) 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;

(8) 为基金设立证券账户、银行存款账户等基金资产账户, 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, 负责办理基金名下的资金往来;

(9) 对基金商业秘密和基金份额持有人、投资者进行基金交易有关情况负有保密义务, 不泄露基金投资计划、投资意向及基金份额持有人或投资者的相关情况资料等; 除《信托法》、《暂行办法》、《试点办法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外, 在基金信息公开披露前予以保密, 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、命令而作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;

(10) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值及本基金的基金份额净值;

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

(12) 负责基金的认购、申购、赎回和基金转换的资金保管和清算;

(13) 采取适当、合理的措施, 使基金单位的认购、申购、赎回和基金转换等事项符合本《基金合同》等有关法律文件的规定;

(14) 采取适当、合理的措施, 使基金投资和融资条件以及使基金管理人用以计算开放式基金单位认购、申购、赎回和基金转换的方法符合法律法规和本《基金合同》等法律文件的规定;

(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) 在定期报告内出具基金托管人意见, 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) 保存基金会计账册、报表和其他有关基金托管事务的完整记录等 15 年以上；

(18) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(19) 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；

(20) 参加基金清算小组，参与基金资产保管、清理、估价、变现和分配；

(21) 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；

(22) 基金管理人因过错造成基金资产损失时，基金托管人应为基金向基金管理人追偿；

(23) 因过错导致基金资产的损失或因违背托管职责或者处理基金事务不当对第三人所负债务或者自己受到的损失，应以其自有财产承担，其责任不因其退任而免除；

(24) 不从事任何有损基金及基金其他当事人利益的活动；

(25) 法律、法规、本《基金合同》和依据本《基金合同》制定的其他法律文件所规定的其他义务。

(四) 基金份额持有人

基金投资者购买本基金基金单位的行为即视为对本基金合同的承认和接受，基金投资者自取得依据本基金合同发行的基金单位，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人。基金份额持有人作为当事人并不以在本基金合同上书面签章为必要条件。

1、基金份额持有人的权利

(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) 申购或赎回基金单位；

(5) 在不同的基金直销或代销机构之间转托管；

(6) 获取基金清算后的剩余资产；

(7) 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；

(8) 依照本合同的规定，召集基金份额持有人大会；

(9) 要求基金管理人或基金托管人及时依据法律法规、本《基金合同》以及

依据本《基金合同》制定的其他法律文件行使权利、履行义务；

(10) 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规定的其他权利。

2、基金份额持有人的义务

- (1) 遵守基金合同；
- (2) 缴纳基金认购、申购款项，承担基金合同规定的费用；
- (3) 以其对基金的投资额为限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本基金其他当事人利益的活动；
- (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

(一) 召开事由

1、有以下情形之一的，应召开基金份额持有人大会：

- (1) 修改基金合同（基金合同中约定可由基金管理人和基金托管人协商后修改而无需召开基金份额持有人大会的情形除外）；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 提前终止基金合同；
- (5) 与其它基金合并；
- (6) 代表基金总份额 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；
- (7) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (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；
- (10) 法律、法规及中国证监会规定的其他情形。

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

- (1) 调低基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- (2) 在基金合同约定的范围内变更本基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
- (3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

- (4) 对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- (5) 对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- (6) 按照法律法规或基金合同规定不需要召开基金份额持有人大会的其他情形。

(二) 召集方式

1、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；

2、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

3、代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额百分之十以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开。

4、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，应当至少提前三十日向中国证监会备案。

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

(三) 通知

召开基金份额持有人大会，召集人应当至少提前30天，在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告通知。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。

（四）会议召开方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会与通讯方式开会。

会议的召开方式由召集人确定，但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。

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）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；

（2）本人出席会议者应持有本基金份额凭证、受托出席会议者应出具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。

（3）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，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50%。

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，在两个工作日内在指定媒体上连续公布相关提示性公告；

（2）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；

(3) 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；

(4) 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。

3、不论现场开会或通讯方式开会，若该次会议不符合本《基金合同》规定的开会条件，则该次会议不得审议会议通知中的各项议题，但召集人可以按照本《基金合同》规定的方式和程序，对于同一议题再次召集基金份额持有人大会；再次开会日期的提前通知期限为 30 天，但确定有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人资格的权益登记日不发生变化；再次召开的基金份额持有人大会需满足上述现场开会或通讯方式开会的各项条件方为有效。

(五) 议事内容与程序

1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如修改基金合同、提前终止基金合同、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、转换基金运作方式、提高基金管理人或基金托管人报酬以及召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

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作出决定。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

以就程序性问题提请基金份额持有人大会作出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

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，律师见证并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人未能主持大会的情况下，由基金托管人授权出席会议的代表主持；如果基金管理人和基金托管人均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人以所代表的基金份额 50%以上多数选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。

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

（2）通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，由召集人至少提前 30 天公布提案，在所通知的表决截止日期第二天统计全部有效表决，在公证机构监督下形成决议。

（六）表决

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

2、基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

（1）一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人所持表决权的 50%以上通过方为有

效；除下列（2）所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

（2）特别决议

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

3、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

6、基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。

（七）计票

1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；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三名基金份额持有人代表担任监票人。

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

（3）如果会议主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果会议主持人未进行重新清点，而出席会议的基金份额持有人或者基金份额持有人的代理人对会议主持人宣布的表决结果有异议，有权在宣布表决结果后立即要求重新清点；重新清点以一次为限，会议主持人应当于重新清点后当场公布重新清点结果。

（4）计票过程应由公证机关予以公证。

2、通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管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。

（八）生效与公告

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

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两日内在至少一种中国证监会指定的报刊上公告。

五、基金管理人、基金托管人的更换条件与程序

（一）基金管理人和基金托管人的更换条件

1、基金管理人的更换条件

有下列情形之一的，经中国证监会批准，须更换基金管理人：

- （1）基金管理人解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产；
- （2）基金托管人有充分理由认为更换基金管理人符合基金份额持有人利益；
- （3）代表基金总份额 50%以上基金单位的基金份额持有人要求基金管理人退任；

（4）中国证监会有充分理由认为基金管理人不能继续履行基金管理职责。基金管理人辞任，但新的管理人确定之前，其仍须履行基金管理人的职责。

2、基金托管人的更换条件

有下列情形之一的，经中国证监会和中国银监会批准，须更换基金托管人：

- （1）基金托管人解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产；
- （2）基金管理人认为更换基金托管人符合基金份额持有人利益；
- （3）代表基金总份额 50%以上基金单位的基金份额持有人要求基金托管人退任；

（4）中国银监会有充分理由认为基金托管人不能继续履行基金托管职责。基金托管人辞任的，但新的托管人确定之前，其仍须履行基金托管人的职责。

（二）基金管理人和基金托管人的更换程序

1、基金管理人的更换程序

（1）提名：新任基金管理人由基金托管人提名。基金管理人与基金托管人同时更换的，由中国证监会指定临时基金管理人。

(2) 决议：基金份额持有人大会对更换基金管理人形成决议，该决议需经代表基金总份额 50%以上基金单位的基金份额持有人表决通过。基金份额持有人大会还需对被提名的基金管理人形成决议。

(3) 批准：新任基金管理人经中国证监会审查批准方可继任，原任基金管理人经中国证监会批准方可退任。

(4) 公告：基金管理人更换后，由基金托管人在中国证监会批准后 5 个工作日内公告。若基金托管人和基金管理人同时更换，中国证监会不指定且没有中国证监会认可的机构进行公告时，代表基金总份额 10%以上(含 10%)并且出席基金份额持有人大会的基金份额持有人有权按本《基金合同》规定公告基金份额持有人大会决议。

(5) 交接：原基金管理人应作出处理基金事务的报告，并向新任基金管理人办理基金事务的移交手续；新任基金管理人应与基金托管人核对基金资产总值和净值。

(6) 基金名称变更：基金管理人更换后，如果原任或新任基金管理人要求，应按其要求替换或删除基金名称中与原基金管理人有关的名称或商号字样。

2、基金托管人的更换程序

(1) 提名：新任基金托管人由基金管理人提名。基金托管人与基金管理人同时更换的由中国证监会指定临时基金托管人

(2) 决议：基金份额持有人大会对更换基金托管人形成决议，该决议需经代表基金总份额 50%以上基金单位的基金份额持有人表决通过。基金份额持有人大会对被提名的基金托管人形成决议。

(3) 批准：新任基金托管人经中国证监会和中国银监会审查批准方可继任，原任基金托管人经中国证监会和中国银监会批准方可退任。

(4) 公告：基金托管人更换后，由基金管理人在中国证监会和中国银监会批准后 5 个工作日内公告。如果基金托管人和基金管理人同时更换，中国证监会不指定，且没有中国证监会认可的机构进行公告时，代表基金总份额 10%以上并且出席基金份额持有人大会的基金份额持有人有权按本《基金合同》规定公告基金份额持有人大会决议。

(5) 交接：原基金托管人应做出处理基金事务的报告，并与新任基金托管人进行基金资产移交；新任基金托管人与基金管理人核对基金资产总值和净值。

六、基金的基本情况

(一) 基金名称：大成蓝筹稳健证券投资基金。

(二) 基金类型：契约型开放式。

(三) 基金投资者范围：中华人民共和国境内的个人投资者和机构投资者（法

律、法规、规章禁止投资证券投资基金的除外)及合格境外机构投资者。

(四) 存续期限: 不定期。

(五) 基金单位面值: 每份基金单位面值为人民币 1.00 元。

七、基金的设立募集

(一) 设立募集期限

自《招募说明书》公告之日起到基金成立日止, 最长不超过 3 个月。

(二) 销售场所

本基金通过销售机构办理基金销售业务的网点公开发售。

(三) 投资者认购原则

1、投资者认购前, 需按销售机构规定的方式备足认购的金额。

2、设立募集期内, 投资者可多次认购基金单位, 每次认购任意类别基金份额的认购金额不得低于 100 元。

(四) 认购费用

本基金认购费用为认购金额的 1%。

(五) 认购份数的计算

本基金的认购金额包括认购费用和净认购金额。计算方法如下:

(1) 认购费用 = 认购金额 × 认购费率

(2) 净认购金额 = 认购金额 - 认购费用

(3) 认购份额 = (净认购金额 + 认购利息) / 基金单位面值

认购费用以人民币元为单位, 保留到小数点后两位, 小数点后两位以后舍去; 认购份数保留至 0.01 份基金单位, 小数点后两位以后舍去, 舍去部分计入基金资产。

(六) 基金认购的规定

关于基金认购的具体规定由基金管理人在招募说明书或发行公告中规定。

(七) 首次募集期间认购资金利息的处理方式

募集资金利息在全部认购期结束时归入投资者认购金额中, 折合成基金份额, 归投资者所有。

八、基金的成立

(一) 基金成立的条件

净认购金额超过 2 亿元并且认购户数达到或超过 100 人。

(二) 基金的成立

1、设立募集期内, 达到前述基金成立条件, 基金可以成立。

2、基金成立前, 投资人的认购款项只能存入商业银行, 不得动用。

（三）基金设立失败

1、设立募集期满，未达到基金成立条件，或设立募集期内发生使基金无法设立的不可抗力，则基金设立失败，不得成立。

2、本基金不成立时，基金发起人应承担全部募集费用，将已募集资金加计银行活期存款利息在设立募集期结束后 30 天内退还基金认购人。

3、基金设立失败，基金管理人及基金托管人不得请求报酬。

（四）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

本基金成立后的存续期间内，有效基金份额持有人数量连续 20 个工作日达不到 100 人，或连续 20 个工作日基金资产净值低于人民币 5000 万元，基金管理人应当及时向中国证监会报告，说明出现上述情况的原因以及解决方案。存续期间内，基金份额持有人数量连续 60 个工作日达不到 100 人，或连续 60 个工作日基金资产净值低于人民币 5000 万元，基金管理人有权宣布本基金终止，并报中国证监会备案。中国证监会另有规定的，按其规定办理。

九、基金的申购与赎回

（一）申购与赎回办理的场所

本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的销售代理人。

投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购与赎回。

（二）申购与赎回办理的时间

1、开放日及开放时间

本基金为投资者办理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。在开放日的具体业务办理时间由基金管理人在招募说明书及公开说明书中规定。

若出现新的证券交易市场或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日进行相应的调整，并报中国证监会备案。

2、申购的开始时间

本基金宣布成立后不超过 30 个工作日开始办理申购。

3、赎回的开始时间

本基金成立后封闭运作 30 个工作日，封闭期结束后的第一个开放日开始办理赎回。

申购、赎回的时间为上海证券交易所、深圳证券交易所交易日。具体由基金管理人在《招募说明书》或《公开说明书》中规定。若出现新的证券交易市场或交易所交易时间更改或其它原因，基金管理人将视情况进行相应调整并公告。

4、在确定申购开始时间与赎回开始时间后，由基金管理人最迟于开放日前 3

个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

（三）申购与赎回的原则

1、未知价原则，即基金的申购与赎回价格以受理申请当日收市后计算的基金单位净值为基准进行计算；

2、金额申购和份额赎回原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、基金份额持有人在赎回基金份额时，基金管理人按先进先出的原则，对该持有人账户在该销售机构托管的基金份额进行处理，即先确认的份额先赎回，后确认的份额后赎回；

4、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；

5、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前三个工作日予以公告。

（四）申购与赎回的程序

1、申购与赎回申请的提出

基金投资者须按销售机构规定的手续，在开放日的业务办理时间提出申购或赎回的申请。

投资人申购本基金，须按销售机构规定的方式备足申购资金。

投资人提交赎回申请时，其在销售机构（网点）必须有足够的基金单位余额。

2、申购与赎回申请的确认

基金管理人应当于受理基金投资人申购、赎回申请之日起 3 个工作日内，对申请的有效性进行确认。

3、申购与赎回申请的款项支付

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

投资者赎回申请成交后，基金管理人应通过注册登记机构按规定向投资者支付赎回款项，赎回款项自受理基金投资人有效赎回申请之日起不超过 7 个工作日内划往赎回人银行账户。在发生巨额赎回时，款项的支付办法按本基金合同有关规定处理。

（五）申购与赎回的数额限制

1、投资者每次最低申购金额为 100 元（含申购费）。

2、基金份额持有人在销售机构赎回时，每次赎回申请不得低于 100 份基金单位，基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）保留的基金单位余额不足 100 份的，在赎回时需一次全部赎回。

3、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可以根据实际情况对以

上限制进行调整并报中国证监会备案，最迟在调整生效前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

（六）申购与赎回的费用

1、申购费用

根据《试点办法》的规定，基金申购费用是支付给基金销售机构的手续费，按申购金额的一定比例收取，由投资人承担，不列入基金资产。本基金的投资人在申购基金时可选择按“前端收费”模式交纳申购费，也可选择按“后端收费”模式交纳申购费。具体收费方式以及费率结构详见本基金招募说明书及其他相关公告。

2、赎回费用

本基金的赎回费用按持有期递减，最高不超过赎回总金额的 0.50%。赎回费用于支付相关手续费后余额归入基金财产。赎回费归入基金财产的比例不得低于赎回费总额的百分之二十五。具体收费方式以及费率结构详见本基金招募说明书及其他相关公告。

3、基金管理人可根据市场情况在不违背有关法律、法规和本《基金合同》规定的情况下调整本基金的申购、赎回和销售年费率，调整结果将至少提前三个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

4、基金管理人可在不违背法律法规规定的情形下，根据市场情况制定基金促销计划，针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资者，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以对促销活动范围内的投资人调低基金的费率。

（七）申购份额与赎回支付金额的计算方式

1、基金申购份额的计算：

（1）若投资人选择前端收费模式，则申购金额包括申购费用和净申购金额，计算公式如下：

前端：净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购日基金份额净值

（2）若投资人选择后端收费模式，则基金申购份额的计算公式为：

申购份数 = 申购金额 / 申购日基金份额净值

2、基金赎回金额的计算：

基金的净赎回金额为赎回金额扣减赎回费用和其他相关费用后的余额，

计算公式如下：

前端：赎回价格=赎回日基金份额净值

赎回金额=赎回份数×赎回价格

赎回费用=赎回金额×赎回费率

净赎回金额= 赎回金额-赎回费用

后端：后端申购费=赎回份额×申购日基金份额净值×后端申购费费率

赎回费=赎回份额×赎回日基金份额净值×赎回费率

赎回金额=赎回份数×赎回日基金份额净值-后端申购费-赎回

费

3、申请日（T 日）的基金份额净值在当天证券交易所收市后计算，并在下一交易日（T+1 日）公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算和公告。

基金份额净值的计算公式为：

基金份额净值 = 基金资产净值总额 / 发行在外的基金单位总份数。

（八）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 日为投资者办理增加权益的登记手续，投资者自 T+2 日起有权赎回该部分基金。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登记手续。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

（九）巨额赎回的认定及处理方式

1、巨额赎回的认定

单个开放日基金净赎回申请超过上一日基金总份额的 10% 时，为巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

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

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

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难，或认为兑付投资者的赎回申请进行的资产变现可能使基金单位净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额 10% 的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；未受理部分除投资者在提交赎回申请

时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权并将以该下一个开放日的基金单位净值为基准计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。

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中国证监会指定的信息披露媒体公告，并说明有关处理方法。

本基金连续两个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，并应当在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

（十）拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

1、除非出现如下情形，基金管理人不得拒绝或暂停接受基金投资者的申购申请：

- （1）不可抗力的原因导致基金无法正常工作；
- （2）证券交易场所在交易时间非正常停市；
- （3）基金资产规模过大，使相应的基金管理人无法找到合适的投资品种，可能会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；
- （4）当基金管理人认为某笔申购会有损于现有基金份额持有人利益；
- （5）法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

如果投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退划给投资者。

基金管理人拒绝或暂停接受申购的方式包括：

- （1）根据有关法律、法规、中国证监会的规定、本基金合同及基金管理人的业务规则，拒绝接受、暂停接受某笔或某数笔申购申请；
- （2）拒绝接受、暂停接受某个或某数个工作日的全部申购申请；
- （3）按比例拒绝接受、暂停接受某个或某数个工作日的申购申请。

2、除下列情形外，基金管理人不得拒绝接受或暂停接受投资者的赎回申请：

- （1）不可抗力的原因导致基金无法正常工作；
- （2）证券交易场所交易时间非正常停市；
- （3）因市场剧烈波动或其它原因而出现连续巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；
- （4）法律、法规规定或中国证监会认定的其它情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应在当日立即向中国证监会备案。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能支付时，将按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分由基金管理人按照相应的处理办法在后续开放日予以兑付。

3、发生《基金合同》或《招募说明书》中未予载明的事项，但基金管理人有关正当理由认为需要暂停接受基金申购、赎回申请的，应当报经中国证监会批准。

4、基金暂停申购、赎回，基金管理人应立即在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上公告。暂停期间结束、基金重新开放时，基金管理人应当公告最新的基金单位资产净值。

如果发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日在至少一种指定信息披露媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告并公告最新的基金单位资产净值。

如果发生暂停的时间超过 1 日但少于两周，暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 1 个工作日在至少一种指定信息披露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新的基金单位资产净值。

如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 3 个工作日在至少一种指定信息披露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新的基金单位资产净值。

（十一）基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告。

十、基金的非交易过户与转托管

（一）非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金单位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、遗赠、自愿离婚、分家析产、国有资产无偿划转、机构合并或分立、资产售卖、机构清算、企业破产清算、强制执行，及基金注册与过户登记人认可的其它行为。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。其中：

1、“继承”是指基金份额持有人死亡，其持有的基金单位由其合法继承人继承。

2、“捐赠”仅指基金份额持有人将其合法持有的基金单位捐赠给福利性质的基金会或其他具有社会公益性质的社会团体。

3、“遗赠”指基金份额持有人立遗嘱将其持有的基金单位赠给法定继承人以外的其他人；

4、“自愿离婚”指原属夫妻共同财产的基金单位因基金份额持有人自愿离婚而使原在某一方名下的部分或全部基金单位划转至另一方名下；

5、“分家析产”指原属家庭共有（如父子共有、兄弟共有等）的基金单位从某一家庭成员名下划转至其他家庭成员名下的行为；

6、“国有资产无偿划转”指因管理体制改革、组织形式调整或资产重组等原因引起的作为国有资产的基金单位在不同国有产权主体之间的无偿转移；

7、“机构合并或分立”指因机构的合并或分立而导致的基金单位的划转；

8、“资产售卖”指一企业出售它的下属部门（独立部门、分支机构或生产线）的整体资产给另一企业的交易，在这种交易中，前者持有的基金单位随其他经营性资产一同转让给后者，由后者一并支付对价；

9、“机构清算”是指机构因组织文件规定的期限届满或出现其他解散事由，或因其权力机关作出解散决议，或依法被责令关闭或撤销而导致解散，或因其他原因解散，从而进入清算程序（破产清算程序除外），清算组（或类似组织，下同）将该机构持有的基金单位分配给该机构的债权人以清偿债务，或将清偿债务后的剩余财产中的基金单位分配给机构的股东、成员、出资者或开办人；

10、“企业破产清算”是指一企业法人根据《中华人民共和国企业破产法（试行）》或《中华人民共和国民事诉讼法》第十九章的有关规定被宣告破产，清算组依法将破产企业持有的基金单位直接分配给该破产企业的债权人所导致的基金单位的划转；

11、“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。

（二）办理非交易过户业务必须提供基金注册与过户登记人要求提供的相关资料，其中，因继承、捐赠、遗赠、自愿离婚、分家析产原因导致的非交易过户向基金销售网点申请办理，因国有资产无偿划转、机构合并或分立、资产售卖、机构清算、企业破产清算、强制执行原因导致的非交易过户直接向基金注册与过户登记人统一申请办理。

（三）基金份额持有人在变更办理基金申购与赎回等业务的销售机构（网点）时，销售机构（网点）之间不能通存通兑的，可办理已持有基金单位的转托管。

（四）符合条件的非交易过户申请自申请受理日起，二个月内办理；申请人按基金注册与过户登记人规定的标准缴纳过户费用。

（五）基金注册与过户登记人只受理国家有权机关依法要求的基金账户或基金份额的冻结与解冻。基金账户或基金单位被冻结的，被冻结部分产生的权益（包括现金分红和红利再投资）一并冻结。

（六）在相关法律法规有明确规定的条件下，基金管理人将可以办理基金单

位的质押业务或其他非交易过户业务，并制定、公布并实施相应的业务规则。

十一、基金资产的托管

本基金资产由基金托管人依法持有并保管。基金管理人应与基金托管人按照《暂行办法》、《试点办法》、本基金合同及其他有关规定订立《大成蓝筹稳健证券投资基金托管协议》，以明确基金管理人与基金托管人之间在基金资产的保管、基金资产的管理和运作及相互监督等相关事宜中的权利和义务，确保基金资产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

十二、基金的销售与注册登记

（一）基金的销售

本基金的销售业务指接受投资者申请为其办理的本基金的认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务。

本基金的销售业务由基金管理人及基金管理人委托的其他符合条件的机构办理。基金管理人委托其他机构办理本基金销售业务的，应与代理人签订委托代理协议，以明确基金管理人和销售代理人之间在基金单位认购、申购、赎回等事宜中的权利和义务，确保基金资产的安全，保护基金投资者和基金份额持有人的合法权益。

销售机构应严格按照法律法规和基金合同规定的条件办理基金销售业务。

（二）基金的注册登记

本基金的注册登记业务指本基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资人基金账户管理、基金单位注册登记、清算及基金交易确认、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等。

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

注册登记机构享有如下权利：

- 1、取得注册登记费；
- 2、保管基金份额持有人开户资料、交易资料、基金份额持有人名册等；
- 3、法律法规规定的其他权利。

注册登记机构承担如下义务：

- 1、配备足够的专业人员办理本基金的注册登记业务；

- 2、严格按照法律法规和本基金合同规定的条件办理基金的注册登记业务；
- 3、保持基金份额持有人名册及相关的申购与赎回等业务记录 15 年以上；
- 4、对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或基金或其他任何方带来的损失，须以其自身财产承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形除外；
- 5、按本基金合同及招募说明书、公开说明书规定为投资人办理非交易过户业务、提供其他必要的服务；
- 6、法律法规规定的其他义务。

十三、基金的投资

（一）投资理念

（1）随着改革开放和现代化进程的推进，中国已经并将继续涌现一批治理结构良好、经营管理能力突出、信息透明、具备核心竞争力、盈利持续稳定增长的蓝筹上市公司，为长期价值投资提供了可能。

（2）在充分研究的基础上，通过对上述公司的证券进行精选和长期投资，同时运用数量分析方法有效控制系统性风险，在承担风险较低的情况下分享中国经济快速增长的成果，为持有人增加财富。

（二）投资目标

通过精选符合本基金投资理念、流动性良好的证券，在控制非系统风险的前提下获取投资收益，同时辅助运用一系列数量分析方法，有效控制系统性风险，实现基金资产的中长期稳定增值。

（三）投资范围和对象

本基金的股票投资主要投资于上证 180 指数成份股、深证 100 指数成份股以及未来可能入选成份股的股票，并适度投资于新股申购、股票增发申购等。债券投资以国债投资为主，并适度投资于国内依法公开发行、上市的金融债、企业（公司）债（包括可转债）等债券及中国证监会允许投资的其他金融工具。

本基金投资股票比例为基金资产净值的 30%~95%，投资债券比例为基金资产净值的 0%~65%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。法律法规另有规定时从其规定。

（四）投资策略

1、资产配置策略

本基金利用修正的恒定比例投资组合保险策略（CPPI）来动态调基金中股票、债券和现金的配置比例。其中，股票投资部分的 80%投资于上证 180 指数成份股和深证 100 指数成份股。

利用 CPPI 来动态调整基金资产配置，需要动态确定一些相关的参数：无风险利率、初始股票仓位、风险乘数、修正调整幅度等。一般来说，无风险率采用平均隔夜资金拆借成本。初始股票仓位取决于建仓初期宏观经济环境、市场状况和资金供求情况以及未来的市场预期。因此，我们将深入分析、研究宏观经济环境、市场特征、资金供求状况以及对市场未来做合理预期，在此基础上谨慎做出投资期初的资产配置决策，构建投资期初的股票仓位。而风险乘数则是通过对市场的收益、风险特征所做的数量化分析以及对投资者的风险容忍程度的深入调查后确定的，一般介于 2—5 之间。

2、行业配置策略

本基金的行业配置采取较为积极的策略，以投资基准的行业权重为基础，以行业研究及比较分析为核心，通过适时增大或降低相应行业的投资权重，使整体投资表现跟上或超越投资基准。基金管理人将根据国家产业政策、行业周期和景气状况、行业发展前景预期、市场行业轮换情况等因素，综合判断行业投资价值，适当加大对处于产业复苏周期、被市场低估、行业景气指数上升、发展前景良好的行业的投资。具体根据基金管理人研究部的行业投资价值评估系统进行。

3、个股选择策略

个股选择策略采用蓝筹成份股优选策略，运用“价值—势头”选股方法，优选出被市场低估并有良好市场表现，处于价值回归阶段的天相 280 指数成份股投资，并采用积极的资产管理方式，以期获得资本的稳健增值。

选股程序：

（1）确定现有成份股和可能进入的股票

以上证 180 指数和深圳 100 指数成分股作为基础备选股票库；再根据上证 180 指数和深圳 100 指数编制原则，选出未来可能进入上证 180 指数或深圳 100 指数成分股并符合本基金投资理念的股票，加入备选股票库；

（2）价值选股：

①蓝筹公司主要挑选标准：

- 公司治理结构良好，行为规范，信息透明，注重公众股东利益和投资者关系；
- 主营业务鲜明并具有一定的竞争力；
- 经营管理能力和市场竞争能力在行业中具有明显优势；
- 具备长期持续稳定成长性，预期至少未来两年的主营业务收入和利润增长率高于 GDP 增长率；
- 财务状况良好，具备较好的抗风险能力；

②由基金管理人内设的研究部公司分析人员根据上述蓝筹公司挑选标准，采

用 BOTTEM-UP 方式逐个筛选，形成基本面合规备选股票库。

③将基本面合规备选股票库按 P/B 从小到大排序（删除业绩为负的股票），选取前 70% 的股票作备选，产生投资备选股票库。

（3）势头选股：

将备选股票按如下公式计算势头，按势头从大到小排序，并参考排序结果形成最终股票组合：

$$\text{Momentum} = \frac{(R_s - R_i)}{\sigma_{s-i}} \times Tr$$

其中： R_s 为股票最近三个月的收益率，

R_i 为股票所在行业最近三个月的收益率，

σ_{s-i} 为股票收益率与其对应行业收益率之差的月标准差，

Tr 为股票交易活跃度，这里界定为股票最近 5 个交易日平均换手率除以最近 30 个交易日平均换手率。

4、债券投资策略

本基金的债券投资采用完全积极的投资策略，采用利率预测、久期管理、收益率曲线移动策略、相对价值评估、收益率利差策略、套利交易策略以及利用正逆回购进行杠杆操作等积极的投资策略，力求获得超过债券市场的收益。

（五）投资基准（benchmark）

由于我国还没有统一指数，我们暂时采用天相投资顾问有限公司编制的天相 280 指数作为股票投资部分的基准，采用中信国债指数作为债券投资部分的基准。本基金的投资基准如下：

$$70\% \times \text{天相 280 指数} + 30\% \times \text{中信国债指数}$$

（六）产品风险以及管理

本基金属于较低风险证券投资基金，适于能承受一定风险，追求当期收益和长期资本增值的基金投资人投资。本基金采用大成风险风险管理系统和基金绩效评估系统，该系统可以完成市场风险管理、压力测试、多因子风险分析、流动性风险控制等多项风险管理功能。

（七）投资决策

1、决策依据

本基金管理人将主要依据下述因素决定基金资产配置和具体证券的买卖：

- （1）国家有关法律、法规和本《基金合同》的有关规定；
- （2）国家宏观经济环境及其对债券市场的影响；
- （3）国家货币政策、财政政策以及证券市场政策；

- (4) 发债公司财务状况、行业处境、经济和市场的需求状况及当前市场价格；
- (5) 货币市场、资本市场资金供求状况及未来走势。

2、投资流程

(1) 研究部提出市场策略研究报告和宏观经济、类属资产或行业、公司分析报告。

研究部数量分析师和研究员在广泛参考和利用公司外部的研究成果，尤其是研究实力雄厚的证券经营机构提供的研究报告，拜访国家有关部委，了解国家宏观经济政策、财政政策、货币政策，经过筛选、归纳和整理，定期或不定期地撰写市场策略研究报告和宏观经济、行业、上市公司分析报告，定期出具类属资产配置报告。债券投资方面，国债及金融债的选择采取以利率研究为核心的分析方式，由研究部宏观研究员对宏观经济形势、利率走势等进行分析，并向基金经理提交研究报告。公司债和企业债的选择采取以利率研究和发行人偿债能力研究为核心的分析方式，由研究部公司研究员在宏观研究、利率研究的基础上，结合对发行人经营及财务状况的调研，提出投资价值分析报告。

研究部向投资决策委员会和基金经理部提供研究报告，作为其投资决策的依据。

(2) 研究部提出基金资产配置及调整建议，基金经理制定资产配置方案

研究部数量分析师根据数量分析模型的结果，提出基金资产配置建议和组合调整建议，撰写数量分析报告，提交投资决策委员会和基金经理部。基金经理根据研究部的数量分析报告和研究报告制定资产配置方案。

(3) 投资决策委员会决议确定基金资产分配比例

投资决策委员会根据研究部和基金经理提供的市场策略研究报告、宏观研究报告、数量分析报告和资产配置方案，决议确定基金总体投资计划。

(4) 基金经理制定具体的投资策略和投资组合方案

基金经理根据投资决策委员会确定的基金总体投资计划，参考研究部的宏观、行业及上市公司分析报告、市场分析报告，制定股票、债券和现金资产的投资比例，同时确定行业或类属资产的配置计划，构造投资组合方案。

(5) 基金投资组合经投资决策委员会审核后，由基金经理向集中交易室下达具体交易指令。

(6) 风险控制委员会提出风险控制建议

风险控制委员会根据市场变化对基金投资组合进行风险评估，并提出风险防范措施。监察稽核部对计划的执行过程进行日常监督，投资计划执行完毕，基金经理负责向投资决策委员会提出总结报告。

(7) 本基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据市场环境变

化和实际需要调整上述投资流程。

（八）初始建仓期

本基金初始建仓期为 6 个月。本基金宣告成立 6 个月之后，基金投资组合比例达到本基金合同的相关规定。

（九）投资组合

本基金下投资组合须符合以下规定：

- 1、基金持有一家上市公司的股票，不超过基金资产净值的 10%；
- 2、本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，不超过该证券的 10%；
- 3、中国证监会规定的其他比例限制。

由于本基金规模或市场的变化导致基金投资组合超过上述约定的比例，基金管理人应在合理期限内进行调整，以达到上述比例标准。

（十）投资限制

本基金禁止从事下列行为：

- 1、投资于其他基金；
- 2、以本基金的名义使用不属于本基金名下的资金买卖证券；
- 3、将基金资产用于非法抵押、担保、资金拆借或者贷款；
- 4、以基金资产进行房地产投资；
- 5、从事可能使基金资产承担无限责任的投资；
- 6、将基金资产投资于与基金托管人或基金管理人有关联关系的公司所发行的证券；
- 7、内幕交易、操纵市场、通过关联交易损害基金份额持有人的利益；
- 8、配合管理人的发起人及其他任何机构的证券投资业务；
- 9、故意维持或抬高管理人的发起人及其他任何机构所承销股票的价格；
- 10、中国证监会禁止从事的其他行为。

（十一）基金管理人代表基金行使股东权利的原则及方法

基金管理人将按照国家有关规定代表本基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益。基金管理人在代表基金行使股东或债权人权利时应遵守以下原则：

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司或发债公司的经营管理；
- 2、有利于基金资产的安全与增值，有利于保护基金份额持有人的合法权益。

十四、基金资产与基金资产估值

（一）基金资产

1、基金资产总值和基金资产净值

本基金基金资产总值包括基金所拥有的各类有价证券、银行存款本息及其他投资等的价值总和。

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。

2、基金资产的保管及处分

本基金资产独立于基金管理人及基金托管人的资产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对本基金资产行使请求冻结、扣押和其他权利。除依《暂行办法》、《试点办法》、基金合同及其他有关规定处分外，基金资产不得被处分。

3、基金资产的账户

本基金根据相关法律法规、规范性文件开立基金专用银行存款账户以及证券账户，与基金管理人和基金托管人自有的资产账户以及其他基金资产账户独立。

（二）基金资产估值

1、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。

2、估值日

本基金合同生效后，每个交易日对基金财产进行估值。

3、估值对象

基金所持有的金融资产和金融负债。

4、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证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以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) 未上市股票的估值

送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以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。

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

量的情况下,按成本估值。

3) 有明确锁定期股票的估值

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,按交易所上市的同一股票的收盘价估值;非公开发行且处于明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

(2) 固定收益证券的估值方法

1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘净价估值,估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日的收盘净价估值;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) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息(自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息)得到的净价进行估值,估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按有交易的最近交易日所采用的净价估值;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。

3) 未上市债券采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按成本估值。

4) 在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。

5) 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。

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。

(3) 权证估值方法

1) 配股权证的估值

因持有股票而享有的配股权,类同权证处理方式的,采用估值技术进行估值。

2) 认沽 / 认购权证的估值

从持有确认日起到卖出日或行权日止,上市交易的认沽 / 认购权证按估值日的收盘价估值,估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,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。未上市交易的认沽 / 认购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的情况下,按成本估值;因持有股票而享有的配股权,停止交易、但未行权的权证,采用估值技术确定公允价值。

(4) 其他资产的估值方法

其他资产按照国家有关规定或行业约定进行估值。

(5)在任何情况下,基金管理人采用上述 1—4 项规定的方法对基金财产进行估值,均应被认为采用了适当的估值方法。但是,如果基金管理人具有充足的理由认为按上述方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可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的基础上与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

(6) 国家有最新规定的,按其规定进行估值。

5、估值程序

基金管理人完成基金资产净值的估值后,将估值结果以书面形式报给基金托管人,基金托管人按本《基金合同》所规定的估值方法、时间、程序进行复核,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。

6、暂停公告净值的情形

- (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、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。

7、基金单位净值的确认及错误的处理方式

基金单位资产净值的计算,精确到 0.0001 元,小数点第五位四舍五入。国家另有规定的,从其规定。当基金资产的估值导致基金单位资产净值小数点后四位内发生差错时,视为基金单位资产估值错误。

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值出现错误时,基金管理人应当立即予以纠正,并采取合理的措施防止损失进一步扩大;当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.25% 时,基金管理人应当报中国证监会备案;当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.5% 时,基金管理人应当公告,并同时报中国证监会备案。

因基金单位净值计算错误给投资人造成损失的处理原则、方式适用基金管理人根据相关法律法规及基金合同制订的业务规则中的相关规定及《托管协议》的相关规定。

8、特殊情形的处理

(1) 基金管理人按本部分第 4 条有关估值方法规定的第 (5) 款进行估值时,所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

(2) 由于不可抗力原因,或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误,

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,但未能发现错误的,由此造成的基金资产估值错误,基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

十五、基金费用与税收

(一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费;
- 2、基金托管人的托管费;
- 3、投资交易费用;
- 4、基金信息披露费用;
- 5、基金份额持有人大会费用;
- 6、与基金相关的会计师费和律师费;
- 7、按照国家有关规定可以列入的其他费用。

(二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 1.5%年费率计提。

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。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

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.25%年费率计提。

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性

支付给基金托管人。

3、本条第（一）款第3至第7项费用由基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。（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的费用支出或基金资产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金成立之前的律师费、会计师费和信息披露费用不得从基金资产中列支。

（四）基金管理费和基金托管费的调整

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

（五）税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

十六、基金收益与分配

（一）收益的构成

基金收益包括：基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券差价、银行存款利息以及其他收入。

基金净收益为基金收益扣除按照有关规定可以在基金收益中扣除的费用等项目后的余额。

（二）收益分配原则

1、本基金收益分配采用现金方式。基金份额持有人事先可选择将现金收益按权益登记日除息后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。如果基金份额持有人事先未做出选择的，默认为现金方式；

2、每一基金单位享有同等分配权；

3、基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；

4、基金收益分配后每基金单位净值不能低于面值；

5、如果基金当期出现亏损，则不进行收益分配；

6、基金收益分配的比例不低于基金净收益的90%；

7、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至少一次，成立不满3个月，收益可不分配；年度分配在基金会计年度结束后4个月内完成。

法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。

（三）收益分配方案

基金收益分配方案中载明基金收益的范围、基金净收益、基金收益分配对象、

分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式及有关手续费等内容。

（四）收益分配方案的确定与公告

基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人核实后确定，在报中国证监会备案后 2 个工作日内由基金管理人公告。

（五）收益分配中发生的费用

1、基金份额持有人选择将现金红利进行再投资时，免收再投资的费用。

2、基金份额持有人选择现金分红方式时，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权益登记日的基金单位净值转为基金单位。

十七、基金的会计与审计

（一）基金会计政策

1、基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。

2、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。

3、会计制度按国家有关的会计制度执行。

4、本基金独立建账、独立核算。

5、本基金会计责任人为基金管理人，基金管理人也可以委托具有证券从业资格的独立的会计师事务所担任基金会计，但该会计师事务所不能同时从事本基金的审计业务。

（二）基金年度审计

1、本基金管理人聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所及其注册会计师等机构对基金进行年度审计。

2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人和基金托管人同意，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，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。更换会计师事务所须在 2 个工作日内公告。

十八、基金的信息披露

本基金的信息披露按照《暂行办法》及其实施准则、《试点办法》、本基金合同及其他有关规定办理。本基金的信息披露事项须在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

（一）招募说明书

基金发起人按照《暂行办法》、《试点办法》编制并公告招募说明书。

（二）定期报告

本基金定期报告包括半年度报告、年度报告、基金投资组合公告、基金净值公告及公开说明书，由基金管理人和基金托管人按照《暂行办法》、《试点办法》的规定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进行编制并公告，同时报中国证监会备案。

1、半年度报告：基金半年度报告在基金会计年度前 6 个月结束后的 60 日内公告。

2、年度报告：基金年度报告经注册会计师审计后在基金会计年度结束后的 90 日内公告。

3、基金投资组合公告：基金投资组合公告每季度公布一次，于截止日后 15 个工作日内公告。

4、基金净值公告：每开放日公布前一开放日的基金单位净值。

5、公开说明书：公开说明书是对招募说明书的定期更新，由基金管理人编制并公告。本基金成立后，于每 6 个月结束后 30 日内公告公开说明书，并在公告时间 15 日前报中国证监会审核。公开说明书公告内容的截止日为每 6 个月的最后一日。

（三）临时公告

基金在运作过程中发生如下可能对基金份额持有人权益产生重大影响的事项时，基金管理人须按照法律法规及中国证监会的有关规定及时报告并公告：

- 1、基金份额持有人大会决议；
- 2、基金管理人或基金托管人变更；
- 3、基金管理人或基金托管人的董事、监事和高级管理人员变动；
- 4、基金管理人或基金托管人主要业务人员一年内变更达 30%以上；
- 5、基金经理更换；
- 6、重大关联事项；
- 7、基金管理人或基金托管人及其董事、监事和高级管理人员受到重大处罚；
- 8、重大诉讼、仲裁事项；
- 9、基金终止；
- 10、基金发生巨额赎回并延期支付；
- 11、基金暂停申购或赎回；
- 12、开始或者重新开始申购、赎回等一项或多项业务的办理；
- 13、基金费用的调整；
- 14、基金投资限额的调整；
- 15、增加或减少销售代理人；

16、基金或为基金提供服务的相关机构出现有关事项，可能影响投资人对基金风险和未来表现的评估；

17、其他重大事项。

（四）信息披露文件的存放与查阅

本基金招募说明书或公开说明书、半年报告、年度报告、基金投资组合公告、临时公告等文本存放在基金管理人、基金托管人和基金销售代理人的办公场所和营业场所，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制件或复印件。

基金管理人和基金托管人应保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

十九、基金的终止与清算

（一）基金的终止

有下列情形之一的，本基金经中国证监会批准后终止：

- 1、存续期间内，基金份额持有人数量连续 60 个工作日达不到 100 人，或连续 60 个工作日基金资产净值低于人民币 5000 万元，基金管理人宣布本基金终止；
- 2、基金经基金份额持有人大会表决终止；
- 3、因重大违法、违规行为，基金被中国证监会责令终止；
- 4、基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任本基金的管理人，而无其他适当的基金管理机构承接其权利及义务；
- 5、基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任本基金的托管人，而无其他适当的基金托管机构承接其权利及义务；
- 6、由于投资方向变更引起的基金合并、撤销；
- 7、法律法规或中国证监会允许的其他情况。

基金终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金进行清算。

（二）基金的清算

1、基金清算小组

（1）自基金终止之日起 30 个工作日内成立基金清算小组，基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算，在基金清算小组接管基金资产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金资产安全的职责。

（2）基金清算小组成员由基金发起人、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。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。

（3）基金清算小组负责基金资产的保管、清理、估价、变现和分配。基金清

算小组可以依法进行必要的民事活动。

2、清算程序

- (1) 基金终止后，由基金清算小组统一接管基金资产；
- (2) 基金清算小组对基金资产进行清理和确认；
- (3) 对基金资产进行评估和变现；
- (4) 将基金清算结果报告中国证监会；
- (5) 公布基金清算公告；
- (6) 对清算后的剩余基金资产进行分配。

3、清算费用

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

4、基金剩余资产的分配

基金清算后的全部剩余资产扣除基金清算费用后如有余额，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

5、基金清算的公告

基金终止并报中国证监会核准后 5 个工作日内由基金清算小组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金清算结果由基金清算小组于中国证监会批准 3 个工作日内公告。

6、清算账册及文件的保存

基金清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

二十、业务规则

基金份额持有人应遵守《大成基金管理有限公司开放式基金业务规则》（以下称《业务规则》）。《业务规则》由基金管理人制订，并由其解释与修改，但《业务规则》的制定、修改若构成对基金合同的实质修改，则应召开基金份额持有人大会，对本《基金合同》的修改形成决议。

二十一、违约责任与争议处理

（一）违约责任

1、由于《基金合同》一方当事人的过错，造成《基金合同》不能履行或者不能完全履行的，由有过错的一方承担违约责任；如属《基金合同》双方或多方当事人的过错，根据实际情况，双方或多方当事人分别承担各自应负的违约责任。

2、当发生下列情况时，当事人可以免责：

- (1) 管理人及基金托管人按照中国证监会的规定或当时有效的法律、法规或

规章的作为或不作为而造成的损失等；

(2) 在没有过错的情况下，基金管理人由于按照本《基金合同》规定的投资原则进行的投资所造成的损失等；

(3) 不可抗力。

3、《基金合同》当事人违反《基金合同》，给其他方造成直接损失的，应进行赔偿。

4、《基金合同》能够继续履行的应当继续履行。

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

6、第三方的过错而导致本《基金合同》当事人一方违约，并造成其他当事人损失的，违约方并不因此免除其赔偿责任。

7、当事人之一违约而导致其他当事人损失的，基金份额持有人应先于其他受损方获得赔偿。

(一) 争议处理

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》有关的争议可首先通过友好协商解决。自一方书面要求协商解决争议之日起 60 日内如果争议未能以协商方式解决，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届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

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。

二十二、基金合同的效力

(一) 本《基金合同》经基金发起人、基金管理人、基金托管人三方盖章以及三方法定代表人或授权代表签字并经中国证监会批准后生效。

(二) 本《基金合同》的有效期限自其生效之日起至本基金清算结果报中国证监会批准并公告之日止。

(三) 本《基金合同》对基金做出的规定自生效之日起对包括基金发起人、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的《基金合同》各方当事人具有同等的法律约束力。

(四) 本《基金合同》及其修订本正本一式八份，除上报中国证监会、中国银监会各一份外，基金发起人、基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具

有同等的法律效力。

二十三、基金合同的修改与终止

（一）基金合同的修改

1、本基金合同的修改需经包括基金管理人和基金托管人在内的各方当事人同意。

2、修改基金合同应经基金份额持有人大会决议通过，并报中国证监会批准，自批准之日起生效。但如因相应的法律、法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形，或者基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会、中国银监会备案。

（二）基金合同的终止

1、基金的终止

出现本《基金合同》规定的基金终止的情形之一时，经中国证监会批准可以终止基金。

2、《基金合同》的终止

基金终止后，应依据法律、法规和本《基金合同》的规定对基金进行清算。中国证监会对清算结果批准并予以公告之日起，本《基金合同》终止。

二十四、其他事项

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

（二）本《基金合同》如有未尽事宜，由《基金合同》当事人各方通过中国证监会规定的程序依据有关法律、法规 and 规定协商处理。

二十五、基金合同当事人盖章及法定代表人或授权代表签字、签约地、签订日

（一）基金发起人

大成基金管理有限公司（盖章）

法定代表人或授权代表（签字）：

签订地：北京

签订日：2004 年 月 日

（二）基金管理人

大成基金管理有限公司（盖章）

法定代表人或授权代理人（签字）：

签订地：北京

签订日：2004 年 月 日

（三）基金托管人：

中国银行（盖章）

法定代表人或授权代理人（签字）：

签订地：北京

签订日：2004 年 月 日