

# 大成中证互联网金融指数分级证券投资基金之基础份额、A类份额、 B类份额上市交易公告书

大成中证互联网金融指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之基础份额、A类份额、B类份额上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号〈上市交易公告书的内容与格式〉》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，大成基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本基金托管人中国工商银行股份有限公司保证本报告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在中国证监会指定信息披露媒介和大成基金管理有限公司网站（www.dcfund.com.cn）上的本基金招募说明书。

## 二、基金概览

### 1、基金二级市场交易简称和交易代码：

基础份额简称：大成互联网金融分级；场内简称：互联金融；场内代码 502036

A类份额简称：大成互联网金融分级A；场内简称：网金A；场内代码 502037

B类份额简称：大成互联网金融分级B；场内简称：网金B；场内代码 502038

### 2、基金申购、赎回简称：互联金融。

### 3、申购、赎回代码：502036。

4、2015年6月30日基金基础份额总额：215,967,281.63份，A类份额36,375,764.00份，B类份额36,375,764.00份。

5、2015年6月30日基金基础份额净值：1.0000元，A类份额1.0003元，B类份额0.9996元。

6、本次上市交易份额：基础份额18,187,884.00份，A类份额36,375,764.00份，B类份额36,375,764.00份（截至2015年6月30日）。

7、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。

8、上市交易日期：2015年7月7日。

9、基金管理人：大成基金管理有限公司。

10、基金托管人：中国工商银行股份有限公司。

11、上市推荐人：无。

## 三、基金的募集与上市交易

### （一）本基金上市前基金募集情况

1、基金募集申请的核准机构和核准文号：2015年6月4日中国证监会证监许可[2015]1154号文。

2、基金运作方式：契约型开放式、分级基金。

3、基金合同期限：不定期。

4、发售方式：场内、场外认购。

5、发售日期：2015年6月15日至2015年6月24日。

6、发售价格：1.00元人民币。

7、发售期限：8个工作日。

8、发售机构

(1) 场内销售机构

本基金场内销售机构为上海证券交易所内具有基金销售业务资格的会员单位。具体名单可在上海证券交易所网站查询。

(2) 场外销售机构

1) 直销机构：

大成基金管理有限公司

(2) 代销机构

中国工商银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中国光大银行股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、国都证券有限责任公司、渤海证券股份有限公司、中国国际金融有限公司、中国民族证券有限责任公司、东海证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、上海农村商业银行股份有限公司、华宝证券有限责任公司、上海证券有限责任公司、湘财证券有限责任公司、华鑫证券有限责任公司、华福证券有限责任公司、浙商证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、中航证券有限公司、洛阳银行股份有限公司、财富证券有限责任公司、中原证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、南京证券有限责任公司、华安证券有限责任公司、东吴证券股份有限公司、江苏银行股份有限公司、西南证券股份有限公司、东北证券股份有限公司

(二) 基金合同生效

本基金根据中国证监会证监许可[2015]1154号文批准，自2015年6月15日起向全社会公开募集，截至2015年6月24日，募集工作已经顺利结束。经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）验资，本次募集的有效净认购金额为288,673,159.14元人民币，有效净认购金额产生的利息共计45,650.49元人民币。本次有效净认购资金已于2015年6月29日划入本基金在基金托管人中国工商银行股份有限公司开立的基金托管专户。

本次募集有效认购总户数为4637户，按照每份基金份额面值1.00元人民币计算。设立募集期间募集的有效份额为288,673,159.14份基金份额；利息结转的基金份额为45,650.49份基金份额。两项合计共

288,718,809.63份基金份额，已全部计入投资者账户，归投资者所有。其中本公司基金从

业人员认购基金

份额 0.00 份，占基金份额总量的 0.00%，本公司未使用自有资金认购本基金。

本基金于 2015 年 6 月 29 日得到中国证监会书面确认，基金备案手续办理完毕。根据《中华人民共和国

证券投资基金法》及其配套法规和《大成中证互联网金融指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，

本基金的募集情况已符合基金合同生效的条件，基金合同于 2015 年 6 月 29 日正式生效。

自基金合同生效

之日起，基金管理人正式开始管理本基金。按照有关法律规定，本基金合同生效前的律师费、会计师费、信

息披露费由基金管理人承担。

### （三）基金上市交易

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：上海证券交易所自律监管决定书 [2015] 286” “号。

2、上市交易日期：2015 年 7 月 7 日。

3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。

4、基金二级市场交易简称和交易代码：

基础份额简称：互联金融；交易代码：502036

A 类份额简称：网金 A；交易代码：502037

B 类份额简称：网金 B；交易代码：502038

投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与本基金的二级市场交易。

5、基金申购、赎回简称：互联金融。

6、申购、赎回代码：502036。

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份额

的申购与赎回。基金管理人可根据情况变更销售机构，并予以公告。

7、本次上市交易份额：基础份额 18,187,884.00 份；A 类份额 36,375,764.00 份；B 类份额 36,375,

764.00 份(截至 2015 年 6 月 30 日)。

8、未上市交易份额的流通规定：

本基金包括场内份额与场外份额，本次上市的基金份额全部为场内份额。

未上市交易的份额登记在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基金份额持有

人开放式基金账户下，可以通过跨系统转托管转至中国证券登记结算有限责任公司上海分公司证券登记

结算系统持有人上海证券账户下后，在上海证券交易所上市交易。跨系统转托管和份额

配对转换业务将

于 2015 年 7 月 7 日开通。

#### 四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

##### (一) 持有人户数

截至 2015 年 6 月 30 日, 本基金份额持有人户数为 4637 户, 平均每户持有的基金份额为 62,264.14 份。

其中, 场内基础份额持有户数为 239 户, 平均每户持有的基础基金份额为 76,099.93 份。

##### A 类份额持有人户

数为 239 户, 平均每户持有的 A 类基金份额为 152,199.85 份。 B 类份额持有人户数为

239 户, 平均每户持有

的 B 类份额为 152,199.85 份。

##### (二) 持有人结构

截至 2015 年 6 月 30 日, 机构投资者持有的场内基础基金份额为 599,960.00 份, 占场内基础基金份额

比例为 3.30%; 个人投资者持有的场内基础基金份额为 17,587,924.00 份, 占场内基础基金份额比例为

96.70%。

截至 2015 年 6 月 30 日, 机构投资者持有的本次上市交易的 A 类份额为 1,199,920.00 份, 占本次 A 类份

额上市交易基金份额比例为 3.30%; 个人投资者持有的本次上市交易的 A 类份额为 35,175,844.00 份, 占

本次 A 类份额上市交易基金份额比例为 96.70%。

截至 2015 年 6 月 30 日, 机构投资者持有的本次上市交易的 B 类份额为 1,199,920.00 份, 占本次 B 类份

额上市交易基金份额比例为 3.30%; 个人投资者持有的本次上市交易的 B 类份额为 35,175,844.00 份, 占

本次 B 类份额上市交易基金份额比例为 96.70%。

##### (三) 2015 年 6 月 30 日, 前十名基金份额持有人情况

截至 2015 年 6 月 30 日, 基础份额前十名场内基金份额持有人的情况如下表。

序号 持有人名称(全称) 持有场内基础基金份额(份) 占场内基础份额比例(%)

1 王毅 5,999,980.00 32.99

2 李怡名 3,999,980.00 21.99

3 张清平 781,980.00 4.30

4 崔书华 399,998.00 2.20

5 尚绍华 399,980.00 2.20

- 6 重庆华盛房地产开发有  
限公司 399,980.00 2.20
- 7 陈洁明 399,980.00 2.20
- 8 张晨 239,990.00 1.32
- 9 成都共同投资有限公司 199,980.00 1.10
- 10 郭淑兰 199,980.00 1.10
- 11 邱佩珍 199,980.00 1.10
- 12 胡松铨 199,980.00 1.10

截至 2015 年 6 月 30 日，A 类份额前十名场内基金份额持有人的情况如下表。

序号 持有人名称（全称） 持有 A 类份额（份） 占 A 类份额比例（%）

- 1 王毅 11,999,960.00 32.99
- 2 李怡名 7,999,960.00 21.99
- 3 张清平 1,563,960.00 4.30
- 4 崔书华 799,996.00 2.20
- 5 尚绍华 799,960.00 2.20
- 6 重庆华盛房地产开发有  
限公司 799,960.00 2.20
- 7 陈洁明 799,960.00 2.20
- 8 张晨 479,982.00 1.32
- 9 成都共同投资有限公司 399,960.00 1.10
- 10 郭淑兰 399,960.00 1.10
- 11 邱佩珍 399,960.00 1.10
- 12 胡松铨 399,960.00 1.10

截至 2015 年 6 月 30 日，B 类份额前十名场内基金份额持有人的情况如下表。

序号 持有人名称（全称） 持有 B 类份额（份） 占 B 类份额比例（%）

- 1 王毅 11,999,960.00 32.99
- 2 李怡名 7,999,960.00 21.99
- 3 张清平 1,563,960.00 4.30
- 4 崔书华 799,996.00 2.20
- 5 尚绍华 799,960.00 2.20
- 6 重庆华盛房地产开发有  
限公司 799,960.00 2.20
- 7 陈洁明 799,960.00 2.20
- 8 张晨 479,982.00 1.32
- 9 成都共同投资有限公司 399,960.00 1.10
- 10 郭淑兰 399,960.00 1.10

11 邱佩珍 399,960.00 1.10

12 胡松铨 399,960.00 1.10

注：以上信息依据中国证券登记结算有限责任公司上海分公司提供的持有人信息编制。

由于四舍五

入的原因，占场内总份额比例分项之和与合计可能有尾差。

## 五、基金主要当事人简介

### （一）基金管理人

1、名称：大成基金管理有限公司

2、法定代表人：刘卓 B056 ■ 2015年7月2日 星期四

信息披露 Disclosure

3、总经理：罗登攀

4、注册资本：贰亿元人民币

5、注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层

6、批准设立机关及设立批准文号：中国证券监督管理委员会证监基金字【1999】10 号

7、法人营业执照文号：440301102808319

8、经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务

9、股东及持股比例：公司股东为中泰信托有限责任公司、中国银河投资管理有限公司、光大证券股份

有限公司和广东证券股份有限公司，各股东持股比例分别为 48%、25%、25%、2%。

10、内部组织结构及职能：

大成基金管理有限公司设有股东会、董事会、监事会。公司组织架构下设二十三个部门，分别为股票

投资部、研究部、社保基金及机构投资部、固定收益总部（下设公募投资部、非公募投资部、固收研究部、运

营交易室）、数量与指数投资部、专户投资部、市场部（下设渠道管理部、财富管理部）、战略客户部、互联

网金融总部（下设电子商务部、平台创新部、研发部与技术支持部）、产品研发与金融工

程部、品牌管理与

营销策划部、信息技术部、交易管理部、基金运营部、客户服务部、国际业务部、监察稽

核部、风险管理部、

总经理办公室、董事会办公室、人力资源部、计划财务部以及行政部。公司在北京、上海、西安、成都、武

汉、福州、沈阳、广州、青岛和南京等地设立了十家分公司，拥有两家子公司，分别为大成国际资产管理有

限公司及大成创新资本管理有限公司。此外，公司还设立了投资决策委员会、投资风险

略规划委员会等专业委员会。

公司以“责任、回报、专业、进取”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，以稳健灵活的投资策略和注重绩优、高成长的投资组合，力求为投资者获得更大投资回报。

11、人员情况：截止 2014 年 11 月 30 日，公司共有员工 268 名，大学本科及以上学历 246 名，占员工总数 91.79%。

12、信息披露负责人及咨询电话：杜鹏，0755-83183388

13、基金管理业务情况简介：

截至 2015 年 6 月 4 日，本基金管理人共管理 4 只 ETF 及 1 只 ETF 联接基金：大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金、深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金、中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金，2 只 QDII 基金：大成标普 500 等权重指数证券投资基金、大成纳斯达克 100 指数证券投资基金及 47 只开放式证券投资基金：大成景丰债券型证券投资基金（LOF）、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（LOF）、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、大成策略回报股票型证券投资基金、大成行业轮动股票型证券投资基金、大成中证红利指数证券投资基金、大成核心双动力股票型证券投资基金、大成竞争优势股票型证券投资基金、大成景恒保本混合型证券投资基金、大成内需增长股票型证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金、大成消费主题股票型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、大成优选股票型证券投资基金（LOF）、大成月添利理财债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场证券投资

基金、大成月月

盈短理财债券型证券投资基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、大成景安短融债券型证券投

资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金、大成景旭纯债债券型证券投资基金、大成景祥分级债券型

证券投资基金、大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金、大成健康产业股票型证券投资基金、大

成中小盘股票型证券投资基金（LOF）、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成丰财宝货币市场基金、

大成景益平稳收益混合型证券投资基金、大成添利宝货币市场基金、大成景利混合型证券投资基金、大成

产业升级股票型证券投资基金（LOF）、大成高新技术产业股票型证券投资基金、大成互联网思维混合型

证券投资基金、大成景秀灵活配置混合型证券投资基金、大成景明灵活配置混合型证券投资基金、大成景

穗灵活配置混合型证券投资基金、大成景源灵活配置混合型证券投资基金、大成景鹏灵活配置混合型证

券投资基金和大成睿景灵活配置混合型证券投资基金。

14、本基金基金经理：苏秉毅先生：经济学硕士。2004年9月至2008年5月就职于华夏基金管理有限公司

司基金运作部。2008年加入大成基金管理有限公司，历任产品设计师、高级产品设计师、基金经理助理、基

金经理。2011年3月3日至2012年2月8日担任深证成长40交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成

长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理。2012年8月28日至2014年1月23日担任大

成中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2014年1月24日至2014年2月17日任

大成健康产业股票型证券投资基金基金经理。2012年2月9日至2014年9月11日任深证成长40交易型开放

式指数证券投资基金及大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2012年8月

24日起任中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2013年1月1日开始兼任大成沪深300

指数证券投资基金基金经理。2013年2月7日起任大成中证100交易型开放式指数证券投资基金基金经



理。2015年6月5日起任大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理。现同时担任大成基金管

理有限公司数量投资部总监助理。具有基金从业资格。国籍：中国。

夏高先生：工学博士。2011年1月至2012年5月就职于博时基金管理有限公司，任股票投资部投资分

析员。2012年7月加入大成基金管理有限公司，历任数量投资部高级数量分析师。

2013年3月25日起任大

成价值增长证券投资基金基金经理助理。2014年12月6日起任大成中证红利指数证券投资基金基金经理。

具有基金从业资格。国籍：中国。

## （二）基金托管人

### 1、基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司（简称：中国工商银行）

住所：北京市西城区复兴门内大街55号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人：姜建清

成立时间：1984年1月1日

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币349,018,545,827元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会和中国人民银行证监基字【1998】3号

联系人：赵会军

联系电话：010-66105799

### 2、主要人员情况

截至2014年12月末，中国工商银行资产托管部共有员工207人，平均年龄30岁，95%以上员工拥有大

学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

### 3、基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚

实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统

和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供

安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中

产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2014 年 12 月，中国工商银行共托管证券投资基金 407 只。自 2003 年以来，本行连续十年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 45 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

### （三）验资机构

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)  
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼  
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 3 楼  
法定代表人：杨绍信  
经办注册会计师：薛竞、俞伟敏  
电话：021-23238888  
传真：021-23238800  
联系人：俞伟敏

## 六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

## 七、基金财务状况

### （一）基金募集期间费用

本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用, 不从基金资产中支付。

### （二）基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

### （三）基金资产负债表

本基金 2015 年 6 月 30 日资产负债表如下：

资 产 期 末 负 债 和 所 有 者 权 益 期 末  
余 额 余 额

资产：负债：

银行存款 288,688,268.72 短期借款

结算备付金 交易性金融负债

存出保证金 衍生金融负债

交易性金融资产 卖出回购金融资产款

其中：股票投资 应付证券清算款

债券投资 应付赎回款

资产支持证券投资 应付管理人报酬 7,910.08

基金投资 应付托管费 1,740.22

衍生金融资产 应付销售服务费

买入返售金融资产 应付交易费用

应收证券清算款 应付税费

应收利息 36,314.68 应付利息

应收股利 应付利润

应收申购款 其他负债 2,162.37

其他资产 负债合计 11,812.67

所有者权益：

实收基金 288,718,809.63

未分配利润 -6,038.90

所有者权益合计 288,712,770.73

资产合计：288,724,583.40 负债与持有人权益总计：288,724,583.40

## 八、基金投资组合

截止到2015年6月30日，本基金的投资组合如下：

### （一）基金资产组合情况

项目名称	项目市值(元)	占基金资产总值比重(%)
------	---------	--------------

股票	-	0.00
----	---	------

债券	-	0.00
----	---	------

银行存款及清算备付金合计	288,688,268.72	99.99
--------------	----------------	-------

其他资产	36,314.68	0.01
------	-----------	------

资产总值	288,724,583.40	100.00
------	----------------	--------

### （二）按行业分类的股票投资组合

本基金于2015年6月30日未持有股票投资。

### （三）按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

本基金于2015年6月30日未持有股票投资。

### （四）按券种分类的债券投资组合

本基金于2015年6月30日未持有债券投资。

(五) 按市值占净值比例大小排序的前五名债券明细

本基金于 2015 年 6 月 30 日未持有债券投资。

(六) 按市值占净值比例大小排序的前十名资产支持证券明细

本基金于 2015 年 6 月 30 日未持有资产支持证券。

(七) 按市值占净值比例大小排序的前五名权证明细

本基金于 2015 年 6 月 30 日未持有权证投资。

(八) 投资组合报告附注

1、本基金于 2015 年 6 月 30 日未持有证券投资。

2、2015 年 6 月 30 日其他资产构成：

序号 名称 金额（元）

1 存出保证金 -

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 36,314.68

5 应收申购款 -

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 36,314.68

九、重大事件揭示

无。

十、基金管理人承诺

基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出以下承诺：

(一) 严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运

用基金资产。

(二) 真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有

重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。

(三) 在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在

市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专门的基金托管部，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财产托管事宜。

根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比

例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督

和核查。

基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，将及时以

书面形式通知基金管理人限期纠正，并在限期内，随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠

正，并将纠正结果报告中国证监会。

## 十二、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

## 十三、备查文件目录

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

可供免费查阅。

(一) 中国证监会核准大成中证互联网金融指数分级证券投资基金募集的文件

(二) 《大成中证互联网金融指数分级证券投资基金基金合同》

(三) 《大成中证互联网金融指数分级证券投资基金托管协议》

(四) 法律意见书

(五) 基金管理人业务资格批件和营业执照

(六) 基金托管人业务资格批件和营业执照

(七) 中国证监会要求的其他文件

存放地点：基金管理人和基金托管人的住所

查阅方式：基金投资者可在营业时间免费查阅，或通过指定的信息披露媒体、本基金管理人网站

([www.dcfund.com.cn](http://www.dcfund.com.cn)) 查阅。

风险提示：基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈

利，也不保证最低收益。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书。敬请投资者

注意投资风险。

大成基金管理有限公司

2015年7月2日

附件：基金合同摘要

## 一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

### （一）基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

（1）依法募集资金；

（2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；

（3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

（4）销售基金份额；

（5）按照规定召集基金份额持有人大会；

（6）依据《基金合同》及有关法律、法规、规章和规范性文件，对于基金托管人违反了《基金合同》或有关

法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会和其

他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

（7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

（9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的

费用；

（10）依据《基金合同》及有关法律、法规、规章和规范性文件决定基金收益的分配方案；

（11）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

（12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资

于证券所产生的权利；

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

（14）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

（15）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户等

业务的业务规则；

（16）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

- (1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- (2) 办理基金备案手续；
- (3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉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基金管理人财产相互独立，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》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产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) 依法接受基金托管人的监督；
- (8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值、互联网金融份额的基金份额净值、互联网金融 A 份额与互联网金融 B 份额的基金份额参考净值，确定互联网金融份额申购、赎回的价格；
- (9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- (10) 编制季度、半年度和年度基金报告；
- (11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- (12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；
- (13) 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
- (14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- (15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (16) 按规定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) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间内发出，并且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，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

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

(19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

(20) 因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任

任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合

同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

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

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全

部募集费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## (二) 基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

(1) 自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

(2) 依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规

行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保

护基金投资者的利益；

(4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算；

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；



(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

(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自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设

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》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产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) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指

令，及时办理清算、交割事宜；

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披

露前予以保密，不得向他人泄露；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、互联网金融份额的基金份额净值、互

联网金融 A 份

额与互联网金融 B 份额基金份额参考净值、互联网金融份额申购、赎回价格；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对基金财务会计报告、季度、半年度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《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《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；

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

(12) 建立并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

(15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合

基金份额持有

人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

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

(18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知

基金管理人；

(19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反

《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(三) 基金份额持有人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

(1) 分享基金财产收益；

(2) 参与分配清算后的剩余基金财产；

(3) 依法转让或申请赎回其持有的基金份额；

(4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；

(5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

(6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

(7) 监督基金管理人的投资运作；

(8) 对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

(1) 认真阅读并遵守基金合同、招募说明书等信息披露文件；

(2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，

自行承担投资风险；

(3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

(4) 交纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

(一) 基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。

### 基金份

额持有人大会的审议事项应分别由互联网金融份额、互联网金融 A 份额、互联网金融 B 份额的基金份额持

有人独立进行表决。 基金份额持有人持有的每一基金份额在其对应的份额级别内拥有平等的投票权。

本基金份额持有人大会未设日常机构。

(二) 当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止基金合同，但依据本基金合同约定终止基金合同的情形除外；
  - (2) 转换基金运作方式，但基金合同另有约定，或法律法规和中国证监会另有规定的除外；
  - (3) 变更基金类别，但基金合同另有约定的除外；
  - (4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
  - (5) 变更基金份额持有人大会程序；
  - (6) 更换基金管理人、基金托管人；
  - (7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求提高该等报酬标准的除外；
  - (8) 本基金与其他基金的合并；
  - (9) 终止基金份额的上市，但因本基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的除外；
  - (10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
  - (11) 单独或合计持有互联网金融份额、互联网金融 A 份额、互联网金融 B 份额各自份额 10%以上(含 10%)的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同)就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
  - (12) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；
  - (13) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。
- (三) 在不违背法律法规和基金合同约定，以及对份额持有人利益无实质性不利影响的情

况下，出现

以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同，不需召开基金份额持有人大会：

(1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；

(2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内调整互联网金融份额的申购费率、调低赎回费率或不影

响现有基金份额持有人利益的前提下变更收费方式；

(3) 因相应的法律法规、上海证券交易所或登记机构的相关业务规则发生变动必须对基金合同进行

修改；

(4) 在对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，增加或减少份额类别，或调整基金份额分

类办法及规则；

(5) 在符合法律法规规定、基金合同约定，且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基

金推出新业务或服务；

(6) 基金管理人、登记机构、代销机构在法律法规规定的范围内调整有关基金认购、申

购、赎回、转

换、非交易过户、转托管等业务的规则；

(7) 对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重大变化；

(8) 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；

(9) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(10) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

(四) 召集方式：

1、除法律法规或本基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。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。

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，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

3、单独或合计持有互联网金融份额、互联网金融 A 份额、互联网金融 B 份额各自份额

10%以上（含 10%）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，单独或合计持有互联网金融份额、互联网金融 A 份额、互联网金融 B 份额各自份额 10%以上（含 10%）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 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

4、单独或合计持有互联网金融份额、互联网金融 A 份额、互联网金融 B 份额各自份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计持有互联网金融份额、互联网金融 A 份额、互联网金融 B 份额各自份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 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。

#### （五）通知

1、基金份额持有人大会的召集人（以下简称“召集人”）负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登

记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 30 日在指定媒介公告。基金份额持有人大会

通知须至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点和出席方式；
- （2）会议拟审议的主要事项；
- （3）会议形式；
- （4）议事程序；

(5) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日；

(6) 代理投票的授权委托书的内容要求(包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等)、送

达时间和地点；

(7) 表决方式；

(8) 会务常设联系人姓名、电话；

(9) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

(10) 召集人需要通知的其他事项。

2、采用通讯方式开会并进行表决的情况下，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

表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；

如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集

人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监

督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

#### (六) 会议方式

(1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会、通讯方式开会及法律法规、中国证监会允许的

其他方式开会。

(2) 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管

理人和基金托管人的授权代表应当出席，如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效

力。

(3) 通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。在法律法规或监管机

构允许的情况下，经会议通知载明，基金份额持有人采用网络、电话、短信或其他方式，在表决截至日以前

对表决事项进行投票并由召集人予以记录，视为基金份额持有人已以通讯书面方式作出有效表决。

(4) 在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金亦可采用网络、电话等其他非书面方式由基金份额持有人对其代表进行授权；在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会或通讯开会。

(5) 会议的召开方式由召集人确定。

#### 1、现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

1) 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，有效的互联网金融份额、互联网金融 A 份额、互

联网金融 B 份额各自基金份额应占权益登记日各自基金总份额的二分之一以上(含二分之一)；若到会者在

权益登记日代表的有效的互联网金融份额、互联网金融 A 份额、互联网金融 B 份额各自基金份额少于本基

金在权益登记日互联网金融份额、互联网金融 A 份额、互联网金融 B 份额各自基金总份额的二分之一，召

集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集

基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的互联网金融份

额、互联网金融 A 份额、互联网金融 B 份额各自基金份额应不少于本基金在权益登记日互联网金融份额、

互联网金融 A 份额、互联网金融 B 份额各自基金总份额的三分之一（含三分之一）。

2) 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额

的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规

定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符。

#### 2、通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

1) 召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

2) 召集人按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) 召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持

有人的书

面表决意见，如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的，不影响表决效力；

4) 本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的互联网金融份

额、互联网金融 A 份额、互联网金融 B 份额各自的基金份额占权益登记日各自基金总份额的二分之一以上

(含二分之一)；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见基金份额持有人所持有的互联网

金融份额、互联网金融 A 份额、互联网金融 B 份额各自基金份额小于在权益登记日互联网金融份额、互联

网金融 A 份额、互联网金融 B 份额各自基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大

会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。

重新召集的基金份

额持有人大会应当有代表三分之一（含三分之一）以上互联网金融份额、互联网金融 A 份

额、互联网金融 B 份额各自基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见；

5) 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基金份

额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与登记机构记录相符。

#### (七) 议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

(1) 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容，以及法律法规和基

金合同规定的其他事项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。

(2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日互联网金融份额、互联网金融 A 份

额、互联网金融 B 份额各自份额 10%以上(含 10%)的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事

由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

(3) 对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和

基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金



份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在  
该次基金份额持  
有人大会上  
进行解释和说明。

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

(4) 基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修  
改，应当在  
基金份额持有人大会召开前 30 日及时公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少  
与公告日期有 30  
日的间隔期。

## 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规定程序宣布会议议事程序及注意事项，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，经合法执业的律师见证后形成  
大会决议。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的，其授权代表未能主持大会的情况  
下，由基金托  
管人授权代表主持；如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大  
会的基金份额  
持有人和代理人以所代表的基金份额二分之一以上(含二分之一)多数选举产生一名代表作  
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、  
持有或代表有表决权的基金份额数量、委托人姓名(或单位名称)等事项。

### (2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期  
后第 2 个工作  
日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通  
知但拒绝到场监  
督，则在公证机关监督下形成的决议有效。

3、基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

#### (八) 决议形成的条件、表决方式、程序

1、互联网金融份额、互联网金融 A 份额、互联网金融 B 份额的基金份额持有人所持每一基金份额在其

对应份额级别内享有平等的表决权。

2、基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

##### (1) 一般决议

一般决议须经出席会议的互联网金融份额、互联网金融 A 份额、互联网金融 B 份额的各自基金份额持

有人(或其代理人)所持表决权的二分之一以上(含二分之一)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

特别决议须经出席会议的互联网金融份额、互联网金融 A 份额、互联网金融 B 份额的各自基金份额持

有人(或其代理人)所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效；涉及更换基金管理人、更换基

金托管人、转换基金运作方式、互联网金融 A 份额与互联网金融 B 份额的终止运作、终止基金合同、本基金

与其他基金合并必须以特别决议通过方为有效。

3、基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

4、采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律法规和会议

通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计

入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

5、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

6、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。

#### (九) 计票

##### 1、现场开会

(1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则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和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集

人授权的一名监督员共同担任监票人；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和代理人中推举两名基金份额持有人代表与基

金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人；但如果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，由大会主持人当场公布计票结果。

(3) 如大会主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有异议，可以在宣布表决结果后

立即对投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主

持人应当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，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效

力。

## 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票人在监督人派出的授权代表

的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证；基金管理人或基金托管人拒派代表对表决意

见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

### (十) 基金份额持有人大会决议的生效和公告

1、基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会

备案。基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

2、生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。基

金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会决议。

3、基金份额持有人大会决议应自生效之日起2个工作日内在指定媒介公告。如果采用通讯方式进行

表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

(十一) 本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等的规定，凡是直

接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人提前公告后，可

直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

### 三、基金的收益与分配

在存续期内，本基金（包括互联网金融份额、互联网金融 A 份额、互联网金融 B 份额）不进行收益分

配。

### 四、基金的费用与税收

#### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金合同生效后的标的指数许可使用费；
- 4、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、证券账户开户费用、账户维护费用；
- 10、基金的上市费和年费；
- 11、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

#### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由托管人根据与管理人核对一致的财务数

据，自动在次月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若

遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

##### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.22% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.22\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由托管人根据与管理人核对一致的财务数

据，自动在次月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若

遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 3、标的指数许可使用费

本基金的标的指数许可使用费按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率计提。标的指数许可使用费

的计算方法如下：

$$H = E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的标的指数许可使用费

E 为前一日的基金资产净值

标的指数许可使用费每日计算，逐日累计至每季季末，按季支付（当季不足 50,000 元的，按 50,000 元

计算），计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。由基金管理人向基金托管人发送标的指数许

可使用费划款指令，基金托管人复核后于次季前 10P 个工作日内从基金财产中一次性支付给标的指数供

应商。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

标的指数供应商根据相应指数许可协议变更标的指数许可使用费率和计算方式时，基金管理人需依

照有关规定最迟于新的费率和计费方式实施日前 2 日在至少一家指定媒介公告。

上述“一、基金费用的种类中第 4—11 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

列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

#### （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、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财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### （四）基金税收

本基金运作过程中涉及各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相

关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代

缴。

## 五、基金财产的投资方向和投资限制

### （一）投资范围

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板股

票及其他中国证监会核准上市的股票）、债券、债券回购、银行存款、股指期货、权证以及法律法规或中国

证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入

投资范围。

基金的投资组合比例为：股票投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于标的指数成份股和备选

成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金

后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

### （二）投资限制

#### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）股票投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于

非现金基金资产的 80%；

（2）每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的

现金或者到期日在一年以内的政府债券；

（3）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

（5）本基金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%；

（6）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%；

（7）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%；

（8）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%；

(9) 本基金管理人管理的全部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) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(11) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，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；

(12) 基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

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

(14) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

(15) 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

(16) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；

(17) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当不低于基金资产净值的 90%；

(18) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

(19) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合

上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

期间，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投

资的监督与检查自

本基金合同生效之日起开始。如果法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的，基金管理人

与基金托管人协商一致后，可以对上述比例限制进行变更。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基

金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

## 2、禁止行为

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 向基金管理人、基金托管人出资；
- (5) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (6) 法律、行政法规和国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关

系的该公司发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当遵循基金份额持有人

利益优先的原则，防范利益冲突，符合国务院证券监督管理机构的规定，并履行信息披露义务。

若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述约定的投资禁止行为和投

资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在依法履行相应程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资

限制规定。

## 六、基金财产净值的计算方法和公告方式

### (一) 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### (二) 基金资产净值公告、基金份额净值/参考净值公告

1、本基金的基金合同生效后，在互联网金融 A 份额和互联网金融 B 份额两类份额开始上市交易或者

互联网金融份额开始办理申购赎回前，基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值和互联网金融份额

的基金份额净值、互联网金融 A 份额与互联网金融 B 份额的基金份额参考净值；

2、在互联网金融 A 份额和互联网金融 B 份额两类份额上市交易或者互联网金融份额开始办理基金

份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网



点以及其他媒

介，披露开放日的互联网金融份额的基金份额净值、互联网金融 A 份额与互联网金融 B 份

额的基金份额参

考净值；

3、基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日（或自然日）基金资产净值和

互联网金融

份额的基金份额净值、互联网金融 A 份额与互联网金融 B 份额的基金份额参考净值。基

金管理人应当在前

款规定的市场交易日（或自然日）的次日，将基金资产净值以及互联网金融份额的基金份

额净值、互联

金融 A 份额与互联网金融 B 份额的基金份额参考净值登载在指定媒介上。

七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算的方式

#### （一）基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

2、基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在 6 个

月内无其他适当

的基金管理公司承接其原有权利义务；

3、基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在 6 个

月内无其他适当

的托管机构承接其原有权利义务；

4、基金合同约定的其他情形；

5、法律法规和中国证监会规定的其他情况。

#### （二）基金财产的清算

##### 1、基金财产清算组

（1）基金合同终止情形发生时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的

监督下进行

基金清算。

（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。

##### 2、基金财产清算程序

基金合同终止情形发生时，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。

## 基金财

产清算程序主要包括：

- (1) 基金合同终止情形发生后，发布基金财产清算公告；
- (2) 基金合同终止情形发生时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (3) 对基金财产进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行估价和变现；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- (6) 聘请律师事务所出具法律意见书；
- (7) 将基金财产清算结果报告中国证监会；
- (8) 参加与基金财产有关的民事诉讼；
- (9) 公布基金财产清算结果；
- (10) 对基金剩余财产进行分配。

### 3、清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产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。

### 4、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）—（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

### 5、基金财产清算的期限为6个月。

### 6、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、

交纳所  
欠税款并清偿基金债务后，分别计算互联网金融份额、互联网金融 A 份额与互联网金融 B 份额各自的应计

分配比例，并据此由互联网金融份额、互联网金融 A 份额与互联网金融 B 份额各自的基金

份额持有人根据

### 7、基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止情形发生并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；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，  
律师事务所出具

法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

#### 8、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

#### 八、争议的处理和适用的法律

各方当事人同意，因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应

提交仲裁。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，按照其届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点

为北京市。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

基金合同受中国法律管辖，适用中华人民共和国法律并从其解释。

#### 九、基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

（一）基金合同正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，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）基金合同可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。