

# 大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）更新招募说明书摘要

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

二〇一七年七月

## 重要提示

大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）经中国证监会 2015 年 9 月 1 日证监许可

【2015】2047 号文予以注册，并于 2016 年 7 月 15 日获得中国证监会证券投资基金机构监管部《关于大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）延期募集备案的回函》（机构部函【2016】1651 号）。本基金的基金合同于 2016 年 12 月 2 日正式生效。

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注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明中国证监会对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）为香港股票指数型证券投资基金，风险与预期收益高于混合型基金、债券基金以及货币市场基金，属于预期风险较高的产品。本基金投资于香港证券市场，基金净值除了会因香港证券市场波动等因素产生波动之外，还需面临汇率风险等投资海外市场的特殊风险。投资者在投资本基金前，应仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对申购基金的意愿、时机、数量等投资行为做出独立、谨慎决策，获得基金投资收益，亦承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的操作或技术风险、本基金的特有风险等。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险，即当单个交易日基金的净赎回申请超过基金总份额的百分之十时，投资者将可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。

投资有风险，投资人申购基金时，请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同。

本更新的招募说明书所载内容截止日为 2017 年 6 月 2 日（其中人员变动内容的更新以公告日期为准），有关财务数据和基金净值表现截止日为 2017 年 3 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。

## 一、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有限责任公司（持股比例 50%）、中国银河投资管理有限公司（持股比例 25%）、光大证券股份有限公司（持股比例 25%）三家公司。

法定代表人：刘卓

电话：0755-83183388

传真：0755-83199588

联系人：肖剑

### （二）主要人员情况

#### 1. 公司高级管理人员

#### 董事会:

刘卓先生, 董事长, 工学学士。曾任职于共青团哈尔滨市委、哈尔滨银行股份有限公司、中泰信托有限责任公司; 2007年6月, 任哈尔滨银行股份有限公司执行董事; 2008年8月, 任哈尔滨银行股份有限公司董事会秘书; 2012年4月, 任哈尔滨银行股份有限公司副董事长; 2012年11月至今, 任中泰信托有限责任公司监事会主席。2014年12月15日起任大成基金管理有限公司董事长。

靳天鹏先生, 副董事长, 国际法学硕士。1991年7月至1993年2月, 任职于共青团河南省委; 1993年3月至12月, 任职于深圳市国际经济与法律咨询公司; 1994年1月至6月, 任职于深圳市蛇口律师事务所; 1994年7月至1997年4月, 任职于蛇口招商港务股份有限公司; 1997年5月至2015年1月, 先后任光大证券有限责任公司南方总部研究部研究员, 南方总部机构管理部副总经理, 光大证券股份有限公司债券业务部总经理助理, 资产管理总部投资部副总经理(主持工作), 法律合规部副总经理, 零售交易业务总部副总经理; 2014年10月, 任大成基金管理有限公司公司董事; 2015年1月起任大成基金管理有限公司副董事长。

罗登攀先生, 董事、总经理, 耶鲁大学经济学博士。具注册金融分析师(CFA)、金融风险管理师(FRM)资格。曾任毕马威(KPMG)法律诉讼部资深咨询师、金融部资深咨询师, 以及SLCG证券诉讼和咨询公司合伙人; 2009年至2012年, 任中国证券监督管理委员会规划委专家顾问委员, 机构部创新处负责人, 兼任国家千人计划专家; 2013年2月至2014年10月, 任中信并购基金管理有限公司董事总经理, 执委会委员。2014年11月26日起任大成基金管理有限公司总经理。2015年3月起兼任大成国际资产管理有限公司董事长。2017年2月17日起代为履行大成基金管理有限公司督察长职务。

周雄先生, 董事, 金融学博士, 北京大学光华管理学院高级管理人员工商管理硕士(EMBA), 上海市黄浦区政协委员。1987年8月至1993年4月, 任厦门大学财经系教师; 1993年4月至1996年8月, 任华夏证券有限公司厦门分公司经理; 1996年8月至1999年2月, 任人民日报社事业发展局企业管理处副处长; 1999年2月至今任职于中泰信托有限责任公司, 历任副总裁、总裁, 现任中泰信托有限责任公司董事、总裁。

孙学林先生, 董事, 硕士研究生。具注册会计师、注册资产评估师资格。现任中国银河投资管理有限公司党委委员、总裁助理, 兼任投资二部总经理兼行政负责人、投资决策委员会副主任。2012年6月起, 兼任镇江银河创业投资有限公司总经理、投资决策委员会委员。

黄隽女士, 独立董事, 经济学博士。现任中国人民大学经济学院教授、博士生导师, 中国人民大学艺术品金融研究所副所长。

叶林先生, 独立董事, 法学博士。现任中国人民大学法学院教授、民商法教研室主任, 博士研究生导师、国家社会科学重点基地中国民商事法律科学研究中心兼职教授。

吉敏女士, 独立董事, 金融学博士, 现任东北财经大学讲师, 教研室主任, 东北财经大学金融学国家级教学团队成员, 东北财经大学开发金融研究中心助理研究员, 主要从事金融业产业组织结构、银行业竞争方面的研究。参与两项国家自然科学基金、三项国家社科基金、三项教育部人文社会科学一般项目、多项省级创新团队项目, 并负责撰写项目总结报告, 在国内财经类期刊发表多篇学术论文。

金李先生, 独立董事, 博士。现任英国牛津大学商学院终身教职正教授(博士生导师)和北京大学光华管理学院讲席教授(博士生导师), 金融系联合系主任, 院长助理, 北京大学国家金融研究中心主任。曾在美国哈佛大学商学院任教十多年, 并兼任哈佛大学费正清东亚研究中心执行理事。

#### 监事会:

陈希先生, 监事长, 中国人民大学经济学专业研究生, 高级经济师。2006年被亚洲风险与危机管理协会授予企业风险管理师资格。2000年1月, 先后任中国银河证券有限责任公司审计部、合规(法律)部总经理; 2007年1月, 任中国银河投资管理有限公司董事、常务副总裁、党委委员; 2010年7月, 兼任吉林省国家生物产业创业投资有限责任公司董事长兼总经理、吉林省国家汽车电子产业创业投资有限责任公司董事; 2012年6月, 兼任镇江银河创业投资有限公司董事长; 2012年7月, 任中国银河投资管理有限公司总裁; 2015年1月起, 任大成基金管理有限公司监事长。

蒋卫强先生，职工监事，经济学硕士。1997年7月至1998年10月任杭州益和电脑公司开发部软件工程师。1998年10月至1999年8月任杭州新利电子技术有限公司电子商务部高级程序员。1999年8月加入大成基金管理有限公司，历任信息技术部系统开发员、金融工程部高级工程师、监察稽核部总监助理、信息技术部副总监、风险管理部副总监、风险管理部总监，现任信息技术部总监。

吴萍女士，职工监事，文学学士，中国注册会计师协会非执业会员。曾任职于中国农业银行深圳分行、日本三和银行深圳分行、普华永道会计师事务所深圳分所。2010年6月加入大成基金管理有限公司，历任计划财务部高级会计师、总监助理，现任计划财务部副总监。2016年10月起兼任大成国际资产管理有限公司董事。

其他高级管理人员：

肖剑先生，副总经理，哈佛大学公共管理硕士。曾任深圳市南山区委（政府）办公室副主任，深圳市广聚能源股份有限公司副总经理兼广聚投资控股公司执行董事、总经理，深圳市人民政府国有资产监督管理委员会副处长、处长。2015年1月加入大成基金管理有限公司，任公司副总经理。

温智敏先生，副总经理，哈佛大学法学博士。曾任职于HuntonWilliams美国及国际律师事务所。曾任中银国际投行业务副总裁、香港三山投资公司董事总经理、标准银行亚洲有限公司董事总经理兼中国投行业务主管。2015年4月加入大成基金管理有限公司，任首席战略官，2015年8月起任公司副总经理。2016年10月起兼任大成国际资产管理有限公司董事。

周立新先生，副总经理，大学本科学历。曾任新疆精河县党委办公室机要员、新疆精河县团委副书记、新疆精河县人民政府体改委副主任、新疆精河县八家户农场党委书记、新疆博尔塔拉蒙古自治州团委副书记及少工委主任、江苏省铁路发展股份有限公司办公室主任、江苏省铁路发展股份有限公司控股企业及江苏省铁路实业集团有限公司控股企业负责人、中国华闻投资控股有限公司燃气战略管理部项目经理。

2005年1月加入大成基金管理有限公司，历任客户服务中心总监助理、市场部副总经理、上海分公司副总经理、客户服务部总监兼上海分公司总经理、公司助理总经理，2015年8月起任公司副总经理。

谭晓冈先生，副总经理，哈佛大学公共行政管理硕士。曾任财政部世界银行司科长，世界银行中国执基办技术顾问，财政部办公厅处长，全国社保基金理事会办公厅处长、海外投资部副主任。2016年7月加入大成基金管理有限公司，2017年2月起任公司副总经理。

姚余栋先生，副总经理，英国剑桥大学经济学博士。曾任职于原国家经贸委企业司、美国花旗银行伦敦分行。曾任世界银行咨询顾问，国际货币基金组织国际资本市场部和非洲部经济学家，原黑龙江省招商局副局长，黑龙江省商务厅副厅长，中国人民银行货币政策二司副巡视员，中国人民银行货币政策司副司长，中国人民银行金融研究所所长。2016年9月加入大成基金管理有限公司，任首席经济学家，2017年2月起任公司副总经理。

陈翔凯先生，副总经理，香港中文大学工商管理硕士。曾任职于广发证券海南分公司，平安保险集团公司。曾任华安财产保险有限公司高级投资经理，国投瑞银基金管理有限公司固定收益部总监，招商证券资产管理有限公司副总经理。2016年11月加入大成基金管理有限公司，2017年2月起任公司副总经理。

## 2. 基金经理

冉凌浩，金融学硕士，14年证券从业经历。2003年4月至2004年6月就职于国信证券研究部，任研究员；2004年6月至2005年9月就职于华西证券研究部，任高级研究员；2005年9月加入大成基金管理有限公司，历任金融工程师、境外市场研究员及基金经理助理。2011年8月26日起担任大成标普500等权重指数型证券投资基金基金经理。2014年11月13日起担任大成纳斯达克100指数证券投资基金基金经理。2016年12月2日起担任大成恒生综合中小型股指数基金(QDII-LOF)基金经理。2016年12月29日起担任大成海外中国机会混合型证券投资基金(LOF)基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国

## 3. 公司量化投资决策委员会境外投资决策小组

量化投资决策委员会境外投资决策小组由3名成员组成，名单如下：黎新平，基金经理，数量与指数投资部总监，量化投资决策委员会境外投资决策小组成员；苏秉毅，基金经理，数量与指数投资部副总监，量化投资决策委员会境外投资决策小组成员；冉凌浩，基金经理，量化投资决策委员会境外投资决策小组组成

员。

上述人员之间不存在亲属关系。

## 二、基金托管人

### (一) 基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

成立日期：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本：32,479,411.7 万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：林葛

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。经国务院批准,中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月 15 日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。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。在海外,中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉,每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行,中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念,坚持审慎稳健经营、可持续发展,立足县域和城市两大市场,实施差异化竞争策略,着力打造伴你成长服务品牌,依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品,致力为广大客户提供优质的金融服务,与广大客户共创价值、共同成长。

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。自 2010 年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准

(ISAE3402) 认证,表明了独立公正第三方对中国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。中国农业银行着力加强能力建设,品牌声誉进一步提升,在 2010 年首届金牌理财 TOP10 颁奖盛典中成绩突出,获最佳托管银行奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的最佳资产托管奖。2012 年荣获第十届中国财经风云榜最佳资产托管银行称号;2013 年至 2016 年连续荣获上海清算所授予的托管银行优秀奖和中央国债登记结算有限责任公司授予的优秀托管机构奖称号;2015 年、2016 年荣获中国银行业协会授予的养老金业务最佳发展奖称号。

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,2014 年更名为托管业务部/养老金管理中心,内设综合管理处、证券投资基金托管处、委托资产托管处、境外资产托管处、保险资产托管处、风险管理处、技术保障处、营运中心、市场营销处、内控监管处、账户管理处,拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

#### 2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近 140 名,其中具有高级职称的专家 30 余名,服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强,高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称,精通国内外证券市场的运作。

#### 3、基金托管业务经营情况

截止到 2017 年 3 月 31 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 361 只。

## (二) 基金托管人的内部风险控制制度说明

### 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

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。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,独立行使监督稽核职权。

### 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。

## (三) 基金托管人对基金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《基金法》、《运作办法》、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。

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。

## 三、境外托管人

### (一) 基本情况

公司名称: 摩根大通银行(JPMorganChaseBank,NationalAssociation)

注册地址:1111PolarisParkway,Columbus,OH43240,U.S.A.

办公地址:270ParkAvenue,NewYork,NewYork10017

法定代表人:JamesDimon

成立时间:1799 年

作为全球领先的金融服务公司,摩根大通总资产达 2.47 万亿美元,在超过 60 个国家经营。在投资银行业务、消费者金融服务、小企业和商业银行业务、金融交易处理、资产管理和私募股权投资基金等方面,摩根大通均为业界领导者。

摩根大通自 1946 年开始为其美国客户提供托管服务。之后为响应客户投资海外的要求,该公司在 1974 年率先开展了一种综合性的服务全球托管。此后,摩根大通继续扩展服务,以满足不断变化的客户需要。通过提供优质服务和创新的产品,摩根大通始终保持其领先地位。

如今,作为全球托管行业的领先者,摩根大通托管资产达 20.5 万亿美元,为全世界最大的机构投资者提供创新的托管、基金会计和服务以及证券服务。摩根大通是一家真正的全球机构,在超过 60 个国家有实体运作。与很多竞争对手不同之处在于,我们还可为客户提供顶级投资银行在市场领先的服务,包括外汇交易、全球期货与期权清算、股权及股权挂钩产品以及固定收益投资的交易与研究。同时,在资产负债表内和表外的现金和流动性方面,我们也有很强的解决方案能力。

此外,摩根大通还是亚太地区全球托管的先行者之一,其历史可以追溯到 1974 年,在亚太地区 15 个国家

/地区均有客户：日本、澳大利亚、文莱、中国、香港、印度、马来西亚、新西兰、新加坡、韩国、台湾、菲律宾、泰国、东帝汶和越南。

## （二）境外托管人职责

- 1、安全保管基金的境外资产，及时办理清算、交割事宜。
- 2、准时将公司行为信息通知基金管理人和/或基金托管人，确保基金及时收取所有应得收入。
- 3、其他由基金托管人委托其履行的职责。

## 四、相关服务机构

### （一）销售机构及联系人

#### 1. 直销机构

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：刘卓

电话：0755-83183388

传真：0755-83199588

联系人：乐园

公司网址：[www.dcfund.com.cn](http://www.dcfund.com.cn)

大成基金客户服务热线：400-888-5558（免长途固话费）

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：肖成卫、关志玲、白小雪

电话：0755-22223523/22223177/22223555

传真：0755-83195235/83195242/83195232

邮编：518040

#### 2. 代销机构

##### 1、中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

联系人：林葛

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

客服电话：95599

网址：[www.abchina.com](http://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：田国立

客服电话：95566

联系人：王娟

电话：010-66594909

传真：010-66594942

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

##### 3、中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：易会满

客服电话：95588

联系人：洪渊

联系电话：010-66105799

传真：010-66107914

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

#### 4、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

法定代表人：李建红

客服电话：95555

联系人：邓炯鹏

电话：0755-83077278

传真：0755-83195049

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

#### 5、上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

联系人：高天、虞谷云

客服热线：95528

电话：021-61618888

传真：021-63604199

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

#### 6、中国光大银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心

法定代表人：唐双宁

客服电话：95595

联系人：朱红

电话：010-63636153

传真：010-68560312

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

#### 7、上海银行股份有限公司

注册地址：上海市银城中路 168 号

法人代表：范一飞

办公地址：上海市银城中路 168 号

联系人：汤征程

客服电话：95594

网站：[www.bankofshanghai.com](http://www.bankofshanghai.com)

#### 8、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：谢永林

电话：021-38637673

传真：0755-22197701

联系人：张莉

客户服务热线：95511-3

网址：<http://bank.pingan.com>

9、宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市江东区中山东路 294 号

法定代表人：陆华裕

联系人：胡技勋

电话：021-63586210

传真：021-63586215

客服电话：96528（宁波、杭州、南京、深圳、苏州、温州）、962528（北京、上海）

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

10、国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：杨德红

客服电话：95521

联系人：芮敏祺、朱雅崑

联系电话：021-38676666

传真：021-38670161

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

11、中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

法定代表人：王常青

客服电话：4008888108

联系人：权唐

电话：010-85130577

传真：010-65182261

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

12、中国银河证券股份有限公司

注册地址：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：宋卫刚

客服电话：4008-888-888

联系人：宋明

联系电话：010-66568450

传真：010-66568990

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

13、申万宏源证券有限公司

通讯地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 40 层

法定代表人：李梅

客服电话：95523、4008895523

联系人：曹晔

电话：021-54033888

传真：021-54038844

网址：[www.sywg.com](http://www.sywg.com)

14、万联证券有限责任公司



注册地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

法定代表人：张建军

联系人：王鑫

联系电话：020-38286651

客服电话：400-8888-133

网址：[www.wlzq.com.cn](http://www.wlzq.com.cn)

#### 15、渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

法定代表人：王春峰

联系人：蔡霆

电话：022-28451991

传真：022-28451892

客服电话：4006515988

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

#### 16、华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人：周易

客服电话：4008-888-168、95597

联系人：庞晓芸

电话：0755-82492193

传真：0755-82492962

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

#### 17、中信证券（山东）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：杨宝林

客服电话：95548

联系人：吴忠超

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

网址：[www.zxwt.com.cn](http://www.zxwt.com.cn)

#### 18、信达证券股份有限公司

地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

客服电话：4008008899

联系人：唐静

联系电话：010-63081000

传真：010-63080978

公司网址：[www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

#### 19、光大证券股份有限公司

办公地址：上海市静安区新闸路 1508 号

法定代表人：薛峰

客服电话：400-888-8788、95525

联系人：刘晨

电话：021-22169999

传真：021-22169134

网址：www.ebscn.com

20、平安证券股份有限公司

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

法定代表人：曹实凡

客服电话：95511 转 8

传真：0755-82400862

网址：www.pingan.com

21、国都证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人：常喆

客服电话：400-818-8118

联系人：黄静

电话：010-84183333

传真：010-84183311-3389

网址：www.guodu.com

22、申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

法定代表人：韩志谦

电话：010-88085858

传真：010-88085195

联系人：李巍

客服电话：400-800-0562

网址：www.hysec.com

23、中泰证券股份有限公司

办公地址：山东省济南市经十路 20518 号

法定代表人：李玮

客服电话：95538

联系人：吴阳

电话：0531-81283938

传真：0531-81283900

网址：www.qlzq.com.cn

24、第一创业证券股份有限公司

地址：深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25F

法人代表：刘学民

电话：95358

网址：www.firstcapital.com.cn

25、华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

法定代表人：黄金琳

客服电话：0591-96326

联系人：张宗锐

电话：0591-87383600

传真：0591-87841150

网址：[www.gfhfzq.com.cn](http://www.gfhfzq.com.cn)

26、爱建证券有限责任公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1600 号 1 幢 32 楼

法定代表人：钱华

客服电话：4001-962-502

联系人：陈敏

电话：021-32229888

传真：021-62878783

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

27、天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

法定代表人：林义相

客服电话：010-66045678

联系人：尹伶

传真：010-66045527

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

28、和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

联系人：刘洋

联系电话：021-20835785

传真：021-20835879

客服电话：400-920-0022

网址：<http://licaike.hexun.com>

29、深圳众禄金融控股股份有限公司

办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

电话：0755-33227950

传真：0755-82080798

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

客服电话：4006-788-887

30、上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼

法人代表：其实

联系人：潘世友

电话：021-54509998

传真：021-64383798

客服电话：400-1818-188

网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

31、上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室  
办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906  
法定代表人：杨文斌  
客服电话：400-700-9665  
联系人：张茹  
联系电话：021-58870011  
传真：021-68596916  
网址：[www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

32、蚂蚁(杭州)基金销售有限公司（原杭州数米基金销售有限公司）

注册地址：杭州市余杭区仓前街文一西路 1218 号 1 栋 202 室  
法人代表：陈柏青  
联系人：徐映绯  
电话：021-60897840  
传真：0571-26698533  
客服电话：4000-766-123  
网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

33、浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：杭州市西湖区文二西路 1 号元茂大厦 903 室  
办公地址：浙江省杭州市西湖区翠柏路 7 号电子商务产业园 2 号楼  
法人代表：凌顺平  
联系人：林海明  
电话：0571-88911818-8580  
传真：0571-88911818-8002  
客服电话：4008-773-772  
网站地址：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

34、北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室  
办公地址：北京市朝阳区东三环北路甲 19 号 SOHO 嘉盛中心 30 层 3001 室  
法定代表人：周斌  
客服电话：4008980618  
网址：[www.chtfund.com](http://www.chtfund.com)

35、上海基煜基金销售有限公司

住所：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）  
办公地址：上海市杨浦区昆明路 518 号 a1002 室  
法定代表人：王翔  
联系人：安彬  
客服电话：（021）65370077  
网址：[www.jiyufund.com.cn](http://www.jiyufund.com.cn)

36、上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室  
法定代表人：陈继武  
客服电话：4000178000  
联系人：葛佳蕊  
电话：021-63333319

传真：021-63332523

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

37、上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

法定代表人：郭坚

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

联系人：宁博宇

客服电话：4008219031

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

38、珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

法定代表人：肖雯

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203

联系人：黄敏嫦

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

客服电话：020-89629066

39、奕丰金融服务（深圳）有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座 1115 室，1116 室及 1307 室

法定代表人：TANYIKKUAN

联系人：叶健

电话：0755-89460507

传真：0755-21674453

客服电话：400-684-0500

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

40、北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

办公地址：北京市大兴区亦庄经济技术开发区科创十一街 18 号院京东集团总部

法定代表人：江卉

电话：个人业务：95118、4000988511

企业业务：4000888816

传真：010-8919566

网址：[fund.jd.com](http://fund.jd.com)

41、北京蛋卷基金销售有限公司（原北京葱次方资产管理有限公司）

注册地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

法定代表人：钟斐斐

客服电话：4000618518

联系人：袁永娇

电话：010-61840688

传真：010-61840699

网址：<https://danjuanapp.com>

## （二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

联系人：崔巍

电话：010-50938856

传真：010-50938907

### （三）律师事务所和经办律师

名称：北京市金杜律师事务所

注册地址：北京市朝阳区东三环中路 7 号财富中心写字楼 A 座 40 层

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、冯艾

联系人：冯艾

### （四）会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

电话：021-23238189

联系人：俞伟敏

经办注册会计师：张振波、俞伟敏

## 五、基金的名称

大成恒生综合中小型股指数证券投资基金

## 六、基金的类型

股票型证券投资基金、指数型基金

## 七、基金的运作方式

上市契约型开放式

## 八、基金的投资目标

本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

## 九、基金的投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股，也可以投资于以标的指数为跟踪标的的公募基金、上市交易型基金、结构性产品等。本基金可通过沪港股票市场交易互联互通机制（以下简称沪港通）投资于沪港通允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票。本基金还可以投资于全球证券市场中具有良好流动性的其他金融工具，包括在证券交易市场挂牌的普通股、优先股、存托凭证，固定收益类证券（含中期票据）、银行存款、现金等货币市场工具、权证、股指期货以及中国证监会允许本基金投资的其他产品或金融工具。

本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%，投资于以标的指数为跟踪标的的公募基金、上市交易型基金、结构性产品的比例不超过基金资产净值的 10%；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，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。

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。

## 十、基金的投资策略

本基金将主要按照标的指数的成份股及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如股票停牌、流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。

本基金通过港股通投资港股的策略是按照指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

本基金可能将一定比例的基金资产投资于以标的指数为跟踪标的的公募基金、上市交易型基金以及股指期货等金融衍生品，以优化投资组合的建立，达到节约交易成本和有效追踪标的指数表现的目的。本基金投资股指期货等金融衍生品的目的是为了更好的实现基金的投资目标，不得用于投机交易目的，或用作杠杆工具放大基金的投资。

本基金在投资的过程中，由于必须保有一定比例的现金资产，导致在市场上涨的过程中，基金投资组合的表现可能会落后于标的指数的表现。另外，由于基金投资组合权重与目标指数成份股权重的不一致、股票买卖价格与股票收盘价的差异、指数成份股的调整与指数成份股权重的调整所产生的交易费用、基金运作过程中的各项费用与开支都会使基金投资组合产生跟踪误差。

基金管理人会定期对跟踪误差进行归因分析，为基金投资组合下一步的调整及跟踪目标指数偏离风险的控制提供量化决策依据。在正常情况下，本基金力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 5%（以港元资产计价）。

#### 十一、基金的业绩比较基准

恒生综合中小型股指数收益率 95%+人民币活期存款利率（税后）5%

恒生综合中小型股指数由恒生指数有限公司根据恒生资讯服务有限公司特许协议发布及编制。恒生综合中小型股指数之商标及名称由恒生资讯服务有限公司全权拥有。恒生指数有限公司及恒生资讯服务有限公司已同意大成基金管理有限公司可就大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）使用及参考该指数，惟恒生指数有限公司及恒生资讯服务有限公司并无就(i)该指数及其计算或任何与之有关的数据的准确性或完整性；或(ii)该指数或其中任何成份或其所包涵的数据作任何用途之适用性或适合性；或(iii)任何人士因使用该指数或其中任何成份或其所包涵的数据作任何用途之结果，而向该产品之任何经纪或该产品持有人或任何其它人士作出保证或声明或担保，亦不会就该指数提供或默示任何保证、声明或担保。恒生指数有限公司可随时更改或修改计算及编制该指数及其任何有关的公式、成份股份及系数之过程及基准，而无须作出通知。于适用法律容许的范围内，恒生指数有限公司或恒生资讯服务有限公司不会因(i)（被许何人）就该产品使用及/或参考该指数；或(ii)恒生指数有限公司在计算该指数时的任何失准、遗漏、失误或错误；或(iii)与计算该指数有关并由任何其它人士提供的资料的任何失准、遗漏、失误、错误或不完整；或(iv)任何经纪、该产品持有人或任何其它处置该产品的人士，因上述原因而直接或间接接受的任何经济或其它损失承担任何责任或债务。任何经纪、持有人或任何其它处置该产品的人士，不得因有关该产品，以任何形式向恒生指数有限公司及/或恒生资讯服务有限公司进行索偿、法律行动或法律诉讼。任何经纪、持有人或任何其它人士，须在完全了解此免责声明，并且不能依赖恒生指数有限公司及恒生资讯服务有限公司的情况下处置该产品。为免产生疑问，本免责声明并不会于任何经纪、持有人或任何其它人士与恒生指数有限公司及/或恒生资讯服务有限公司之间构成任何合约或准合约关系，而亦不应视作已构成该等关系。

如果指数编制单位变更或停止恒生综合中小型股指数的编制及发布，或恒生综合中小型股指数由其他指数替代，或由于指数编制方法等重大变更导致恒生综合中小型股指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，在履行适当的程序后，变更本基金的标的指数。

#### 十二、基金的风险收益特征

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险

收益特征。本基金基金资产将投资于香港市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

### 十三、基金投资组合报告

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。

基金托管人中国农业银行根据基金合同规定，于2017年6月26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。

本投资组合报告所载数据取自本基金2017年第1季度报告，截至2017年3月31日。（财务数据未经审计）

#### 1. 期末基金资产组合情况

序号 项目 金额（人民币元） 占基金总资产的比例（%）

1 权益投资 112,041,660.27 89.95

其中：普通股 112,041,660.27 89.95

优先股 -0.00

存托凭证 -0.00

房地产信托凭证 -0.00

2 基金投资 -0.00

3 固定收益投资 -0.00

其中：债券 -0.00

资产支持证券 -0.00

4 金融衍生品投资 -0.00

其中：远期 -0.00

期货 -0.00

期权 -0.00

权证 -0.00

5 买入返售金融资产 -0.00

其中：买断式回购的买入返售金融资产 -0.00

6 货币市场工具 -0.00

7 银行存款和结算备付金合计 12,495,906.66 10.03

8 其他资产 22,034.05 0.02

9 合计 124,559,600.98 100.00

注：本基金通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为82,395.80元，占期末基金资产净值的比例为0.07%；通过深港通交易机制投资的港股公允价值为109,128,150.96元，占期末基金资产净值的比例为88.96%。

#### 2. 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区） 公允价值（人民币元） 占基金资产净值比例（%）

香港 112,041,660.27 91.33

合计 112,041,660.27 91.33

#### 3. 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

（1）报告期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别 公允价值（人民币元） 占基金资产净值比例（%）

工业 21,622,006.50 17.63

消费者非必需品 20,533,255.46 16.74

金融 14,209,698.63 11.58

房地产 11,995,888.63 9.78



信息技术 11,980,486.37 9.77  
基础材料 9,733,341.64 7.93  
医疗保健 9,084,257.91 7.41  
公用事业 5,862,929.65 4.78  
消费者常用品 2,838,597.54 2.31  
能源 2,564,274.89 2.09  
电信服务 1,616,923.05 1.32  
合计 112,041,660.27 91.33

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

（2）报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

#### 4. 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

（1）报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

序号 公司名称(英文) 公司名称(中文) 证券代码 所在证券市场 所属国家(地区) 数量(股) 公允价值(人民币元) 占基金资产净值比例(%)

1	SINOPHARMGROUPCO-H	国药控股	1099HK	港交所	中国香港	62,000	1,984,299.43	1.62
2	SUNNYOPTICALTECH	舜宇光学科技	2382HK	港交所	中国香港	38,000	1,916,205.94	1.56
3	GEELYAUTOMOBILEHOLDINGSLT	吉利汽车	175HK	港交所	中国香港	165,000	1,743,175.67	1.42
4	CRRCCORPLTD-H	中国中车	1766HK	港交所	中国香港	230,000	1,541,647.34	1.26
5	CITICSECURITIESCOLTD-H	中信证券	6030HK	港交所	中国香港	106,500	1,512,794.16	1.23
6	ANHUICONCHCEMENTCOLTD-H	安徽海螺水泥股份	914HK	港交所	中国香港	63,500	1,488,291.16	1.21
7	NEWCHINALIFEINSURANCEC-H	新华保险	1336HK	港交所	中国香港	40,500	1,330,353.32	1.08
8	CHINACONCHVENTUREHOLDINGS	海螺创业	586HK	港交所	中国香港	95,500	1,293,803.00	1.05
9	GREATWALLMOTORCOMPANY-H	长城汽车	2333HK	港交所	中国香港	164,000	1,288,538.40	1.05
10	CHINAVANKECOLTD-H	万科企业	2202HK	港交所	中国香港	69,100	1,288,272.07	1.05

（2）报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

#### 5. 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金额衍生品。

#### 9. 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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

#### 10. 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股票。

（3）其他资产构成

序号 名称 金额（人民币元）

1 存出保证金 -

- 2 应收证券清算款 -
- 3 应收股利 18,131.73
- 4 应收利息 3,902.32
- 5 应收申购款 -
- 6 其他应收款 -
- 7 待摊费用 -
- 8 其他 -
- 9 合计 22,034.05

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细  
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明  
报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明  
本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况。  
报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明  
本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分  
由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

#### 十四、基金业绩

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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

(一) 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	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	—	—
2017.01.01—2016.03.31	4.09%	0.53%	10.51%	0.72%	-6.42%	-0.19%
2016.12.02—2017.03.31	4.30%	0.45%	5.00%	0.75%	-0.70%	-0.30%

(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  
本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

(2016年12月2日至2017年3月31日)

注：1、本基金合同生效日为2016年12月2日，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期。截至报告期末，本基金处于建仓期。

#### 十五、费用概览

(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、基金合同生效后的指数许可使用费（包括为指数公司缴纳的相关税收以及与支付外币相关的汇兑损益、手续费、汇款费等）；
- 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（包括但不限于场地费、会计师费、律师费和公证费）；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的证券交易费用及在境外市场的交易、清算、登记等实际发生的费用（out-of-pocket fees），包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费

用等；

10、基金进行外汇兑换的相关费用；

11、基金依照有关法律法规应当缴纳的，购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花税、交易及其他税收及预扣提税（以及与前述各项有关的任何利息及费用）；

12、与基金缴纳税收有关的手续费、汇款费等；

13、基金上市费及年费；

14、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；

15、其他为基金的利益而产生的费用，如代表基金投票产生的费用、与基金有关的诉讼费、追索费等；

16、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：

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

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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。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（如基金托管人委托境外资产托管人，包括向其支付的相应服务费）按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 10 个工作日内从基金财产中一次性支取。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

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费支付方式支付指数许可使用费。其中，基金合同生效前的许可使用固定费是为获取使用指数开发基金的权利而支付的费用，不列入基金费用；基金合同生效后的指数许可使用费从基金财产中列支，按每季金额在 25,000 港币与参考下列公式逐日累计计算的金额中孰高者计。

计算方法如下：

$$H = EA \times \text{当年实际天数}$$

H 为每日应计提的指数使用费，币种为人民币

A 等于 0.04%，为恒生综合中小型股指数指数许可使用费的费率

E 为前一日基金资产净值

指数使用费每日计提，按季支付。由基金管理人向基金托管人发送指数使用费划付指令，经基金托管人复核后于次季度首日起 15 日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人根据指数使用许可协议所规定的方式支付给标的指数许可方。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

如果指数许可使用费的计算方法和费率等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费，此项变更无需召开基金份额持有人大会审议。基金管理人应及时按照《信息披露管理办法》的规定在指定媒介进行公告。

上述一、基金费用的种类中第 4—15 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的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

#### 十六、对招募说明书更新部分的说明

本更新招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集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，并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动，对2016年11月4日公布的《大成恒生综合中小型股指数证券投资基金招募说明书》进行了内容补充和更新，本更新的招募说明书主要更新的内容如下：

1. 根据最新数据，对四、基金的投资部分内容进行了更新。
2. 根据最新财务数据，对五、基金的业绩部分内容。
3. 根据最新资料，对六、基金管理人部分内容进行了更新。
4. 根据最新资料，对十六、基金托管人部分内容进行了更新。
5. 根据最新公告，对十八、相关服务机构部分内容进行了更新。
6. 根据最新情况，更新了二十三、招募说明书更新部分的说明。

大成基金管理有限公司

二〇一七年七月十七日