大成恒生指数证券投资基金（LOF）更新招募说明书摘要

2018年第2期

基金管理人：大成基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
二〇一八年九月

重 要 提 示

大成恒生指数证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）经中国证监会2015年11月25日证监许可【2015】2748号文予以注册，并于2017年4月11日获得中国证监会证券基金机构监管部《关于对大成恒生指数证券投资基金（LOF）延期募集备案的回函》（机构部函【2017】877号）。基金合同于2017年8月10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信息真实性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

证券投资基金（以下简称“基金”）是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资者购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

基金分为股票基金、混合基金、债券基金、货币市场基金等不同类型，投资者投资不同类型的基金将获得不同的收益预期，也将承担不同程度的风险。一般来说，基金所收益预期越高，投资者承担的风险也越大。

大成恒生指数证券投资基金（LOF）是股票指数型基金，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。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，本基金所特有风险等。巨额赎回风险，投资者承担的风险也越大。

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，投资人认购（或申购）基金时，请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同，基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负担。

本基金按照份额初始面值1.00元发售，在市场波动等因素的影响下，基金份额净值可能低于份额初始面值，投资者存在遭受损失的风险。

投资者应当通过本基金管理人或代销机构购买本基金，基金代销机构名单详见本基金《大成恒生指数证券投资基金（LOF）招募说明书》或《大成恒生指数证券投资基金（LOF）基金份额发售公告》。

本更新的招募说明书编载内容截止日为2018年8月10日（其中人员变动信息以公告日为准），有关财务数据和基金净值表现截止日为2018年6月30日，所列财务数据未经审计。

一、风险揭示

本基金为投资于香港市场的股票型指数基金，其主要面临以下三类风险：一是境外投资的特殊风险，包括海外市场风险、汇率风险、政府管制风险、法律风险、政治风险以及税务风险；二是本基金特有风险，包括指数投权风险、金融模型风险、跟踪误差风险、衍生品投资风险、证券借贷和正回购/逆回购风险、港股通特定业务风险、单一投资者集中度较高的风险；三是开放式基金投资的一般风险，包括上市公司经营风险、流动性风险、信用风险、利率风险、大宗交易风险、会计核算风险、交易结算风险、操作或技术风险以及不可抗力风险。

（一）境外投资的特殊风险

1. 海外市场风险

海外市场风险是指由于基金投资于海外证券市场，因而会受到不同国家或地区（对本基金而言，主要指香港）特有的政治因素、法律制度、经济周期等基本因素的影响，导致基金绩效面临较大的波动性和存在潜在的损失的风险。例如香港证券交易市场对每日证券交易价格并无涨跌幅上下限的规定，使得证券的每日涨跌幅有存在较大空间的可能性，另外，香港会计准则和信息披露制度与中国相比会有较大差异，可能导致基金管理人对公司盈利能力和投资价值判断产生偏差，从而也会给投资带来潜在的风险。

2. 汇率风险

本基金以人民币募集和认购，经过换汇后投资于香港市场以避元计价的金融工具。港币相对于人民币的汇率变化将会影响本基金以人民币计价的基金资产价值，从而导致基金资产面临潜在风险。

3. 政府管制风险

政府管制风险是指国家政府机关通过制定相关法律法规或采用行政干预手段对社会经济行为实施直接控制而使基金资产有遭受损失的风险。在境外证券投资过程中，基金所投资的国家/地区（对本基金而言，主要是香港）可能会不时采取某项管制措施，如资本或外汇管制，对公司或行业的国有化、政收资产以及征收高额税等，造成相应的财产受损、交易延误等相关风险，从而对基金收益以及基金资产带来不利影响。

4. 法律风险

由于香港的法律法规与中国大陆不同的原因，可能导致本基金在投资运作、交易结算以及资金汇出人等方面受到限制，从而使得基金资产面临损失的可能性。

5. 政治风险

香港因政治局势变化（如罢工、暴动、战争等）或法令的变动，可能导致市场的较大波动，从而给本基金的投资收益造成直接或间接的影响。

6. 税务风险

香港因政治局势变化（如罢工、暴动、战争等）或法令的变动，可能导致市场的较大波动，从而给本基金的投资收益造成直接或间接的影响。

6. 税务风险

由于香港在税务方面的法律法规存在一定差异，可能会要求基金就股息、利息、资本利得等收益向当地税务机构缴纳税金，该行为会减损或间接影响基金的净值，因此，香港的税收规定可能发生变化，或者实施具有追溯力的修订，从而导致基金资产面临潜在基金净值、估值或者出售投资当日并未预计的额外税项。

（二）本基金特有风险

1. 指数投权风险

本基金管理人依据指数投权许可协议依法取得在中国境内发行大成恒生指数证券投资基金（LOF）的权利。

恒生指数是由恒生指数有限公司根据恒生资讯服务有限公司的授权发布及编制。恒生指数的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可就本基金使用及参考该指数，但是，恒生指数有限公司及恒生资讯服务有限公司并不就(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)该指数或其计算或任何或合或其所包括的数据的适用性或适合性；或(iii)任何人士因使用该指数或其中任何或合或其所包括的数据产生的结果；而向本基金的任何投资者或其他公众作出保证或声明或责任。恒生指数有限公司及恒生资讯服务有限公司并未就(i)该指数及其任何有关的人士、任何证券或一般市场或其他事项的表现作出任何保证、声明或责任。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、成份股份及系数的过程及基准，而无须作出通知。在适用法律允许的范围内，恒生指数有限公司或恒生资讯服务有限公司不会因(i)大成基金就本基金使用及/或参考该指数；或(ii)恒生指数有限公司在计算该指数时出现任何失误、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误、遗漏、失误、错误或不完整；或(iv)任何经纪、本基金价格或任何其它交易本基金的人士，因上述原因而直接或间接蒙受的任何经济或其它损失承担任何责任或债务。任何经纪、本基金价格持有人或任何其它交易本基金的人士不得因本基金、为避免产生疑问，为使用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，并且不能获悉恒生指数有限公司及恒生资讯服务有限公司的情况下交易本基金，为避免产生疑问，本免责声明亦构成其中间经纪、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的任何合约或准合约关系，也不应视作已构成这种关系，任何投资者如认购或购买本基金权益，该投资者将被视为已承认、理解并接受此免责声明并受其约束，以及承认、理解并接受本基金所受用之该指数数据为恒生指数有限公司的勤奋计算的结果。

如果指数编制单位变更或停止恒生指数的编制及发布，或恒生指数的其他基本特征发生变化，或由于指数编制方法等重大变更导致恒生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。

2. 金融模型风险

本基金为指数基金，指数基金的管理会借用一定的金融模型来进行投资决策。然而任何金融模型都是建立在一定理论假设的基础之上，理论假设是对现实情况的高度抽象，这使得金融模型在实际运用当中可能会产生偏差。此外，在实际运作中，可能因市场结构、投资者行为模式等条件发生变动，导致有关模型出现重大偏离的问题，从而引起基金资产损失的风险。

3. 跟踪误差风险

指数基金的跟踪误差是指指数基金的收益率与业绩比较基准之间的偏差。在跟踪指数的过程中，跟踪误差来源主要有：实际组合与标准指数组合构成的差异，指数股份分红、配股、增发，指数成份股的调整以及上述过程中发生的交易成本，基金的管理费、申购赎回带来的调整成本等。

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%。该日均跟踪偏离度与年化跟踪误差是将基金资产折算为港元资产后进行计算，因不考虑汇率波动对基金日均跟踪偏离度与年化跟踪误差的影响。在人民币兑港币汇率大幅波动的情况下，投资人实际感受到的日均跟踪偏离度与年化跟踪误差可能与本基金计算出的日均跟踪偏离度与年化跟踪误差不一致。

4. 衍生品投资风险

由于金融衍生产品具有杠杆效应，价格波动较为剧烈，在市场面临突发事件时，可能会导致投资亏损高于初始投资金额，从而对基金收益带来不利影响。此外，衍生品的交易可能不够活跃，在市场变化时，可能因无法及时找到交易对手或交易对方于无低报价，导致基金资产的额外损失。

本基金投资衍生品不得应用于投机交易目的，会通过控制规模、计算风险价值等手段来有效控制风险。

5. 证券借贷和正回购 / 逆回购风险

证券借贷、正回购 / 逆回购的主要风险在于交易对手风险，具体讲，对于证券借贷，作为证券借出方，如果交易对手方（即证券借入方）违约，则基金可能面临到期无法获得证券借贷收入甚至借出证券无法归还的风险，从而导致基金资产发生损失；对于正回购 / 逆回购，交易期满时，可能会出现交易对手方未如约实回正式入证券未如约交付售出证券产生的所有权风险，利息和分红的风险；对于逆回购，交易期满时，可能会出现交易对手方未如约实回已售出证券的风险。

6. 港股通特定业务风险

（1）本基金可以通过“沪港股票市场交易互联互通机制”投资于香港市场，在市场进入、投资额度、可投资对象、税务政策等方面都有一定的限制，而且此类限制可能会不断调整，这些限制因素的变化可能对本基金进入或退出当地市场造成障碍，从而对投资收益以及正常的申购赎回产生直接或间接的影响。

（2）香港市场交易规则有别于内地A股市场规则，此外，在“沪港股票市场交易互联互通机制”下参与香港股票投资还将面临包括但不限于如下特殊风险：

1）香港证券交易市场实行T+0回转交易，同时，对证券交易价格并无涨跌幅上下限的规定，因此每日涨跌幅空间相对较大，将面临股价波动较大的风险。

2）港股通机制下香港不准售可能带来的风险：只有沪港两地均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日；香港出现台风、黑色暴雨或者联交所规定的其他情形时，联交所将可能停市；出现上交所证券交易服务公司认定的交易异常情况时，上交所证券交易服务公司将可能暂停港股通交易；在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，基金资产的申购赎回不能及时实出，可能带来一定的流动性风险。

3）投资者因港股通股票权益分派、转换、上市公司被收购等情形或者异常情况，所取得的港股通股票以外的联交所上市证券，只能通过港股通卖出，但不得买入，上交所另有规定的除外；因港股通股票权益分派或者转换等情形取得的联交所上市股票的认购权利的联交所上市证券，可以通过港股通卖出，但不得行权；因港股通股票权益分派、转换或者上市公司被收购等所取得的非联交所上市证券，可以享有相关权益，但不得通过港股通买入或卖出。

4）代理投票。由于中国结算是代理人的原因，香港结算提交投票意愿，中国结算提交的投票意愿需在香港结算的征集期前早结束；投票没有权益登记日的，以投票截止日的持有作为计算基准；投票数量超出持有数量的，按照比例分配持有基数。 以上所述规定可能会给本基金投资带来特殊交易风险。

（3）在极端情况下不投资港股的风险

本基金的投资组合比例为：股票占基金资产的比例不低于80%，其中投资于港股通标的股票占基金资产的比例为0—95%；投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于基金非现金资产的80%。基金管理人应当在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。

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，但在极端情况下（如为应对巨额赎回时），可能存在不投资港股的风险。

7. 单一投资者集中度较高的风险

由于投资者的申购赎回行为可能导致本基金的单一投资者持有的份额占本基金总份额的比例较高，该单一投资者的申购赎回行为可能影响本基金的投资运作，从而对基金收益产生不利影响。

基金管理人将控制单一投资者持有基金份额的比例低于50%，并防止投资者以其他方式变相规避50%集中度限制的情形发生（监作过程中，因基金份额赎回等情形导致被动超标的除外）。如基金管理人认为投资某笔或多笔申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%，或者基金管理人认为可能存在变相规避50%集中度限制的情形时，基金管理人有权拒绝单一投资者的全部或部分的认/申购申请或确认失败。

（3）基金投资的一般风险

1. 上市公司经营风险

上市公司的经营受多种因素影响，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。虽然本基金可通过分散化投资减少这种非系统性风险，但并不能完全消除该种风险。

2. 流动性风险

流动性风险是指在市场或者个股流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

由于开放式基金的特殊要求，本基金必须保持一定的现金比例以应付赎回要求。在管理现金头寸时，有可能存在现金不足的风险或现金过多导致收益的下降风险。

3. 信用风险

基金交易对于为发生交易违约或者基金持仓债券的发行人出现违约、拒绝支付债券本息，或者债券发行人信用质量下降导致债券价格下降，造成基金资产损失的风险。

4. 利率风险

利率风险是指由于利率的变动导致证券价格波动，由此给基金的收益带来不确定因素。利率与证券的价格一般呈反方向变化。当市场上的利率普遍提高时，证券价格会下降（包括股票和债券）。一般债券对利率的变化反应较快，方向基本是反向的；而股票的反应相对慢一些，同时股票价格的变化在短期和长期对利率变动的反应方向可能是相反的。利率风险是固定收益证券、债券的主要风险，利率变动对长期债券的影响大于短期债券。

5. 大宗交易风险

大宗交易是指单笔交易规模远大于市场平均单笔交易规模的交易。大宗交易价格的形成并非完全是由市场供求关系决定的，可能与市场价格存在一定差异，从而导致大宗交易参与者的非正常损益。

6. 会计核算风险

会计核算风险是指由于会计核算及会计管理上失误或违规操作形成的风险，如基金管理人在计算、整理、制证、填单、登账、编表、报送、保管及其相关业务处理中，由于客观原因与基础数据的行为过失，从而对基金收益造成影响的风险。

7. 交易结算风险

交易结算风险是指基金在投资交易的过程中，因交易对手方无法履行支付义务而使基金资产有遭受损失的可能性。

8. 操作或技术风险

相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等原因可能引致风险，例如，越权违规交易、会计部门账证、交易错误、IT系统故障等风险。

在开放式基金的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能发生在基金管理人、银外投资顾问、基金托管人、银行间证券市场、证券经纪商、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等。

9. 不可抗力风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产遭受损失。基金管理人、银外投资顾问、基金托管人、证券交易所、证券登记结算机构和销售代理机构等可能因不可抗力无法正常工作，从而影响基金的各项业务按正常时限完成；金融市场危机、行业竞争、代理机构违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金资产遭受损失的风险。

二、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：0755-83196588

联系人：肖剑

（二）主管人员情况

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长兼行长；2009年6月至今，任中国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董事长主席。2014年12月15日起任大成基金管理有限公司董事长。

崔天鹏先生，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，任职于深圳市财政口岸物事务所；1994年7月至1997年5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)等资格，国家“千人计划”专家，曾任华马咸（KPMG）法律诉讼部资深咨询师、金融期货咨询师，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，机构部副新处负责人；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。

周瑞先生，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，任鄱丁大学财经系教师；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2012年6月任职于中泰信托有限责任公司，历任副总裁、总裁，现为中泰信托有限责任公司董事。

孙学林先生，董事，硕士研究生。具注资会计师、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子政负责人、投资决策委员会副主任。2012年6月起，兼任镇江国利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。

古敏女士，独立董事，金融学博士。现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，在国内国际类期刊发表多篇学术论文。

金李先生，独立董事，博士。现任英国中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师兼教授（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：

许国平先生，监事会主席，中国人民大学国民经济学博士。1987年至2004年先后任中国人民银行国际司处长、东京代表处代表、研究局调研员、金融稳定局体改处处长；2005年6月至2008年1月任中央汇金投资有限责任公司建行股权管理部主任；2006年8月至2016年11月任中国银河金融控股有限责任公司董事、副总经理、党委委员；2007年2月至2016年11月任中国银河投资管理有限公司董事长、总裁、党委书记；2010年6月至2014年3月兼任北京银河共赢投资有限责任公司董事长；2007年1月至2015年6月任中国银河证券股份有限公司董事；2014年1月至2017年6月任银河基金管理有限公司董事长；2014年3月至2018年1月任银河基金管理有限公司董事长（至2017年11月）及法定代表人；2018年3月加入大成基金管理有限公司，任监事会主席。

燕玉强先生，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。2014年11月加入大成基金管理有限公司，2015年1月起任公司副总经理。

温智敏先生，副总经理，哈佛大学法学博士。曾任职于美国Hunton & Williams国际律师事务所纽约州执业律师，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秘书、新疆精河县人家户安场党委书记、新疆博乐塔拉蒙古自治州团委副书记及少工委主任、江苏省铁路发展投资有限公司办公室主任、江苏省铁路发展投资有限公司控股企业江苏铁路运业集团有限公司董事、总经理、党委副书记；2010年1月至今，任中国铁路投资控股有限公司燕京战略管理实项目经理。2006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。

谢晓冈先生，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地区主管经济学家，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。曾任职于招商证券投资企业司、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经济学家，原黑龙江省财政局副局长、黑龙江省省务厅副厅长，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8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。

陈翔民先生，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。

赵冰女士，督察长，清华大学工商管理硕士。曾任职于中国证券业协会资格管理部、专业联络部、基金公司会员部，曾任中国证券业协会分析师委员会委员、基金销售专业委员会委员，曾参与基金业协会筹备组的筹备工作。曾先后任中国证券投资基金业协会投教与媒体公关部负责人、理财及服务机构部负责人。2017年7月加入大成基金管理有限公司，2017年8月起任公司督察长。

2. 基金经理

冯凌洁：金融学硕士。证券从业年限15年。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6月起担任大成标普500等权重指数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。2017年8月10日起担任大成恒生指数证券投资基金（LOF）基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国

3. 公司投资决策委员会

公司量化投资决策委员会由6名成员组成，设量化投资决策委员会主席1名，其他委员5名。名单如下：

黎新平先生，基金经理，数量与指数投资部总监，量化投资决策委员会主席；李炬，期货投资部总监，量化投资决策委员会委员；苏家毅，基金经理，数量与指数投资部副总监，量化投资决策委员会委员；冉凌浩，基金经理，量化投资决策委员会委员；夏高，基金经理，量化投资决策委员会委员；张忻玉，基金经理，量化投资决策委员会委员。

上述人员之间不存在亲属关系。

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委员会主席；苏家毅，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委员会委员；冉凌浩，基金经理，量化投资决策委员会境外投资决策委员会委员。

上述人员之间不存在亲属关系。

三、基金托管人

（一）基金托管人基本情况

名称：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

成立时间：1984年1月1日

法定代表人：易会满

注册资本：人民币35,640,625.71万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

（二）主管人员情况

截至2018年6月，中国工商银行资产托管部共有员工212人，平均年龄33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。

（三）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最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、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、商业银行信贷资产托管业务、证券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2018年6月，中国工商银行共托管证券投资基金874只。在2003 年以来，本行连续十五年获得香港《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》等国内外权威财经媒体评选的入围最佳托管银行大奖；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。

（四）基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控管理”的理念和加强内部风险管理、规范内部控制、防范风险的工作分不开的。资产托管部一直高度重视内部控制工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的工作，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013、2014、2015、2016、2017共十一次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的ISAS3402审计，获得无保留意见的控制发有效性报告。充分表明我立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可，也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

1. 内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制衡化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；提升持有人的价值。

2. 内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规岗、内部审计岗）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3. 内部风险控制原则

（1）合法性原则：内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

（2）完整性原则：托管业务各个环节经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

（3）及时性原则：托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

（4）审慎性原则：各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

（5）有效性原则：内控制度必须根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

（6）独立性原则：设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

4. 内部风险控制措施实施

（1）严格的隔离制度：资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册，严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

（2）高层检查：主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促部门托管部部门改进。

（3）人事控制：资产托管部严格落实岗位责任制，建立“目控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训，签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

（4）经营控制：资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

（5）内部风险管理：资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

（6）数据安全控制：我们通过业务操作区和对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

（7）应急准备与响应：资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

5. 资产托管部内部风险控制制度

（1）资产托管部内部设置稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

（2）完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不间断、不间风险相互制衡的组织结构。

（3）建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责，制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

4. 内部风险控制的特殊措施

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。此外，为了更好地实现本基金的投资目标，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，以及银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产投资信托证券；在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品以及法律法规或监管机构允许本基金投资的其他产品或金融工具。

基金的投资组合比例：股票占基金资产的比例不低于80%，其中投资于港股通标的股票占基金资产的比例为0—95%；投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于基金非现金资产的80%。基金管理人应当在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。

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，但在极端情况下（如为应对巨额赎回时），可能存在不投资港股的风险。

7. 单一投资者集中度较高的风险

由于投资者的申购赎回行为可能导致本基金的单一投资者持有的份额占本基金总份额的比例较高，该单一投资者的申购赎回行为可能影响本基金的投资运作，从而对基金收益产生不利影响。

基