## 大成中证500深市交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书摘要

(一)基金管理人職品 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

设立日前:1999年4月12日 注册资本: 咸亿元人民币 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%),

版权结构:公司版东为中华信托有限责任公司(持股比例95%)、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:0755-83183388 传真:0755-83199588 联系人:台创 (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流市委、哈尔流银行股份有限公司,中泰信托有限责任公司:2007年6月,任哈尔流银行股份有限公司执行董事会: 刘卓先生,董事长、江22年11月至今,任中泰信托有限责任公司执行责任股份有限公司制董事长;2018年9月,任哈尔流银行股份有限公司执行责任无成违金管理有限公司董事全书;2018年1月,任哈尔流银行股份有限公司制商事长;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日起任大成违金管理有限公司董事长。新天鹏先生,副董事长。国际法学硕士,1991年7月至1997年4月,任巴尔流战管行股份有限公司前前事的公司,1994年7月至1997年4月,任职于共有高港务股份有限公司;1997年19至105年1月,先后任光大证券省银责任公司南市发总部所资员,南方总部机旁理部副总经理(为代本证券有银责任公司债务业务股份有限公司;1997年1月至2015年1月,先后任光大证券有银责任公司债务业务股份有限公司;1997年10年10年1年,允成基金管理申报公司公司债务业务股票总会发现业务企图和股分部配约总理(主持工作)法律合规部副总经理,2016年1月起任大成基金管理专限公司副首事长。罗登拳先生,董事、经经理,那各个人之200年至2012年(任中国证券监督管理委员会规划委专家顺向委员、机构部创新处负责人。2014年11月26日任大成基金管理有限公司董事保公司董事总经理,执委会委员,2014年11月26日起任大成基金管理有限公司董事自经理,执安会委员,2014年11月26日已任大成基金管理有限公司董事官经理,执安会委员。2014年11月26日任人成基金管理有限公司董事官经理,其安全委员,2014年11月26日民任大成基金管理有限公司董事官经理。2015年2月起来任于成团际资产管理有限公司董事下。

周维先生,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(BMBA)上海市黄浦区区协委员。1997年8月至1993年4月 任厦门大学财务系统师;1993年4月 任贸与大学财务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2018年2月任职于平豪信托有限责任公司方任副总裁。这款,要与传托有限责任公司董事。 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资委委员、总裁助理,兼任投资二部总经理兼行政负责人,投资决策委员会会员。 20 裁助理,兼任投资二部总经理兼行政负责担,投资决策委员会委员。 20 数据第一次,独立董事、经济学博士、现任中国人民大学经济学院教授、民商法教研室上、1911年1月,1911年1日,1911年1月

五年。同人即为上年初。自然已安付于显然选定下语民的事化保护干净仍定于心殊或较慢。 若數女士,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,朱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,并聚任哈佛大学费正清东亚研究中心执行理事。

公厅处长、两户外以对厅即侧工厅。然后一个 起任公司副总经理。 姚余依先生,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 姚余依先生,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

聚余桥/左生,劇》這至理,與国初的/个十年以上可求。 東国大龍银行伶敦分行。曾任世界银行各询询问,国际货币基金组织国际资本市场部和非洲部经济学家,原黑龙江省招南局副局长、黑龙江省商务厅副厅长、中国人民银行货币政策司副司副巡视员,中国人民银行资而政策司副司副巡视员,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

陈翔凯先生, 刚总经理, 香港中文大学工商管理硕士。曾任年职于广发证券海南 分公司, 平安保险集团公司, 曾任年安时/年限合和成公司高级投资各型, 周校路瑞 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, 督祭长, 清华大学工商管理硕士, 曾伐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印第备工作,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. 其会经知

人人民族並曾是目的人。 2.基金经理 (1)现任基金经理 (1)现任基金经理 派钟玉、基计学硕士。证券从业年限8年。2010年7月加入大成基金管理有限公 司,历任研究部研究员、数量投资部数量分析师。2013年3月25日至2015年1月14日 且任大成优选股票型证券投资基金(100)和大成产源300指数证券投资基金基金 益经理助理。2015年2月28日至2015年7月21日任大成核心双动力股票型证券投资 能金基金经理、2015年7月22日起任大成核心双动力加高型证券投资基金基金经理 2016年5月23日起任大成核少双动力混合型证券投资基金基金经理 2016年5月23日起任天派证成长40交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成 理。2015年5月23日起任察证成长40交易型开放式指数证券投资基金、大成察证成 长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金及大成中证500深市交易型开放式 指数证券投资基金基金经理。2015年8月26日起担任大成沪深300指数证券投资基 金基金经理。具有基金从业资格。国籍:中国 (21)历任基金经理

历任基金经理姓名 管理本基金时间 」 公司投资决策委员会 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

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 他委员名。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主席,李绍、 期货投资地总监,量化投资决策委员会委员,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委员;申凌浩,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;张钟玉,基金经理,量化投资决策委员会委员;

是时,2003年2000年 会委员。 上述人员之间不存在亲属关系。 二、基金托管人

二、基金托管人
(一)基本情况
名称:中国银行股份有限公司(简称:"中国银行")
住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期:1983年10月31日
注册资本:人民市或仟玖佰肆拾叁亿捌仟粜佰粜拾玖万壹仟或佰肆拾壹元整
法定代表,陈四清
基金托管业务批准立号:中国证监会证监基字【1998】24 号
红德郑二位号计案理案》:1、1 元 日

传真:(010)66594942 中国银行客服电话:95566 (二)基金托管部丁及主要人员情况 中国银行无管验少务部设立于1998年,现有员工110余人,大部分员工具有丰富 设行、证券、基金、信托从业经验。且具有部外工作、学习或培训经历,60%以上的 具有领土以上学位返高级职称。为给各户提供专业化的托管服务,中国银行已 战外,外分行开展托管业务。

在域内,外分行开展托管业务。 作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行,中国银行拥有证券投资基金、基金(一对多、一对一)、社保基金、保险资金、QFII、ROFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划。信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系、在国内,中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务,为各类客户提供个性化的托管增值服务,是国内领先的大型中级托管银行。 (三)证券投资基金托管情况。

设定及闸级建设、内外保险恒发申订等捐施强化估官业务主页、全面、全租的风险管控。2007年起,中国银行连续聘请外部会计会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于 "SAS70"、"AAF01/06" "ISAE3402"和 "SSAB16"等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2017年,中国银行托管业务内控制度完善,内控措施严密,能够有效保证托管资产的安全。 (五)托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序。 (在)托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序。 根据代中华人民共和国证券投资基金法》《公开筹集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,基金托管人及现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和,其他有关规定。或者违反基金合同约定的,应当指绝对行,及时通知基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定。或者违反基金合同约定分,应当每处资指令违反法律、行政法规和其他有关规定。或者违反基金合同约定分,应当每处资指令违反法律、行政法规和其他有关规定。或者违反基金合同约定的,应当及投资证券结合管理机构报告。 主机关服务机构 三、相关服务机构 (一)基金份额发售机构 一、网下观金和网下股票发售直销机构 名称:大成基金管理有限公司 住所:深圳市福田区蔡南大道7088号招商银行大厦32层 办公地址:深圳市福田区落南大道7088号招商银行大厦32层

传真:0755-83199588 联系人:教姣

联系人:教姣 公司网址:www.dcfund.com.cn 全国统一客户服务号码:400-888-5558(免固活长途费) 大成基金管理有限公司在按测设有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22层 电话。0755-22223523,0756-22223556 联系人:肖成卫、关志玲、白小雪

投资人可直接通过具有基金代销业务资格及深圳证券交易所会员资格的证券 公司办理网上现金申购业务。

法定代表人:张佑君 客服电话:010-84588888 联系人:顾凌 电话:010-60838696 传真:010-84865560

传真: 010—E3655550 例址:www.ssecitic.com 2.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 联条人;宋明

联系人: 末明 联系电话: 010-66568450 传真: 010-66568990

网址:www.chinastock.com.cn 3、招商证券股份有限公司 注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38–45层 在册地址:深圳市福 法定代表人:宫少林 客服电话: 95565 联系人:黄婵君

网址:www.newone.com.cn 4.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

☆正代表人:周易 客服电话:4008−888−168、95597 联系人:庞晓芸 电话:0755−82492193 隻真:0755−82492962

b.光文址秀股份有限公司 办公地址:上海市静安区新闸路1508号 法定代表,i 薛峰 客服电话:400-888-8788,95525 联系人:刘晨 电话:021-22169999 传真:021-22169134

电话:021-68778075 传真:021-68868117 784:0221~0666047 7人上海证券有限责任公司 注册地址:上海市黄浦区四川中路213号久事商务大厦7楼 法定代表人:李俊杰 客服电话:021~962518,4008918918

\*\*;v61-05008830 址;www.962518.com 华鑫证券有限责任公司 册地址;深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01,B01(b)单元 公地址:上海市肇嘉浜路750号 定代表人;俞祥

联系人:陈敏 网站:www.cfsc.com.cn 客服电话:021-32109999;029-68918888;4001099918 9.中国瓦族近券有限责任公司 注册地址:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼40层-43层 法人代表:赵大建 能名 4.态微

联系人:李微 客服电话:400-889-5618 网址:www.e5618.com 10、东海证券股份有限公司 注册地址:江苏省常州延坡西路23号投资广场18层 办公地址:上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦 法定代表人;赵俊

传真-021-50450000 联系人:王一彦 客服电话:95531;400-8888-588 阿址:www.longone.com.cn 11.申万宏顺证券有限公司 通讯地址:上海市徐汇区长乐路989号40层 表人:李梅 旦话:95523或4008895523

法定代表人: 李楷 客服电话: 59523或4008895523 联系人: 曹滕 电话: 021-54033888 传真: 021-54033884 陶址: www.swy.com 12. 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 家服由话: 99521

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 14、海通证券股份有限公司

网址:www.htseccom 基金管理人可根据有关法律法规要求,选择其他符合要求的机构代理销售本 金或变更上述发售代期机构,并及时公告。 (二) 验记结算机构 名称:中国证券登记结算有限责任公司

名称:中国证券登记结算有限责任公 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;越外请 电话:(010)50938782 传真:(010)50938907 (三)律师事务所和经办律师 名称:北京市金社律师事务所

生册地址: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

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·斯庆军、冯艾 联系、:冯艾 (四)会计师事务所和经办注册会计师 名称:安永华明会计师事务所 (任所:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层 01-12室 办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层 01-12室 执行事务合伙、:吴港平 电话:(010)85153000、(0755)25028288 传真:(010)85188298、(0755)25028288 传真:(010)85188298、(0755)25026188 签章注册会计师:昌华、高鹤 联系人:昌华

联系人: 自毕 中证500深市交易型开放式指数证券投资基金 五、基金的类型

六. 基金的运作方式

交易型开放式

交易型开放式

七、基金的投资目标
紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
(人基金的投资范围
本基金主要投资于标的指数成份股内格选成份股。
为更好地实现基金的投资目标,本基金还可投资于国内依法发行上市的非标的指数成份股值的在场景。)新股、债券(含中期票据)货币市场工具,银行存款,权证,股指铜货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关相对。 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

知底年达观域。而是1955年5月2日 程序后,可以将其纳人投资范围。 本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的90%,权证、股有期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的

投资管理体制

2、投资管理体制 本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会负责

2.投资管理体制
本基金实行投资法策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会负责
决定有关指数重大调整的应对决策。其他重大组合调整决策以及重大的单项投资
决策;基金经理负责决定自常指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策以及每日
申购、赎回清单的编制决策。
3.投资程序。
3.投资程序。
研究支持,投资决策,组合构建、交易执行、投资绩效评估、组合维护的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的
正确执行、避免重大风险的发生。
(1)研究支持。数量投资部依托公司整体研究平台,整合外部信息以及券商等
外部研究力量的研究成果开展捐数跟踪。成份股公司行为等相关信息的搜集与分析,流动性分析,跟踪误差及其归因分析等工作。作为基金投资法策的重要依据。
(2)投资决策、投资决策系是会依据数量投资部提供的研究报告,定期召开或
遇重大事项时召开投资决策委员会依据数量投资部提供的研究报告,定期召开或
遇重大事项时召开投资决策委员会依据数量投资部提供的研究报告,定期召开或
遇重大事项时召开投资决策委员会依据数量投资部提供的研究报告,定期召开或
遇重大事项时召开投资决策委员会的
决议、每日进行基金投资管理的日常决策。
(3)组合构建、根据的方法构建组合。在追求实现基金投资目标的前提下,基金经理将将取货的方方法,应险管理部的上帮决策。建金经理有规定分决,并是依任发资效评估,以险管理部定期和不定期对基金进行投资缴效评估的职责。
(6)投资缴效评估,风险管理部定期和不定期对基金进行投资缴效评估,并提供用关报告,缴效评估能够确认组合是否实现了投资预期,组合根踪误差组合。(6)投资缴效评估,以险管理部定,即和不定期对基金进行的资税资组合。(6)投资缴效评估的数年等,采取在总书报等和规则的现金流量情况以及组合投资领效评估的结果等,采取在当时报时的现金流量情况以及组合投资领效评估的结果等,采取在当时报路标,对股资组合进行监控和调整,据可服整决等组合

30A所に出る。 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环境变化和实际需要对上述投资管理程序做出调整,并在更新的招募说明书中公告。 (四)投资管理程序 1.投资组合的建立

基金管理人构建投资组合的过程主要分为三步:确定目标组合、确定建仓策略 罗姆登。 (1)确定目标组合:基金管理人根据完全复制标的指数成份股及其权重的方

(1) 爾定目标组口: 建亚口亚八四亚 法确定目标组合。 (2) 确定建仓策略: 基金经理根据对成份股流动性, 公司行为等因素的分析, 确定合理的建仓策略。

确定合理的建仓策略。
(3) 逐步调整:根据完全复制法确定目标组合之后,基金经理在规定时间内采用适当的手段调整实际组合直至还到跟影情数要求。
正常情况下本基金投资于标的指数成份股利备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的90%、农证。股捐销股及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金将在基金合同生效之日起6个月的时间内达到这一投资比例。此后,如因标时制数成份股票整,基金申取或赎回带来应套等因素导致基金不符合这一投资比例的,基金管理人应在10个交易日内进行调整。
2. 日常投资组合管理

基金不符合这一投资比例的,基金管理人应在10个交易日内进行调整。 2.日常投资组合管理 (1)成份股公司行为信息的跟踪与分析,跟踪标的指数成份股公司行为(如)股本变化,分红,停牌、复牌等)信息,以及成份股公司其他重大信息,分析这些信息对指数的影响,进而进行组合调整分析,为投资决策提供依据。 (2)标的指数的跟踪与分析;跟踪标的指数编制方法的变化,确定指数变化是 否与预期一致,分析是否存在差异及差异产生的原因,为投资决策提供依据。 (3)每日申购赎回情况的跟踪与分析;跟踪本基金申购和赎回信息,分析其对 组合的影响。 组合的影响。 (4)组合持有证券、现金头寸及流动性分析:基金经理分析实际组合与目标组合的差异及其原因,并进行成份股调整的流动性分析。

(5)组合调整: 1)利用数量化分析模型,找出将实际组合调整到目标组合的最优方案,确定 组合调整及交易策略。 2)如发生成份股变动、成份股公司合并及其他重大事项,可提请投资决策委 员会召开会以份股变动、成份股公司合并及其他重大事项,可提请投资决策委

员会召开会议,决定基金的操作策略。 3)测整组合,达到目标组合的持仓结构。 (6)对比指数与组合的每日及累计的感效数据,检测跟踪误差及其趋势。分析 由于组合每只眼架构成与指数构成的差异导数的跟踪误差的程度与趋势以找出跟 踪误差的来源,进而决定需要对组合调整的部分及调整方法。

(7)根据指数跟踪研究结果及当日最新组合情况进行指数分析及组合分析并进行组合调整计算,进而制定下一个交易目的交易内容与策略。(8)以下-1日指数成份股构成及其权重为基础,考虑T口将会发生的上市公司变动等情况,设计T口串映赎回清单并公告。3、定期投资组合管理

3.定期投资组合管理 (1)每月 每月末、根据基金合同中基金管理费、基金托管费等的支付要求,及时检查组合中现金的比例,进行支付现金的准备。 每月末,在基金经理会议上对投资操作,组合,跟踪误差等进行分析。分析最近基金组合与标的指数间的跟踪偏离度情况,找出未能有效控制较大偏离的原因。 每月末,投资决策委员会可对基金的操作进行指导与决策。基金经理根据公司 投资决策委员会的决策开展下一阶段的工作。

(2) 标的指数调整制规则及调整公告,基金经理依据投资决策委员会的决策,根据陈的指数的编制规则及调整公告,基金经理依据投资决策委员会的决策,数成份影视整生效前,分析并确定组合调整策略,尽量减少成份股变更带来的徐偏离度和跟踪误差。 4、投资绩效评估 (1)每日,基金经理分析基金的跟踪偏离度。

(1)時日,基金经理分別基金的根係偏腐度。 (2)每月末,风险管理部分本基金的运行情况进行量化评估。 (3)每月末,基金经理根据评估报告分析当月的投资操作,组合状况和跟踪误差等情况。重点分析基金的跟除偏腐度和跟踪误差产生原因,现金控制情况,标价投调整前后的操作以及成份股末来可能发生的变化等。 在正常市场情况下,本基金力争日均跟踪偏腐度的绝对值不超过0.2%,年跟 紧误差不超过2%。如因指数编制规则调整底地包泵导动根除偏腐度和跟踪误差 超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏腐度、跟踪误差进一步扩

VIIX I	1別不签並以厂组合 同仇	ì		
号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)	
1	权益投资	27,912,477.12	97.81	
	其中:股票	27,912,477.12	97.81	
2	固定收益投资	-	0.00	
	其中:债券	-	0.00	
	资产支持证券	-	0.00	
3	贵金属投资	-	0.00	
4	金融衍生品投资	-	0.00	
5	买人返售金融资产	-	0.00	
	其中:买断式回购的买人返售金 融资产	-	0.00	
6	银行存款和结算备付金合计	624,871.13	2.19	
7	其他各项资产	213.67	0.00	
8	合计	28,537,561.92	100.00	
	与期末按行业分类的股票		•	
1)扌	设告期末指数投资按行业	:分类的股票投资组合	ì	
代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
Α	农、林、牧、渔业	383,180.6	6 1.35	

24	なく、ヤルノイズ、八世・山上	303,100.00	1.50
В	采矿业	650,398.40	2.29
C	制造业	16,863,195.89	59.42
D	电力、热力、燃气及水生产和 供应业	629,236.90	2.22
E	建筑业	641,943.32	2.26
F	批发和零售业	1,065,241.18	3.75
G	交通运输、仓储和邮政业	113,985.00	0.40
Н	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服 务业	3,652,160.66	12.87
J	金融业	715,976.20	2.52
K	房地产业	1,159,334.92	4.08
L	租赁和商务服务业	695,141.43	2.45
M	科学研究和技术服务业	-	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	285,557.00	1.01
0	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Ω	卫生和社会工作	76,800.40	0.27
R	文化、体育和娱乐业	586,374.00	2.07
S	综合	150,430.00	0.53
	合计	27,668,955.96	97.49
	用末积极投资按行业分类		
代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
Α	农、林、牧、渔业	_	0.00
В	采掘业	5,500.00	0.02
C	制造业	65,836.00	0.23
D	电力、热力、燃气及水生产和 供应业	172,185.16	0.61
Ε	建筑业	-	0.00
F	批发和零售业	-	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	0.00
Н	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术 服务业	-	0.00
J	金融业	-	0.00
K	房地产业	-	0.00
L	租赁和商务服务业	-	0.00

合比 3)报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

(3)报告期末按介班77年四個聚则以內以來22年日本基金本报告期末未持有港股通投资股票。 3.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细 (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股

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	净值比例 (%)
1	000661	长春高新	2,060	469,062.00	1.65
2	002410	广联达	9,800	271,754.00	0.96
3	000977	浪潮信息	11,100	264,735.00	0.93
4	002049	紫光国微	6,000	264,720.00	0.93
5	000830	鲁西化工	14,900	254,492.00	0.90
6	000703	恒逸石化	16,220	241,353.60	0.85
7	002340	格林美	38,728	234,304.40	0.83
8	002038	双鹭药业	6,000	227,940.00	0.80
9	002179	中航光电	5,791	225,849.00	0.80
10	000418	小天鹅A	3,200	221,920.00	0.78
(2)	明末积极	殳资按公允价	值占基金资产净	值比例大小排序的	的前十名股票

细细	417/17/17X	又风1又公儿!	1 国口基立风厂6	チョロトログリンヘノハットトナナ	1781   45/123
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
1	000939	*ST凯迪	24,234	120,927.66	0.43
2	002005	德豪润达	15,100	65,836.00	0.23
3	000669	金鸿控股	7,070	51,257.50	0.18
4	onogon	acom/d4/202	F F00	E E00.00	0.00

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 z时知 本基金本报告期末未持有资产支持证券。 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五名贵金属投资明

本基金本报告期末未持有贵金属。 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权证投资明细 本基金本报告期末未持有权证。 9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 (1)报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细 本基金本报台期未投资股指期货的投资政策 (2)本基金投资股指期货的投资政策 本基金投资股指期货物报股险管理的原则,以套期保值为目的,力争利用股 股货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪 的接触的目的。

信奴的自的。 10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1战上界明显使用货投资政策 本基金本报告期未投资国债期货 (2.1报告期末本基金投资的国债期货 本基金本报告期未投资国债期货。 (3.1本期国债期货投资评价

其他资产构成

存出保证金 其他应收款 待摊费用 )报告期末持有的处于转股期的可转换债券明约

(6)期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况[ 役票名称

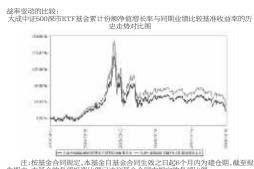
流涌受阻情况说明

(7)投资组合报告附注的其他文字描述部分 由于四舍五人原因,分项之和与合计可能有尾差。 十三、基金的业绩 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,也不保证是低收益。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)目基金合同生效日(2013年9月12日)至2018年6月30日基金合同生效 以来完整会计年度的基金份额净值增长率投资业绩以及与同期业绩比较基准收益 家的比较。 D-3

34.44%

9.12-2018.06.30 23.26% 1.77% 40.20% 1.78% -16.94% -0.01% 自基金合同生效以来基金份额增长率变动及其与同期业绩比较基准

1.26% -3.64% -0.07%



注: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,本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。 十四、基金的费用与税率

(一)基金费用的种类
1.基金管理人的管理费;
2.基金上的管理费;
2.基金上的管理费;
4.基金合同生效后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;
6.基金上市费及年费。
6.基金上市费及年费。
7.基金份翻持有人太会费用;
8.基金的银行汇划费用;
9.基金的银行汇划费用;
9.基金的银行汇划费用;
0.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.基金管果口管管理费

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0.5%年费率计提。管理费的计算方 法如下:
H=E×0.5%-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
托管人及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
本基金的好管费券前一日基金涂定净值的0.1%的在费索计据。托管费的计管

2.基金代官人的代官数 本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提。托管费的计算

法如下:
H=E×0.1%+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
管人发送基金托管费划款捐令,基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金
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,基金合同之效后标的指数于可使用费 标的指数使用许可费按前一日基金资产净值的年费率0.03%计提。标的指数 可维用表性管方注如下:

H=E×标的指數使用许可费年费率-当年天数 H为每日应计提的基金标的指数使用许可费 E为前一日基金资产净值 自基金合同生效之日起,指数使用许可费每日计算,逐日累计,按季支付。指数 使用许可费的收取下限为每季度人民而5万元,即若不足人民而5万元则按照人民 而5万元收息。 标的指数供应商根据相应指数许可协议变更上述标的指数使用许可费费率和 计费方式时,本基金将采用变更后的费率和计费方式计算指数使用费,基金管理人 应在招募说明书及其更新中披露基金最新适用的指数使用许可费费率和计费方式。 上述"一样全难用处证"。

式。

上述"一、基金费用的种类中第4-9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)不列人基金费用的项目
下列费用不列人基金费用。
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

f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人基金费用的项 目。 (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根期基金发展情况调整基金管理费率和基金托管 费率,解低基金管理费率和基金托管费率,无须召开基金份赖持有人大会。基金管 理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施曰前在指定媒体上刊登公告。 (五)税收 本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执

大成基金管理有限公司关于旗 下部分基金增加平安银行股份 有限公司为销售机构的公告

2 大成體成货币市场基金 投资者可通过以下途径咨询有关详情 1、平安银行股份有限公司 客户服务热线:95511-3

2、大成基金管理有限公司 客户服务电话:400-888-5558(免长途通话费用)

网址:www.dcfund.com.cm 风影想示: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。投资者投资于上述基金时应认真 阅读上述基金的基金合同,招募说明书等资料。敬请投资者注意投资风险。 特此公告

## 大成基金管理有限公司 关于召开大成景旭纯债债券型 证券投资基金基金份额持有人 大会 通讯方式 的公告

大成景旭纯债债券型证券投资基金(以下简称"本基金")的管理人大成基金管理 有限公司(以下简称"本基金管理人")经与本基金的基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致,决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会,会议具

切有限公司的商 表, 6次足及週刊/打造百开华基金司基金团/667年入人会, 云侯侯侯安排规下: 1、会议召开方式, 通讯方式 2、会议投票表决起止时间: 2018年10月31日起, 至2018年11月25日17:00止(以本公告列明的公证机关指定的表决票收件人收到表决票的时间为准) 3、会议通讯表决票的寄达地点 收件人; 大成基金管理有限公司北京分公司 地址: 北京市西城区平安里西大街28号中海国际中心1601室 147346421

邮政编码:100035

联系人:吕婧 联系电话:400-888-5558,010-88009300 传真:010-85252282 请在信封背面注明:"大成景旭纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用" 二、会议审议事项 一、云以甲以事项 本次持有人会议审议事项为《关于大成景旭纯债债券型证券投资基金调整基 金管理费率及基金托管费率相关事项的议案》(见附件一) 上述议案的说明请参见《大成景旭纯债债券型证券投资基金调整基金管理费 率及基金托管费率方案说明书》(附件四)。

三、权益登记日 本次大会的权益登记日为2018年10月30日,即该日在大成基金管理有限公司 登记在册的本基金全体基金份额持有人或其委托代理人享有本次会议的表决权。

在本次大会上充分表达其意志。基金价额持有人旅可以直接投票外,还可以接权他人代其在基金份额持有人大会上投票。根据法律法规的规定及《基金间》的约定,基金份额持有人大会上投票。 (一)委托人 本基金的基金份额持有人自本公告发布之日起可委托他人代理行使本次基金 UTNIFF有人大会的表决权。 基金份额持有人在权益登记日是否持有基金份额以及所持有的基金份额的数额以注册登记机构的登记为准。

五、授权 为便于基金份额持有人有尽可能多的机会参与本次大会,使基金份额持有人

(三)受托人 基金份额持有人可以委托本基金的基金管理人以及其他符合法律规定的机构 和个人,代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。 (三)授权方式 本基金的基金份额持有人可通过纸面授权方式授权受托人代为行使表决权。 基金份额持有人通过纸面方式授权的,授权委托书的样本请见本公告附件三。 基金份额持有人通过剪报、复印或登录基金管理人网站下载(www.dctund.com.cn)等方式获取授权委托书样本。 1.纸面方式按权 (1)基金份额持有人进行纸面授权所需提供的文件

(1)基金份额持有人进行纸面接权所需提供的文件 1)个人基金份额持有人委托他人投票的。受托人应提供由委托人填妥并签署 授权委托书原件(授权委托书的格式可参考附件三的样本),并提供基金份额持有 人的个人身份证明文件复印件,如受托人为个人,还需提供委托人的身份证明文件 复印件,如受托人为相构,还需提供委任人加需公学的曾业从照复即件(事业单位 位,社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书,有权部门的批 定理整计证书程即4件等。 证、代正资间降级疾犯毕节证可设出加油资量的争业单型运入运产证证书、有权制、即纳、 实或替记证计算包印件等)。 多利构基金价额持有人委托他人投票的,受托人应提供由委托人填妥的授权 委托书原件(投权委托书的格式可参考附件三的样本)并在授权委托书上加盖该 机构公章,并提供该机构持有人加盖公章的营业执照复即件(事业单位、社会团体 或其他单位可使用加递公章的事业单位达人登记证书、有权部门的批文或登记证 书复印件等)。如受托人为个人,还需提供受托人的身份证明文件复印件;如受托

4、按(XXX)相足死则 (1)多次以有效纸面方式授权的 以时间在最后的一次纸面授权为准 同时: 次以有效纸面方式授权的,若授权表示一致,以一致的授权表示为准:若授权表示

次以有效纸面方式授权的,若授权表示一致,以一致的授权表示为准; 若授权表示不一致,视为无效授权;
(2)如委托人未在授权委托表示中明确其表决意见的,视为委托人授权受托人按照受托人的意志行使表决权;如委托人在授权委托表示中表达多种表决意见的,视为无效授权。
(3)如委托人既进行委托授权,自身又送达了有效表决票,则以自身有效表决票为准。
六、会议召开的条件和表决票数要求
本次会议召开的条件和表决票数要求
本次会议召开的条件为;本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的,基金份额持有人持有的基金份额不少于在权益登记日基金总份额的50%

(含5%)。本会议表决的票数要求为:基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权、不足一份的基金份额不具有表决权。本次议案按一般决议处理,须经参加会议的基金份额持有人或其代理人所持表决权的50%以上(含50%)通过方为有效。基金份额持有人大会协议。自表决通过之日起生效、基金管理人应当自决议通过之日起5日内报中国证监会备案。基金份额持有人大会决议自生效之日起2个工作日内在指定媒介上公告。 七、计图

1.本次通出会议股时课第7五次:由本基金管理人授权的两名监督员在基金托管人中国市箱银行股份有限公司,提权代表的监督不任所通知的表决截止日期后2个工作日内进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的,不影响计票和表决结果。
2.基金份额持有人所待每份基金份额享有一票表决权。
3.表决票效力的认定如下;
(1)纸面表决票通过专人送交,邮寄或传真送达本公告规定的败件人的,表决时间以收到时间为准。2018年11月25日17:00以后送达基金管理人的,为无效表达

决。 (2) 纸面表决票的效力认定 纸面表决票填写完整清晰,所提供文件符合本公告规定,且在截止时间之前送 达本公告规定的收件人的,为有效表决票,有效表决票按表决意见计人相应的表决 结果,其所代表的基金份额计人参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总

品来,其所代表的基金订额时人参加本价基金订额时有人人会表决的基金订额总数。如纸面表决票上的表决意见未选。多选或无法辨认,但其他各项符合本公告规定的,视为弃权表决,让人有效表决票;并按"弃权"计人对应的表决结果,其所代表的表量。分额持有人大会表决的基金份额启数。如纸面表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的。或未能程能有效证明基金份额持有人与份或代理人经有效授权的证明文件的,或未能在截止时间之前送达本公告规定的收件人的,均为无效表决票;无效表决票不计入参加本次基金份额启载、基金份额持有人直复提全纸面表决票的,如各表决票表决意见相同,则视为同一表决票,如各表决来表决意见不相同,则按如下原则处理:
1)送达时间不是同一天的,以最后送达的填写有效的表决票为准,先送达的表决票积处撤回。

送达时间不是同一天的,以最后送达的填写有效的表决票为准,先送达的 表决票视为被倾回;
 这达时间为同一天的,视为在同一表决票上做出了不同表决意见,计人弃 权表决票;
 送达时间按如下原则确定;专人送达的以实际递交时间为准,邮寄的以本 公告规定的收件人收到的时间为准,传真的以本公告规定的收件人传真接收到的 时间为准。

记为准。 八、本次大会相关机构 1. 召集人:大成基金管理有限公司 联系地址:广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层 联系人:首边 联系电话:0755-83183388

传真:0755-83199588 客户服务电话:400-888-5558

A办律师:安冬、陆奇 九、韭安促示 1、请基金份额持有人在提交表决票时,充分考虑邮寄在途时间,提前寄出表决

票。
 2.本次基金份额持有人大会有关公告可通过本基金管理人网站查阅,投资者如有任何疑问,可致电本基金管理人客户服务电话400-888-5558咨询。基金管理人将在发布本公告质连续公布相关提示性公告,就持有人大会相关情况做必要说明,请予以留意。
 3.本基金份额持有人大会召开期间,本基金日常申购赎回业务照常进行,投资者可以按照本基金招募说明书的相关规定办理申购赎回。
 4.本公告的有关内容由大成基金管理有限公司负责解释。
 大成基金管理有限公司

二〇一八年十月二十六日 附件一:《关于大成景旭纯债债券型证券投资基金调整基金管理费率及基金 托管费率相关事项的议案》 附件二:《大成景旭纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会通讯表决 那// 附件三:《授权委托书》 附件四:《大成景旭纯债债券型证券投资基金调整基金管理费率及基金托管 费率方案说明书》 附件一:《关于大成景旭纯债债券型证券投资基金调整基金管理费率及基金

附件一、(关于大成景旭纯债债券型址券投资基金则至每平日在以下公司 托管费率相关事项的议案) 大成景旭纯债债券型证券投资基金份额持有人; 为维护基金份额持有人利益,提高产品的市场竞争力,根据《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》和《大成景旭纯债债 券型证券投资基金基金合同》以下简称"基金合同》"的有关规定,基金管理人 经与本基金的基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致,提议召开本基金 的基金份额持有人大会审议调整大成景旭纯债债券型证券投资的基金管理费率及 工物费数。

印鑑证 扩配持行人人公平以购证人成员把他应取好至证分为交配的基金目建筑平及 托管费率。《大成景旭纯债债券型证券投资基金调整基金管理费率及基金托管费率方案 说明书》见附件四。 为实施大成景旭纯债债券型证券投资基金调整基金管理费率与基金托管费率 事宜,据议授权基金管理人办理本次调整费率有关具体事宜。包括但不限于可以在 不涉及基金合同当事人权利义务关系变化成对基金份额持有人利益无空质性不利 影响的前距下根据《大成景旭纯债债券型证券投资基金调整基金管理费率及基金 托管费率方案说明书》对《大成景旭纯债债券型证券投资基金基金合同》等法律 文件进行必要的修改和补充。修订后的《大成景旭纯债债券型证券投资基金基金 台同》于基金份额持有人大会的决议表决通过之口起生效。 以上议案,请予审议。

基金管理人:大成基金管理有限公

票》 基金份额持有人名称; 证件导码(身份证号/营业执照号); 基金账户号; 表决事项;关于大成景旭纯债债券型证券投资基金调整基金管理费率及基金 托普费率相关事项的议案 表决结果; □同意 □反对 □弃权 机构基金份额持有人或代理人签章栏 个人基金份额持有人或代理人签字栏

单位公章: 日期: 签字: 日期: 

前送达本公告规定的W作A的, PV刀尤双农伙菜: TV双环饮菜(P) 八字/加下公司 价额持有人大会表决的基金价额总数。 3、"基金账户号" 仅指持有本基金价额的基金账户号, 同一基金份额持有人拥 有多个此类账户目需要按照不同账户持有基金份额分别行使表决权的, 应当填写 基金账户号; 其他情况可必填写, 此处空白, 多填 错填 无法识别等情况的, 将被 默认为代表此基金份额持有人所持有的本基金所有份额。 4、本表决票可从相关网站下载, 从报纸上剪载、复印或按此格式打印。

名/盖章: 人身份证明文件名称及编号:

基金账户号: 受托人签章。受托人为自然人则签字/受托人为机构则盖公章): 受托人证件号码身份证号或营业执照号): 委托日期: 年 月 日 、本授权委托书可剪报、复印或按以上格式自制、在填写完整并签字盖章后均

为有效。
2、"基金账户号",仅指持有本基金份额的基金账户号,同一基金份额持有人 拥有多个此类账户目需要按照不同账户持有基金份额分别授权的,应当填写基金 账户号,其他情况可不必填写。此处空日。多填、错填、无法识别等情况的、将被默认 为代表此基金份额持有人所持有的本基金所有份额 附件四。《大成景旭纯债债券型证券投资基金调整基金管理费率及基金托管 费率介鉴明书》

7条呪明书》 5.成县加纯债债券刑证券投资甚会 ( 以下简称"太甚全" )于2013年7日23日

能。 基金份额持有人大会表决通过的事项须报中国证监会备案,且基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。中国证监会对本次基金持有人大会决议的备案,均不表明其对本基金的投资价值、市场前景或投资者的收益做出实质性判断或保证。 证。
— ,基金合同修改内容
— ,基金合同修改内容
— 将"第十五部分 基金费用与税收"中"二、基金费用计提方法、计提标准和 付方式"的"1.基金管理人的管理费"和"2.基金托管人的托管费"由原来的: "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0.7%年费率计提。管理费的计算方

I ト: H=E× 0.7% ÷ 当年天数 H为毎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 推查自建筑可目标。於日本財主時月7月18月2月2日, 托管人及送基金管理教助就有令,基本任管人复核后于次月前3个工作日內从基金 財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.基金托管人的托管数 本基金的托管数技前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算 方法如下: H=E×0.2%÷当年天数 H为每日应计提的基金托管费

日沙绿口应时,建印金金化自筑 吃为前一时,建印塞安宁净值 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3个工作日内从基金 财产中一次性支取。若遇法定市假日、公休日等、支付日期顺延。"

"社会"的。 "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0.3%年费率计提。管理费的计算方

」ト: H=E×0.3%÷当年天数 H为每日应计据的基金管理费 E为前一日的基金资产净值 基金管理费够日计算,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,支付日期顺延至下一 7. 计算量 2. 基金托管人的托管费 2. 基金托管人的托管费 本基金的托管费技前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提。托管费的计算

联系机构:大成基金管理有限公司客户服务部

联系电话:400-888-5558 网站:www.dcfund.com.cn

大成基金管理有限公司 二〇一八年十月二十六日

777年 (本) 上 (本) 主 ( 中) 主 ( 中)

信息披露 Disclosure