（上接B193版）

客服电话：400-799-1888
网址：www.520fund.com.cn
（50）北京新浪仓石基金销售有限公司
注册地址： 北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期（西扩）N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室
办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期（西扩）N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室
法定代表人:李昭琛
联系人:李唯
联系电话：010-58982465
传真:010-62676582
客服电话:010-62675369
网址:http://www.fund.sina.com.cn
（51）北京汇成基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108
法定代表人:王伟刚
联系人:丁向坤
电话:010-56282140
传真:010-62680827
客服电话:400-619-9059
网址:http://www.hcjijin.com
（52）玄元保险代理有限公司
办公地址:中国（上海）自由贸易试验区张杨路707号1105室
法定代表人:马永谙
联系人:卢亚博
联系电话:021-50701003
传真:021-50701053
客服电话:400-080-8208
网址:www.licaimofang.cn
（53）泛华普益基金销售有限公司
注册地址:四川省成都市成华区建设路9号高地中心1101室
办公地址:四川省成都市金牛区西宸龙湖国际大厦B座12楼
法定代表人:于海锋
联系人:隋亚方
电话:13910181936
客服电话:400-080-3388
网址:www.puyifund.com

三. 场内代销机构

指具有基金代销业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位,具体名单详见深圳证券交易所网站（www.szse.cn）。

基金管理人可根据有关法律、法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

（二）注册登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司
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:赵亦清
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:沈娜、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:021-23238888
传真:021-23238800
联系人:陈薇瑶
经办注册会计师:张振波、陈薇瑶

六、基金的名称

本基金名称:大成恒生指数证券投资基金（LOF）。

七、基金的类型

本基金类型:股票型证券投资基金、指数型基金

八、基金的运作方式

本基金运作方式:上市契约型开放式

九、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。

十、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。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、房地产信托凭证;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%;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（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）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%;权证、股指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规定执行。

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。

十一、基金的投资策略

本基金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进行相应调整。但因特殊情况（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。本基金将优先使用港股通渠道投资指数成份股,在港股通额度不足或因港股通机制问题导致部分指数成份股标的无法投资时,基金管理人将使用自有的QDII额度投资指数成份股。

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,以化化投资组合的建立,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。

在正常市场情况下,本基金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）。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的,基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。

十二、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%;

（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,保持现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）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%;

（3）本基金持有同一家银行的存款不得超过基金资产净值的20%。在基金托管账户的存款可以不受上述限制;

（4）本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的10%,其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的3%;

（5）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的10%;因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

（6）本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与本基金合同约定的投资范围保持一致;

（7）本基金持有境外基金的市值合计不得超过基金资产净值的10%,但持有货币市场基金不受此限制;

（8）基金管理人所管理的全部基金持有任何一只境外基金,不超过该境外基金总份额的20%；

（9）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。

2、金融衍生品投资限制

基金投资衍生品应当仅限于投资组合避险或有效管理,不得用于投机或放大交易,同时应当严格遵守下列规定:

（1）本基金的金融衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的100%;

（2）本基金投资期货支付的初始保证金、投资期权支付或收取的期权费、投资柜台交易衍生品支付的初始费用的总额不得高于基金资产净值的10%;

（3）基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品,应当符合以下要求:

1）所有参与交易的对手方（中资商业银行除外）应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级。

2）交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值,并且本基金可在任何时候以公允价值终止交易。

3）任一交易对手方的市值计价敞口不得超过本基金资产净值的20%。

基金管理人应当在本基金会计年度结束后60个工作日内向中国证监会提交包括衍生品头寸及风险分析年度报告。

本基金不得直接投资与实物商品相关的衍生品。

3、本基金可以参与证券借贷交易,并且应当遵守下列规定:

（1）所有参与交易的对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级。

（2）应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的102%。

（3）借方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红。一旦借方违约,本基金根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要。

（4）除中国证监会另有规定外,担保物可以是以下金融工具或品种:

1）现金;
2）存款证明;
3）商业票据;
4）政府债券;
5）中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构（作为交易对手方或其关联方的除外）出具的不可撤销信用证。

（5）本基金有权在任何时候终止证券借贷交易并在正常市场惯例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券。

（6）本基金管理人将对本基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负相应责任。

4、本基金可以根据正常市场惯例参与正回购交易、逆回购交易,并且应当遵守下列规定:

（1）所有参与正回购交易的对手方（中资商业银行除外）应当具有中国证监会认可的信用评级机构信用评级。

（2）参与正回购交易,应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已售出证券市值的102%。一旦买方违约,本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要。

（3）买方应当在正回购交易期内及时向本基金支付售出证券产生的所有股息、利息和分红。

（4）参与逆回购交易,应当对购入证券采取市值计价制度进行调整以确保已购入证券市值不低于支付现金的102%。一旦卖方违约,本基金根据协议和有关法律有权保留或处置已购入证券以满足索赔需要。

（5）本基金管理人将对基金参与证券正回购交易、逆回购交易中发生的任何损失负相应责任。

本基金参与证券借贷交易、正回购交易,所有已借出而未归还证券总市值或所有已售出而未回购证券总市值均不得超过基金总资产的50%。

前项比例限制计算,基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金总资产。

除上述第1款“投资限制”中的第（2）、（5）、（6）项外,若基金超过上述投资比例限制，应当在超过比例后30个工作日内采用合理的商业措施减仓以符合投资比例限制要求。

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,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。

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。

5、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

（1）购买不动产。
（2）购买房地产抵押按揭。
（3）购买贵重金属或代表贵重金属的凭证。
（4）购买实物商品。
（5）除应付赎回、交易清算等临时用途以外,借入现金。该临时用途借入现金的比例不得超过基金资产净值的10%。
（6）用融资购买证券,但投资金融衍生品除外。
（7）参与未持有基础资产的卖空交易。
（8）从事证券承销业务。
（9）基金不得购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层。
（10）法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

十三、基金的业绩比较基准

恒生指数收益率×95%+人民币活期存款利率（税后）×5%

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。

恒生指数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)该指数或其中任何成份或其所包涵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成份或其所包涵的数据而产生的结果,而向本基金的任何经纪或本基金份额持有人或任何其它人士作出保证或声明或担保,也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、本基金份额持有人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、本基金份额持有人或任何其它交易本基金的人士不得因本基金，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交易本基金。为避免产生疑问,本免责声明不构成任何经纪、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使用之该指数数值为恒生指数有限公司酌情计算的结果。

十四、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。

十五、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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同规定,于2020年8月19日复核了本基金投资组合报告中的财务指标、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2020年2季度报告,数据截至日为2020年6月30日,本报告中所列财务数据未经审计。

（一）报告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	97,125,650.48	82.72
	其中:普通股	97,125,650.48	82.72
	优先股	-	-
	存托凭证	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	13,546,211.53	11.54
8	其他资产	6,740,574.78	5.74
9	合计	117,412,436.79	100.00

注：本基金通过深港通交易机制投资的港股公允价值为97,125,650.48元,占期末基金资产净值的比例为89.87%。

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（%）
中国香港	97,125,650.48	89.87
合计	97,125,650.48	89.87

注:1.股票的国家（地区）类别根据其所在证券交易所确定。
2.本基金本报告期末未持有存托凭证。

（二）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（%）
金融	49,754,720.55	46.04
通信服务	15,320,096.94	14.18
房地产	8,036,751.14	7.44
能源	3,971,637.12	3.67
公用事业	4,330,808.12	4.01
非日常生活消费品	4,193,411.22	3.88
工业	4,384,635.31	4.06
日常消费品	2,635,228.74	2.44
信息技术	1,466,938.97	1.36
医疗保健	2,392,745.12	2.21
原材料	0.00	0.00
合计	96,486,973.23	89.28

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

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例(%)
金融	-	-
电信服务	-	-
房地产	638,677.25	0.59
能源	-	-
公用事业	-	-
消费者非必需品	-	-
工业	-	-
消费者常用品	-	-
信息技术	-	-
医疗保健	-	-
基础材料	-	-
合计	638,677.25	0.59

注:以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

（四）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及存托凭证投资明细

（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票及存托凭证投资明细

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	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股	700 HK	香港联合交易所	中国香港	24,400	11,112,764.89	10.28
2	AIA GROUP LTD	友邦保险	1299 HK	香港联合交易所	中国香港	154,200	10,183,631.99	9.42
3	HSBC HOLDINGS PLC	汇丰控股	5 HK	香港联合交易所	中国香港	274,400	9,073,455.28	8.40
4	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	建设银行	939 HK	香港联合交易所	中国香港	1,579,000	9,043,357.44	8.37
5	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国平安	2318 HK	香港联合交易所	中国香港	79,000	5,592,536.40	5.17
6	HONG KONG EXCHANGE S&CLEAR	香港交易所	388 HK	香港联合交易所	中国香港	15,900	4,792,819.68	4.43
7	BANK OF CHINA LTD-H	中国银行	3988 HK	香港联合交易所	中国香港	1,508,000	3,953,331.78	3.66
8	CHINA MOBILE LTD	中国移动	941 HK	香港联合交易所	中国香港	81,500	3,893,492.33	3.60
9	BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	交通银行	3328 HK	香港联合交易所	中国香港	779,000	3,401,303.45	3.15
10	CNOOC LTD	中国海洋石油	883 HK	香港联合交易所	中国香港	237,000	1,866,103.11	1.73

（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股票及存托凭证投资明细

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	NEW WORLD DEVELOPMENT	新世界发展	2909 HK	香港联合交易所	中国香港	19,000	638,677.25	0.59

（五）报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

（六）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

无。

（七）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

无。

（八）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

无。

（九）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

无。

（十）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本期是否出现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、处罚的情形。

1、本基金投资的前十名证券之一汇丰控股（0005.HK）的发行主体汇丰控股有限公司创始成员香港上海汇丰银行有限公司于2019年9月10日因没有遵守《操守准则》下的电话录音规定,受到香港证券及期货事务监察委员会谴责及罚款。汇丰控股为本基金跟踪标的指数的成份股。

2、本基金投资的前十名证券之一建设银行（0939.HK）的发行主体中国建设银行股份有限公司于2019年12月27日因用于风险缓释的保证金管理存在漏洞等,受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字（2019）22号）,于2020年4月20日因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在违法违规行为,受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字（2020）8号）。建设银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

3、本基金投资的前十名证券之一交通银行（3328.HK）的发行主体交通银行股份有限公司于2019年12月27日因授信审批不审慎等,受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字（2019）24号）,于2020年4月20日因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在违法违规行为,受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字（2020）6号）。交通银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

4、本基金投资的前十名证券之一中国银行（3988.HK）的发行主体中国银行股份有限公司于2020年4月20日因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在违法违规行为等,受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监罚决字（2020）4号）。中国银行为本基金跟踪标的指数的成份股。

（2）本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

（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	182,792.44
4	应收利息	1,246.76
5	应收申购款	6,556,535.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,740,574.78

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

1. 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

无。

2. 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

无。

（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。

十六、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。

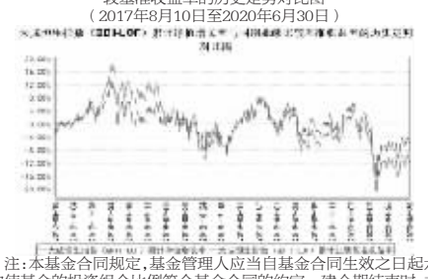
自基金合同生效日（2017年8月10日）至2020年6月30日以来完整会计年度的基金份额净值增长率以及与同期业绩比较基准收益率的比较:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2017.8.10-2017.12.31	4.80%	0.62%	7.41%	0.78%	-2.61%	-0.16%
2018.01.01-2018.12.31	-9.73%	1.18%	-12.88%	1.22%	3.15%	-0.04%
2019.01.01-2019.12.31	10.25%	0.94%	8.68%	0.94%	1.57%	0.00%
2020.01.01-2020.06.30	-9.30%	1.72%	-12.63%	1.81%	3.33%	-0.09%
2017.08.10-2020.06.30	-5.40%	1.15%	-11.16%	1.20%	5.76%	-0.05%

（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:

大成恒生指数证券投资基金（LOF）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

（2017年8月10日至2020年6月30日）



注:本基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

十七、基金份额的申购与赎回

（一）申购与赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售网点将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并在管理人网站公示。基金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。

投资人可以通过场外、场内两种方式申购赎回本基金份额。本基金场外申购和赎回场所为场外销售机构的销售网点,场内申购和赎回场所为深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位。

办理本基金份额场内申购、赎回业务应遵守深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。

（二）申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回,本基金的开放日为港股通交易日,但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。开放日的具体业务办理时间在招募说明书或相关公告中载明。

基金合同生效后,若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况,基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整,但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金已于2017年8月28日开始办理日常申购、赎回及定期定额投资业务。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购或者赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的,其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

（三）申购与赎回的原则

1. “未知价”原则,即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算;

2. “金额申购、份额赎回”原则,即申购以金额申请,赎回以份额申请;

3. 当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销;

4、基金份额持有人在场外赎回基金份额时,赎回遵循“先进先出”原则,即按照投资人申购的先后次序进行顺序赎回;

5、投资人办理场外申购、赎回应使用基金账户,办理场内申购、赎回应使用深圳证券账户;

6、投资人通过深圳证券交易所交易系统办理本基金的场内申购、赎回时,需遵守深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对申购、赎回业务等规则有新的规定,按新规定执行。

基金管理人可在法律法规允许的情况下,对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

（四）申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序,在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时,必须全额交付申购款项,投资人交付申购款项,申购申请成立;登记机构确认基金份额时,申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请,赎回成立;基金份额登记机构确认赎回时,赎回生效。投资人赎回申请成功后,基金管理人将在T+10日(包括该日)内支付赎回款项。如基金投资所涉及的主要市场休市时,本基金所投资市场的交易清算规则有变更或国家外汇管理相关规定有变更时,赎回款项支付的时间将相应调整。在发生巨额赎回时,款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T日）,在正常情况下,本基金登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请,投资人可在T+2日后（包括该日）到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功,则申购款项退还给投资人。

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况,投资人应及时查询并妥善行使合法权利,否则,由此产生的投资人的任何损失由投资人自行承担。

如基金管理人接受某笔或者某些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,基金管理人有权对该单一投资者的申请全部或部分确认失败。由此,给投资者造成的损失,有投资人自行承担。

（五）申购与赎回的数额限制

1、单个基金账户单笔申购的最低金额为1元,投资者可多次申购,累计申购金额不设上限。

2、本基金不对投资者每个交易账户的最低基金份额余额进行限制,亦不对单个投资者累计持有的基金份额上限进行限制,但单一投资者持有基金份额的比例不得达到或者超过50%，或者以其他方式变相规避50%集中度限制。

3、基金管理人可在法律法规允许的前提下,根据基金运作的实际情况并在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下,调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

4、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时,基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施,切实保护存量基金份额持有人的合法权益。具体请参见相关公告。

（六）申购与赎回的费率

本基金目前开通前端收费模式，将来根据市场发展状况和法律法规、监管机构的规定,可能增加新的收费模式,也可能相应增加新的基金份额种类,并可能需计算新基金份额类别的基金份额净值。增加新的收费模式,应当按照法律法规、监管机构的规定,履行适当的程序,并及时公告。新的收费模式的具体业务规则,请见有关公告、通知。

1、申购和赎回费率

（1）日常申购费率

本基金日常申购费率具体为:

	日常申购金额（M）	日常申购费率
场外日常申购费率	M（100万元	1.20%
	100万≤M（200万元	0.80%
	200万≤M（500万元	0.50%
	M≥500万元	1000元/笔
场内日常申购费率	深圳证券交易所会员单位应按照场外日常申购费率设定投资者的场内日常申购费率	

（2）日常赎回费率

场外赎回费率见下表。

持有基金时间（T）	赎回费率
T<7日	1.50%
7日≤T<1年	0.50%
1年≤T<2年	0.25%
T≥2年	0%
注:1年指365天	

本基金对持续持有基金份额少于7 日的投资人收取的赎回费,将全额计入基金财产;对持续持有基金份额长于7日（含7日）的投资人收取的赎回费,将不低于赎回费总额的 25%归入基金财产。

场内赎回费率见下表:

持有基金时间（T）	赎回费率
T<7日	1.5%
T≥7日	0.5%

本基金对持续持有基金份额少于7 日的投资人收取的赎回费,将全额计入基金财产;对持续持有基金份额长于7日（含7日）的投资人收取的赎回费,将不低于赎回费总额的 25%归入基金财产。

3、基金管理人可以在法律法规和本基金合同规定范围内调整申购费率和赎回费率。费率如发生变更,基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

（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

基金申购采用金额申购的方式，投资者在申购时支付申购费用,申购费率随申购金额的不同而有所不同。计算公式为:

基金的申购金额包括申购费用和净申购金额,其中:

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/申购当日基金份额净值

例:某投资者申购本基金100,000元,申购费率为1.20%,假设申购当日基金份额净值为1.045元,则其可得到的申购份额为:

净申购金额=100,000/（1+1.20%）=98,814.23元
申购费用=100,000-98,814.23=1,185.77元
申购份额=98,814.23/1.045=94,559.07份

即:该投资者投资100,000元申购本基金,假设申购当日基金份额净值为1.045元,则可得到94,559.07份基金份额。

2、基金赎回金额的计算

本基金采用“份额赎回”方式,赎回价格以T日的基金份额净值为基准进行计算,计算公式:

赎回总金额=赎回份额×T日基金份额净值
赎回费用=赎回总金额×赎回费率
净赎回金额=赎回总金额(赎回费用

例:某投资者赎回10万份基金份额（持有半年）,对应的赎回费率为0.5%,假设赎回当日基金份额净值是1.016元,则其可得到的赎回金额为:

赎回总金额 =100,000×1.016=101,600元
赎回费用 = 101,600× 0.5% =508元
净赎回金额 = 101,600 -508 =101,092元

即投资者赎回本基金10万份基金份额，假设赎回当日基金份额净值是1.016元,则其可得到的赎回金额为101,092元。

3、基金份额净值的计算

本基金份额净值的计算,保留到小数点后3位,小数点后第4位四舍五入,由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的基金份额净值在当天收市后计算,并在T+1日公告。遇特殊情况,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。

4、申购份额的计算及余额的处理方式

申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值,有效份额单位为份,场外申购涉及金额、份额的计算结果均按四舍五入方法,保留到小数点后2位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。场内申购涉及金额的计算结果按四舍五入方法,保留到小数点后两位,由此产生的收益或损失由基金财产承担；场内申购涉及份额的计算结果按截位法,保留到整数位,整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资人资金账户。

5、净赎回金额的处理方式

净赎回金额为按实际确认的有效赎回份额以当日基金份额净值为基准并扣除相应的费用,赎回净金额计算结果保留到小数点后2位,小数点后两位以后的部分四舍五入,由此产生的误差计入基金财产。

6、基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后,对基金投资者适当调低基金申购费率和赎回费率。

（八）基金的登记和转托管

1、基金份额的登记

（1）本基金的份额采用分系统登记的原则。场内申购或上市交易买入的基金份额登记在证券登记结算系统持有人证券账户下;场外申购买入的基金份额登记在注册登记系统持有人开放式基金账户下。

（2）登记在证券登记结算系统中的基金份额既可以在深圳证券交易所上市交易,也可以直接申请场内赎回。

（3）登记在注册登记系统中的基金份额可以申请场外赎回。

2、系统内转托管

（1）系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转托管的行为。

（2）基金份额登记在注册登记系统的基金份额持