# 大成沪深300指数证券投资基金更新的招募说明书摘要

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
二〇〇九年五月

重要提示

大成沪深300指数证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证监会证监基金字【2006】24号文核准募集,基金合同于2006年4月6日正式生效。

本基金管理人保证本更新的招募说明书摘要的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其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。

基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责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。

投资有风险,投资者申购本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

本更新的招募说明书已经本基金托管人复核。该更新招募说明书摘要所载内容截止日为2009年4月6日,有关财务数据和净值表现截止日为2009年3月31日。(财务数据已经审计)

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

本基金管理人大成基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字[1999]10号文批准发起设立,概况介绍如下:

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:张树忠
成立日:1999年4月12日
注册资本:贰亿元人民币
股权结构:中泰信托投资有限责任公司(持股比例48%)、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%)、广东证券股份有限公司(持股比例2%)。
电话:0755-83183388
传真:0755-83199588
联系人:肖冰

大成基金管理有限公司设有股东会、董事会、监事会、下设十五个部门,分别是股票投资部、固定收益部、委托投资部、研究部、交易管理部、金融工程部、客户服务部、市场部、总经理办公室、人力资源部、综合财务部、基金运营部、监察稽核部和国际业务部;此外,还设立了投资决策委员会、投资风险控制委员会和战略规划委员会。

公司以"稳健、高效"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。公司所有人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。

(二)证券投资基金管理情况

截至2009年4月6日,本基金管理人共管理3只封闭式证券投资基金:基金景宏、基金景福、大成优选股票型证券投资基金,及12只开放式证券投资基金:大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、大成监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、大成创新成长股票型证券投资基金、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和大成策略回报股票型证券投资基金等。

(三)主要人员情况

1.公司高级管理人员

董事会:

张树忠先生,董事长,经济学博士。1989年7月—1993年2月,任中央财经大学财政系讲师;1993年2月—1997年3月,任华夏证券股份有限公司投资银行总部总经理,研究发展部总经理;1997年3月—2003年7月,任光大证券股份有限公司总裁助理兼北方总部总经理、资产管理总监;2003年7月—2004年6月,任北大保德信基金管理公司董事、副总经理;2004年6月—2006年12月,任大通证券股份有限公司副总经理;2007年1月—2008年11月,任大通证券股份有限公司总经理;2008年11月—2008年4月,任职中国人保资产管理股份有限公司;2008年4月起任中国人保资产管理股份有限公司副总裁、党委委员;2008年11月起同时担任大成基金管理有限公司董事长。

王颖先生,董事总经理,国际工商管理专业博士。2000年12月—2002年9月,任招商证券股份有限公司深圳管理总部副总经理、机构管理部副总经理;2002年9月加入大成基金管理有限公司,历任助理总经理、副总经理;2008年11月起担任大成基金管理有限公司总经理。

王长林先生,董事,研究生,高级经济师。曾任中国农业银行天津分行计划处副处长、信息中心副总经理,中国长城信托投资公司计划财务部总经理、现任中国银河投资管理有限公司办公室主任。

曾北川先生,董事,博士。1989年8月—1992年6月,任建设部中国城乡建设发展总公司项目经理;1992年6月—1994年3月,任中国建设银行总行房地产信贷部房地产信贷项目经理;1994年4月—1998年5月,任国家开发银行国际金融局信贷一处信贷项目经理、国家开发银行国际金融局综合计划处处长;1998年5月—2001年10月,任华夏银行北京管理部副总经理、华夏银行北京管理部副总经理(主持工作);2001年10月—2006年10月,任华夏银行总行营业部常务副总经理(党组副书记),华夏银行总行稽核部总经理(监事会监事、审计委员会委员);2006年10月—2008年4月,任中国人寿保险股份公司市场拓展部总经理;2008年4月,任人保控股投资有限公司筹备组成员;2008年7月起任中国华闽投资控股有限公司总裁、党委书记。

杨亦忠先生,董事,大学本科。历任深圳监天基金管理公司投资与研究部经理;长盛基金管理有限公司研究部副总监、基金经理;大成基金管理有限公司研究总监;光大证券证券投资部总经理。现任光大证券助理总裁。

阚春林先生,独立董事,大学本科。1970—1971年,解放军信阳坦克师锻炼;1971—1987年,任氏器部5107、5137厂生产会计员、财务处长;1987年—1998年,任湖北省财政厅中央企业处副处长、财政部驻湖北省专员助理;1998年—2005年,任财政部驻江西专员办专员助理、副专员、专员、党组书记;2005年8月,任中央纪委、中组部金融巡视组局长;2007年1月退休。

于绪刚先生,独立董事,法学博士,环太平洋律师协会会员、全国律协金融证券委员会委员、华中科技大学兼职教授及研究生导师、北京工商大学客座教授、华北电力大学客座教授。1990年—1995年,任河北省保定市中级人民法院助理审判员;1995年—1998年,北京大学法学硕士学习;1999年,香港大学法律学院访问学者、香港法律教育信托基金访问学者;1999年—2001年,北京大学法学博士学习;2001年起任大成律师事务所律师、高级合伙人、管委会委员。

万曾炜先生,独立董事,经济学博士,研究员,曾任上海市政府发展研究中心处长、上海市浦东新区综合规划土地局党组书记、局长,浦东新区发展计划局党组书记,上海浦东发展集团和上海浦东投资建设有限公司筹建负责人和法人代表,现任上海市公积金管理中心党委书记、主任,上海市政府特聘决策咨询专家。

刘大为先生,独立董事,国家开发银行总会计师,高级经济师,享受政府特殊津贴专家。中国人民银行研究生部硕士生指导老师,首都经济贸易大学兼职教授,清华大学中国经济研究中心高级研究员。先后在北京市人民政府研究室(副处长、处长)、北京市第一商业局(副局长)、中国建设银行信托投资公司(总经理)、中国投资银行(行长)、国家开发银行(总会计师)工作。

监事会:

胡学光先生,监事长,硕士,高级经济师,广东省高级经济师评审委员会委员。曾在湖北金融高等专科学校任教,广州金融高等专科学校任金融系副主任;1992年—2003年4月,在广东证券股份有限公司先后任"广证基金"、"广证受益"经理、部门总经理、总裁助理、副总裁,兼任中山大学岭南学院兼职教授、中天证券研究院副院长;广东证券博士后科研工作站指导导师;2003年5月至2008年8月任大成基金管理有限公司董事长。

宁加岭先生,监事,大学本科。1983年2月—1987年6月,任财政部人教司副处长、处长;1987年6月—1994年6月,任财政部行政司副司长、司长;1994年6月—1999年6月,任财政部德宏实业总公司总经理、法人代表;1999年6月起,任职于财政部离退休老干部局。

黄建农先生,监事,大学本科。曾任中国银河证券有限责任公司上海江苏北路营业部总经理,中国银河证券有限责任公司资产管理总部副总经理,总经理,中国银河投资管理公司投资管理部总经理。现任中国银河投资管理公司上海投资部董事总经理。

其他高级管理人员:

刘彩晖女士,副总经理,管理学硕士。1999年-2002年,历任江南信托投资有限公司投资银行部副总经理、总经理;2002年-2006年,历任江南证券有限公司总裁助理、投资银行部总经理、机构管理部总经理,期间还任江南宏富基金管理公司筹备组副组长;2006年4月-7月任深圳中航集团公司人力资源部副总经理;2006年8月-2008年5月,任大成基金管理有限公司助理总经理;2008年5月起任大成基金管理有限公司副总经理。

杜鹏女士,督察长,研究生学历。1992年-1994年,历任原中国银行陕西省信托咨询公司证券部驻上交所出市代表、上海业务部负责人;1994年-1998年,历任广东省南方金融服务总公司投资基金管理部证券投资部副经理、广东华侨信托投资公司证券总部资产管理部经理;1998年9月参与大成基金管理有限公司的筹建;1999年3月起,任大成基金管理有限公司督察长兼监察稽核部总监。

2.基金经理

(1)现任基金经理

杨丹先生,基金经理,理学硕士,8年证券从业经验。2001年加入大成基金管理有限公司,先后任职于基金经理部、研究部、金融工程部,长期从事指数化投资及金融工程研究工作。2006年5月起担任大成沪深300指数证券投资基金基金经理,2008年8月23日起兼任景福证券投资基金基金经理。

(2)历任基金经理

| 历任基金经理姓名 | 管理本基金时间 |
|---|---|
| 施永辉 | 2006年4月6日—2006年5月26日 |

3.公司投资决策委员会

刘明,投资总监,大成优选股票型证券投资基金基金经理,投资决策委员会主任委员;杨建华,股票投资部总监,负责公司股票投资业务,大成景阳领先股票型证券投资基金基金经理,投资决策委员会委员;陈尚前,固定收益部总监,负责公司固定收益证券投资业务,大成债券投资基金、大成强化收益债券型证券投资基金基金经理,投资决策委员会委员;曹建飞,研究总监,大成精选增值混合型证券投资基金基金经理,投资决策委员会委员;邓韶勇,交易管理部总监,投资决策委员会委员;姚[illegible]2,研究部副总监,投资决策委员会委员;施永辉,大成蓝筹稳健证券投资基金基金经理,投资决策委员会委员;杨丹,大成沪深300指数证券投资基金基金经理、景福证券投资基金基金经理,投资决策委员会委员;王立,大成货币市场证券投资基金基金经理,投资决策委员会委员。

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:北京市海淀区西三环北路100号金玉大厦
法定代表人:项俊波
成立时间:2009年1月15日
注册资本:2600亿元人民币
存续期间:持续经营
联系电话:010-68424199
联系人:李芳菲

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。2009年1月15日,中国农业银行股份有限公司正式成立,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。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,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,2004年9月更名为托管业务部,内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处,拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

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。股份公司于2009年1月15日依法成立。股份公司自成立之日起,将完整承继中国农业银行的资产、负债和所有业务,并将继续从事原经营范围和业务许可文件上批准/核准的业务。中国农业银行已有的营业机构、商标、互联网域名和咨询服务电话等保持不变,由股份公司继续使用,各项业务照常进行。客户毋需因改制而办理任何变更手续。

2.主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工93名,其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家10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2008年12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63只,包括基金裕阳、基金裕隆、基金汉盛、基金景福、基金天华、基金鸿阳、基金丰和、基金久益、富国动态平衡开放式基金、长盛成长价值开放式基金、宝盈鸿利收益开放式基金、大成价值增长开放式基金、大成债券开放式基金、银河稳健开放式基金、银河收益开放式基金、长盛债券开放式基金、长信利息收益开放式基金、长盛动态精选开放式基金、景顺长城内需增长开放式基金、万家增强收益债券型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式基金、富国天瑞强势开放式基金、鹏华货币市场基金、国联分红增利开放式基金、国泰货币市场基金、新世纪优选分红证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达荷银货币市场基金、交银施罗德货币市场基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金(LOF)、信诚四季红混合型证券投资基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、富国天时货币市场基金、益民货币市场基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心精选股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、长盛中证100指数证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、富盛策略增长股票型证券投资基金、泰达荷银首选企业股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金、国泰金牛创新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、益民创新优势混合型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、华夏复兴基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、新世纪优选成长股票型证券投资基金、金元比联成长动力灵活配置混合型证券投资基金、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金。

三、相关服务机构

(一)销售机构及联系人

1.直销机构:

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
法定代表人:张树忠
电话:0755-83183388
传真:0755-83199588
联系人:杨春明
公司网址:www.dcfund.com.cn
大成基金客户服务热线:021-53599588,400-888-5558(免长途固话费)
大成基金管理有限公司现分别在深圳、北京、上海设有投资理财中心:
(1)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:梁婧、瞿宏伟
电话:0755-83195090,83195236
传真:0755-83195091
(2)大成基金北京投资理财中心
地址:北京市朝阳区朝阳门外大街16号中国人寿大厦1201室
联系人:廖红军、李宁
电话:010-85252345&46
传真:010-85252732&2275
(3)大成基金上海投资理财中心
地址:上海市广东路689号海通证券大厦19层
联系人:徐▮、朱君
电话:021-6351392&526
传真:021-63513928
2.场外代销机构
(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
法定代表人:项俊波
客服电话:95599
联系人:蒋浩
电话:010-85109219
传真:010-85109219
网址: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:肖钢
客服电话:95566
传真:010-66594946
电话:010-66594977
网址:www.boc.cn
(3)中国建设银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号长安兴融中心1号楼
法定代表人:郭树清
联系人:王琳
电话:010-67596084
传真:010-66275654
客服电话:95533
网址:www.ccb.com
(4)中国工商银行股份有限公司
注册地址:中国北京复兴门内大街55号
法定代表人:姜建清
客服电话:95588
联系人:田耕
电话:010-66107900
传真:010-66108013
网址:www.icbc.com.cn
(5)深圳市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:黄立哲
电话:0755-25859591
传真:0755-25878304
联系人:霍兆龙
客户服务热线:0755-961202,4006699999
公司网站:www.18ebank.com
(6)深圳发展银行股份有限公司
办公地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
法定代表人:法兰克纽曼(Frank N.Newman)
客服电话:95501
联系人:周勤
电话:0755-82088888-8811
传真:0755-82080714
网址:www.sdb.com.cn
(7)上海浦东发展银行股份有限公司
办公地址:上海市北京东路689号17楼
法定代表人:吉晓辉
联系人:倪苏云
客服热线:95528
电话:021-61618888
传真:021-63602431
网址:www.spdb.com.cn
(8)兴业银行股份有限公司
办公地址:福州市五一中路元洪大厦25层
法定代表人:高建平
电话:021-62677777
传真:021-62569070
联系人:潘玲
客户服务电话:95561
网址:www.cib.com.cn
(9)交通银行股份有限公司
办公地址:上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人:胡怀邦
客服电话:95559
联系人:曹榕
电话:021-58781234
传真:021-58408842
网址:www.bankcomm.com
(10)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号招商银行股份有限公司大厦
法定代表人:秦晓
客服电话:95555
联系人:刘薇
电话:0755-83195915
传真:0755-83195061
网址:www.cmbchina.com
(11)中国光大银行
注册地址:北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦
法定代表人:唐双宁
客服电话:95595
联系人:李伟
电话:010-68560675
传真:010-68560661
网址:www.cebbank.com
(12)中国民生银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区正义路4号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人:董文标
客服电话:95568
联系人:董云巍
电话:010-58351666-8155
传真:010-83914283
网址:www.cmbc.com.cn
(13)广东发展银行股份有限公司
注册地址:广州市农林下路83号
法定代表人:李若虹
客服电话:95508
电话:020-87310888
网址:www.gdbc.com.cn
(14)山西证券有限责任公司
注册地址:山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
法定代表人:侯巍
客服电话:400-666-1618
联系人:张治国
电话:0351-8686703
传真:0351-8686619
网址:www.i618.com.cn
(15)长江证券股份有限公司
注册地址:湖北省武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人:胡运钊
联系人:李良
联系电话:021-63219781
客服电话:4008-888-999
委托电话:4008-888-318
传真:027-85481900
网址:www.cjsc.com.cn
(16)国泰君安证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区商城路618号
通讯地址:上海浦东新区银城中路168号上海银行大厦
法定代表人:祝幼一
客服电话:400-8888-666
联系人:芮敏祺
电话:021-62580818-213
传真:021-62583439
网址:www.gtja.com
(17)中信建投证券有限责任公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
通讯地址:北京市朝阳门内大街188号
法定代表人:张佑君
客服电话:400-8888-108
联系人:魏明
电话:010-85130579
网址:www.csc108.com
(18)国信证券有限责任公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26
法定代表人:何如
客服电话:800-810-8868
联系人:林建闽
电话:0755-82130833-2181
传真:0755-82133302
网址:www.guosen.com.cn
(19)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
法定代表人:宫少林
客服电话:4008888111,95565
联系人:黄健
电话:0755-82943511
传真:0755-83734343
网址:www.newone.com.cn
(20)广发证券股份有限公司
注册地址:广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心26楼2611室
法定代表人:王志伟
客服电话:020-87555888转各营业网点
联系人:肖中梅
电话:020-87555888-875
传真:020-87557985
网址:www.gf.com.cn
(21)中国银河证券股份有限公司
通讯地址: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:肖时庆
客服电话:4008-888-888
联系人:李洋
联系电话:010-66568047
传真:010-66568536
网址:www.chinastock.com.cn
(22)联合证券有限责任公司
办公地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层
法定代表人:马韶明
客服电话:400-8888-555
联系人:盛宗凌
电话:0755-82492000
传真:0755-82492962
网址:www.lhzq.com
(23)申银万国证券股份有限公司
通讯地址:上海市常熟路239号2楼
法定代表人:丁国荣
客服电话:021-962505
联系人:曹晔
电话:021-54033888
传真:021-54038844
网址:www.sw2000.com.cn
(24)海通证券股份有限公司
注册地址:上海市淮海中路98号
法定代表人:王开国
客服电话:95553、400-888-8001
联系人:金芸
电话:021-23219000
传真:021-63602722
网址:www.haitongzq.com
(25)中信证券股份有限公司
办公地址:北京朝阳区新源南路6号京城大厦
法定代表人:王东明
客服电话:010-84588888各地营业部咨询电话
联系人:陈忠
电话:010-84683893
传真:010-84865560
网址:www.cs.ecitic.com
(26)安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元
法定代表人:牛冠兴
客服电话:4008001001
联系人:张西洋
电话:0755-82558335
传真:0755-82558335
网址:www.axzq.com.cn
(27)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:徐浩明
客服电话:400-888-8788、10108998
联系人:刘晓、李芳芳
电话:021-22169081
传真:021-22169134
网址:www.ebscn.com
(28)华林证券有限责任公司
办公地址:珠海市拱北夏湾华平路96号二层202-203房
法定代表人:段文清
客服电话:0750-3160388各地营业部客户服务电话
联系人:杨玲
电话:0755-82707855
传真:0755-82707850
网址:www.chinalions.com
(29)中信万通证券有限责任公司
注册地址:青岛市崂山区前哨路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:史洁民
客服电话:0532-96577
联系人:丁鼎燕
电话:0532-85022026
传真:0532-85022026
网址:www.zxwt.com.cn
(30)东海证券有限责任公司
注册地址:常州延陵西路59号常信大厦18、19楼
办公地址:上海市浦东区东方路989号中达广场17楼
法定代表人:朱科敏
客服电话:0519-88166222、0379-64902266、021-52574550
联系人:李涛
电话:021-50586660
传真:021-50586660-8880
网址:www.longone.com.cn
(31)江海证券有限责任公司
注册地址:南昌市抚河北路291号
办公地址:南昌市抚河北路291号六楼
法定代表人:赵江涛
客服电话:0791-6768763
联系人:余雅娜
电话:0791-6768763
传真:0791-6789414
网址:www.scstock.com
(32)中信金通证券有限责任公司
注册地址:杭州市中河南路11号万凯旅院商务楼A座
办公地址:杭州市中河南路11号万凯旅院商务楼A座
法定代表人:刘军
电话:0571-96598
传真:0571-85783771
联系人:王勤
联系电话:0571-85783715
网址:www.bigsun.com.cn
(33)广州证券有限责任公司
注册地址:广州市先烈中路69号主楼五楼
办公地址:广州市先烈中路69号东山广场主楼五楼
法定代表人:吴志明
客服电话:020-961303
联系人:江欣
联系电话:020-87320991
传真:020-87325036
网址:www.gzs.com.cn
(34)平安证券有限责任公司
办公地址:深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦三楼
法定代表人:陈欣达
客服电话:95511
联系人:袁月
电话:0755-22627802
传真:0755-83433794
网址:www.pa18.com
(35)华泰证券有限责任公司
地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人:吴万善
客服电话:4008-888-168、95597
联系人:李金龙、张小波
电话:025-84457777-950、248
网址:www.htsc.com.cn
(36)湘财证券股份有限公司
住所:长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
办公地址:上海陆家嘴环路958号华能联合大厦5层
法定代表人:陈学荣
客服电话:400-888-1551
联系人:钟康莉
电话:021-68634518
传真:021-68865680
网址:www.xcsc.com
(37)国元证券股份有限公司
注册地址:安徽省合肥市寿春路179号
公司办公地址:安徽省合肥市寿春路179号(邮政编码:230001)
法定代表人:凤良志
客服电话:400-888-8777、0551-95888
联系人:程维
电话:0551-2634400
传真:0551-2645709
网址:www.gyzq.com.cn
(38)上海证券有限责任公司
注册地址:上海市西藏中路336号
办公地址:上海市西藏中路336号
法定代表人:蒋元真
客服电话:021-962518
联系人:谢秀峰
电话:021-51539888
传真:021-65081063
网址:www.962518.com
(39)华安证券有限责任公司
住所:安徽省合肥市长江中路357号
法定代表人:李工
客服电话:0551-5161671
联系人:甘霖
电话:0551-5161671
传真:0551-5161672
网址:www.hazq.com.cn
(40)兴业证券股份有限公司
住所:福建省福州市湖东路99号标力大厦
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴东路166号中国保险大厦18楼
法定代表人:兰荣
电话:021-68419974
传真:021-68419867
联系人:杨盛芳
网址:www.xyzq.com.cn
客服电话:400888123
(41)财通证券经纪有限责任公司
注册地址:杭州市解放路111号金钱大厦
办公地址:杭州市解放路111号金钱大厦
法定代表人:沈继宁
联系人:乔骏
电话:0571-87925129
传真:0571-87925129
网址:www.ctsec.com
客户服务电话:0571-96336
(42)信泰证券有限责任公司
办公地址:江苏省南京市长江路88号国信大厦18、19楼(邮政编码:210005)
法定代表人:钱凯法
客服电话:400-8888-918
联系人:舒萌菲
电话:025-84784765
传真:025-84784830
网址:www.thope.com
(43)浙商证券有限责任公司
地址:浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼
法定代表人:吴承根
联系人:吴颖
电话:0571-87901963
传真:0571-87902081
网址:www.stocke.com
(44)渤海证券有限责任公司
注册地址:天津市经济技术开发区第一大街29号
办公地址:天津市河西区宾水道3号
法定代表人:张志军
客服电话:4006515988
联系人:王兆权
电话:022-28451861
传真:022-28451892
客服电话:28455588
网址:www.cbsc.com.cn
(45)上海农村商业银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区浦东大道981号
法定代表人:李秀仑
电话:021-62126969
传真:021-62521689
联系人:吴海平、翁敏芬
客服电话:021-962999
网址:www.shrcb.com
(46)万正证券有限责任公司
注册地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
办公地址:湖南省长沙市建湘路479号
法定代表人:雷杰
客服电话:0571-95571、0731-95571、13258915782
电话:0731-2882340、0571-87782047
传真:0731-2882332
网址:www.foundersc.com
(47)东莞证券有限责任公司
办公地址:东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼
法定代表人:游锦辉
客服电话:0769-961130
联系人:张建平
电话:0769-22119426
传真:0769-22119423
网址:www.dgzq.com.cn
(48)国海证券有限责任公司
注册地址:广西南宁市滨湖路46号
办公地址:广西南宁市滨湖路46号
客服电话:400-888-8100(全国)、96100(广西)
法定代表人:张雅锋
联系人:覃清芳
电话:0771-5539262
传真:0771-5539033
网址:www.ghzq.com.cn
(49)恒泰证券有限责任公司
注册地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
法人代表:刘汝军
客户服务电话:0471-4961259
联系人:帝向东
电话:0471-4913998
传真:0471-4930707
网址:www.cnht.com.cn
(50)瑞银证券有限责任公司
注册地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
法定代表人:刘弘
电话:010-59226788
传真:010-59226840
联系人:谢亚凡
客户服务电话:400-887-8827
网址:www.ubssecurities.com
(51)宏源证券股份有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐市建设路2号
办公地址:北京市海淀区西直门北大街甲43号金运大厦B座6层
法定代表人:冯世生
联系人:韩梅
电话:010-62294608-6957
传真:010-62296854
客户服务电话:010-62294600
网址:www.hysec.com
(52)长城证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人:黄耀华
联系人:匡婷
电话:0755-83516289
传真:0755-83516199
客户服务热线:0755-33680000、400-6666-888
长城证券网站:www.cc168.com.cn
(53)国都证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田中心区金田路4028号荣超经贸中心26层11、12
办公地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层
法定代表人:王少华
联系人:黄静
客户服务电话:800-810-8809
网址:www.guodu.com
(54)东北证券股份有限公司
注册地址:长春市自由大路1138号
办公地址:长春市自由大路1138号
法定代表人:矫正中
联系人:潘僧
电话:85096709
客户服务电话:0431-96688-0、0431-85096733
网址:www.nesc.cn
(55)世纪证券有限责任公司
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼
法定代表人:段强
客服电话:0755-83199511
联系人:刘军辉
电话:0755-83199511
传真:0755-83199545
网址:www.cscc.com.cn
电子邮箱:liuj@cscc.com.cn;
(56)中银国际证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39F
法定代表人:平岳
联系人:张静
电话:021-68604866-8309
网址:www.bocichina.com.cn
(57)齐鲁证券有限公司
办公地址:山东省济南市经十路128号
法定代表人:李玮
联系人:傅咏梅
电话:0531-82024184、0531-82024147
传真:0531-82024197
网址:www.qlzq.com.cn
3.场内代销机构是指具有开放式基金代销资格,经上海证券交易所和本基金管理人认可的,可通过上海证券交易所场内"上证基金通"办理开放式基金的申购与赎回业务的会员单位,详见上海证券交易所网站(www.sse.com.cn)。

本基金管理人可以根据相关法律法规要求,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
注册地址:北京市西城区金融大街27号投资广场23层
办公地址:北京市西城区金融大街27号投资广场23层
法定代表人:陈耀先
电话:010-58598839
传真:010-58598907
联系人:朱立元

(三)律师事务所和经办律师

律师事务所名称:通力律师事务所
注册地址:上海市浦东南路528号上海证券大厦南塔21楼
办公地址:上海市浦东南路528号上海证券大厦南塔21楼
经办律师:秦悦民、傅轶
电话:021-68818100
传真:021-68816880

(四)会计师事务所和经办注册会计师

公司名称:安永华明会计师事务所
注册地址:北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层
办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层
法定代表人:葛明
经办注册会计师:张小东、樊淑华
电话:010-58153000
传真:010-85188298
联系人:徐丶施

四、基金的名称

大成沪深300指数证券投资基金

五、基金类别

股票型指数基金

六、基金的运作方式

契约型开放式

七、基金的投资目标

通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,实现指数投资偏离度和跟踪误差的最小化。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0.35%,年跟踪误差不超过4%。

八、基金的投资范围

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具,包括沪深300指数成份股、备选成份股、新股(如一级市场初次发行或增发)等,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金财产净值的5%。本基金还可以投资于法律法规及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。待金融衍生产品推出后,本基金可以依照法律法规或监管机构的规定运用金融衍生产品进行风险管理。

本基金跟踪标的指数的投资组合资产原则上不低于基金财产净值的90%。除非法律法规另有规定,本基金的股票投资比例可以提高到基金财产净值的100%。

九、基金的投资策略

本基金采用被动式指数投资策略。原则上,股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合、复制标的指数,并原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因其他特殊情况(如股权分置改革等)导致流动性不足时,或因其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,并辅之以金融衍生产品投资管理等,最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。

1.决策依据

(1)有关法律、法规、基金合同和标的指数等的相关规定;

(2)经济运行态势和证券市场走势。

2.投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理团队制。投资决策委员会负责制定基金投资方面的整体投资计划与投资原则;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;基金经理根据投资决策委员会的决策,负责投资组合的构建、调整和日常管理等工作。

3.投资程序

(1)金融工程部运用风险监测模型以及各种风险监控指标,结合公司内外研究报告,对市场预期风险和指数化投资组合风险进行风险测算与预期分析,依此提出研究分析报告。

(2)投资决策委员会依据金融工程部等部门提供的研究报告,定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议,决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议,进行基金投资管理的日常决策。

(3)根据标的指数、金融工程部研究报告、基金经理原则上依据指数成份股的权重构建组合。在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下,基金经理将采取适当的方法,以降低交易成本、控制投资风险。

(4)交易管理部根据基金经理下达的交易指令制定交易策略,完成具体证券品种的交易。

(5)金融工程部等部门根据市场变化定期和不定期对基金进行投资绩效评估,并提供相关绩效评估报告。监察稽核部对投资计划的执行进行日常监督和实时风险控制。

(6)基金经理跟踪标的指数变动,结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况、金融工程部和监察稽核部的绩效评估报告和对各种风险的监控和评估结果,对投资组合进行监控和调整,密切跟踪标的指数。

(7)本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市场环境变化和实际需要调整上述投资程序,并予以公告。

4.金融衍生产品投资管理

本基金若投资金融衍生产品,则其目的主要包括:对冲某些成份股的特殊突发风险和某些特殊情况下的流动性风险,以及适当利用金融衍生产品组合的持有收益覆盖一定的基金固定费用,最终使得基金收益率尽可能地贴近所跟踪标的指数的收益率。

本基金投资金融衍生产品的投资策略主要包括:主要采用市场公认的多种期权定价模型对权证进行定价,作为权证投资的价值基准;根据权证对应公司基本面的研究估值,结合权证理论价值进行权证的趋势投资;利用权证衍生工具的特性,基金通过权证与证券的组合投资,达到改善组合风险收益特征的