大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金更新招募说明书摘要

(2013年第1期)

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

重 要 提 示

大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金经中国证监会2010年10月27日证监许可【2010】1478号文核准募集,本基金的基金合同已于2010年12月21日正式生效。本基金为深证成长40交易型开放式指数证券投资基金的联接基金,将绝大部分基金财产投资于深证成长40交易型开放式指数证券投资基金,实现对标的指数的紧密跟踪,追求跟踪偏离度及跟踪误差最小化,并采用交易型开放式基金的运作方式。

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核准,但中国证监会对本基金募集的核准,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。

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。

投资有风险,投资者申购本基金时应认真阅读本更新的招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本基金为深证成长40交易型开放式指数证券投资基金的联接基金,二者既有联系也有区别:(1)在基金的投资方法方面,深证成长40交易型开放式指数证券投资基金主要采取完全复制法,直接投资于标的指数的成份股;而本基金则采取间接的方法,通过将绝大部分基金财产投资于深证成长40交易型开放式指数证券投资基金,实现对标的指数的紧密跟踪。(2)在交易方式方面,投资者既可以像股票一样在交易所市场买卖深证成长40交易型开放式指数证券投资基金,也可以按照最小申赎单位和申购赎回清单的要求,以实物形式申赎深证成长40交易型开放式指数证券投资基金;而本基金则像普通的开放式基金一样,通过基金管理人及代销机构按未知价法进行基金的申购与赎回。本基金与深证成长40交易型开放式指数证券投资基金业绩表现可能出现差异。可能引发差异的因素主要包括:(1)法规对投资比例的要求。深证成长40交易型开放式指数证券投资基金可将全部或接近全部的基金资产,用于跟踪标的指数的表现;而本基金作为普通的开放式基金,仍需将不低于基金资产净值5%的资产投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券。(2)申购赎回的影响。深证成长40交易型开放式指数证券投资基金采取实物申赎的方式,申购赎回对基金净值影响较小;而本基金申赎采取现金方式,投资者申购赎回行为对基金净值产生的影响相对较大。

本更新招募说明书已经本基金托管人复核。本更新招募说明书所载内容截止日为2013年6月21日(其中人员变动内容的更新以公告日期为准),有关基金投资组合、基金净值表现及财务数据截止日为2013年4月31日(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%)四家公司。
法定代表人:张树忠
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,下设二十个部门,分别是股票投资部、数量投资部、社保基金及机构投资部、固定收益部、委托投资部、研究部、交易管理部、产品开发与金融工程部、信息技术部、客户服务部、市场部、总经理办公室、董事会办公室、人力资源部、计划财务部、行政部、基金运营部、监察稽核部、风险管理部和国际业务部。公司在北京、上海、西安、成都、武汉、福州、沈阳、广州和南京等地设立了九家分公司,并在香港设立了子公司。此外,公司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等专业委员会。

公司以"责任、回报、专业、进取"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2013年6月21日,本基金管理人共管理2只封闭式证券投资基金:景宏证券投资基金、景福证券投资基金,3只ETF及2只ETF联接基金:大成中证100交易型开放式指数证券投资基金,深证成长40交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金及大成中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金,1只创新型基金:大成景丰分级债券型证券投资基金,1只QDII基金:大成标普500等权重指数证券投资基金及28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、大成蓝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、大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)、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、大成策略回报股票型证券投资基金、大成行业轮动股票型证券投资基金、大成中证红利指数证券投资基金、大成核心双动力股票型证券投资基金、大成保本混合型证券投资基金、大成景恒保本混合型证券投资基金、大成内需增长股票型证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金、大成中证内地消费主题指数证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、大成优选股票型证券投资基金(LOF)、大成月添利理财债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场证券投资基金、大成理财21天债券型发起式证券投资基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、大成景安短融债券型证券投资基金和大成景兴信用债债券型证券投资基金。

(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,任光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1月,任大通证券股份有限公司总经理;2008年1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月起兼任大成基金管理有限公司董事长。

王颢先生,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。

刘虹先生,董事,博士,高级经济师。1985年7月-1998年11月,任国家计委国土局主任科员、副处长(主持工作);1998年11月-2000年9月,任中国农业发展银行资金计划部计划处副处长(主持工作);2000年9月-2004年9月,任中国人寿保险(集团)公司战略规划部战略研究与规划处处长;2004年9月-2006年2月,任中国人寿保险(集团)公司战略规划部副总经理;2006年2月-2007年6月,任中国人寿保险股份有限公司发展改革部副总经理;2007年6月-2007年8月, 任中国人保集团公司高级专家;2007年8月至今,任人保投资控股有限公司总裁、党委书记;2009年11月起,兼任中国华闻投资控股有限公司总裁、党委书记以及中泰信托有限责任公司董事长。

杨赤忠先生,董事,硕士。历任深圳蓝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、基金经理;光大证券投资部总经理、研究所所长;光大保德信基金公司董事。现任光大证券党委委员、助理总裁。

孙学林先生,董事,博士研究生在读,中国注册会计师,注册资产评估师。1997年5月-2000年4月,任职于中国长城信托投资公司;2000年4月-2007年2月,任职于中国银河证券有限公司审计与合规管理部;现任中国银河投资管理有限公司资产管理部总经理。

刘大为先生,独立董事,国家开发银行顾问,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。

宣伟华女士,独立董事,日本国立神户大学法学院法学修士,中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员、上海仲裁委员会仲裁员,曾任上海市律师协会证券与期货法律研究委员会副主任。1986年-1993年,华东政法大学任教;1993年-1994年,日本神户学院大学法学部访问学者;1994年-1998年, 日本国立神户大学学习;1999年-2000年,锦天城律师事务所兼职律师、北京市中伦金通律师事务所上海分所负责人;2001年始任国浩律师(上海)事务所合伙人。擅长于公司法、证券法、基金法、外商投资企业法、知识产权法等相关的法律事务。曾代理过中国证券市场第一例上市公司虚假陈述民事索赔共同诉讼案件,被CCTV? 证券频道评为"五年风云人物",并获得过"上海市优秀女律师"称号。

叶永刚先生,独立董事,经济学博士,武汉大学经济与管理学院教授、副院长、博士生导师,中国金融学会理事,中国金融学会金融工程研究会常务理事,中国金融学年会常务理事,湖北省政府咨询委员。1983-1988年,任武汉大学管理学院助教;1989-1994年,任武汉大学管理学院讲师;1994-1997年,任武汉大学管理学院副教授;1997年至今,任武汉大学教授,先后担任副系主任、系主任、副院长等行政职务。

王江先生,独立董事,金融学博士。2005年至今任职美国麻省理工学院斯隆管理学院瑞穗金融集团教授。2007年-2010年,兼任美国金融学会理事;2010年至今兼任美国西部金融学会理事;1997年至今兼任美国国家经济研究局研究员;2007年至今兼任纳斯达克公司经济顾问理事会理事;2009年至今兼任上海交通大学上海高级金融学院院长;2003年至今兼任清华大学中国金融研究中心主任。

监事会:

黄建农先生,监事长,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。

谢红兵先生,监事,双学士学位。1968年入伍,历任营教导员、军直属政治处主任;1992年转业,历任交通银行上海分行杨浦支行副行长(主持工作),营业处处长兼房地产信贷部经理,静安支行行长,杨浦支行行长;1998年调总行负责筹建基金托管部,任交通银行基金托管部副总经理(主持工作)、总经理;2005年负责筹建银行试点基金公司,任交银施罗德基金公司董事长;2008年任中国交银保险公司(香港)副董事长。2010年退休。

吴朝雷女士,监事,硕士学位。1988年9月-1990年12月任浙江省永嘉县岭口乡人民政府妇联主任、团委书记;1991年10月-1998年2月任浙江省温州市鹿城区人民政府民政科长;1998年3月-2001年6月, 任浙江省温州市人民检察院起诉处助理检察员;2001年6月-2007年8月, 就职于北京市宣武区人民检察院, 任三级检察官;2007年8月起任民生人寿北京公司人事部经理。2007年11月-2009年12月,任中国人民人寿保险股份有限公司人力资源部副总经理;2010年1月加入大成基金管理有限公司,任纪委副书记、大成慈善基金会常务副秘书长。

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1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。2009年7月13日起兼任大成国际资产管理有限公司董事。

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。2009年3月19日起兼任大成国际资产管理有限公司董事。

杨春明先生,副总经理,经济学学士。曾先后任职于长春税务学院、吉林省国际信托投资公司、招商证券股份有限公司。2005年6月加入大成基金管理有限公司,历任基金运营部总监、市场部总监、公司助理总经理。2009年7月13日起任大成国际资产管理有限公司董事。2010年11月起任大成基金管理有限公司副总经理。

肖冰先生,副总经理,工商管理硕士。曾任联合证券有限责任公司国际业务部总经理助理、鹏华基金管理有限公司市场部总监、泰达宏利基金管理有限公司市场部总监、景顺长城基金管理有限公司营销主管。2004年3月加入大成基金管理有限公司,历任市场部总监、综合管理部总监、公司董事会秘书。2009年7月13日起任大成国际资产管理有限公司董事。2010年11月起任大成基金管理有限公司副总经理兼董事会秘书。

2、基金经理

(1)现任基金经理

苏秉毅先生,基金经理,经济学硕士。2004年9月至2008年5月就职于华夏基金管理有限公司基金运作部。2008年加入大成基金管理有限公司,历任产品设计师、高级产品设计师、基金经理助理、基金经理。2011年3月3日至2012年2月8日担任深证成长40交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理。2012年2月9日起担任深证成长40交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2012年8月24日起任中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2012年8月28日起任大成中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2013年1月1日开始兼任大成沪深300指数证券投资基金基金经理。2013年2月7日起任大成中证100交易型开放式指数证券投资基金基金经理。现同时担任大成基金管理有限公司数量投资部总监助理。具有基金从业资格。国籍:中国

(2)历任基金经理

姓名	任期起始日	任期结束日
何光明	2010年12月21日	2012年2月8日

3、公司投资决策委员会(股票投资)

公司投资决策委员会由9名成员组成,设投资决策委员会主席1名,其他委员8名。名单如下:

刘明,助理总经理,大成优选股票型证券投资基金(LOF)基金经理,股票投资决策委员会主席;曹雄飞,首席投资官,股票投资部总监,大成财富管理2020生命周期证券投资基金基金经理,大成行业轮动股票型证券投资基金基金经理,股票投资决策委员会委员;支兆华,研究部总监,股票投资决策委员会委员;汤义峰,数量投资部总监,大成优选股票型证券投资基金(LOF)基金经理,大成价值增长证券投资基金基金经理,股票投资决策委员会委员;于雷,交易管理部总监,股票投资决策委员会委员;蒋卫强,风险管理部执行总监,股票投资决策委员会委员;施永辉,股票投资部副总监,大成蓝筹稳健证券投资基金基金经理,股票投资决策委员会委员;孙蓓琳,大成核心双动力股票型证券投资基金基金经理,大成积极成长股票型证券投资基金基金经理,股票投资决策委员会委员;朱文辉,大成保本混合型证券投资基金基金经理,大成可转债增强债券基金基金经理,大成景恒保本混合型证券投资基金基金经理,股票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)基金托管人基本情况

1、基本情况

名称:中国农业银行股份有限公司(以下简称"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9层
法定代表人:蒋超良
成立时间:2009年1月15日
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:010-68424199
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。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,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"。

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。

2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工146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

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161只,包括富国天源平衡混合型证券投资基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、大成积极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、大成创新成长混合型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、裕阳证券投资基金、汉盛证券投资基金、裕隆证券投资基金、景福证券投资基金、鸿阳证券投资基金、丰和价值证券投资基金、久嘉证券投资基金、长盛成长价值证券投资基金、宝盈鸿利收益证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、银河稳健证券投资基金、银河收益证券投资基金、长盛中信全债指数增强型债券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长盛动态精选证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、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证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、鹏华货币市场证券投资基金、中海分红增利混合型证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、新华优选分红混合型证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、信诚四季红混合型证券投资基金、富国天时货币市场基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、益民货币市场基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心优选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、交银施罗德成长股票证券投资基金、长盛中证100指数证券投资基金、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、大成核心双动力股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、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、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、金元惠理成长动力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、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、金元惠理丰利债券型证券投资基金、交银施罗德先锋股票证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)、大成行业轮动股票型证券投资基金、交银施罗德上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金、富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金、南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金、东吴货币市场证券投资基金、博时创业成长股票型证券投资基金、招商信用添利债券型证券投资基金、易方达消费行业股票型证券投资基金、富国汇利分级债券型证券投资基金、大成景丰分级债券型证券投资基金、兴全沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国可转换债券证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金、泰达宏利领先中小盘股票型证券投资基金、交银施罗德信用添利债券证券投资基金、东吴中证新兴产业指数证券投资基金、工银瑞信四季收益债券型证券投资基金、招商安瑞进取债券型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业股票型证券投资基金、易方达黄金主题证券投资基金(LOF)、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金、嘉实领先成长股票型证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、南方保本混合型证券投资基金、交银施罗德先进制造股票证券投资基金、上投摩根新兴动力股票型证券投资基金、富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金、金元惠理保本混合型证券投资基金、招商安达保本混合型证券投资基金、交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金、南方中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF)、交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)、长信内需成长股票型证券投资基金、大成中证内地消费主题指数证券投资基金、中海消费主题精选股票型证券投资基金、长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金、景顺长城核心竞争力股票型证券投资基金、汇添富信用债债券型证券投资基金、光大保德信行业轮动股票型证券投资基金、富兰克林国海亚洲(除日本)机会股票型证券投资基金、汇添富逆向投资股票型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、申万菱信中小板指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、鹏华金刚保本混合型证券投资基金、汇添富理财14天债券型证券投资基金、嘉实全球房地产证券投资基金、金元惠理新经济主题股票型证券投资基金、东吴保本混合型证券投资基金、建新社会责任股票型证券投资基金、嘉实理财宝7天债券型证券投资基金、富兰克林国海恒久信用债券型证券投资基金、大成月添利理财债券型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、富国7天理财宝债券型证券投资基金、交银施罗德理财21天债券型证券投资基金、易方达中债新综合指数发起式证券投资基金(LOF)、工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场基金、景顺长城支柱产业股票型证券投资基金、易方达月月利理财债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫量化配置股票型证券投资基金、东方央视财经50指数增强型证券投资基金、交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金、鹏华理财21天债券型证券投资基金、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、万家14天理财债券型证券投资基金、华安纯债债券型发起式证券投资基金、金元惠理惠利保本混合型证券投资基金、南方中证500交易型开放式指数证券投资基金、招商双债增强分级债券型证券投资基金、景顺长城品质投资股票型证券投资基金、中海可转换债券债券型证券投资基金、融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、富兰克林国海焦点驱动灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城沪深300等权重交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、大成景安短融债券型证券投资基金、嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金。

三、相关服务机构

(一)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:张树忠
电话:0755-83183388
传真:0755-83199588
联系人:王肇栋
公司网址:www.dcfund.com.cn
大成基金客户服务热线: 400-888-5558(免长途固话费)

大成基金管理有限公司现分别在深圳、北京、上海设有投资理财中心,并在武汉分公司开通了直销业务:

(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:瞿宗怡
电话:0755-83195236
传真:0755-83195229/39

(2)大成基金北京投资理财中心
地址:北京市东城区东直门南大街5号中青旅大厦105-106室
联系人:戴晓燕
电话:010-85252345/46、010-58156152/53
传真:010-58156315/23

(3)大成基金上海投资理财中心
地址:上海市浦东新区陆家嘴东路161号101室
联系人:徐黔
电话:021-62185377/62185277/63513925/62173331
传真:021-63513928/62185233

(4)大成基金管理有限公司武汉分公司
地址:湖北省武汉市新华路218号浦发银行大厦15楼
联系人:肖利霞
联系电话:027-85552889
传真:027-85552860

(二)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:蒋超良
客服电话:95599
电话:010-85109219
传真:010-85109219
网址:www.abchina.com

(2)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号院1号楼长安兴融中心1号楼
法定代表人:王洪章
联系人:王琳
电话:010-67596084
传真:010-66275654
客服电话:95533
网址:www.ccb.com

(3)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
联系人:王娟
电话:010-66594909
传真:010-66594942
网址:www.boc.cn

(4)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:姜建清
客服电话:95588
电话:010-66107900
传真:010-66107914
网址:www.icbc.com.cn

(5)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:021-58408483
网址:www.bankcomm.com

(6)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:傅育宁
客服电话:95555
联系人:邓炯鹏
电话:0755-83077278
传真:0755-83195049
网址:www.cmbchina.com

(7)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:李伟
电话:010-68098778
传真:010-68560312
网址:www.cebbank.com

(8)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:胡平西
客服电话:021-962999
电话:021-38576985
传真:021-50105124
联系人:周睿
网址:www.shrcb.com

(9)北京农村商业银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区阜成门内大街410号
法定代表人:乔瑞
联系人:刘雨喻
联系电话:010-63229482
传真:010-66506163
客服电话:96198
网址:www.bjrcb.com

(10)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:倪苏云
客服热线:95528
电话:021-61618888
传真:021-63604199
网址:www.spdb.com.cn

(11)温州银行股份有限公司
注册地址:温州市车站大道华海广场1号楼
办公地址:温州市车站大道196号
法定代表人:邢增福
联系人:林波
电话:0577-88990082
传真:0577-88995217
客户服务热线:96699,浙江省外0577-96699
网址: www.wzbank.cn

(12)浙商银行股份有限公司
注册地址:杭州市庆春路288号(办公地址同注册地址)
法定代表人:张达洋
联系人:吴强
客户服务热线:95105665
电话:0571-87659167
传真:0571-87659188
网址:www.czbank.com

(13)洛阳银行股份有限公司
注册地址:洛阳市洛龙区开元大道256号
办公地址:洛阳市洛龙区开元大道256号
客服电话:0379-96699
法定代表人:王建甫
联系人:胡艳丽
电话:0379-65921977
传真:0379-65921851
网址:www.bankofluoyang.com.cn

(14)深圳农村商业银行股份有限公司
注册地址:深圳市深南东路3038号合作金融大厦
法定代表人:李伟
电话:0755-25188371 0755-25188611
传真:0755-25188785
联系人:曾明 宋永成
客户服务电话: 961200
网址:www.961200.net

(15)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
法定代表人:万建华
客服电话:95521
联系人:芮敏祺
电话:021-38676666
传真:021-38670161
网址:www.gtja.com

(16)中信建投股份有限公司
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

(17)国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦六层
法定代表人:何如
客服电话:95536
联系人:齐晓燕
电话:0755-82130833
传真:0755-82133952
网址: www.guosen.com.cn

(18)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: 95565
联系人:林生迎
电话:0755-82960223
传真:0755-82943636
网址:www.newone.com.cn

(19)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
客户服务电话:4006000686
联系人:潘锴
电话:0431-85096709
网址:www.nesc.cn

(20)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:陈有安
客服电话:4008-888-888
联系人:田薇
联系电话:010-66568430
传真:010-66568990
网址:www.chinastock.com.cn

(21)申银万国证券股份有限公司
通讯地址:上海市常熟路171号
法定代表人:丁国荣
客服电话:021-962505
联系人:黄维琳、曹晔
电话:021-54033888
传真:021-54038844
网址:www.sywg.com

(22)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、李笑鸣
电话:021-23219000
传真:021-63602722
网址:www.htsec.com

(23)中信证券股份有限公司
注册地址:深圳市深南路7088号招商银行大厦
法定代表人:王东明
客服电话:010-84588888
联系人:陈忠
电话:010-84588888
传真:010-84865560
网址:www.cs.ecitic.com

(24)安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
法定代表人:牛冠兴
客服电话:4008 001 001
联系人:陈剑虹
电话:0755-82825551
传真:0755-82558355
网址:www.essence.com.cn

(25)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、95525
联系人:刘晨、李芳芳
电话:021-22169081
传真:021-22169134
网址:www.ebscn.com

(26)中信万通证券有限责任公司
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:张智河
客服电话:0532-96577
联系人:吴忠超
电话:0532-85022326
传真:0532-85022605
网址:www.zxwt.com.cn

(27)东海证券有限责任公司
注册地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
办公地址:上海市东方路1928号东海证券大厦
法定代表人:朱科敏
客服电话:95531
免费服务热线:95531
联系人:汪汇
电话:021-20333333
传真:021-50498825
网址:www.longone.com.cn

(28)中信证券(浙江)有限责任公司
注册地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
法定代表人:沈强
客服电话:95548
联系人:王霈霈
电话:0571-87112507
传真:0571-85783771
网址:www.bigsun.com.cn

(29)广州证券有限责任公司
注册地址:广州市先烈中路69号东山广场主楼十七楼
法定代表人:刘东
客服电话:961303
联系人:林洁茹
联系电话:020-87322668
传真:020-87325036
网址:www.gzs.com.cn

(30)平安证券有限责任公司
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:杨宇翔
客服电话:95511转8
联系人:郑舒丽
电话:0755-22626391
传真:0755-82400862
网址:www.pingan.com

(31)华泰证券股份有限公司
注册地址: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:舒萌菲
电话:025-84457777
传真:025-84579763
网址:www.htsc.com.cn

(32)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
法定代表人:凤良志
客服电话:400-888-8777、95578
联系人:李蔡
电话:0551-2207114
传真:0551-2207965
网址:www.gyzq.com.cn

(33)上海证券有限责任公司
注册地址:上海市西藏中路336号
法定代表人:龚德雄
客服电话:021-962518,4008918918
联系人:张瑾
电话:021-53519888
传真:021-63608830
网址:www.962518.com

(34)兴业证券股份有限公司
注册地址:福州市湖东路268号
法定代表人:兰荣
客户服务电话:95562
联系人:黄英
电话:0591-38162212
传真:0591-38507538
网址:www.xyzq.com.cn

(35)浙商证券股份有限公司
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:谢项辉
电话:0571-87901053
客服电话:967777
网址:www.stocke.com.cn

(36)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:杜庆平
联系人:王兆权
电话:022-28451861
传真:022-28451892
客服电话:4006515988
网址:www.bhzq.com

(37)方正证券股份有限公司
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
法定代表人:雷杰
客服电话:95571
联系人:邵艳霞
电话:010-57398063
传真:010-57398058
网址:www.foundersc.com

(38)东莞证券有限责任公司
注册地址:东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼
法定代表人:张运勇
客服电话:0769-961130
联系人:梁健伟
电话:0769-22119341
传真:0769-22116999
网址:www.dgzq.com.cn

(39)宏源证券股份有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐市文艺路233号
办公地址:北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人:冯戎
客户服务电话:4008000562
联系人:李巍
电话:010-88085858
传真:010-88085195
网址:www.hysec.com

(40)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
客户服务热线:0755-33680000、400-6666-888
联系人:高峰
电话:0755-83516094
传真:0755-83516199
网址:www.cgws.com

(41)国都证券有限责任公司
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
客户服务电话:400-818-8118
联系人:黄静
电话:010-84183333
传真:010-84183311-3389
网址:www.guodu.com

(42)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39层
法定代表人:唐新宇
客户服务电话:4006208888
联系人:张静
电话:021-68604866-8309
传真:021-50372474
网址:www.bocichina.com.cn

(43)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

(44)江海证券有限公司
办公地址:哈尔滨市香坊区赣水路56号
法人代表:孙名扬
电话:0451-82336863
客服热线:4006662288
联系人:徐世旺
网址:www.jhzq.com.cn

(45)长江证券股份有限公司
注册地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人:胡运钊
客户服务热线:95579、4008-888-999
联系人:李良
电话:027-65799999
传真:027-85481900
网址:www.95579.com

(46)国金证券股份有限公司
注册地址:成都市东城根上街95号
法定代表人:冉云
客户服务电话:4006600109
联系人:刘一宏
电话:028-86690070
传真:028-86690126
网址:www.gjzq.com.cn

(47)中航证券有限公司
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:杜航
客服电话:4008866567
联系人:余雅娜
电话:0791-6768763
传真:0791-6789414
网址:www.scstock.com

(48)爱建证券有限责任公司
地址:上海市南京西路758号23楼
法定代表人:郭林
客服电话:021-63340678
联系人:陈敏
电话:021-32229888
传真:021-62878783
网址:www.ajzq.com

(49)国联证券股份有限公司
注册地址:江苏省无锡市县前东街168号
法定代表人:雷建辉
客服电话:4008885288
联系人:徐欣
电话:0510-82831662
传真:0510-82830162
网址:www.glsc.com.cn

(50)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
客户服务电话:4008008899
联系人:唐静
联系电话:010-63081000
传真:010-63080978
公司网址:www.cindasc.com

(51)华宝证券有限责任公司
地址:上海市浦东新区环球金融中心57楼
法定代表人:陈林
客户服务电话:400-820-9898
联系人:汪明丽
电话:021-68778075
传真:021-68868117
网址:www.cnhbstock.com

(52)广发证券股份有限公司
注册地址:广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)
办公地址: 广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼
法定代表人:孙树明
客服电话:95575联系人:黄岚
电话:020-87555888
传真:020-87555305
网址:www.gf.com.cn

(53)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:卢长才
客服电话:0755-83199599
联系人:张婷
电话:0755-83199511
传真:0755-83199545
网址:www.csco.com.cn

(54)中国中投证券有限责任公司
注册地址: 深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元?
办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层?
法定代表人:龙增来
联系人:刘毅
客户电话:400 600 8008
电话:0755-82023442
传真:0755-82026539
网址:www.china-invs.cn

(55)齐鲁证券有限公司
办公地址:山东省济南市经十路20518号
法定代表人:李玮
客户服务电话:95538
联系人:吴阳
电话:0531-81283938
传真:0531-81283900
网址:www.qlzq.com.cn

(56)日信证券有限责任公司
注册地址:呼和浩特市新城区锡林南路18号
法定代表人:孔佑杰
联系电话:010-88086830
联系人:陈韦杉
传真:010-66412537
网址:www.rxzq.com.cn

(57)财富证券有限责任公司
办公地址:湖南长沙芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26层
法人代表:周晖
客户服务热线:0731-84403319
联系人:胡智
电话:0731-84779521
传真:0731-84403439
网址:www.cfzq.com

(58)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:张腾
电话:0591-87278701/
传真:0591-87841150
网址:www.gfhfzq.com.cn

(59)中原证券股份有限公司
地址:郑州市郑东新区商务外环路10号
法定代表人:菅明军
客服电话:0371-967218、4008139666
联系人:程月艳、耿铭
联系电话:0371-65585670
联系传真:0371-65585665
网址:www.ccnew.com

(60)西南证券股份有限公司
地址:重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦A幢
法定代表人:王珠林
客服电话:4008096096
联系人:徐雅筠、杨再巧
网址:www.swsc.com.cn

(61)红塔证券股份有限公司
注册地址: 云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦7-11楼
办公地址: 云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
法人: 况雨林
联系人:高国泽
联系电话:0871-3577398
传真: 0871-3578827
客服电话:0871-3577942
公司网址:www.hongtastock.com

(62)天源证券经纪有限公司
注册地址:青海省西宁市长江路53号汇通大厦六楼
办公地址:深圳市福田区民田路新华保险大厦18楼
法定代表人:林小明
电话:0755-33331188
传真:0755-33329815
统一客服电话:4006543218
公司网站地址:www.tyzq.com.cn

(63)国盛证券有限责任公司
注册地址:江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦
办公地址:江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦4楼
法定代表人:曾小普
联系人:徐美云
电话:0791-6285337
传真:0791-6282293
网址:www.gsstock.com

(64)华鑫证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元
办公地址:上海市肇嘉浜路750号
法定代表人:洪家新
联系人:陈敏
网站:www.cfsc.com.cn
客户服务电话:021-32109999;029-68918888;4001099918

(65)深圳众禄基金销售有限公司
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
客服电话:4006-788-887
联系人:童彩平
电话:0755-33227950?
传真:0755-82080798?
网址:www.zlfund.cn

(二)注册登记机构
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33层
法定代表人:张树忠
电话:0755-83183388
传真:0755-83195239
联系人:范瑛

(三)律师事务所和经办律师
名称:北京市金杜律师事务所
住所: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
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦3楼
法定代表人:杨绍信
经办注册会计师:薛竞、刘颖
电话:021-23238888
传真:021-23238800
联系人:刘颖

四、基金的名称

大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金

五、基金的类型

基金类型:契约型

六、基金的运作方式

基金运作方式:开放式

七、基金的投资目标

通过投资于目标ETF,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

八、基金的投资范围

本基金以目标ETF基金份额、标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象。正常情况下投资于目标ETF基金份额的投资组合资产不低于基金资产净值的90%,持有现金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%。

为更好地实现投资目标,本基金还可投资于新股、债券、回购、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。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。

九、基金的投资策略

本基金以深证成长40ETF作为其主要投资标的,方便特定的客户群通过本基金投资深证成长40ETF。本基金并不参与深证成长40ETF的管理。

本基金主要以一级市场申购的方式投资于目标ETF,获取基金份额净值上涨带来的收益;在目标ETF基金份额二级市场交易流动性较好的情况下,也可以通过二级市场买卖目标ETF的基金份额。

1、决策依据

有关法律法规、基金合同和标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。

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;基金经理负责决定日常指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策。

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:金融工程部依托公司整体研究平台,整合内部信息以及券商等外部研究力量的研究成果开展目标ETF申购赎回清单分析、目标ETF流动性分析、标的指数成份证券相关信息的搜集与分析,作为基金投资决策的重要依据。

(2)投资决策:投资决策委员会依据金融工程部提供的研究报告,定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议,决策相关事项。基金经理根据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)交易执行:交易管理部负责具体的交易执行,同时履行一线监控的职责。

(4)投资绩效评估:金融工程部定期和不定期对基金进行投资绩效评估,并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合跟踪误差的来源及投资策略成功与否,基金经理可以据此检讨投资策略,进而调整投资组合。

(5)组合监控与调整:基金经理将跟踪目标ETF申购赎回清单特征、二级市场交易特征、标的指数变动情况,并结合成份股基本面情况、成份股公司行为、流动性状况、本基金申购和赎回的现金流量以及组合投资绩效评估的结果等,对投资组合进行持续的监控和调整,以实现本基金的投资目标。

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。

十、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为深证成长40价格指数×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

十一、基金的风险收益特征

本基金属股票基金,预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,紧密跟踪标的指数,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。

十二、基金的投资组合报告(截至2013年3月31日)

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2013年7月18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截至2013年3月31日,本报告中所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	45,373,548.59	3.10
	其中:股票	45,373,548.59	3.10
2	基金投资	1,341,023,500.00	91.53
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
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	银行存款和结算备付金合计	78,509,689.70	5.36
7	其他资产	224,536.81	0.02
8	合计	1,465,131,275.10	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	0.00
B	采矿业	4,307,746.50	0.29
C	制造业	36,505,980.29	2.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	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
H	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	1,530,408.00	0.10
L	租赁和商务服务业	994,370.00	0.07
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	2,035,043.80	0.14
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	-	0.00
	合计	45,373,548.59	3.10

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明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000651	格力电器	195,284	5,579,263.88	0.38
2	000157	中联重科	659,144	5,299,517.76	0.36
3	002155	辰州矿业	251,915	4,307,746.50	0.29
4	000858	五 粮 液	165,200	3,690,568.00	0.25
5	000527	美的电器	360,000	3,675,600.00	0.25
6	000568	泸州老窖	132,579	3,380,764.50	0.23
7	002304	洋河股份	50,918	3,175,755.66	0.22
8	002241	歌尔声学	50,999	2,570,349.60	0.18
9	000970	中科三环	81,559	2,256,737.53	0.15
10	000826	桑德环境	71,380	2,035,043.80	0.14

4、报告期末按券种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

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。

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8、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

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	大成深证成长40ETF	股票型	交易型开放式(ETF)	大成基金管理有限公司	1,341,023,500.00	91.62

9、投资组合报告附注

(1)本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本期被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(2)本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

(3)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	86,674.07
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,189.77
5	应收申购款	121,672.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	224,536.81

(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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000527	美的电器	3,675,600.00	0.25	重大事项停牌,于2013年4月1日复牌。

(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。

十三、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。

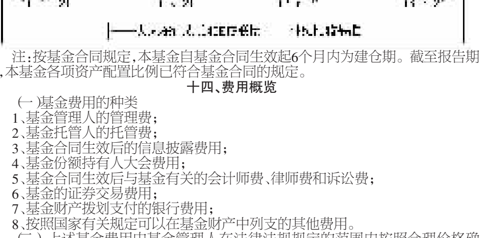
(一)自基金合同生效日(为2010年12月21日),至2013年3月31日基金合同生效以来完整会计年度的基金份额净值增长率投资业绩以及与同期业绩比较基准收益率的比较:

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
2010.12.21-2010.12.31	0.40%	0.31%	-0.77%	1.45%	1.17%	-1.14%
2011.01.01-2011.12.31	-25.70%	1.06%	-27.51%	1.22%	1.81%	-0.16%
2012.01.01-2012.12.31	0.67%	1.23%	0.06%	1.25%	0.61%	-0.02%
2013.01.01-2013.03.31	0.00%	1.29%	-0.20%	1.24%	0.20%	0.05%
2010.12.21-2013.03.31	-24.90%	1.16%	-28.18%	1.24%	3.28%	-0.08%

(二)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收益率变动的比较:

大成深证成长40ETF联接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

(2010年12月21日至2013年3月31日)



注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期。截至报告期末,本基金各项资产配置比例已符合基金合同的规定。

十四、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、基金合同生效后的信息披露费用;
4、基金份额持有人大会费用;
5、基金合同生效后与基金有关的会计师费、律师费和诉讼费;
6、基金的证券交易费用;
7、基金财产拨划支付的银行费用;
8、按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内按照合理价格确定,法律法规和基金合同另有规定时从其规定。

(三)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

本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费。在通常情况下,按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标ETF份额所对应资产后剩余部分(若为负数,则取0)的0.5%年费率计提基金管理费。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为前一日基金资产净值扣除基金财产中目标ETF份额所对应资产后的剩余部分,若为负数,则E取0

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起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、休息日,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取托管费。在通常情况下,按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标ETF份额所对应资产后剩余部分(若为负数,则取0)的0.1%年费率计提基金托管费。计算方法如下:

H=E×0.1%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值扣除基金财产中目标ETF份额所对应资产后的剩余部分,若为负数,则E取0

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

3、上述(一)中3到8项费用由基金托管人根据其他有关法律法规及相应协议的规定,按费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。

(四)不列入基金费用的项目

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,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付,基金收取认购费的,可以从认购费中列支。

(五)基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率,无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在至少一家指定媒体上刊登公告。

(六)基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定,履行纳税义务。

十五、对招募说明书更新部分的说明

本更新的招募说明书依据《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》、《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,对2013年2月6日公布的《大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金更新招募说明书(2012年第2期)》进行了更新,并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动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、根据最新资料,更新了"三、基金管理人"部分。
2、根据最新资料,更新了"四、基金托管人"部分。
3、根据最新资料,更新了"五、相关服务机构"部分。
4、根据最新数据,更新了"九、基金的投资"部分。更新了(十二)"基金投资组合报告"。
5、根据最新数据,更新了"十、基金的业绩"部分。
6、根据最新公告,增加了"二十一、其他应披露的事项"部分,披露了2012年12月22日至2013年6月21日的公告。
7、根据最新情况,更新了"二十二、对招募说明书更新部分的说明"。

大成基金管理有限公司
二〇一三年八月六日