（上接A30版）

2)确定建仓策略：基金经理根据对成份股的分析、成份股流动性的分析和跟踪误差情况等因素，利用数量化模型，确定合理的建仓策略；

3)逐步调整：通过不断的优化最终确定目标组合之后，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达到跟踪指数的要求。

3、股票投资组合的管理

基金管理人通过定期对成份股公司行为信息、标的指数变化、申购赎回情况、投资组合头寸和流动性、投资操作、跟踪误差以及标的指数的编制规则和调整公告等进行跟踪分析，利用数量化分析模型，制定并将投资组合调整到目标组合的优化方案，力求最大限度地降低跟踪误差，以实现基金的投资目标。

4、跟踪误差的计算和控制

在基金运作过程中，对指数基金的跟踪误差进行分析、计算和控制，基本思路如下：

(1)确定跟踪误差及其相关指标的控制目标值；

(2)计算跟踪误差及其相关指标的实际值：每周、月、季度、半年、年、或根据需要计算一定时间内的跟踪误差及其相关指标的具体指标值，如达到或超过预警阀值，将发出警戒信号，提示基金经理关注和调整；

(3)将跟踪误差及其相关指标的实际值与控制目标值进行比较，若符合条件，则维持组合；若不符合条件，则对投资组合进行调整。

5、股票投资组合的调整

(1)调整原则

本基金指数化投资组合原则上将根据标的指数成份股变化或其权重的变动进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发因素等变化，对基金投资组合进行调整，以保证基金净值增长率与基准指数收益率之间的高度正相关，寻求跟踪误差最小化。

(2)调整条件

当出现股票投资组合需要进行调整的事件或情形时，如在建仓期、或遇有特殊情况、或在一定时间内的跟踪误差或其相关指标超过相应的控制目标值时，或出现其他实际情况时，本基金将对股票投资组合进行调整。 特殊情况包括但不限于第（四）节第1条《股票投资策略》中所列示的情形。

(3)调整步骤

1)计算投资组合目标权重：使用多因素最优化模型，求解使跟踪误差最小化的投资组合，作为目标组合，用以替代个股或复制指数；

2) 计算投资组合实际权重与目标权重的差值，据此确定组合中买卖股票的品种、买卖方向，以及买卖比例或买卖数量；

3)根据确定的买卖品种、买卖方向、买卖比例或买卖数量，由基金经理发出交易指令，交易员执行交易指令，完成投资组合的调整。

(4)调整方法

1)定期调整

本基金将根据所跟踪的沪深300 价值指数对其成份股及其权重的定期调整方案，结合本基金投资组合的构造原则和权重，在考虑跟踪误差风险的基础上，对股票投资组合进行相应调整。

2)不定期调整

a.与指数相关的调整

当沪深300 价值指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时，本基金将根据沪深300 价值指数在股权变动公告日次日发布的临时调整决定及其需调整的权重比例，进行相应调整。

b.根据跟踪误差的情况调整

在实际投资中，本基金实行对跟踪误差的密切监控和预警。定期或根据需要计算基金组合跟踪误差及其相关指标，如达到或超过设定的预警阀值，将发出警戒信号，提示基金经理进行相应调整。

c.限制性调整

当投资组合中按基准权重投资的股票资产比例或个股比例超过法律法规或监管机构对基金投资比例规定限制时，本基金将对其进行实时的被动性卖出调整，并相应地对其他资产类别或个股进行微调，以保证基金合法规范运行。

d.大额赎回调整

当发生大额赎回超过最高现金保有比例5%时，本基金将对股票投资组合进行同比例的被动性卖出调整，以保证基金正常运行。

e.特殊情况的调整

对成份股中有按照法律法规规定不能进行买卖、或因重大事件导致停牌、或财务风险较大、或面临重大不利的司法诉讼等情况的股票，本基金将根据数学优化模型构造模拟组合来进行替代。

f.其他调整

本基金将参与一级市场新股认购，得到的非成份股将在其规定持有期之后的一定时间以内卖出。

6、债券投资策略

基于基金流动性管理和有效利用基金资产的需要，本基金将投资于到期日在一年以内的国债、央行票据等债券，所投资的债券的信用评级级别应在BBB以上（含BBB）。本基金将根据宏观经济形势、货币政策、证券市场变化等分析判断未来利率变化，结合债券定价技术，进行个券选择。

五、投资决策依据和决策程序

1、投资决策依据

(1)有关法律法规、基金合同的相关规定；

(2)标的指数的编制规则和调整方案；

(3)经济发展状况和证券市场发展态势。

2、投资决策程序

(1)研究与分析

本基金管理人内设研究部和数量分析小组，将定期或不定期地开展指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、成份股流动性分析、跟踪误差及其相关指标的计算监控和分析等工作，并结合市场部门提供的申购赎回数据，进行投资组合的流动性分析，提供分析报告，供基金经理参考。

(2)投资组合的构建和日常管理

投资决策委员会在基金合同规定的投资框架下，定期或遇重大事项时召开投资决策会议，对基金的操作进行指导，确定基金资产配置方案，并审批重大单项投资决定。

基金经理在投资决策委员会的授权下，参考研究部和数量分析小组提供的分析报告，制定基金的投资策略。在追求跟踪误差最小化的前提下，在其权限范围内进行基金的日常投资组合管理工作。

(3)交易

基金经理制定具体的操作计划并通过交易系统或书面指令形式向中央交易室发出交易指令。中央交易室依据投资指令具体执行买卖操作，并将指令的执行情况反馈给基金经理。

(4)组合监控与调整

基金经理负责向投资决策委员会汇报基金投资执行情况。监察部对基金投资进行日常监督。研究部和数量分析小组定期对基金投资进行绩效评估和风险分析，并通过监察部呈报给合规审查与风险控制委员会及督察长办公室、投资决策委员会、基金经理及相关人员。在监察部和数量分析小组提供的绩效评估和风险分析报告的基础上，基金经理定期对投资操作、组合状况、跟踪误差情况等进行总结，重点分析基金的跟踪偏离度和跟踪误差产生原因、现金控制情况、标的指数成份股调整前后的操作、以及成份股未来可能发生的变化等，并对基金投资组合进行相应调整。

六、业绩比较基准

沪深300 价值指数收益率*95% +银行活期存款收益率（税后）*5%。

沪深300价值指数是中证指数公司开发的沪深300风格指数系列中的子指数。该指数以沪深300指数样本股为样本空间，由其中100只价值Z值最高的股票构成。该指数由中证指数有限公司于2008年1月21日正式发布，以2004年12月31日为基期，基点为1000点。根据沪深300价值指数的编制方案，价值Z值的计算方法为：首先计算出样本空间每只样本股的四个价值因子——股息收益率（D/P）、每股净资产与价格比率 （B/P）、每股净现金流与价格比率 （CF/P）、每股收益与价格比率（E/P），然后对所有股票的四个变量值进行标准化z分处理。一个公司股票的价值Z值是四个价值因子变量Z值的均值。沪深300价值指数具有市场认可程度高、市场代表性好、流动性强、成份股调整频率低等特点，适合作为指数基金的跟踪标的。同时考虑到基金资产净值中有不低于5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，因此选择上述业绩比较基准。

如果沪深300价值指数被停止编制及发布或由其他指数替代，或由于指数编制方法等重大变更导致沪深300价值指数不适用于本基金，不宜继续作为业绩比较基准，或证券市场有其他代表性更强、更适合本基金投资策略的指数推出时，本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则，在履行适当程序后变更本基金的标的指数和业绩比较基准，并在变更前提前2个工作日在中国证监会指定的媒体上公告。

七、风险收益特征

本基金为股票型指数基金，属于证券投资基金中高风险高收益的品种，其预期风险大于货币型基金、债券型基金、混合型基金。

八、投资限制

1、组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

(1)本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；

(2)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；

(3)本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%；

(4) 本基金跟踪标的指数的股票投资组合资产（包括标的指数成份股和备选成份股）不低于基金资产的90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；

(5)本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的债券；

(6)基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(7)法律法规以及监管机构规定的其他投资限制；

(8)以后如有法律法规或监管机构允许基金投资的其他品种（包括股指期货、股指期权等金融衍生产品），投资比例将遵从法律法规或监管机构的规定。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

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。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。

2、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)承销证券；

(2)向他人贷款或者提供担保；

(3)从事承担无限责任的投资；

(4)买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；

(5)向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

(6)买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

(7)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

(8)依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动；

(9)法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

九、基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；

2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

3、有利于基金财产的安全与增值；

4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

十、基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

十一、基金投资组合报告（截止于2014年6 月30 日）

本投资组合报告已经基金托管人复核，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。本报告中所列财务数据未经审计。

1.1 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	286,978,734.09	93.97
	其中：股票	286,978,734.09	93.97
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	17,056,674.42	5.58
7	其他资产	1,372,163.33	0.45
8	合计	305,407,571.84	100.00

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

1.2.1 报告期末指数投资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	-	-
B	采矿业	16,743,417.30	5.53
C	制造业	62,101,539.22	20.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,465,909.06	5.11
E	建筑业	12,185,437.63	4.03
F	批发和零售业	4,091,681.04	1.35
G	交通运输、仓储和邮政业	12,879,024.82	4.26
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,014,688.20	1.00
J	金融业	139,937,793.10	46.25
K	房地产业	18,682,169.71	6.17
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,877,074.01	0.62
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	286,978,734.09	94.85

1.2.2 报告期末积极投资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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	-	-

1.3 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

1.3.1 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投资明细

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	601318	中国平安	526,895	20,728,049.30	6.85
2	600036	招商银行	1,841,381	18,855,741.44	6.23
3	600016	民生银行	3,006,552	18,670,687.92	6.17
4	601166	兴业银行	1,258,385	12,621,601.55	4.17
5	600000	浦发银行	1,232,040	11,149,962.00	3.69
6	000002	万 科A	1,065,616	8,812,644.32	2.91
7	601288	农业银行	3,383,209	8,525,686.68	2.82
8	000651	格力电器	264,888	7,800,951.60	2.58
9	601398	工商银行	2,007,945	6,806,933.55	2.25
10	601328	交通银行	1,728,316	6,705,866.08	2.22

1.3.2 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投资明细

注：无

1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

1.5 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投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

1.6 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资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

1.7 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金报告期末内未持有股指期货合约。

1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金依据基金合同的规定，以控制跟踪误差最小化为管理目标，未进行股指期货的投资。

1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1.10.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

1.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金未投资国债期货。

1.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

1.11 投资组合报告附注

1.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现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

1.11.2

报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	16,027.59
2	应收证券清算款	1,312,807.79
3	应收股利	-
4	应收利息	3,420.22
5	应收申购款	39,907.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,372,163.33

1.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

1.11.5.1 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

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

1.11.5.2 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

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

第六节 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预示其未来表现。投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读本招募说明书。有关业绩数据经托管人复核，但未经审计。

1、银河沪深300价值指数净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表（截至2014 年6月30日）

注：本基金合同于2009年12月28日生效。

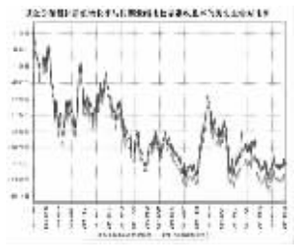
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2010-01-01至2010-12-31	-15.98%	1.45%	-22.83%	1.55%	6.85%	-0.10%
2011-1-1至2011-12-31	-17.72%	1.24%	-17.08%	1.24%	-0.64%	0.00%
2012-1-1至2012-12-31	13.44%	1.09%	12.49%	1.11%	0.95%	0.02%
2013-1-1至2013-12-31	-9.17%	1.44%	-11.13%	1.43%	1.96%	0.01%
2014-1-1至2014-6-30	-2.95%	0.97%	-4.07%	0.96%	1.12%	0.01%
自基金合同生效起至今	-30.80%	1.28%	-35.33%	1.31%	4.53%	-0.03%

注：本基金合同于2009年12月28日生效。

2、自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

银河沪深300价值指数累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2009 年12 月28 日至2014 年6 月30日）



第七节 基金的费用

一、与基金运作有关的费用

1、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)基金财产拨划支付的银行费用；

(4)基金合同生效后的基金信息披露费用；

(5)基金份额持有人大会费用；

(6)基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；

(7)基金的指数使用费；

(8)基金的证券交易费用；

(9)依法可以在基金财产中列支的其他费用。

2、上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

3、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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年管理费率÷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

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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

(2)基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年托管费率÷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

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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

(3)基金的指数使用费

本基金作为指数基金，需根据与指数所有人中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付指数使用费。通常情况下，指数使用费按前一日基金资产净值的0.02%（2个基点）的年费率计提，且收取下限为每季度人民币5万元。计算方法如下：

H= E×指数使用费年费率÷当年天数

H 为每日计提的指数使用费

E 为前一日的基金资产净值

指数使用费从基金合同生效日开始每日计算，逐日累计；基金设立当年不足3个月的，按照3个月收费。

指数使用费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令，经基金托管人复核后于次季初10个工作日内从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司。

如果指数使用费的计算方法和费率等需要调整，本基金将在履行适当程序后变更本基金的指数使用费率或费率计算方法，基金管理人应及时按照《信息披露管理办法》的规定在指定媒体进行公告。

(4)上述“1、基金费用的种类”中(3)到(9)项费用由基金托管人根据其他有关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。

4、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。基金合同生效前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。

5、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。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。

二、与基金销售有关的费用

本基金认购费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“六、基金的募集”中“（六）本基金的初始面值、认购价格及计算公式、认购费用”中的相关规定。

本基金的申购费、赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“八、基金份额的申购、赎回、非交易过户与转托管”中的“（六）申购和赎回的价格、费用及其用途”中的相关规定。

第八节 对招募说明书更新部分的说明

银河沪深300价值指数证券投资基金本次更新招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法规及《银河沪深300价值指数证券投资基金基金合同》进行更新编写，更新的内容主要包括以下几部分：

1、“第三节 基金管理人”徐旭女士不再担任本公司董事长一职。许国平先生任本公司董事长。其他董事、监事、经理及其他高级管理人员信息根据实际情况进行了更新。

2、“第四节 基金托管人”之“一、基金托管人情况”根据实际情况进行了相应更新。

3、“第五节 相关服务机构”根据实际情况进行了相应更新，第三方独立销售机构有两家变更并替换。诺亚正行和泛华普益替换为：北京展恒和北京增财。

4、“第十节 基金的投资”更新了“十一、基金投资组合报告”，本报告截止日为2014年6月30日，该部分内容均按有关规定编制，并经基金托管人复核，但未经审计。

5、更新了“第十一节 基金的业绩”，对基金成立以来至2014年6月30日的基金业绩表现进行了披露。该部分内容均按有关规定编制，并经基金托管人复核，但相关财务数据未经审计。

6、“第二十四节 其他应披露事项” 中列示了本报告期内本基金及本基金管理公司在指定报纸上披露的临时报告。

银河基金管理有限公司
二〇一四年八月十一日

大成基金管理有限公司关于召开大成理财21天债券型发起式证券投资基金基金份额持有人大会（通讯方式）的第二次提示性公告

大成基金管理有限公司已于2014年8月7日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站（www.dcfund.com.cn）发布了“大成基金管理有限公司关于召开大成理财21天债券型发起式证券投资基金基金份额持有人大会（通讯方式）的公告”，并于2014年8月8日发布了第一次提示性公告。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，根据基金合同的相关规定，现发布本次基金份额持有人大会的第二次提示性公告。

一、会议基本情况

为优化基金的投资目标与投资策略，维护基金持有人利益，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》和《大成理财21天债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，大成理财21天债券型发起式证券投资基金（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，审议本基金转型方案等相关事宜，将本基金转型成为“大成月月盈短期理财债券型证券投资基金”。会议具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式

2、会议投票表决起止时间：2014年8月14日起，至2014年9月10日17:00止（以本通知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

邮政编码：100034

联系人：吕婧

联系电话：400-888-5558，010-88009300-5802

传真：010-85252282

请在信封背面注明：“大成理财21天债券型发起式证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”

其他形式的会议通讯表决票按本公告规定的方式提交或发送至基金管理人或其指定的系统，并在公证机关的监督下进行统计。

二、会议审议事项

本次持有人会议审议事项为《关于大成理财21天债券型发起式证券投资基金转型相关事项的议案》（见附件一）

三、权益登记日

本次大会的权益登记日为2014年8月13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。

四、投票方式

（一）纸质表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票见附件二。基金份额持有人可通过剪报、复印或登陆基金管理人网站下载（www.dcfund.com.cn）等方式下载并打印表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

（1）个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人身份证件正反面复印件；

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章或经授权的业务公章（以下合称“公章”），并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、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、有权部门的批文或登记证书复印件等）；合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章（如有）或由授权代表在表决票上签字（如无公章），并提供该授权代表的身份证件、护照或其他身份证明文件的复印件，该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件，以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件；

（3）基金份额持有人可根据本公告“五、授权”规定的授权其他个人或机构代其在本次基金份额持有人大会上投票。受托人接受基金份额持有人纸面方式授权代理投票的，应由受托人在表决票上签字或盖章，并提供授权委托书原件以及本公告“‘五、授权’第（三）条授权方式1、纸面方式授权”中所规定的基金份额持有人以及受托人的身份证明文件或机构主体资格证明文件，但下述“第（4）项”另有规定的除外；

（4）基金份额持有人通过本公告规定的电话授权方式或短信授权方式授权基金管理人投票的，接受有效委托的基金管理人应在表决票上加盖本单位公章，并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件。

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件自2014年8月14日起，至2014年9月10日17:00以前（以本次大会公证机关指定的表决票收件人收到表决票时间为准）通过专人送交、邮寄送达至以下地址或按以下传真号码以传真的方式送达至下述收件人：

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

邮政编码：100035

联系人：吕婧

联系电话：400-888-5558，010-88009300-5802

传真：010-85252282

（二）电话投票

为方便基金份额持有人参与大会投票，自2014年8月14日起，至2014年9月10日17:00以前（以基金管理人系统记录时间为准）基金管理人在客服电话上增设持有人专用通道，基金份额持有人可免费拨打并按提示转人工坐席进行投票。

基金管理人也将主动与预留联系方式的基金份额持有人取得联系，在通话过程中以回答提问方式核实持有人身份后，由人工坐席根据客户意愿进行投票记录从而完成投票。为保护基金份额持有人利益，整个通话过程将被录音。

基金份额持有人通过电话投票的方式仅适用于个人持有人，对机构持有人暂不开通。

（三）短信投票

为方便基金份额持有人参与大会，自2014年8月14日起，至2014年9月10日17:00以前（以基金管理人系统记录时间为准），基金管理人提供以下短信通道供投资者进行投票。

基金管理人通过短信平台向预留手机号码的个人持有人发送征集投票短信，持有人回复短信表明表决意见。

基金份额持有人通过短信投票的方式仅适用于个人持有人，对机构持有人暂不开通。

基金份额持有人原预留手机号码已变更或已不再实际使用的，可选择其他方式进行投票。因电信运营商原因导致持有人无法获取短信进行投票，请投资者采用纸质或电话方式进行投票。

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，使基金份额持有人在本次大会上充分表达其意志，基金份额持有人除可以直接投票外，还可以授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《基金合同》的约定，基金份额持有人授权他人在基金份额持有人大会上表决需符合以下规则：

（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份额持有人大会的表决权。

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。

（二）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、电话和短信等其他法律法规和中国证监会认可的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。基金份额持有人可通过剪报、复印或登录基金管理人网站下载（www.dcfund.com.cn）等方式获取授权委托书样本。

基金份额持有人通过非纸面方式授权的，授权形式及程序应符合本通知的规定。基金份额持有人通过非纸面方式授权仅限授权给基金管理人。

1、纸面方式授权

（1）基金份额持有人进行纸面授权所需提供的文件

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，还需提供受托人的身份证明文件复印件；如受托人为机构，还需提供该受托人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、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、有权部门的批文或登记证书复印件等）。

2）机构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的授权委托书原件（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企业法人营业执照复印件（事业单位、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；如受托人为机构，还需提供该受托人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、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、有权部门的批文或登记证书复印件等）。

2、电话授权方式

为方便基金份额持有人参与大会，基金管理人在客服电话上增设持有人专用通道，基金份额持有人可免费拨打并按提示转人工坐席进行授权。

基金管理人也将主动与预留联系方式的基金份额持有人取得联系，在通话过程中以回答提问方式核实持有人身份后，由人工坐席根据客户意愿进行授权记录从而完成授权。为保护基金份额持有人利益，整个通话过程将被录音。电话授权仅支持授权给基金管理人模式。

基金份额持有人通过电话授权的方式仅适用于个人持有人，对机构持有人暂不开通。

3、短信授权

为方便基金份额持有人参与大会，基金管理人提供以下短信通道供投资者进行授权。

基金管理人将通过短信平台向预留手机号码的个人持有人发送征集授权短信，持有人可回复短信表明授权意见。

基金份额持有人通过短信授权的方式仅适用于个人持有人，对机构持有人暂不开通。短信授权仅支持授权给基金管理人模式。

基金份额持有人原预留手机号码已变更或已不再实际使用的，可选择其他方式进行授权。因电信运营商原因导致持有人无法获取短信进行授权，请投资者采用纸质或电话方式进行授权。

4、授权效力确定规则

（1）如果同一基金份额存在包括有效纸面方式授权和其他非纸面方式有效授权的，以有效的纸面授权为准。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。同时多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）如果同一基金份额在只存在有效纸面方式授权时，委托人签署的授权委托书没有表示具体表决意见的，视为委托人授权受托人按照受托人意志行使表决权；

（3）如果同一基金份额无有效纸面方式授权，但存在任意一种有效的其他非纸面方式授权的，以该种有效的其他非纸面方式的授权为准；

（4）如果同一基金份额以非纸面方式进行多次授权的，以时间在最后的授权为准。同时多次以非纸面方式进行授权的，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；

（5）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。

（6）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为：本人或委托他人代表出具有效表决意见的基金份额持有人持有的基金份额不少于权益登记日本基金基金总份额的50%（含50%）。

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，须经出席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。

本次基金份额持有人大会决议自表决通过之日起5日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。届时生效的法律法规另有规定或者证监会另有要求的，从其规定或要求。

七、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由本基金管理人授权的两名监督员在基金托管人（中国银行股份有限公司）授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

2、基金份额持有人所持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收件人的，表决时间以收到时间为准；通过其他非纸面方式表决的，表决时间以系统记录时间为准。2014年9月10日17:00以后送达基金管理人的，为无效表决。

（2）如果同一基金份额存在包括有效纸面方式表决和其他非纸面方式有效表决的，以有效的纸面表决为准。

（3）纸面表决票的效力认定

纸面表决票填写完整清晰，所提供文件符合本会议通知规定，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入相应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

如纸面表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认，但其他各项符合会议通知规定的，视为弃权表决，计入有效表决票；并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表