

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

二〇〇七年十一月

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。本招募说明书摘要经中国证监会审核同意，但中国证监会对本基金做出的任何决定，均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。

基金管理人承诺以诚实信用、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。

投资人申购本基金时应认真阅读本招募说明书。

投资有风险，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。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，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。基金投资人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2007年10月06日，有关财务数据和净值表现截止日为2007年09月30日。（财务数据未经审计）

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：胡学光

成立日：1999 年 4 月 12 日

注册资本：2 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%）、中国银河证券股份有限公司（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：李宏伟

大成基金管理有限公司设有董事会、监事会，下设十个部门，分别是投资部、交易部、金融工程部、规划发展部、委托投资部、市场部、监察稽核部、信息技术部、基金运营部和综合管理部；此外，还设立了投资决策委员会和风险控制委员会。

公司拥有一支充满活力的高素质、高学历、具备丰富市场经验的专家队伍，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。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，力求为投资人获得更大投资回报。

(二) 证券投资基金管理情况

截止 2007 年 10 月 6 日，本基金管理人共管理 4 只封闭式证券投资基金：景宏证券投资基金、景阳证券投资基金、景福证券投资基金、大成优选股票型证券投资基金及 9 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。

(三) 主要人员情况

1、公司高级管理人员

董事会：

胡学光先生，董事长，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 月起任大成基金管理有限公司董事长。

于华先生，董事，总经理，工商管理硕士，金融博士，美国注册金融分析师（CFA）。1989 年—1991 年，任英国里丁大学经济系金融财务讲师；1991 年—1997 年，加拿大魁北克大学管理学院金融终身教授；1997 年—2000 年，任深圳证券交易所综合研究所所长；2000 年—2004 年 1 月，任加拿大鲍尔集团亚太分公司基金与保险业务副总裁，加拿大伦敦人寿保险公司北京代表处首席代表；现任中国证券业协会基金业委员会委员；2004 年 1 月起任大成基金管理有限公司总经理。

蔡红标先生，董事，中共党员，经济学博士。1994年2月至1997年2月，任华泰证券有限责任公司业务主任；1997年3月至1997年6月，任深圳证券交易所综合研究所研究员；1997年6月至1997年9月，任招商证券有限责任公司研究部研究员；1997年10月至2000年5月，任联合证券有限责任公司研究部副总经理级研究员，分管公司证券市场研究咨询业务；2000年6月至2001年11月，任二十一世纪科技投资有限公司（招商银行控股）证券投资部副总经理；2001年11月至今，在中国华闻投资控股有限公司，任总裁助理、计划部副总经理，担任联合证券有限责任公司董事、中国人民健康保险股份有限公司董事、中国财产再保险股份有限公司监事。

徐浩明先生，董事，硕士研究生。1988 年 7 月—1991 年 4 月，任职于上海体制改革研究所；1991 年 4 月—2000 年 6 月，历任交通银行研究开发部副主任科员、主任科员，办公室综合处副处长、处长，党委办公室综合处处长兼党委秘书；2000 年 6 月—2003 年 2 月，历任中国光大集团有限公司董事会秘书，执董办及党办副主任，办公厅、党办、执董办主任；2002 年 9 月起任光大证券股份有限公司董事；2003 年 2 月至今，

任光大证券股份有限公司董事、副总裁、总裁。

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；现任银河证券投资咨询公司办公室主任。

杨建文先生，独立董事，经济学博士。1982年-1996年，上海社会科学院经济研究所研究室主任；1996年至今，上海社会科学院部门经济研究所副所长，总支书记；目前兼任上海市工商联（商会）副会长、上海市人民政府决策咨询研究专家、上海市国有资产规划投资委员会常任委员、上海市对外文化交流协会经济金融分会召集人、上海国际金融研究中心执行理事、上海社会科学院金融研究中心主任。

胡春元先生，独立董事，经济学（会计）博士，中国注册会计师。1991年-1994年，在厦门大学会计师事务所兼职，任审计员；1994年-1995年，任厦门会计师事务所项目经理；1996年-1997年，在深圳大华天诚会计师事务所兼职从事审计与管理咨询工作；1997年11月起，在深圳大华天诚会计师事务所专职从事审计与管理咨询工作，历任经理、合伙人（1999）、高级合伙人、注册会计师。

查竞传先生，独立董事，比较法硕士，美国纽约州注册律师。1984年创办竞诚国际律师事务所；1984年-1994年兼任台湾大学纽约校友会理事；1988年-1992年兼任纽约华人参政会理事、会长；1991年-1996年兼任银川市人民政府顾问；1992年-1996年兼任台湾国民大会代表；1999年-2001年兼任中国大学生创业投资大赛评委、清华大学创业投资大赛顾问或评委，现任美国竞诚国际律师事务所纽约总部合伙人兼北京代表处首席代表。

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；上海市浦发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。

监事会：

周洪先生，监事长，经济学博士。1988年8月-1994年8月，任山东财政学院经贸系副主任、副教授；1994年9月-1995年8月北京大学西方经济学博士研究生；1995年9月-1998年8月在光大证券股份有限公司工作，历任研究部负责人、办公室副主任、总裁办主任、总裁助理职务；1998年9月起参与大成基金管理有限公司的筹建，1999年3月-2005年5月，任大成基金管理有限公司副总经理。

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，任财政部德宝实业总公司总经理、法人代表；1999年6月至今，任职于财政部离退休老干部局。

沈烁先生，监事，法学学士。1993年7月—1997年6月任职于福建九州商社有限公司，企业管理部、法律顾问室经理助理；1997年7月—2002年2月任职于厦门联合信托投资公司，法律事务部总经理；2002年3月至今任中泰信托投资有限责任公司，法律事务部总经理兼稽核审计部副总经理。

其他高级管理人员：

周一烽先生，副总经理，经济学硕士。1984年—1992年，历任上海市社会科学院经济研究所研究人员、宏观经济研究室副主任、上海企业发展研究所副所长；1992年起历任广联（南宁）投资有限公司总经理特别助理及证券投资业务负责人、上海广联投资有限公司总经理；2001年起任中泰信托投资有限责任公司副总裁；2005年4月任大成基金管理有限公司任助理总经理；2006年5月起任大成基金管理有限公司副总经理，2007年6月27日起担任大成积极成长股票型证券投资基金基金经理。

王颢先生，副总经理，国际工商管理专业博士。2000年12月—2002年9月，任招商证券深圳管理总部副总经理、机构管理部副总经理；2002年9月—2004年6月，任大成基金管理有限公司助理总经理；2004年7月起任大成基金管理有限公司副总经理。

李宏伟先生，董事会秘书兼助理总经理，法学硕士。1991年7月—1992年5月，任南京旭普电子有限公司总经理助理；1992年6月—1997年2月，任深圳金地（集团）股份有限公司总经理办公室主任、董事会秘书、发展委主任；1997年3月—1998年4月，任光大证券股份有限公司深圳营业部副总经理；1998年5月—2003年12月，任南方基金管理有限公司综合管理部及市场部高级经理；2004年1月至今，任大成基金管理有限公司董事会秘书兼助理总经理。

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上市代表、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月至今，任大成基金管理有限公司督察长兼监察稽核部经理。

刘彩晖女士，助理总经理，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，其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月至今，任大成基金管理有限公司助理总经理。

2、基金经理

(1) 现任基金经理

杨丹先生，基金经理，理学硕士，6年证券从业经验。2001年加盟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。

(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

公司投资决策委员会6名成员组成，设主任和执行主任各1名，其他委员4名。名单如下：

于华，总经理，投资决策委员会主任；周一烽，副总经理、大成积极成长股票型证券投资基金基金经理，投资决策委员会执行主任；刘明，投资部总监，基金景宏、大成优选股票型证券投资基金基金经理；卢纪平，交易部总监；杨建华，投资部副总监，大成价值增长证券投资基金、基金景阳基金经理；陈尚前，投资部副总监，大成债券证券投资基金基金经理。

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

名称：中国农业银行

住所：北京市复兴路甲23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：1979年2月23日

注册资金：361 亿元人民币

存续期间：持续经营

电话：68424199

联系人：李芳菲

中国农业银行是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。在国内,中国农业银行网点遍布城乡,资金实力雄厚,服务功能齐全,不仅为广大客户所信赖,而且与他们一道取得了长足的共同进步,已成为中国最大的银行之一。在海外,农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉,被《财富》评为世界 500 强企业之一。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。中国农业银行自 1979 年恢复成立以来,在社会各界的大力支持下,全行员工开拓创新,奋力拼搏,在建设现代商业银行的征途上,积极探索,勇于实践,资金实力显著增强,业务领域不断拓宽,经营结构逐年优化,财务收益大幅跃升,管理水平不断提高,在支持国民经济发展、为客户提供优质服务的同时,自身不断成长壮大。

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之一,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、综合管理处、风险管理处、境外资产托管处和投资银行处,拥有先进的安全防范设施和基金清算、核算、交易监督快捷处理系统。

(二) 主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工 77 名,其中硕士与博士 42 人,高级会计师、高级经济师、高级工程师 10 余名,服务团队成员都具有高素质高学历的托管业务能力,高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称。

(三) 基金托管业务经营情况

截止 2007 年 9 月 30 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 54 只，包括基金裕阳、基金裕隆、基金汉盛、基金景阳、基金景福、基金天华、基金同德、基金鸿阳、基金丰和、基金久嘉、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、万家保本增值开放式基金、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、宝盈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，托管基金份额达 2494.76 亿份。

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：胡学光

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：郑丽芳、梁静静

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：王艳、廖红军

电话：010-85252345/46

传真：010-85252273/2274/2275

（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：杨静、徐舫

电话：021-63513925/26

传真：021-63513928

2、场外代销机构

（1）中国农业银行

注册地址：北京市海淀区复兴路甲23号

法定代表人：项俊波

客服电话：95599

电话：010-85109219

传真：010-85109219

联系人：蒋浩

网址：www.abchina.com

（2）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：蒋超良

客服电话：95559

联系电话：021-58781234

传真：(021) 58408842

联系人：杜宇

网址：www.bankcomm.com

(3) 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：王明权

客服电话：95595

联系电话：010-68560675

传真：010-68560661

联系人：张建春

网上银行：www.cebbank.com

(4) 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：上海市延平路135号

法定代表人：祝幼一

客户服务电话：400-8888-666

电话：021-62580818-213

传真：021-62583439

联系人：芮敏祺

网站：www.gtja.com

(5) 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：北京市朝阳区门内大街188号

法定代表人：黎晓宏

客服电话：400-8888-108

电话：010-65182261

联系人：魏明

网站: www.csc108.com

(6) 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层

法定代表人: 何如

客户服务电话: 800-810-8868

电话: 0755-82130833-2181

传真: 0755-82133302

联系人: 林建闽

网址: www.guosen.com.cn

(7) 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39-45层

法定代表人: 宫少林

客户服务电话: 4008888111、0755-26951111

电话: 0755-82943511

联系人: 黄健

网址: www.newone.com.cn

(8) 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

办公地址: 广州市天河区天河北路183号大都会广场36、38、41、42楼

法定代表人: 王志伟

客服电话: 020-87555888 转各营业网点

电话: 020-87555888-875

传真: 020-87557985

联系人: 肖中梅

网站: www.gf.com.cn

(9) 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

客户服务电话: 010-68016655

联系人: 郭京华

网址: www.chinastock.com.cn

(10) 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: 马国强

客户服务热线: 400-8888-555

联系人: 范雪玲

网址: www.lhzq.com

(11) 长江证券有限责任公司

注册地址: 武汉市新华下路特8号

法定代表人: 胡运钊

服务热线: 400-8888-999

电话: 021-63296362

传真: 021-51062920

联系人: 甘露

网址: www.cz318.com.cn

(12) 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: 吴晋安

电话: 0351-8686703

传真: 0351-8686709

联系人: 张治国

客服电话: 0351-8686868

网址: www.i618.com.cn

(13) 世纪证券有限责任公司

注册地址: 深圳市深南大道7088号招商银行大厦41层

办公地址: 深圳市深南大道7088号招商银行大厦41层

法定代表人: 段强

电话: 0755-83199511

传真: 0755-83199545

联系人: 夏尚

网址: www.csc.com.cn

(14) 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3楼

法定代表人: 叶黎成

电话: 0755-82450826 22622287

传真: 0755-82433794

联系人: 余江、庄维佳

全国统一客户服务热线: 95511

网址: www.pa18.com

(15) 光大证券股份有限公司

注册地址: 上海市浦东南路528号上海证券大厦南塔15楼

法定代表人: 王明权

电话: 021-68816000

传真: 021-68817271

客服电话: 021-68823685

联系人: 刘晨

网址: www.ebscn.com

(16) 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

客户服务电话: 021-962505

电话: 021-54033888

联系人: 孙洪喜

网址: www.sw2000.com.cn

(17) 海通证券股份有限公司

通讯地址: 上海市淮海中路98号

法定代表人: 王开国

客服电话: 021-962503

电话: 021-53594566-4125

传真: 021-53858549

联系人：金芸

网站：www.htsec.com

(18) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福建福州湖东路99 号标力大厦

法定代表人：兰荣

电话：021-68419974

传真：021-68419867

客服电话：400-8888-123

联系人：杨盛芳

网址：www.xyzq.com.cn

(19) 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：平岳

联系电话：021-68604866-8309

传真：021-50372474

联系人：张静

客服电话：021-68604866

公司网址：www.bocichina.com.cn

(20) 东北证券有限责任公司

注册地址：长春市人民大街138-1 号

通讯地址：长春市自由大路1138 号1007 室

法定代表人：李树

客服电话：0431-5096733 ， 0431-96688-99

电话：0431-5096710

传真：0431-5680032

联系人：高新宇

网站：www.nesc.cn

(21) 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3楼

法定代表人：王东明

电话：010-84864818-63266

传真：010-84865560

联系人：陈忠

客服电话：010-84588266

网址：www.ecitic.com

（22）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

电话：0531-82024184，0531-82024147

传真：0531-82024197

客服热线：0531-2024197

联系人：傅咏梅

网址：www.qlzq.com.cn

（23）湘财证券有限责任公司

注册地址：长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼

法定代表人：陈学荣

客服热线：021-68865020

联系电话：021-68634518

传真：021-68865938

联系人：陈伟

网址：www.xcsc.com，www.eestart.com

（24）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

客服热线：400-888-8588

联系人：邵一明

电话：021-50586660

传真：021-50586660-8880

网址：www.longone.com.cn

(25) 广东发展银行

咨询热线：020-38322542、38322974

网址：www.gdb.com.cn

(26) 江南证券有限责任公司

咨询热线：0791-6768763

网址：www.scstock.com

(27) 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5楼

法定代表人：吴志明

基金业务联系人：曾洋

联系电话：020-87322668

传真：020-87325036

咨询热线：020-961303，020-83963933

网址：www.gzs.com.cn

(28) 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)

联系电话：(0755) 82088888-8811

传真电话：(0755) 82080714

联系人：周勤

客户服务热线：95501

网址：www.sdb.com.cn

(29) 中信金通证券有限责任公司

注册地址：杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座

办公地址：杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座

法定代表人：刘军

联系人：龚晓军

联系电话：0571-85783750

(30) 华林证券有限责任公司

办公地址：深圳市福田区民田路178号华融大厦5楼

法定代表人：姚桥盛

联系人：杨玲

联系电话：0755-82707855

传真：0755-82707850

网址：www.chinalions.com

(31) 华泰证券有限责任公司

办公地址：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

联系电话：025-84457777-950、248

联系人：李金龙、张小波

客户咨询电话：025-84579897

3、场内代销机构

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，包括：东吴证券有限责任公司、北京证券有限责任公司、广发证券股份有限公司、东海证券有限责任公司、长城证券有限责任公司、西部证券股份有限公司、华泰证券有限责任公司、国信证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、联合证券有限责任公司、长江证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、国联证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、南京证券有限责任公司、中银国际证券有限责任公司、申银万国证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、中国银河证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、湘财证券有限责任公司、海通证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、山西证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、天和证券经纪有限公司、江南证券有限责任公司、民生证券有限责任公司、华安证券有限责任公司、东北证券有限责任公司、国盛证券有限责任公司、兴业证券股份有限公司、第一创业证券有限责任公司、新时代证券有限责任公司、国元证券有限责任公司、金信证券有限责任公司、恒泰证券有限责任公司、中原证券股份有限公司、东莞证券有限责任公司、广州证券有限责任公司、华西证券有限责任公司、信泰证券有限责任公司、西南证券有限责任公司、财富证券有限责任公司、国海证券有限责任公司、国都证券有限责任公司、宏源证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、泰阳证券有限责任公司、德邦证券有限责任公司、

中信金通证券股份有限公司、万联证券有限责任公司、渤海证券有限责任公司、大同证券经纪有限责任公司、广发华福证券有限责任公司、财通证券经纪有限责任公司、世纪证券有限责任公司。

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) 注册登记人

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东三办公楼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东三办公楼16层

法定代表人：葛明

经办注册会计师：葛明，金馨

电话：010—65246688

传真：010—85188298

联系人：涂佩施

四、基金名称

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，或因某些特殊情况(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归因分析，依此提出研究报告。

(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，结合研究报告，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，来达到改善组合风险收益特征的目的，包括但不限于杠杆交易策略、看跌保护组合策略、保护组合成本策略、获利保护策略、买入跨式投资策略。

十、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数。

如果沪深 300 指数被停止编制及发布，或沪深 300 指数由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致沪深 300 指数不宜继续作为业绩比较基准，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，变更本基金的业绩比较基准。

本基金由于上述原因变更业绩比较基准，基金管理人需报中国证监会核准后，应于正式实施变更前 2 日内在至少一种中国证监会指定的媒体上予以公告。

十一、基金的风险收益特征

本基金为指数基金，是风险中等、获得证券市场平均收益率的产品。

十二、基金投资组合报告（截至 2007 年 09 月 30 日）

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，保证本报告所载内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金托管人中国农业银行根据本基金合同规定，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2007年9月30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

项目	金额（元）	占基金资产总值比例
银行存款和清算备付金合计	691,675,331.04	5.76%
股票	11,295,621,191.93	94.10%
债券	1,407,628.68	0.01%
权证	0.00	0.00%
其他资产	15,356,111.03	0.13%
合计	12,004,060,262.68	100.00%

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

(1) 指数投资部分

行业	市值（元）	占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	58,217,907.57	0.49%
B 采掘业	699,703,012.54	5.87%
C 制造业	4,009,329,808.00	33.63%
C0 食品、饮料	428,850,527.72	3.60%
C1 纺织、服装、皮毛	94,798,550.58	0.80%
C2 木材、家具	0.00	0.00%
C3 造纸、印刷	54,060,795.10	0.45%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	325,312,643.98	2.73%
C5 电子	47,786,078.71	0.40%
C6 金属、非金属	1,841,957,717.65	15.45%
C7 机械、设备、仪表	997,903,751.57	8.37%
C8 医药、生物制品	179,201,072.85	1.50%
C99 其他制造业	39,458,669.84	0.33%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	655,249,036.33	5.50%
E 建筑业	98,490,350.07	0.83%
F 交通运输、仓储业	849,677,836.46	7.13%
G 信息技术业	378,629,304.13	3.18%
H 批发和零售贸易	494,447,091.74	4.15%
I 金融、保险业	2,710,200,253.40	22.73%
J 房地产业	806,694,304.99	6.77%
K 社会服务业	178,812,780.63	1.50%
L 传播与文化产业	48,683,816.14	0.41%
M 综合类	296,864,089.93	2.49%
合计	11,284,999,591.93	94.65%

(2) 非指数投资部分

行业	市值（元）	占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	0.00	0.00%
B 采掘业	0.00	0.00%
C 制造业	0.00	0.00%
C0 食品、饮料	0.00	0.00%
C1 纺织、服装、皮毛	0.00	0.00%
C2 木材、家具	0.00	0.00%
C3 造纸、印刷	0.00	0.00%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	0.00	0.00%
C5 电子	0.00	0.00%
C6 金属、非金属	0.00	0.00%
C7 机械、设备、仪表	0.00	0.00%
C8 医药、生物制品	0.00	0.00%
C99 其他制造业	0.00	0.00%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	0.00	0.00%
E 建筑业	0.00	0.00%
F 交通运输、仓储业	0.00	0.00%
G 信息技术业	0.00	0.00%
H 批发和零售贸易	0.00	0.00%
I 金融、保险业	10,621,600.00	0.09%
J 房地产业	0.00	0.00%
K 社会服务业	0.00	0.00%
L 传播与文化产业	0.00	0.00%
M 综合类	0.00	0.00%
合计	10,621,600.00	0.09%

3、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票明细

(1) 指数投资部分

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	市值（元）	市值占基金资产净值比例
1	600030	中信证券	6,894,130	666,731,312.30	5.59%
2	600000	浦发银行	7,198,639	377,928,547.50	3.17%
3	600036	招商银行	9,618,834	368,112,777.18	3.09%
4	000002	万科A	11,833,038	357,357,747.60	3.00%
5	600016	民生银行	17,120,420	270,673,840.20	2.27%

(2) 非指数投资部分

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	市值（元）	市值占基金资产净值比例
1	601939	建设银行	1,136,000	10,621,600.00	0.09%

4、报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券名称	市值（元）	占基金资产净值比例
1	国债	0.00	0.00%
2	金融债	0.00	0.00%
3	央行票据	0.00	0.00%
4	企业债	1,407,628.68	0.01%
5	可转债	0.00	0.00%
6	其他	0.00	0.00%
	合计	1,407,628.68	0.01%

5、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券名称	市值（元）	占基金资产净值比例
1	国安债1	1,407,628.68	0.01%

6、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无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。

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

(3) 基金的其他资产构成

项目	金额（元）
交易保证金	4,314,963.93
应收证券清算款	0.00
应收股利	0.00
应收利息	152,590.65
应收申购款	10,888,556.45
合计	15,356,111.03

(4) 报告期末基金持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

(5) 权证投资情况

权证代码	权证名称	期初数量 (份)	期间买入 数量(份)	买入成本 (元)	期间卖出数 量(份)	卖出收入(元)	期末数 量(份)
031003	深发 SFC1	501,524	0	0.00	501,524	10,450,121.94	0
031004	深发 SFC2	250,762	0	0.00	250,762	6,554,553.67	0

031005	国安 GAC1	0	111,998	610,958.49	111,998	1,401,797.69	0
--------	---------	---	---------	------------	---------	--------------	---

注：本基金本报告期内投资的权证深发 SFC1(031003)、深发 SFC2(031004)源于深发展(000001)股权分置所获得的对价,投资的权证国安 GAC1 (031005)源于中信国安(000839)配售可分离交易债所获得的权证。

(6) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券明细无。

(7) 本报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金情况无。

(8) 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。

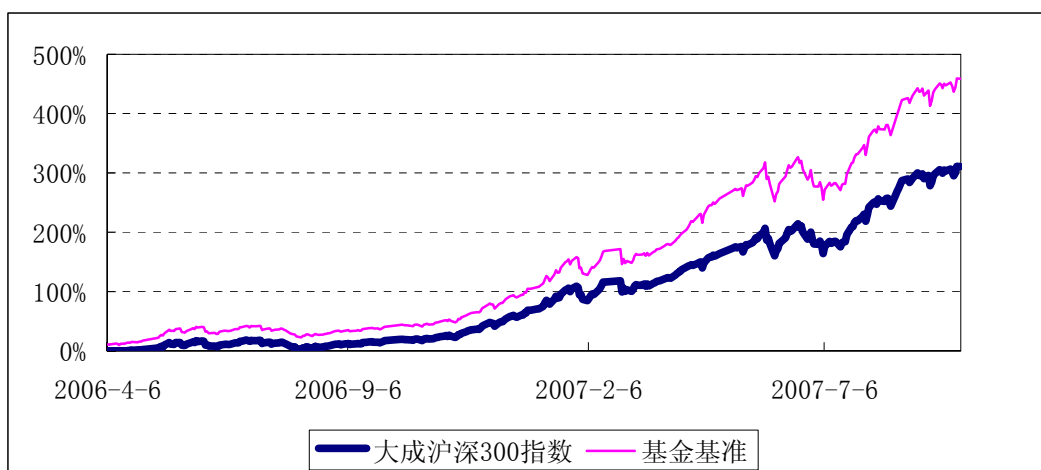
(一) 基金合同生效以来至 2007 年 09 月 30 日, 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较:

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
2006.04.06-2006.12.31	68.66%	1.41%	85.01%	1.52%	-16.35%	-0.11%
2006.04.06-2007.09.30	310.56%	1.89%	459.24%	2.07%	-148.68%	-0.18%

(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

大成沪深 300 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

(2006 年 4 月 6 日至 2007 年 09 月 30 日)



注：1、

本基金合同生效日为 2006 年 4 月 6 日；

2、按《基金合同》规定，本基金的初始建仓期为 6 个月。截至报告日，本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二条之（六）投资组合中规定的各项比例。

十四、费用概览

（一）与基金运作有关的费用

1、与基金运作相关费用列示

- （1）基金管理人的管理费；
- （2）基金托管人的托管费；
- （3）基金的证券交易费用；
- （4）基金合同生效后的信息披露费用；
- （5）基金份额持有人大会费用；
- （6）基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费；
- （7）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。

2、与基金运作相关费用计提方法、计提标准和支付方式

（1）基金管理人的管理费

本基金的基金管理费按基金财产净值的 0.75% 年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金财产净值的 0.75% 年费率计提。计算方法如：

$$H = E \times 0.75\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金财产净值

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，基金托管人复核后于次月首日起 5 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) 基金托管人的基金托管费

本基金的基金托管费按基金财产净值的 0.15% 年费率计提。

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

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金财产净值

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，基金托管人复核后于次月首日起 5 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、公休假等，支付日期顺延。

(3) 本条第 1 款第 3 至第 8 项费用由基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。

3、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。

基金合同生效前的相关费用，包括但不限于律师费、会计师费、验资费、信息披露费用等不得从基金财产中列支，其他具体不得列入基金费用的项目依据相关法律法规执行。

(二) 与基金销售等相关费用

本基金分为 A 类和 B 类两种收费模式，对应 A 类和 B 类两种不同的份额。

A 类收费模式，即前端收费模式，指在本基金中，选择在认（申）购本基金时直接交纳认（申）购费，再以扣除认（申）购费后的净额作为认（申）购金额的收费模式。

B 类收费模式，即后端收费模式，指在本基金中，选择在认（申）购时不交纳认（申）购费，以认（申）购总额直接作为认（申）购金额，但在赎回时交纳认（申）购费的收费模式。

本基金因不同的收费模式而有两类基金份额：A 类基金份额和 B 类基金份额。A 类

基金份额是选择 A 类收费方式（前端收费模式）的基金份额；B 类基金份额是选择 B 类收费方式（后端收费模式）的基金份额。

本基金将来若增加新的收费模式，对应地，可能会增加新的基金份额种类，并可能需计算其新基金份额类别的基金份额净值。

此分类对募集期的认购行为和基金合同生效后的申购行为，均同样适用。

投资者在认（申）购本基金时，每笔认（申）购只能选择 A 类或 B 类之一。

1、基金申购（基金合同生效后购买本基金）

投资者申购本基金时只能从 A 类和 B 类两种收费模式中选择一个。投资者申购本基金采用全额缴款的申购方式。

(1) A 类收费模式：前端收费模式

	申购金额 M	前端申购费率
A 类：前端收费模式	M < 50 万元	1.2%
	50 ≤ M < 200 万元	1.0%
	200 ≤ M < 500 万元	0.5%
	M ≥ 500 万元	每笔 1000 元

前端申购费用的计算方法如下：

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

申购费用在基金申购时从申购金额中扣除，不列入基金财产。基金申购费用用于市场推广、销售、注册登记、客户服务等各项费用。

(2) B 类收费模式：后端收费模式

	持有期限 T	后端申购费率
B 类：后端收费方式	T < 1 年	1.2%
	1 年 ≤ T < 2 年	0.8%
	2 年 ≤ T < 3 年	0.4%
	T ≥ 3 年	0

采用 B 类收费模式，投资者在申购时无须支付申购费用，但是赎回时需交纳申购费用。后端申购费用的计算方法如下：

后端申购费用 = 赎回份数 × 申购日基金份额净值 × 后端申购费率

2、基金赎回（对 A 类基金份额和 B 类基金份额均适用）

本基金赎回费用由基金赎回人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。

本基金的赎回费率按持有期(T)递减，最高不超过总的赎回金额的 0.5%，持有期超过 2 年赎回费率则为 0。

赎回费率表如下：

赎回费率	持有期 T	适用的赎回费率
	T<1 年	0.5%
	1≤T<2 年	0.15%
	T≥2 年	0%

注：1 年按照 365 天计算，2 年按照 730 天计算，其余同。

赎回费用的计算方法如下：

赎回费用=赎回金额×赎回费率

本基金赎回费在扣除手续费后，余额不得低于赎回费总额的 25%，并应当归入基金财产。

3、基金转换

本基金转换费用详见本基金开放转换业务公告、最新的更新的招募说明书或其他刊登在指定媒体上的公告。

（三）费率调整

基金管理人和基金托管人可根据实际情况分别调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。调高基金管理费率和基金托管费率，原则上须召开基金份额持有人大会审议，除非法律法规另有规定、或本基金合同另有约定、或获得监管机关的豁免等。

基金管理人等可根据市场情况在不违背有关法律法规之规定和本基金合同之约定的情况下调整本基金的认购费率、申购费率、赎回费率等。调低前述相关费率，或在不增加整体费率水平的情况下改变收费模式，无须召开基金份额持有人大会。

若将来法律法规或监管机构许可本基金或本类型的基金采取持续性销售服务费模式，则本基金可以依法引入持续性销售服务费收费模式；若引入该类收费模式，并没有增加现有投资者的费用负担，则无须召开基金份额持有人大会，法律法规或监管机关另有规定的除外。

基金管理人或其授权或认可的机构，在不违背相关法律法规之规定和本基金合同之约定的情况下，有权仅对场外或者仅对场内的费率结构进行调整。

费率的调整，最迟在调整生效前 2 日内在至少一种中国证监会指定媒体上公告。

（四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，应按国家法律、法规履行其纳税义务。

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 2007 年 05 月 16 日公布的《大成沪深 300 指数证券投资基金更新的招募说明书》进行了补充和更新，主要修改内容如下：

1、在“三、基金管理人”部分，更新了公司“注册资本”、“部门设置”、“证券投资基金管理情况”、“其他高级管理人员”及“公司投资决策委员会”等相关信息。

2、根据最新资料，对“四、基金托管人”的基本情况及相关业务经营情况进行了更新。

3、在“五、相关服务机构”中，根据相关公告，对直销机构、代销机构进行了更新。

4、在“七、基金的申购与赎回”中，对“（四）申购与赎回的数额限制”和“（七）申购份额与赎回支付金额的计算方式”的内容进行了更新。

5、在“八、基金投资”中，对“（十一）基金投资组合报告”部分的内容进行了更新。

6、在“九、基金业绩”中，对具体的时间和数据进行了更新。

7、更新了“十二、基金财产估值”的相关内容。

8、对“二十二、其他应披露的事项”进行了更新。

9、对“二十三、对招募说明书更新部分的说明”进行了更新。

大成基金管理有限公司

2007年11月20日