

# 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10月6日，有关财务数据和净值表现截止日为2009年6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：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、信息技术部、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，并在北京、上海、西安、成都、武汉、福州和沈阳等地设立了七家分公司；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 10 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 13 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、大成策略回报股票型证券投资基金和大成行业轮动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月起同时担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。

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投资部董事总经理。

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副处长；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有限公司市场拓展部总经理；2008年4月，任人保金控投资有限公司筹备组成员；2008年7月起任中国华闻投资控股有限公司总裁、党委书记。

杨赤忠先生，董事，大学本科。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；光大证券证券投资部总经理。现任光大证券助理总裁。

蔺春林先生，独立董事，大学本科。1970—1971年，解放军信阳坦克师锻炼；1971—1987年，任兵器部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、中组部金融巡视组组长；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，任财政部德宝实业总公司总经理、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。

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27日起担任大成沪深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**

公司投资决策委员会由9名成员组成，设主任委员1名，其他委员8名。名单如下：

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；曹雄飞，研究部总监，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；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；王立，大成债券投资基金、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；曹志刚，金融工程部首席金融工程师，投资决策委员会委员；刘安田，研究部总监助理，首席宏观策略分析师，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。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 130 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 2009 年 10 月 6 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 72 只，包括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、富国天源平衡混合型证券投资基金、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、泰达荷银货币市场基金、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型证券投资基金、长盛中证 100 指数证券投资基金、泰达荷银首选企业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、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、金元比联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、金元比联丰利债券型证券投资基金、交银施罗德先锋股票型证券投资基金、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 指数证券投资基金(LOF)。

### 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: 梁靖

公司网址: [www.dcfund.com.cn](http://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: 梁靖、瞿宗怡

电话: 0755-83195090、83195236

传真: 0755-83195091

##### (2) 大成基金北京投资理财中心

1) 东直门

电话：010-58156152/53

传真：010-58156315/23

地址：北京市东城区东直门南大街5号中青旅大厦105室

联系人：郑琳娜

2) 朝阳门

电话：010-85252345/46

传真：010-85252272/73

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

(3) 大成基金上海投资理财中心

1) 广东路

地址：上海市广东路689号海通证券大厦19层

联系人：徐舫、朱君

电话：021-63513925/26

传真：021-63513928

2) 南京西路

地址：上海市静安区南京西路580号南证大厦102、103室

联系人：彭莉

电话：021-62185377、62185277

传真：021-62185233

**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](http://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](http://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](http://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](http://www.icbc.com.cn)

(5) 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

（6）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

（7）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

（8）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

（9）中国光大银行股份有限公司

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

（10）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

（11）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.gdb.com.cn

（12）北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街丙17号

法定代表人：闫冰竹

联系人：王曦

客服电话：010-96169（北京）、022-96269（天津）、021-53599688（上海）、  
029-85766888（西安）0755-23957088、（深圳）、0571-86590900（杭州）

网址：www.bankofbeijing.com.cn

(13) 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：021-38576977

传真：021-62521689

联系人：吴海平，翁敏芬

客服电话：021-962999

网址：[www.shrcb.com](http://www.shrcb.com)

(14) 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、400-66-99999

公司网站：[www.18ebank.com](http://www.18ebank.com)

(15) 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](http://www.cib.com.cn)

(16) 宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市江东区中山东路294号

法定代表人：陆华裕

电话：021-63586210

传真：021-63586215

联系人：胡技勋

客服电话：96528、上海地区962528

网址：www.nccb.com.cn

（17）东莞银行股份有限公司

注册地址：东莞市运河东一路193号

法定代表人：廖玉林

联系人：胡昱

客服电话：96228

网址：www.dongguanbank.cn

（18）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

（19）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

（20）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：张佑君

客服电话：400-8888-108

联系人：魏明

电话：010-85130579

网址：www.csc108.com

（21）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：400-8888-111、95565

联系人：黄健

电话：0755-82943511

传真：0755-83734343

网址：www.newone.com.cn

（22）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

（23）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：胡长生

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](http://www.chinastock.com.cn)

(24) 华泰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](http://www.lhzq.com)

(25) 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：021-54047892

传真：021-54038844

网址：[www.sw2000.com.cn](http://www.sw2000.com.cn)

(26) 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.htsec.com](http://www.htsec.com)

(27) 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

（28）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：400-800-1001

联系人：张茜萍

电话：0755-82558335

传真：0755-82558335

网址：www.axzq.com.cn

（29）光大证券股份有限公司

办公地址：上海市静安区新闻路1508号

法定代表人：徐浩明

客服电话：400-8888-788;10108998

联系人：刘晨、李芳芳

电话：021-22169081

传真：021-22169134

网址：www.ebscn.com

（30）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

（31）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：史洁民

客服电话：0532-96577

联系人：丁韶燕

电话：0532-85022026

传真：0532-85022026

网址：[www.zxwt.com.cn](http://www.zxwt.com.cn)

（32）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](http://www.longone.com.cn)

（33）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

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](http://www.bigsun.com.cn)

（34）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

（35）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：陈敬达

客服电话：95511

联系人：袁月

电话：0755-22627802

传真：0755-83433794

网址：www.pa18.com

（36）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

（37）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：钟康莺

电话：021-68634518

传真：021-68865680

网址：[www.xcsc.com](http://www.xcsc.com)

(38) 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](http://www.gyzq.com.cn)

(39) 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](http://www.962518.com)

(40) 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：0551-96518、400-80-96518

联系人：甘霖

电话：0551-5161821

传真：0551-5161672

网址：[www.hazq.com](http://www.hazq.com)

(41) 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：400-888-123

（42）财通证券有限责任公司

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

（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）渤海证券股份有限公司

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：400-651-5988

联系人：王兆权

电话：022-28451861

传真：022-28451892

客服电话：28455588

网址：[www.ewww.com.cn](http://www.ewww.com.cn)

（45）方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](http://www.foundersc.com)

（46）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](http://www.dgzq.com.cn)

（47）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](http://www.ubssecurities.com)

(48) 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：汤世生

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](http://www.hysec.com)

(49) 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](http://www.cc168.com.cn)

(50) 国都证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区中心区金田路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](http://www.guodu.com)

(51) 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](http://www.bocichina.com.cn)

(52) 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](http://www.qlzq.com.cn)

(53) 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：潘锴

电话：85096709

客户服务电话：0431-96688-0、0431-85096733

网址：[www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

(54) 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：0451-82269286

客服热线：400-666-2288

联系人：葛新

网址：[www.jhzq.com.cn](http://www.jhzq.com.cn)

(55) 中国国际金融有限公司

注册地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

办公地址：北京市建国门外大街甲6号SK大厦

法定代表人：李剑阁

联系人：王雪筠

客服电话：010-85679238、010-85679169

网址：[www.ciccs.com.cn](http://www.ciccs.com.cn)

(56) 恒泰证券股份有限公司

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：张同亮

电话：021-68405273

网址：[www.cnht.com.cn](http://www.cnht.com.cn)

(57) 国金证券股份有限公司

注册地址：成都市东城根上街95号

办公地址：成都市东城根上街95号6、16、17楼

法定代表人：雷波

联系人：金喆

客户服务电话：028-86690126

网址：[www.gjzq.com.cn](http://www.gjzq.com.cn)

(58) 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](http://www.thope.com)

(59) 广发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8层

办公地址：福州市五四路157号新天地大厦8层

法定代表人：王比

客服电话：0591-87383623

联系人：张腾

传真：0591-87383610

网址：[www.gfhfzq.com.cn](http://www.gfhfzq.com.cn)

（60）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](http://www.ghzq.com.cn)

（61）江南证券有限责任公司

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：姚江涛

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](http://www.scstock.com)

（62）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.csc.com.cn](http://www.csc.com.cn)

电子邮箱：[liujh@csc.com.cn](mailto:liujh@csc.com.cn)

(63) 爱建证券有限责任公司

地址：上海市南京西路758号24楼

法定代表人：张建华

客服电话：021-63340678

联系人：陈敏

网址：www.ajzq.com

(64) 英大证券有限责任公司

地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层

法定代表人：赵文安

客服电话：0755-26982993

网址：www.vsun.com

(65) 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号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

客服电话：95536

联系人：齐晓燕

电话：0755-82130833

传真：0755-82133302

网址：www.guosen.com.cn

(66) 山西证券股份有限公司

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

### 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，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：涂珮施

#### **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，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，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 2009 年 6 月 30 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股份有限公司根据基金合同规定，于 2009 年 10 月 26 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2009年6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

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	6,426,416,212.84	93.69
	其中：股票	6,426,416,212.84	93.69
2	固定收益投资	-	0.00
	其中：债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
3	金融衍生品投资	-	0.00
4	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
5	银行存款和结算备付金合计	404,935,523.55	5.90
6	其他资产	28,216,863.82	0.41
7	合计	6,859,568,600.21	100.00

### 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	26,694,523.37	0.39
B	采掘业	756,700,959.57	11.06
C	制造业	1,608,898,712.44	23.52
C0	食品、饮料	246,500,590.06	3.60
C1	纺织、服装、皮毛	35,636,755.42	0.52
C2	木材、家具	3,509,892.54	0.05
C3	造纸、印刷	20,908,247.16	0.31

C4	石油、化学、塑胶、塑料	137,292,328.28	2.01
C5	电子	35,582,940.09	0.52
C6	金属、非金属	572,533,692.37	8.37
C7	机械、设备、仪表	418,739,059.98	6.12
C8	医药、生物制品	103,584,094.95	1.51
C99	其他制造业	34,611,111.59	0.51
D	电力、煤气及水的生产和供应业	246,124,687.80	3.60
E	建筑业	146,783,461.04	2.15
F	交通运输、仓储业	335,364,218.94	4.90
G	信息技术业	190,817,703.57	2.79
H	批发和零售贸易	199,152,919.94	2.91
I	金融、保险业	2,170,322,622.71	31.72
J	房地产业	481,063,787.74	7.03
K	社会服务业	98,238,777.31	1.44
L	传播与文化产业	15,048,004.84	0.22
M	综合类	151,205,833.57	2.21
	合计	6,426,416,212.84	93.93

3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	12,341,675	276,576,936.75	4.04
2	600016	民生银行	27,924,271	221,160,226.32	3.23
3	601328	交通银行	22,772,840	205,183,288.40	3.00
4	601166	兴业银行	5,192,363	192,688,590.93	2.82
5	600030	中信证券	6,765,489	191,192,719.14	2.79
6	601318	中国平安	3,853,702	190,604,100.92	2.79
7	600000	浦发银行	8,096,239	186,375,421.78	2.72
8	000002	万科A	14,360,761	183,099,702.75	2.68
9	601088	中国神华	4,892,905	146,346,788.55	2.14
10	601398	工商银行	21,883,488	118,608,504.96	1.73
11	601169	北京银行	6,381,032	103,755,580.32	1.52
12	000001	深发展A	4,545,622	99,185,472.04	1.45
13	600050	中国联通	12,410,779	85,137,943.94	1.24
14	601857	中国石油	5,762,807	83,445,445.36	1.22
15	600519	贵州茅台	552,575	81,786,625.75	1.20
16	601939	建设银行	13,173,963	79,438,996.89	1.16
17	600900	长江电力	5,510,811	75,938,975.58	1.11
18	600028	中国石化	5,940,583	63,326,614.78	0.93
19	002024	苏宁电器	3,940,367	63,321,697.69	0.93
20	600019	宝钢股份	8,690,112	61,178,388.48	0.89

21	601628	中国人寿	2,195,614	60,489,165.70	0.88
22	601006	大秦铁路	5,698,469	60,346,786.71	0.88
23	000858	五粮液	2,778,172	54,813,333.56	0.80
24	000983	西山煤电	1,774,140	53,046,786.00	0.78
25	600048	保利地产	1,846,670	51,503,626.30	0.75
26	601390	中国中铁	7,505,866	50,964,830.14	0.74
27	600383	金地集团	3,069,290	49,476,954.80	0.72
28	601601	中国太保	2,124,920	47,555,709.60	0.70
29	601919	中国远洋	3,222,792	43,733,287.44	0.64
30	601186	中国铁建	4,247,596	43,707,762.84	0.64
31	600739	辽宁成大	1,266,884	41,959,198.08	0.61
32	601988	中国银行	8,959,974	40,230,283.26	0.59
33	000069	华侨城 A	1,918,365	40,093,828.50	0.59
34	000402	金融街	2,831,893	38,966,847.68	0.57
35	000651	格力电器	1,850,100	38,667,090.00	0.57
36	600489	中金黄金	578,674	38,123,043.12	0.56
37	000792	盐湖钾肥	674,160	37,173,182.40	0.54
38	000063	中兴通讯	1,316,337	36,989,069.70	0.54
39	600089	特变电工	2,034,068	36,694,586.72	0.54
40	600015	华夏银行	2,847,977	35,685,151.81	0.52
41	000898	鞍钢股份	2,700,155	35,615,044.45	0.52
42	600005	武钢股份	4,473,037	35,247,531.56	0.52
43	601600	中国铝业	2,804,751	34,133,819.67	0.50
44	000623	吉林敖东	839,312	33,966,956.64	0.50
45	000629	攀钢钢钒	4,143,576	33,853,015.92	0.49
46	600018	上港集团	5,792,697	33,192,153.81	0.49
47	601009	南京银行	1,834,294	32,998,949.06	0.48
48	601898	中煤能源	2,575,218	31,778,190.12	0.46
49	600585	海螺水泥	750,497	31,625,943.58	0.46
50	000825	太钢不锈	4,007,123	30,774,704.64	0.45
51	600547	山东黄金	500,554	30,083,295.40	0.44
52	000568	泸州老窖	1,020,405	29,285,623.50	0.43
53	000024	招商地产	918,940	29,176,345.00	0.43
54	601899	紫金矿业	2,854,047	29,111,279.40	0.43
55	600550	天威保变	805,814	28,751,443.52	0.42
56	600011	华能国际	3,603,775	28,686,049.00	0.42
57	601666	平煤股份	988,189	28,568,543.99	0.42
58	600104	上海汽车	1,853,383	27,708,075.85	0.41
59	600320	振华重工	2,585,197	26,886,048.80	0.39
60	601699	潞安环能	651,065	25,710,556.85	0.38
61	600795	国电电力	3,586,089	24,995,040.33	0.37
62	600832	东方明珠	2,273,008	24,843,977.44	0.36
63	601168	西部矿业	1,626,021	24,780,560.04	0.36

64	600031	三一重工	781,372	22,480,072.44	0.33
65	000157	中联重科	996,537	22,252,671.21	0.33
66	000937	金牛能源	557,355	21,569,638.50	0.32
67	600583	海油工程	1,807,024	21,377,093.92	0.31
68	002142	宁波银行	1,634,689	21,022,100.54	0.31
69	600649	城投控股	1,502,579	20,720,564.41	0.30
70	600348	国阳新能	676,701	20,544,642.36	0.30
71	600415	小商品城	496,447	20,423,829.58	0.30
72	601958	金钼股份	1,260,253	20,353,085.95	0.30
73	600177	雅戈尔	1,458,814	20,117,045.06	0.29
74	000060	中金岭南	923,445	19,844,833.05	0.29
75	601998	中信银行	3,284,168	19,606,482.96	0.29
76	000839	中信国安	1,324,146	19,517,912.04	0.29
77	600635	大众公用	1,661,216	19,452,839.36	0.28
78	600009	上海机场	1,262,478	19,391,662.08	0.28
79	000630	铜陵有色	923,317	19,380,423.83	0.28
80	000527	美的电器	1,330,279	19,022,989.70	0.28
81	600325	华发股份	839,788	18,970,810.92	0.28
82	601333	广深铁路	3,703,286	18,923,791.46	0.28
83	600123	兰花科创	536,029	18,905,742.83	0.28
84	600895	张江高科	1,219,921	18,896,576.29	0.28
85	600642	申能股份	1,893,278	18,667,721.08	0.27
86	000709	唐钢股份	2,379,937	18,611,107.34	0.27
87	000878	云南铜业	821,734	17,733,019.72	0.26
88	600309	烟台万华	1,094,304	17,257,174.08	0.25
89	601001	大同煤业	470,925	17,132,251.50	0.25
90	600881	亚泰集团	2,102,434	16,672,301.62	0.24
91	600887	*ST 伊利	1,124,541	16,654,452.21	0.24
92	000425	徐工科技	491,660	16,214,946.80	0.24
93	000800	一汽轿车	1,048,774	16,193,070.56	0.24
94	000562	宏源证券	752,877	15,659,841.60	0.23
95	000338	潍柴动力	427,087	15,558,779.41	0.23
96	600675	中华企业	972,238	15,516,918.48	0.23
97	600100	同方股份	967,498	15,228,418.52	0.22
98	600997	开滦股份	797,194	14,899,555.86	0.22
99	600875	东方电气	373,197	14,517,363.30	0.21
100	600808	马钢股份	2,972,985	14,389,247.40	0.21
101	600655	豫园商城	820,588	14,179,760.64	0.21
102	601111	中国国航	2,016,493	14,155,780.86	0.21
103	000895	双汇发展	390,534	14,059,224.00	0.21
104	600362	江西铜业	414,739	13,964,262.13	0.20
105	600001	邯郸钢铁	2,506,602	13,961,773.14	0.20
106	000768	西飞国际	1,277,014	13,638,509.52	0.20

107	600196	复星医药	937,428	13,583,331.72	0.20
108	600690	青岛海尔	1,018,284	13,502,445.84	0.20
109	600663	陆家嘴	523,532	13,376,242.60	0.20
110	600029	南方航空	2,467,304	13,372,787.68	0.20
111	600717	天津港	1,077,487	13,069,917.31	0.19
112	601866	中海集运	2,963,652	13,069,705.32	0.19
113	600010	包钢股份	3,266,679	12,936,048.84	0.19
114	600068	葛洲坝	1,058,704	12,873,840.64	0.19
115	600153	建发股份	941,196	12,734,381.88	0.19
116	000046	泛海建设	636,971	12,675,722.90	0.19
117	000009	中国宝安	1,048,629	12,436,739.94	0.18
118	000100	TCL 集团	3,243,101	12,421,076.83	0.18
119	000031	中粮地产	1,113,838	12,408,155.32	0.18
120	600331	宏达股份	771,210	12,254,526.90	0.18
121	601808	中海油服	752,791	12,187,686.29	0.18
122	601588	北辰实业	2,013,948	12,144,106.44	0.18
123	600741	华域汽车	1,497,779	12,132,009.90	0.18
124	600694	大商股份	363,816	11,929,526.64	0.17
125	600111	包钢稀土	611,564	11,852,110.32	0.17
126	600208	新湖中宝	1,062,488	11,846,741.20	0.17
127	600660	福耀玻璃	1,409,055	11,568,341.55	0.17
128	600188	兖州煤业	739,112	11,530,147.20	0.17
129	000933	神火股份	559,658	11,193,160.00	0.16
130	600811	东方集团	1,300,556	11,041,720.44	0.16
131	600058	五矿发展	603,283	11,034,046.07	0.16
132	600598	北大荒	862,565	10,980,452.45	0.16
133	600664	哈药股份	784,428	10,950,614.88	0.16
134	600631	百联股份	834,171	10,894,273.26	0.16
135	600271	航天信息	674,108	10,711,576.12	0.16
136	600500	中化国际	895,897	10,643,256.36	0.16
137	000725	京东方 A	2,091,829	10,605,573.03	0.16
138	600643	爱建股份	814,703	10,566,697.91	0.15
139	000039	中集集团	1,073,893	10,556,368.19	0.15
140	000932	华菱钢铁	1,421,910	10,536,353.10	0.15
141	000538	云南白药	300,584	10,520,440.00	0.15
142	600150	中国船舶	165,115	10,478,197.90	0.15
143	600026	中海发展	801,336	10,345,247.76	0.15
144	600108	亚盛集团	2,027,682	10,138,410.00	0.15
145	600688	S 上石化	1,213,976	10,112,420.08	0.15
146	600528	中铁二局	854,948	10,019,990.56	0.15
147	600611	大众交通	739,372	9,922,372.24	0.15
148	600256	广汇股份	641,268	9,862,701.84	0.14
149	000652	泰达股份	1,309,678	9,783,294.66	0.14

150	601872	招商轮船	1,701,197	9,747,858.81	0.14
151	600497	驰宏锌锗	484,085	9,580,042.15	0.14
152	600220	江苏阳光	1,539,691	9,484,496.56	0.14
153	600596	新安股份	255,236	9,438,627.28	0.14
154	000686	东北证券	310,322	9,334,485.76	0.14
155	600110	中科英华	1,301,694	9,307,112.10	0.14
156	000423	东阿阿胶	518,473	9,301,405.62	0.14
157	600748	上实发展	526,495	9,097,833.60	0.13
158	600601	方正科技	2,120,577	9,097,275.33	0.13
159	000729	燕京啤酒	594,611	9,008,356.65	0.13
160	000960	锡业股份	396,702	8,997,201.36	0.13
161	600037	歌华有线	781,312	8,992,901.12	0.13
162	000897	津滨发展	1,610,025	8,903,438.25	0.13
163	600812	华北制药	1,024,822	8,618,753.02	0.13
164	600886	国投电力	821,650	8,569,809.50	0.13
165	000027	深圳能源	767,748	8,568,067.68	0.13
166	000718	苏宁环球	593,466	8,557,779.72	0.13
167	600428	中远航运	824,063	8,545,533.31	0.12
168	600600	青岛啤酒	320,776	8,529,433.84	0.12
169	600062	双鹤药业	354,844	8,509,159.12	0.12
170	000488	晨鸣纸业	1,093,917	8,423,160.90	0.12
171	000959	首钢股份	1,396,214	8,405,208.28	0.12
172	000401	冀东水泥	601,696	8,303,404.80	0.12
173	600432	吉恩镍业	364,476	8,218,933.80	0.12
174	600096	云天化	367,415	8,215,399.40	0.12
175	000680	山推股份	745,963	8,213,052.63	0.12
176	600638	新黄浦	590,000	8,183,300.00	0.12
177	600653	申华控股	1,763,690	8,077,700.20	0.12
178	600779	水井坊	481,113	7,957,609.02	0.12
179	000969	安泰科技	317,026	7,792,499.08	0.11
180	600269	赣粤高速	707,560	7,740,706.40	0.11
181	000012	南玻A	491,050	7,694,753.50	0.11
182	000422	湖北宣化	670,503	7,677,259.35	0.11
183	600022	济南钢铁	1,680,328	7,645,492.40	0.11
184	000667	名流置业	1,124,139	7,644,145.20	0.11
185	600143	金发科技	857,341	7,630,334.90	0.11
186	601918	国投新集	460,902	7,600,273.98	0.11
187	600839	四川长虹	1,610,300	7,584,513.00	0.11
188	600859	王府井	285,750	7,578,090.00	0.11
189	600266	北京城建	441,824	7,519,844.48	0.11
190	600820	隧道股份	630,668	7,498,642.52	0.11
191	600737	中粮屯河	617,673	7,498,550.22	0.11
192	601991	大唐发电	908,414	7,367,237.54	0.11

193	600674	川投能源	392,469	7,276,375.26	0.11
194	000778	新兴铸管	854,040	7,267,880.40	0.11
195	600006	东风汽车	1,538,528	7,261,852.16	0.11
196	600879	火箭股份	524,215	7,197,471.95	0.11
197	600170	上海建工	423,178	7,109,390.40	0.10
198	000758	中色股份	443,627	7,089,159.46	0.10
199	600132	重庆啤酒	356,618	7,046,771.68	0.10
200	000690	宝新能源	828,051	7,046,714.01	0.10
201	600008	首创股份	1,071,788	7,020,211.40	0.10
202	000783	长江证券	399,305	6,991,830.55	0.10
203	000625	长安汽车	837,721	6,819,048.94	0.10
204	000539	粤电力A	966,637	6,805,124.48	0.10
205	002128	露天煤业	252,584	6,749,044.48	0.10
206	000528	柳工	405,516	6,747,786.24	0.10
207	600125	铁龙物流	851,947	6,713,342.36	0.10
208	600158	中体产业	678,568	6,419,253.28	0.09
209	000968	煤气化	357,907	6,385,060.88	0.09
210	000807	云铝股份	746,919	6,378,688.26	0.09
211	600219	南山铝业	618,627	6,340,926.75	0.09
212	000089	深圳机场	812,120	6,269,566.40	0.09
213	000061	农产品	542,557	6,174,298.66	0.09
214	600508	上海能源	336,224	6,122,639.04	0.09
215	000917	电广传媒	393,956	6,055,103.72	0.09
216	000301	东方市场	997,556	6,035,213.80	0.09
217	000900	现代投资	328,771	6,013,221.59	0.09
218	000717	韶钢松山	1,236,572	5,935,545.60	0.09
219	600087	长航油运	939,728	5,816,916.32	0.09
220	600236	桂冠电力	726,830	5,756,493.60	0.08
221	600357	承德钒钛	683,630	5,749,328.30	0.08
222	600456	宝钛股份	250,325	5,732,442.50	0.08
223	600835	上海机电	448,435	5,695,124.50	0.08
224	600549	厦门钨业	306,183	5,679,694.65	0.08
225	600804	鹏博士	688,635	5,667,466.05	0.08
226	600210	紫江企业	1,009,761	5,664,759.21	0.08
227	600027	华电国际	1,080,169	5,638,482.18	0.08
228	600418	江淮汽车	959,070	5,610,559.50	0.08
229	000793	华闻传媒	1,142,554	5,587,089.06	0.08
230	600251	冠农股份	224,463	5,575,660.92	0.08
231	600588	用友软件	283,922	5,391,678.78	0.08
232	000021	长城开发	475,148	5,321,657.60	0.08
233	600066	宇通客车	428,152	5,249,143.52	0.08
234	002001	新和成	149,802	5,213,109.60	0.08
235	600426	华鲁恒升	317,965	5,208,266.70	0.08

236	600307	酒钢宏兴	377,728	5,133,323.52	0.08
237	600085	同仁堂	306,412	5,101,759.80	0.07
238	600117	西宁特钢	492,547	4,999,352.05	0.07
239	600747	大连控股	838,411	4,971,777.23	0.07
240	002202	金风科技	161,773	4,872,602.76	0.07
241	600616	金枫酒业	282,376	4,870,986.00	0.07
242	600109	国金证券	214,052	4,771,219.08	0.07
243	600151	航天机电	371,395	4,575,586.40	0.07
244	000503	海虹控股	660,796	4,566,100.36	0.07
245	600770	综艺股份	319,118	4,435,740.20	0.06
246	600098	广州控股	681,246	4,428,099.00	0.06
247	600033	福建高速	652,359	4,370,805.30	0.06
248	600004	白云机场	453,866	4,343,497.62	0.06
249	600020	中原高速	1,066,309	4,339,877.63	0.06
250	000822	山东海化	607,649	4,308,231.41	0.06
251	000951	中国重汽	179,501	4,290,073.90	0.06
252	000059	辽通化工	506,668	4,276,277.92	0.06
253	600685	广船国际	190,049	4,232,391.23	0.06
254	002097	山河智能	240,625	4,210,937.50	0.06
255	600569	安阳钢铁	944,663	4,194,303.72	0.06
256	000876	新希望	401,888	4,127,389.76	0.06
257	600282	南钢股份	725,328	4,112,609.76	0.06
258	000612	焦作万方	315,033	4,098,579.33	0.06
259	600350	山东高速	728,754	4,095,597.48	0.06
260	000088	盐田港	549,588	4,050,463.56	0.06
261	600316	洪都航空	188,827	4,040,897.80	0.06
262	600221	海南航空	741,022	3,979,288.14	0.06
263	002152	广电运通	154,801	3,978,385.70	0.06
264	600308	华泰股份	365,671	3,927,306.54	0.06
265	600639	浦东金桥	263,710	3,889,722.50	0.06
266	002155	辰州矿业	202,635	3,850,065.00	0.06
267	000829	天音控股	616,303	3,833,404.66	0.06
268	600183	生益科技	566,474	3,823,699.50	0.06
269	600115	ST东航	710,673	3,787,887.09	0.06
270	000927	一汽夏利	517,186	3,615,130.14	0.05
271	600021	上海电力	693,743	3,524,214.44	0.05
272	600978	宜华木业	651,186	3,509,892.54	0.05
273	600118	中国卫星	195,218	3,422,171.54	0.05
274	600837	海通证券	206,407	3,395,395.15	0.05
275	600809	山西汾酒	128,481	3,380,335.11	0.05
276	000912	泸天化	317,830	3,378,532.90	0.05
277	600595	中孚实业	315,702	3,283,300.80	0.05
278	600376	首开股份	153,888	3,256,270.08	0.05

279	600780	通宝能源	539,475	3,242,244.75	0.05
280	000559	万向钱潮	439,239	3,184,482.75	0.05
281	601003	柳钢股份	541,462	3,183,796.56	0.05
282	600863	内蒙华电	620,795	3,166,054.50	0.05
283	600961	株冶集团	233,812	3,154,123.88	0.05
284	600380	健康元	470,027	3,031,674.15	0.04
285	600591	*ST 上航	505,733	2,993,939.36	0.04
286	600270	外运发展	373,074	2,984,592.00	0.04
287	600102	莱钢股份	270,117	2,973,988.17	0.04
288	600017	日照港	456,656	2,908,898.72	0.04
289	600299	蓝星新材	233,994	2,697,950.82	0.04
290	600761	安徽合力	250,691	2,554,541.29	0.04
291	000755	山西三维	315,043	2,451,034.54	0.04
292	600597	光明乳业	334,692	2,352,884.76	0.03
293	000767	漳泽电力	477,564	2,115,608.52	0.03
294	000728	国元证券	109,722	2,016,690.36	0.03
295	600007	中国国贸	173,226	2,009,421.60	0.03
296	600874	创业环保	293,793	1,886,151.06	0.03
297	002146	荣盛发展	110,431	1,814,381.33	0.03
298	000543	皖能电力	222,674	1,768,031.56	0.03
299	601005	重庆钢铁	308,177	1,621,011.02	0.02
300	600548	深高速	233,573	1,373,409.24	0.02

#### 4. 报告期内股票投资组合的重大变动

##### (1) 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601328	交通银行	139,459,536.61	3.05
2	600000	浦发银行	68,153,037.92	1.49
3	601186	中国铁建	59,986,125.67	1.31
4	601169	北京银行	59,669,177.10	1.31
5	600036	招商银行	51,832,820.64	1.13
6	600016	民生银行	50,840,190.48	1.11
7	000629	攀钢钢钒	49,394,820.98	1.08
8	601318	中国平安	40,420,498.04	0.88
9	600030	中信证券	37,763,282.55	0.83
10	000002	万 科 A	30,476,559.50	0.67
11	601166	兴业银行	24,943,859.83	0.55
12	601088	中国神华	24,484,110.09	0.54
13	000623	吉林敖东	23,535,998.91	0.52
14	600900	长江电力	21,363,030.11	0.47

15	601398	工商银行	21,247,999.04	0.47
16	000725	京东方 A	19,710,558.69	0.43
17	601899	紫金矿业	19,192,012.38	0.42
18	000001	深发展 A	16,912,907.96	0.37
19	601958	金钼股份	15,166,199.01	0.33
20	600875	东方电气	14,741,058.54	0.32

注：本期累计买入金额指买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

(2) 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	97,985,124.44	2.14
2	600000	浦发银行	94,693,026.39	2.07
3	601318	中国平安	90,205,414.66	1.97
4	600030	中信证券	76,419,595.53	1.67
5	000002	万 科 A	55,962,563.34	1.22
6	600016	民生银行	51,470,165.37	1.13
7	000629	攀钢钢钒	50,064,458.59	1.10
8	601088	中国神华	48,108,875.78	1.05
9	601166	兴业银行	46,835,403.30	1.03
10	601328	交通银行	46,761,303.53	1.02
11	600900	长江电力	33,423,710.63	0.73
12	600050	中国联通	30,559,455.05	0.67
13	601857	中国石油	28,956,643.84	0.63
14	600519	贵州茅台	27,433,714.65	0.60
15	601398	工商银行	23,965,347.48	0.52
16	601939	建设银行	23,876,457.62	0.52
17	601169	北京银行	23,007,017.83	0.50
18	600028	中国石化	21,922,557.00	0.48
19	601006	大秦铁路	21,887,191.32	0.48
20	600875	东方电气	20,375,351.21	0.45

注：本期累计卖出金额指卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

(3) 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,393,289,179.49
卖出股票收入（成交）总额	2,129,444,771.71

注：上述金额均指成交金额（成交单价乘以成交数量），不考虑相关交易费用。

5. 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。

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五名债券明细

本基金本报告期末未持有债券。

7. 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

8. 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。

9. 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的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

（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

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	980,505.33
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	2,404,269.03
4	应收利息	68,064.24
5	应收申购款	24,764,025.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,216,863.82

（4）报告期末基金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）期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

（6）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

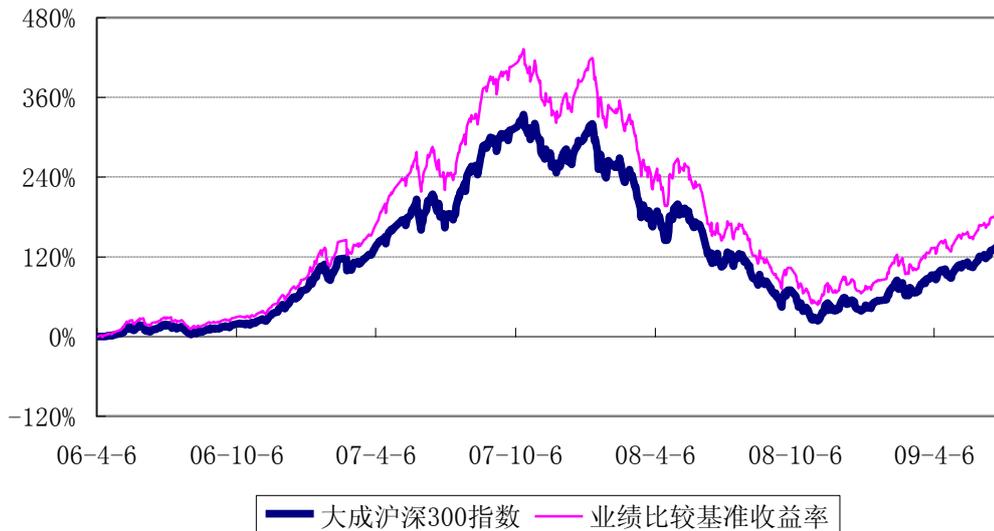
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

(一) 本报告期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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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%
2007.01.01-2007.12.31	133.11%	2.18%	161.57%	2.30%	-28.46%	-0.12%
2008.01.01-2008.12.31	-64.77%	2.90%	-65.95%	3.05%	1.18%	-0.15%
2009.01.01-2009.6.30	70.79%	1.87%	74.20%	1.96%	-3.41%	-0.09%
自基金合同生效起至今	136.56%	2.27%	187.02%	2.40%	-50.46%	-0.13%

(二) 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：

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 2009 年 6 月 30 日)



注：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。

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 类之一种。

### 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

A 类：前端收费模式	申购金额 M	前端申购费率
	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

B 类：后端收费方式	持有期限 T	后端申购费率
	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：

	持有期 T	适用的赎回费率
--	-------	---------

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 2009 年 5 月 4 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》（2009 年第 1 期）进行了补充和更新，主要修改内容如下：

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“八、基金的投资”部分。
5. 根据最新数据，更新了“九、基金的业绩”部分。
6. 根据最新公告，更新了“二十二、其他应披露的事项”。
7. 根据最新情况，更新了“二十三、招募说明书更新部分的说明”。

大成基金管理有限公司

2009年11月20日