

大成沪深 300 指数证券投资基金  
更新的招募说明书摘要  
2011 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

二〇一一年六月

## 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 2011 年 4 月 6 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2010 年 12 月 31 日（财务数据已经审计）。

## 一、基金管理人

### （一）基金管理人概况

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投资有限公司（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，下设十九个部门，分别是股票投资部、数量投资部、社保基金投资部、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、董事会办公室、人力资源部、计划财务部、行政部、基金运营部、监察稽核部和国际业务部。公司在北京、上海、西安、成都、武汉、福州、沈阳和广州等地设立了八家分公司，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2011年4月6日，本基金管理人共管理3只封闭式证券投资基金：景宏证券投资基金、景福证券投资基金、大成优选股票型证券投资基金，1只ETF及1只ETF联接基金：深证成长40ETF及大成深证成长40ETF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等权重指数基金及16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和大成保本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：

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。

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总经理；2007年6月—2007年8月，任中国人民保险集团公司高级专家；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。

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。

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。

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，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，现任浦东改革与发展研究院院长。

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。

#### 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。

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、市场部总经理、公司助理总经理。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。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

杨丹先生，基金经理，理学硕士，10 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。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。具有基金从业资格。

## (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，投资总监，大成优选股票型证券投资基金基金经理，投资决策委员会主席；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、大成核心双动力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、大成景丰分级债券型证券投资基金基金经理、大成保本混合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，大成财富管理 2020 生命周期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，股票投资部副总监，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；孙蓓琳，研究部总监助理，投资决策委员会委员。

上述人员之间不存在亲属关系。

## 二、基金托管人

### (一) 基金托管人概况

#### 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：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：项俊波

成立日期：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：010-63201510

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130余名,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2011年4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



93只，包括大成沪深300指数证券投资基金、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、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、泰达宏利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)、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、兴业沪深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。

## (二) 基金托管人的内部风险控制制度说明

### 1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

### 2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风险管理和内部控制工作进行进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,独立行使监督稽核职权。

### 3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理实行严格的复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;专门设置业务操作区,并实施封闭管理和音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

## (三) 基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统,每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作,并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时,基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理:

- 1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题，电话提示基金管理人；
- 2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题，以书面方式对基金管理人进行提示；
- 3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

### 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：王肇栋

公司网址：[www.dcfund.com.cn](http://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：0755-83195091

##### （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：李宁

2) 平安里

电话：010-85252345/46

传真：010-85252272/73

地址：北京市西城区平安里西大街 28 号光大国际中心 1601 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

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：朱君

电话：021-62185377、62185277

传真：021-62185233

(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

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：滕涛

电话：010-85109219

传真：010-85109219

网址：[www.abchina.com](http://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)

(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](http://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

联系人：田耕

电话：010-66107900

传真：010-66107914

网址：[www.icbc.com.cn](http://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：021-58408842

网址：[www.bankcomm.com](http://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](http://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：010-68098778

传真：010-68560312

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

(9) 北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

法定代表人：闫冰竹

联系人：王曦

电话：010-66223584

传真：010-66226073

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

（10）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：孙建一

电话：0755-22197874

传真：0755-22197701

联系人：蔡宇洲

客户服务热线：0755-961202、4006699999

网址：[www.18ebank.com](http://www.18ebank.com)

（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](http://www.gdb.com.cn)

（12）杭州银行股份有限公司

地址：杭州市凤起路 432 号

法定代表人：马时雍

联系人：严峻

电话：0571-85108195

传真：0571-85106576

客服电话：0571-96523、4008888508

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

(13) 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：肖遂宁

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

(14) 江苏银行股份有限公司

地址：南京市洪武北路 55 号

法定代表人：黄志伟

联系人：田春慧

客户服务电话：96098、400-86-96098

电话：025-58588167

传真：025-58588164

网址：[www.jsbchina.cn](http://www.jsbchina.cn)

(15) 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

电话：0769-22119061

传真：0769-22117730

客服电话：96228

网址：[www.dongguanbank.cn](http://www.dongguanbank.cn)

(16) 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

（17）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

（18）华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

客服电话：95577

法定代表人：吴建

联系人：董金

电话：010-85238441

传真：010-85238680

网址：www.hxb.com.cn

（19）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

（20）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](http://www.bankofluoyang.com.cn)

(21) 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

联系人：胡技勋

电话：021-63586210

传真：021-63586215

客服电话：96528（宁波、杭州、南京、深圳、苏州、温州）

962528（北京、上海）

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

(22) 青岛银行股份有限公司

地址：青岛市市南区香港中路 68 号华普大厦

法定代表人：张广鸿

联系人：滕克

客服电话：96588（青岛）、400-66-96588（全国）

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

(23) 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](http://www.cmbc.com.cn)

(24) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人：宫少林

客服电话：4008888111、95565

联系人：林生迎

电话：0755-82960223

传真：0755-82943636

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

(25) 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](http://www.nesc.cn)

(26) 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：顾伟国

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)

(27) 华泰联合证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层（01A、02、03、04）、  
17A、18A、24A、25A、26A

法定代表人：马昭明

客服电话：400-8888-555、95513

联系人：盛宗凌

电话：0755-82492000

传真：0755-82492962

网址：www.lhzq.com

（28）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

（29）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：祝幼一

客服电话：95521

联系人：芮敏祺

电话：021-38676666

传真：021-38670161

网址：www.gtja.com

（30）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

（31）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 A 层

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

(32) 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：4008001001

联系人：陈剑虹

电话：0755-82825551

传真：0755-82558355

网址：www.essence.com.cn

(33) 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：400-888-8788、95525

联系人：刘晨、李芳芳

电话：021-22169081

传真：021-22169134

网址：www.ebscn.com

(34) 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](http://www.zxwt.com.cn)

(35) 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 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：0519-88157761

传真：0519-8157761

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

(36) 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

法定代表人：刘军

客服电话：0571-96598

联系人：俞会亮

电话：0571-85776115

传真：0571-85783771

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

(37) 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：吴志明

客服电话：020-961303

联系人：林洁茹

联系电话：020-87322668

传真：020-87325036

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

(38) 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：4008816168

联系人：郑舒丽

电话：0755-22626391

传真：0755-82400862

网址：www.pingan.com

（39）华泰证券有限责任公司

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

（40）湘财证券股份有限公司

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：林俊波

客服电话：400-888-1551

联系人：钟康莺

电话：021-68634518-8503

传真：021-68865938

网址：www.xcsc.com

（41）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

（42）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：蒋元真

客服电话：021-962518

联系人：王伟力

电话：021-53519888

传真：021-54670436

网址：www.962518.com

（43）华安证券有限责任公司

注册地址：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

（44）兴业证券股份有限公司

注册地址：福建省福州市湖东路 99 号标力大厦

法定代表人：兰荣

客户服务电话：4008888123

联系人：谢高得

电话：021-38565785

传真：021-38565783

网址：www.xyzq.com.cn

（45）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

法定代表人：沈继宁

客户联系电话：96336、021-962336

联系人：乔骏

电话：0571-87925129

传真：0571-87925100

网址：www.ctsec.com

（46）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：谢项辉

电话：0571-87901053

客服电话：967777

网址：www.stocke.com.cn

（47）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：张志军

联系人：王兆权

电话：022-28451861

传真：022-28451892

客服电话：4006515988

网址：www.bhzq.com

（48）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：0731-85832507

传真：0731-85832214

网址：www.foundersc.com

（49）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

## (50) 瑞银证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层

法定代表人：刘弘

电话：010-58328752

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)

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

## (52) 长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：黄耀华

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：[new.cgws.com](http://new.cgws.com)

## (53) 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

(54) 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

联系人：杨玲

电话：0755-82707855

传真：0755-82707850

网址：www.chinalions.com

(55) 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

(56) 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

(57) 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

（58）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

（59）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：0471-4913998

传真：0471-4930707

网址：www.cnht.com.cn

（60）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：金喆

电话：028-86690126

传真：028-86690126

网址：www.gjzq.com.cn

（61）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：姚江涛

客服电话：4008866567

联系人：余雅娜

电话：0791-6768763

传真：0791-6789414

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

(62) 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](http://www.ajzq.com)

(63) 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、4008-698-698

联系人：王睿

电话：0755-83007069

传真：0755-83007167

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

(64) 华西证券有限责任公司

注册地址：四川省成都市陕西街 239 号

法定代表人：杨炯洋

客户服务热线：4008888818

联系人：金达勇

电话：0755-83025723

传真：0755-83025991

网址：[www.hx168.com.cn](http://www.hx168.com.cn)

(65) 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](http://www.glsc.com.cn)

(66) 天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

法定代表人：林义相

客服电话：010-66045678

联系人：潘鸿

传真：010-66045500

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

(67) 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](http://www.cindasc.com)

(68) 华宝证券经纪有限责任公司

地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 23 层

法定代表人：陈林

客户服务电话：400-820-9898

联系人：徐方亮

电话：021-50122222

传真：021-50122220

网址：www.cnhbstock.com

(69) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼

法定代表人：王志伟

客服电话：95575

联系人：黄岚

电话：020-87555888

传真：020-87555305

网址：www.gf.com.cn

(70) 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.csc.com.cn

(71) 中国建银投资证券有限责任公司

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 18 层至 20 层

办公地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋 18 层至 20 层

法定代表人：杨明辉

联系人：刘权

电话：0755-82026521

传真：0755-82026539

网址：www.cjis.cn

(72) 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)

(73) 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

法定代表人：张佑君

客服电话：4008888108

联系人：权唐

电话：010-85130577

传真：010-65182261

网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

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

(75) 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](http://www.rxzq.com.cn)

(76) 华龙证券有限责任公司

注册地址：甘肃省兰州市静宁路 308 号

法定代表人：李晓安



联系人：李昕田

联系电话：0931-8490208

甘肃省客服电话：96668

网址：www.hlzqgs.com

（77）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

（78）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 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

（79）大通证券股份有限公司

客服电话：4008-169-169

联系人：谢立军

电话：0411-39673202

网址：www.daton.com.cn

（80）中原证券股份有限公司

地址：郑州市经三路 15 号广汇国际贸易大厦

法定代表人：石保上

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

(81) 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](http://www.swsc.com.cn)

(82) 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

### 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](http://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，周刚

电话：010-58153000

传真：010-85188298

联系人：李妍明

## 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 2010 年 12 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股份有限公司根据基金合同规定，于 2011 年 4 月 13 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 2010 年 12 月 31 日，本报告中所列财务数据已经审计。

### 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	8,073,253,779.58	94.38
	其中：股票	8,073,253,779.58	94.38
2	固定收益投资	2,757,762.77	0.03
	其中：债券	2,757,762.77	0.03
	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	475,807,218.37	5.56
6	其他资产	2,174,213.44	0.03
7	合计	8,553,992,974.16	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	35,040,305.37	0.41
B	采掘业	1,026,465,172.82	12.02

C	制造业	2,807,789,922.80	32.87
C0	食品、饮料	429,434,530.50	5.03
C1	纺织、服装、皮毛	27,667,074.82	0.32
C2	木材、家具	-	0.00
C3	造纸、印刷	9,026,019.38	0.11
C4	石油、化学、塑胶、塑料	199,503,538.63	2.34
C5	电子	33,297,653.32	0.39
C6	金属、非金属	750,347,661.51	8.78
C7	机械、设备、仪表	1,010,259,496.67	11.83
C8	医药、生物制品	317,148,909.05	3.71
C99	其他制造业	31,105,038.92	0.36
D	电力、煤气及水的生产和供应业	246,482,035.15	2.89
E	建筑业	255,469,769.05	2.99
F	交通运输、仓储业	334,226,578.39	3.91
G	信息技术业	255,839,560.73	2.99
H	批发和零售贸易	248,551,539.15	2.91
I	金融、保险业	2,172,030,382.64	25.42
J	房地产业	419,621,666.53	4.91
K	社会服务业	71,778,844.34	0.84
L	传播与文化产业	13,309,893.05	0.16
M	综合类	186,648,109.56	2.18
	合计	8,073,253,779.58	94.50

### 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

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	5,139,975	288,660,996.00	3.38
2	600036	招商银行	19,571,363	250,709,160.03	2.93
3	601328	交通银行	32,942,432	180,524,527.36	2.11
4	600016	民生银行	35,748,109	179,455,507.18	2.10
5	601166	兴业银行	6,638,572	159,657,656.60	1.87
6	600000	浦发银行	11,228,407	139,119,962.73	1.63
7	600030	中信证券	11,016,681	138,700,013.79	1.62
8	601088	中国神华	5,218,888	128,958,722.48	1.51
9	000002	万科A	15,320,070	125,930,975.40	1.47
10	601601	中国太保	4,974,720	113,921,088.00	1.33
11	600519	贵州茅台	597,326	109,860,197.92	1.29
12	601398	工商银行	24,436,450	103,610,548.00	1.21
13	000858	五粮液	2,958,969	102,469,096.47	1.20
14	002024	苏宁电器	6,544,372	85,731,273.20	1.00
15	600900	长江电力	10,443,778	79,059,399.46	0.93
16	601169	北京银行	6,899,141	78,926,173.04	0.92

17	601939	建设银行	15,454,553	70,936,398.27	0.83
18	600050	中国联通	13,218,436	70,718,632.60	0.83
19	600031	三一重工	3,251,191	70,323,261.33	0.82
20	000063	中兴通讯	2,555,875	69,775,387.50	0.82
21	000001	深发展 A	4,322,368	68,250,190.72	0.80
22	601899	紫金矿业	8,212,916	67,428,040.36	0.79
23	601857	中国石油	5,857,873	65,725,335.06	0.77
24	000983	西山煤电	2,442,591	65,192,753.79	0.76
25	601668	中国建筑	18,988,928	64,942,133.76	0.76
26	600089	特变电工	3,290,428	61,399,386.48	0.72
27	600362	江西铜业	1,347,226	60,854,198.42	0.71
28	600837	海通证券	6,295,216	60,685,882.24	0.71
29	600547	山东黄金	1,125,901	59,346,241.71	0.69
30	000651	格力电器	3,075,678	55,762,042.14	0.65
31	600111	包钢稀土	777,735	55,561,388.40	0.65
32	600348	国阳新能	1,930,658	55,371,271.44	0.65
33	600028	中国石化	6,685,448	53,884,710.88	0.63
34	000338	潍柴动力	1,012,524	53,025,881.88	0.62
35	600019	宝钢股份	8,190,524	52,337,448.36	0.61
36	000527	美的电器	3,005,820	52,301,268.00	0.61
37	600585	海螺水泥	1,712,445	50,825,367.60	0.59
38	601168	西部矿业	2,692,903	50,734,292.52	0.59
39	600015	华夏银行	4,642,170	50,599,653.00	0.59
40	600256	广汇股份	1,193,042	50,024,251.06	0.59
41	601628	中国人寿	2,338,453	49,809,048.90	0.58
42	000792	盐湖钾肥	728,908	48,282,865.92	0.57
43	601766	中国南车	6,303,976	47,595,018.80	0.56
44	601006	大秦铁路	6,046,023	47,279,899.86	0.55
45	002202	金风科技	2,114,049	47,143,292.70	0.55
46	600489	中金黄金	1,142,411	46,084,859.74	0.54
47	000568	泸州老窖	1,119,251	45,777,365.90	0.54
48	600048	保利地产	3,566,746	45,297,674.20	0.53
49	000423	东阿阿胶	863,984	44,149,582.40	0.52
50	600104	上海汽车	2,963,287	43,501,053.16	0.51
51	000157	中联重科	3,072,871	43,450,395.94	0.51
52	601699	潞安环能	717,733	42,805,596.12	0.50
53	600739	辽宁成大	1,409,182	42,444,561.84	0.50
54	000060	中金岭南	1,743,290	39,224,025.00	0.46
55	600415	小商品城	1,092,410	38,278,046.40	0.45
56	000425	徐工机械	666,003	38,095,371.60	0.45
57	600068	葛洲坝	3,262,202	37,841,543.20	0.44
58	600795	国电电力	12,337,957	37,754,148.42	0.44
59	601958	金钼股份	1,554,128	37,672,062.72	0.44



60	600518	康美药业	1,904,260	37,532,964.60	0.44
61	600875	东方电气	1,068,555	37,292,569.50	0.44
62	601989	中国重工	3,116,715	36,746,069.85	0.43
63	601299	中国北车	5,175,836	36,696,677.24	0.43
64	601988	中国银行	11,323,298	36,574,252.54	0.43
65	600690	青岛海尔	1,289,424	36,374,651.04	0.43
66	600383	金地集团	5,774,875	35,688,727.50	0.42
67	000630	铜陵有色	988,285	34,639,389.25	0.41
68	601390	中国中铁	7,995,469	34,620,380.77	0.41
69	601111	中国国航	2,519,305	34,464,092.40	0.40
70	601009	南京银行	3,455,433	34,347,004.02	0.40
71	601919	中国远洋	3,571,591	33,572,955.40	0.39
72	601186	中国铁建	4,775,200	32,375,856.00	0.38
73	000039	中集集团	1,404,928	32,299,294.72	0.38
74	601898	中煤能源	2,938,775	31,915,096.50	0.37
75	000895	双汇发展	363,527	31,626,849.00	0.37
76	601666	平煤股份	1,458,052	30,750,316.68	0.36
77	601618	中国中冶	7,821,690	30,582,807.90	0.36
78	601600	中国铝业	3,010,846	30,529,978.44	0.36
79	000069	华侨城 A	2,494,584	30,309,195.60	0.35
80	600100	同方股份	1,084,664	28,754,442.64	0.34
81	000009	中国宝安	1,649,774	27,666,709.98	0.32
82	600664	哈药股份	1,196,450	27,003,876.50	0.32
83	000538	云南白药	445,868	26,930,427.20	0.32
84	601607	上海医药	1,215,646	26,549,708.64	0.31
85	000878	云南铜业	953,970	26,234,175.00	0.31
86	600029	南方航空	2,678,593	26,089,495.82	0.31
87	600132	重庆啤酒	467,426	25,909,423.18	0.30
88	000402	金融街	3,888,068	25,700,129.48	0.30
89	600018	上港集团	6,622,345	25,231,134.45	0.30
90	600188	兖州煤业	887,665	25,200,809.35	0.29
91	000528	柳工	680,407	25,175,059.00	0.29
92	600309	烟台万华	1,308,781	25,115,507.39	0.29
93	600011	华能国际	4,321,372	24,891,102.72	0.29
94	600655	豫园商城	1,846,137	24,830,542.65	0.29
95	000709	河北钢铁	6,624,551	24,709,575.23	0.29
96	600166	福田汽车	1,015,232	24,649,832.96	0.29
97	000933	神火股份	976,678	24,465,783.90	0.29
98	000768	西飞国际	1,988,953	24,145,889.42	0.28
99	600583	海油工程	2,953,631	23,924,411.10	0.28
100	600123	兰花科创	507,577	23,896,725.16	0.28
101	000623	吉林敖东	699,708	23,818,060.32	0.28
102	000783	长江证券	2,091,596	23,635,034.80	0.28

103	000825	太钢不锈	4,415,518	23,578,866.12	0.28
104	000012	南 玻 A	1,192,336	23,548,636.00	0.28
105	002142	宁波银行	1,852,031	22,965,184.40	0.27
106	000898	鞍钢股份	2,961,736	22,894,219.28	0.27
107	600660	福耀玻璃	2,185,919	22,427,528.94	0.26
108	600694	大商股份	471,576	22,347,986.64	0.26
109	601001	大同煤业	1,037,896	21,806,194.96	0.26
110	600005	武钢股份	5,033,774	21,544,552.72	0.25
111	000969	安泰科技	927,750	21,505,245.00	0.25
112	601808	中海油服	841,767	21,498,729.18	0.25
113	000401	冀东水泥	906,216	21,413,884.08	0.25
114	000937	冀中能源	533,614	21,371,240.70	0.25
115	002007	华兰生物	436,977	21,145,317.03	0.25
116	600832	东方明珠	2,464,398	20,972,026.98	0.25
117	600881	亚泰集团	3,086,900	20,682,230.00	0.24
118	600550	天威保变	891,234	20,578,593.06	0.24
119	600999	招商证券	1,084,417	20,560,546.32	0.24
120	000960	锡业股份	624,233	20,412,419.10	0.24
121	600058	五矿发展	617,397	20,188,881.90	0.24
122	000800	一汽轿车	1,235,910	19,836,355.50	0.23
123	600600	青岛啤酒	558,658	19,374,259.44	0.23
124	600497	驰宏锌锗	753,263	19,351,326.47	0.23
125	600271	航天信息	698,591	19,218,238.41	0.22
126	600196	复星医药	1,425,328	19,199,168.16	0.22
127	600009	上海机场	1,546,900	19,166,091.00	0.22
128	600642	申能股份	2,504,209	19,107,114.67	0.22
129	600352	浙江龙盛	1,603,169	18,805,172.37	0.22
130	600812	华北制药	1,192,385	18,732,368.35	0.22
131	600997	开滦股份	922,951	18,579,003.63	0.22
132	600320	振华重工	2,835,614	18,516,559.42	0.22
133	600177	雅戈尔	1,691,336	18,469,389.12	0.22
134	000729	燕京啤酒	968,746	18,396,486.54	0.22
135	601998	中信银行	3,409,772	17,901,303.00	0.21
136	600970	中材国际	439,571	17,894,935.41	0.21
137	600549	厦门钨业	374,985	17,845,536.15	0.21
138	000024	招商地产	1,106,180	17,643,571.00	0.21
139	002155	辰州矿业	479,387	17,219,581.04	0.20
140	000839	中信国安	1,428,710	17,115,945.80	0.20
141	000758	中色股份	540,520	17,048,000.80	0.20
142	600395	盘江股份	492,427	16,028,498.85	0.19
143	600143	金发科技	993,927	16,012,163.97	0.19
144	601866	中海集运	3,571,499	16,000,315.52	0.19
145	600741	华域汽车	1,562,839	15,956,586.19	0.19

146	600221	海南航空	1,769,964	15,876,577.08	0.19
147	000680	山推股份	863,374	15,704,773.06	0.18
148	002304	洋河股份	68,363	15,313,312.00	0.18
149	000422	湖北宣化	808,864	15,247,086.40	0.18
150	600125	铁龙物流	1,042,810	15,037,320.20	0.18
151	600811	东方集团	1,899,215	14,889,845.60	0.17
152	000999	华润三九	580,252	14,825,438.60	0.17
153	000562	宏源证券	884,069	14,799,315.06	0.17
154	600010	包钢股份	3,889,147	14,739,867.13	0.17
155	000778	新兴铸管	1,649,845	14,733,115.85	0.17
156	600169	太原重工	688,616	14,681,293.12	0.17
157	600062	双鹤药业	514,793	14,666,452.57	0.17
158	601333	广深铁路	4,225,503	14,577,985.35	0.17
159	600598	北大荒	1,095,189	14,489,350.47	0.17
160	000728	国元证券	1,174,513	14,399,529.38	0.17
161	600331	宏达股份	927,013	14,377,971.63	0.17
162	000061	农产品	813,582	14,327,179.02	0.17
163	600219	南山铝业	1,429,064	13,861,920.80	0.16
164	600649	城投控股	1,704,750	13,552,762.50	0.16
165	600601	方正科技	3,294,217	13,473,347.53	0.16
166	600631	百联股份	877,450	13,381,112.50	0.16
167	600216	浙江医药	405,278	13,199,904.46	0.15
168	600208	新潮中宝	2,199,345	13,196,070.00	0.15
169	600516	方大炭素	940,413	13,175,186.13	0.15
170	600153	建发股份	2,004,588	13,130,051.40	0.15
171	600809	山西汾酒	190,143	13,030,499.79	0.15
172	000100	TCL 集团	3,793,064	13,010,209.52	0.15
173	600108	亚盛集团	1,977,093	13,009,271.94	0.15
174	600150	中国船舶	190,325	12,894,518.75	0.15
175	600085	同仁堂	371,611	12,738,825.08	0.15
176	600118	中国卫星	507,747	12,602,280.54	0.15
177	600432	吉恩镍业	487,626	12,473,473.08	0.15
178	000876	新希望	594,408	12,452,847.60	0.15
179	600635	大众公用	1,860,338	12,408,454.46	0.15
180	600879	航天电子	922,057	12,392,446.08	0.15
181	600508	上海能源	437,242	12,369,576.18	0.14
182	600595	中孚实业	895,606	12,359,362.80	0.14
183	000951	中国重汽	445,911	12,333,898.26	0.14
184	600808	马钢股份	3,612,569	12,318,860.29	0.14
185	600500	中化国际	1,027,000	12,169,950.00	0.14
186	601918	国投新集	842,469	11,836,689.45	0.14
187	600312	平高电气	867,841	11,828,672.83	0.14
188	000612	焦作万方	539,658	11,764,544.40	0.14

189	600688	S 上石化	1,383,574	11,732,707.52	0.14
190	600418	江淮汽车	1,102,781	11,722,562.03	0.14
191	601888	中国国旅	378,212	11,713,225.64	0.14
192	000021	长城开发	989,889	11,621,296.86	0.14
193	600037	歌华有线	914,720	11,434,000.00	0.13
194	000652	泰达股份	1,467,393	11,416,317.54	0.13
195	600096	云天化	426,782	11,399,347.22	0.13
196	600737	中粮屯河	712,732	11,296,802.20	0.13
197	600316	洪都航空	421,998	11,292,666.48	0.13
198	600066	宇通客车	534,920	11,249,367.60	0.13
199	600008	首创股份	1,670,570	11,242,936.10	0.13
200	600643	爱建股份	1,170,531	11,143,455.12	0.13
201	601688	华泰证券	794,028	10,894,064.16	0.13
202	002001	新 和 成	430,630	10,873,407.50	0.13
203	600588	用友软件	467,071	10,864,071.46	0.13
204	600779	水井坊	489,275	10,861,905.00	0.13
205	600596	新安股份	705,329	10,735,107.38	0.13
206	600839	四川长虹	2,849,408	10,542,809.60	0.12
207	600717	天津港	1,235,137	10,301,042.58	0.12
208	002122	天马股份	762,952	10,116,743.52	0.12
209	000807	云铝股份	841,567	10,048,309.98	0.12
210	000690	宝新能源	1,804,179	9,977,109.87	0.12
211	000059	辽通化工	859,340	9,959,750.60	0.12
212	002028	思源电气	376,324	9,886,031.48	0.12
213	601179	中国西电	1,249,560	9,871,524.00	0.12
214	002128	露天煤业	382,486	9,761,042.72	0.11
215	000725	京东方 A	3,083,745	9,744,634.20	0.11
216	600528	中铁二局	1,069,491	9,710,978.28	0.11
217	000718	苏宁环球	1,034,396	9,671,602.60	0.11
218	600895	张江高科	1,100,885	9,665,770.30	0.11
219	600663	陆家嘴	573,986	9,642,964.80	0.11
220	600210	紫江企业	1,660,864	9,599,793.92	0.11
221	600325	华发股份	939,028	9,521,743.92	0.11
222	000027	深圳能源	939,837	9,482,955.33	0.11
223	000897	津滨发展	1,802,250	9,389,722.50	0.11
224	000625	长安汽车	985,790	9,374,862.90	0.11
225	000968	煤 气 化	358,381	9,307,154.57	0.11
226	600183	生益科技	816,186	9,296,358.54	0.11
227	600269	赣粤高速	1,668,063	9,291,110.91	0.11
228	600675	中华企业	1,330,020	9,203,738.40	0.11
229	600220	江苏阳光	1,775,615	9,197,685.70	0.11
230	601727	上海电气	1,079,925	9,157,764.00	0.11
231	000488	晨鸣纸业	1,278,473	9,026,019.38	0.11

232	000780	平庄能源	571,937	8,767,794.21	0.10
233	600456	宝钛股份	323,171	8,757,934.10	0.10
234	600517	置信电气	527,346	8,743,396.68	0.10
235	600026	中海发展	899,278	8,633,068.80	0.10
236	600718	东软集团	535,505	8,589,500.20	0.10
237	600380	健康元	769,992	8,523,811.44	0.10
238	000900	现代投资	401,642	8,253,743.10	0.10
239	000686	东北证券	368,123	8,205,461.67	0.10
240	000031	中粮地产	1,309,245	8,156,596.35	0.10
241	600161	天坛生物	355,153	8,133,003.70	0.10
242	000959	首钢股份	1,836,456	8,117,135.52	0.10
243	601872	招商轮船	1,964,729	8,075,036.19	0.09
244	600428	中远航运	959,745	8,004,273.30	0.09
245	601588	北辰实业	2,269,295	7,942,532.50	0.09
246	601117	中国化学	1,342,908	7,762,008.24	0.09
247	600863	内蒙华电	809,111	7,670,372.28	0.09
248	000667	名流置业	2,532,444	7,622,656.44	0.09
249	600820	隧道股份	693,508	7,607,782.76	0.09
250	600251	冠农股份	265,272	7,541,682.96	0.09
251	600170	上海建工	514,155	7,501,521.45	0.09
252	600151	航天机电	558,125	7,339,343.75	0.09
253	600266	北京城建	594,676	7,260,993.96	0.08
254	600300	维维股份	1,198,443	7,070,813.70	0.08
255	600674	川投能源	477,303	7,035,446.22	0.08
256	600426	华鲁恒升	503,431	6,962,450.73	0.08
257	600611	大众交通	900,868	6,873,622.84	0.08
258	600087	长航油运	1,394,253	6,776,069.58	0.08
259	600804	鹏博士	777,921	6,744,575.07	0.08
260	600033	福建高速	1,883,316	6,685,771.80	0.08
261	600239	云南城投	356,468	6,619,610.76	0.08
262	600022	济南钢铁	1,855,109	6,585,636.95	0.08
263	601107	四川成渝	985,680	6,535,058.40	0.08
264	600816	安信信托	468,845	6,376,292.00	0.07
265	600369	西南证券	543,985	6,326,545.55	0.07
266	600109	国金证券	427,057	6,243,573.34	0.07
267	601991	大唐发电	1,016,630	6,191,276.70	0.07
268	600835	上海机电	573,922	6,077,833.98	0.07
269	000717	韶钢松山	1,608,531	6,048,076.56	0.07
270	600597	光明乳业	584,276	5,994,671.76	0.07
271	002244	滨江集团	530,690	5,986,183.20	0.07
272	000046	泛海建设	645,160	5,793,536.80	0.07
273	600886	国投电力	796,332	5,709,700.44	0.07
274	000932	华菱钢铁	1,473,621	5,408,189.07	0.06

275	600004	白云机场	603,834	5,325,815.88	0.06
276	600236	桂冠电力	1,207,046	5,311,002.40	0.06
277	600307	酒钢宏兴	556,358	5,257,583.10	0.06
278	000927	一汽夏利	638,926	5,207,246.90	0.06
279	000961	中南建设	448,892	5,130,835.56	0.06
280	600006	东风汽车	1,049,577	5,079,952.68	0.06
281	600376	首开股份	295,361	4,976,832.85	0.06
282	000089	深圳机场	899,541	4,974,461.73	0.06
283	601139	深圳燃气	373,595	4,636,313.95	0.05
284	600748	上实发展	574,402	4,635,424.14	0.05
285	600246	万通地产	767,785	4,445,475.15	0.05
286	600027	华电国际	1,321,647	4,308,569.22	0.05
287	600569	安阳钢铁	1,272,675	4,301,641.50	0.05
288	002242	九阳股份	282,216	4,252,995.12	0.05
289	601099	太平洋	376,797	4,092,015.42	0.05
290	600017	日照港	998,838	4,075,259.04	0.05
291	600350	山东高速	830,376	3,877,855.92	0.05
292	601003	柳钢股份	778,083	3,843,730.02	0.04
293	000685	中山公用	208,437	3,639,310.02	0.04
294	600657	信达地产	568,266	3,477,787.92	0.04
295	601877	正泰电器	127,806	3,060,953.70	0.04
296	600282	南钢股份	867,589	2,975,830.27	0.03
297	600102	莱钢股份	343,539	2,696,781.15	0.03
298	000631	顺发恒业	361,148	2,531,647.48	0.03
299	601801	皖新传媒	123,985	1,875,893.05	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	600036	招商银行	169,722,083.33	2.18
2	601328	交通银行	122,943,105.16	1.58
3	601318	中国平安	120,482,419.97	1.55
4	601166	兴业银行	115,201,214.61	1.48
5	600016	民生银行	113,383,210.03	1.46
6	601668	中国建筑	94,438,658.93	1.21
7	600030	中信证券	90,622,553.15	1.16
8	600000	浦发银行	84,878,216.71	1.09
9	601899	紫金矿业	68,510,612.77	0.88
10	601601	中国太保	65,321,255.45	0.84
11	601088	中国神华	63,711,248.20	0.82

12	000002	万 科 A	60,769,795.59	0.78
13	601398	工商银行	51,470,631.65	0.66
14	601169	北京银行	46,653,607.16	0.60
15	601618	中国中冶	44,568,869.14	0.57
16	600519	贵州茅台	41,708,451.81	0.54
17	000063	中兴通讯	41,556,559.78	0.53
18	600900	长江电力	41,010,041.46	0.53
19	600089	特变电工	40,245,695.10	0.52
20	600104	上海汽车	40,034,614.53	0.51

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	121,287,118.03	1.56
2	600016	民生银行	88,834,987.41	1.14
3	601328	交通银行	80,128,543.93	1.03
4	601166	兴业银行	78,121,791.49	1.00
5	600030	中信证券	74,380,657.37	0.95
6	601318	中国平安	68,963,206.60	0.89
7	600000	浦发银行	59,755,721.28	0.77
8	601088	中国神华	51,255,414.99	0.66
9	000002	万 科 A	50,089,116.74	0.64
10	601601	中国太保	49,164,376.40	0.63
11	601398	工商银行	36,295,283.89	0.47
12	601169	北京银行	36,016,024.07	0.46
13	600104	上海汽车	34,755,468.83	0.45
14	600519	贵州茅台	32,355,411.75	0.42
15	000858	五 粮 液	31,798,559.76	0.41
16	000001	深发展 A	31,257,804.17	0.40
17	600837	海通证券	31,220,739.01	0.40
18	000629	*ST 钒钛	30,444,817.43	0.39
19	600900	长江电力	30,369,715.21	0.39
20	002024	苏宁电器	28,976,229.74	0.37

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	4,260,434,085.44
卖出股票收入（成交）总额	2,821,299,542.49

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. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	-	0.00
	其中：政策性金融债	-	0.00
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	-	0.00
6	可转债	2,757,762.77	0.03
7	其他	-	0.00
8	合计	2,757,762.77	0.03

#### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110011	歌华转债	11,510	1,414,463.90	0.02
2	126729	燕京转债	9,957	1,343,298.87	0.02

#### 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）报告期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	566,195.63
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-



4	应收利息	95,412.01
5	应收申购款	1,512,605.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,174,213.44

(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无流通受限情况。

(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。

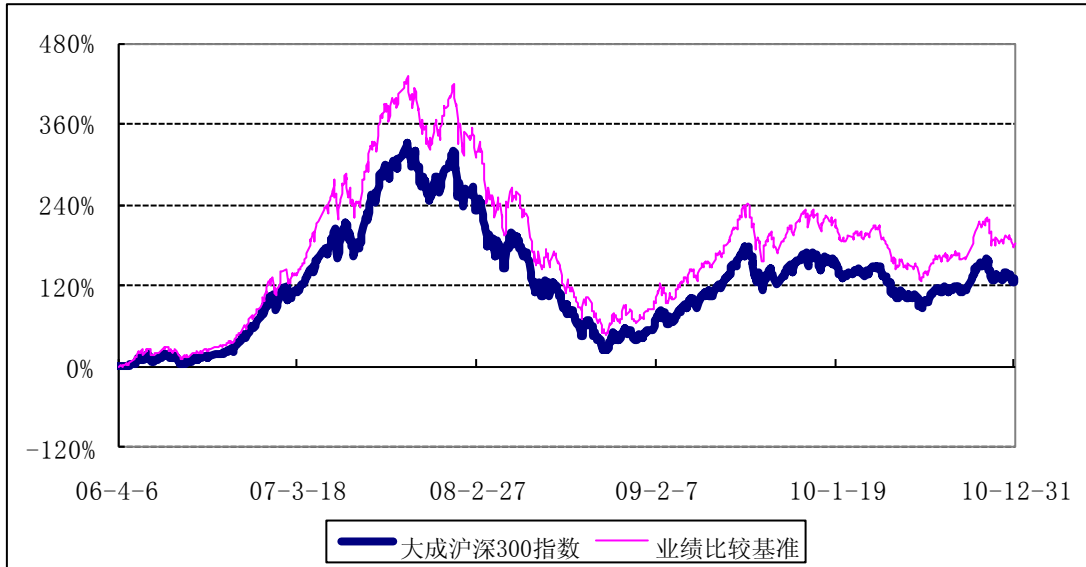
(一) 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较：

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%
2009.01.01-2009.12.31	90.08%	1.95%	96.71%	2.06%	-6.63%	-0.11%
2010.01.01-2010.12.31	-12.67%	1.51%	-12.51%	1.58%	-0.16%	-0.07%
2006.04.06-2010.12.31	129.92%	2.11%	183.55%	2.22%	-53.63%	-0.11%

(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 2010 年 12 月 31 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：

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 2010 年 11 月 23 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》（2010 年第 2 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. 根据最新资料，更新了“十二、基金资产评估”部分。
7. 根据最新公告，更新了“二十二、其他应披露的事项”。

8. 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

二〇一一年六月十四日