

大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金

上市交易公告书

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：深圳证券交易所

上市日期：2013 年 3 月 5 日

公告日期：2013 年 2 月 28 日

目 录

一、重要声明与提示.....	2
二、基金概览.....	2
三、基金份额的募集与上市交易.....	3
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人.....	5
五、基金主要当事人简介.....	6
六、基金合同摘要.....	10
七、基金财务状况.....	11
八、基金投资组合.....	12
九、重大事件揭示.....	14
十、基金管理人承诺.....	15
十一、基金托管人承诺.....	15
十二、基金上市推荐人意见.....	15
十三、备查文件目录.....	16
附件：大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同摘要.....	17

一、重要声明与提示

《大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》（以下简称“本公告书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 1 号〈上市交易公告书的内容与格式〉》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，大成基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）的董事会及董事保证本公告书所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）托管人中国银行股份有限公司保证本公告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和深圳证券交易所（以下简称“深交所”）对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

凡本公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在 2013 年 1 月 16 日《证券时报》及大成基金管理有限公司网站（www.dcfund.com.cn）上的《大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）。

二、基金概览

- 1、基金名称：大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金
- 2、基金类型：股票型
- 3、基金运作方式：交易型开放式
- 4、基金场内简称：100ETF
- 5、基金代码：159923
- 6、标的指数简称：中证 100 指数
- 7、标的指数代码：399903
- 8、基金份额总额：399,285,812.00 份（截至：2013 年 2 月 26 日）
- 9、基金份额净值：0.997 元（截至：2013 年 2 月 26 日）
- 10、本次上市交易份额：399,285,812.00 份（截至：2013 年 2 月 26 日）
- 11、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

12、上市交易日期：2013年3月5日

13、基金管理人：大成基金管理有限公司（网站：www.dcfund.com.cn）

14、基金托管人：中国银行股份有限公司

15、登记结算机构：中国证券登记结算有限责任公司

16、申购赎回代办券商：中国银河证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司。

三、基金份额的募集与上市交易

（一）上市前基金募集情况

1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会证监许可【2012】1699号

2、基金合同生效日：2013年2月7日

3、基金运作方式：交易型开放式

4、基金合同期限：不定期

5、发售日期：2013年1月21日至2013年2月1日。其中，网下现金认购和网上现金认购的日期为2013年1月21日起到2013年2月1日，网下股票认购的日期为2013年1月28日起到2013年2月1日

6、发售价格：1.00元人民币

7、份额发售方式：网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购3种方式

8、发售机构：

（1）网上现金发售代理机构

具有基金代销业务资格及深圳证券交易所会员资格的证券公司

（2）网下现金及网下股票发售机构

大成基金管理有限公司

（3）网下股票发售代理机构

中信证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、国都证券有限责任公司、渤海证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投股份有限公司、民生证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、爱建证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、国金证券股份有

限公司、国泰君安证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、上海证券有限责任公司、申银万国证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中信证券（浙江）有限责任公司、东海证券有限责任公司、浙商证券有限责任公司、财富证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、江海证券有限公司、招商证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、长城证券有限责任公司、广州证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、东莞证券有限责任公司、广发证券股份有限公司、金元证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、长城证券有限责任公司。

9、验资机构名称：普华永道中天会计师事务所

10、募集资金总额及入账情况：

本次募集的净认购金额为 399,268,419.00 元人民币（含所募集股票市值），认购款项在本基金验资确认日之前产生的银行利息共计 17,393.00 元人民币。本次募集的净认购金额已于 2013 年 2 月 7 日全额划入本基金在基金托管人中国银行股份有限公司开立的大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金托管专户。利息将由中国证券登记结算公司于下一季度银行结息日（2013 年 3 月 21 日）划付至中国银行开立的中国证券登记结算公司的结算备付金账户。

本次募集有效认购户数为 4,046 户，按照每份基金份额面值 1.00 元人民币计算，本次募集资金及其产生的利息结转的基金份额共计 399,285,812.00 份，已全部计入各基金份额持有人的基金账户。

11、本基金募集备案情况：本基金于 2013 年 2 月 7 日验资完毕，2013 年 2 月 7 日向中国证监会提交了验资报告，办理基金备案手续，并于 2013 年 2 月 7 日获得书面确认，本基金合同自该日起正式生效。

12、基金合同生效日：2013 年 2 月 7 日

13、基金合同生效日的基金份额总额：399,285,812.00 份。

（二）本基金日常申购、赎回情况

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理申购、赎回。基金管理人在申购开始日、赎回开始日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

（三）本基金日常申购、赎回安排

本基金日常申购、赎回开放日：2013 年 3 月 5 日。

（四）本基金上市交易的主要内容

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上【2013】71 号

2、上市交易日期：2013年3月5日

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。

投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。

4、基金场内简称：100ETF

5、基金交易代码：159923

6、本次上市交易的基金份额：399,285,812.00份

7、未上市交易份额的流通规定：本基金上市交易后，所有的基金份额均可进行交易，不存在未上市交易的基金份额。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）截至2013年2月26日，本基金持有人户数为4,046户，平均每户持有的基金份额：98,686.56份

截至2013年2月26日，机构投资者持有的基金份额为81,095,529.00份，占基金总份额的比例为20.31%；个人投资者持有的基金份额为318,190,283.00份，占基金总份额的比例为79.69%。

（二）基金份额前十名持有人情况：

截至2013年2月26日，本基金前十名基金份额持有人情况

序号	持有人名称(全称)	持有基金份额(份)	占基金总份额的比例
1	华汇人寿保险股份有限公司—自有资金	40,002,166	10.02%
2	丁碧霞	40,001,166	10.02%
3	东航集团财务有限责任公司	10,000,583	2.50%
4	张绍霞	10,000,291	2.50%
5	中信证券股份有限公司	8,000,233	2.00%
6	李洁	5,847,738	1.46%
7	颜金棍	5,000,340	1.25%
8	世兴科技创业投资有限公司	5,000,340	1.25%
9	光大证券—工行—光大阳光混合优选（阳光6号）集合资产管理计划	5,000,144	1.25%
10	光大证券—工行—光大阳光新兴产业集合资产管理计划	5,000,144	1.25%

合计		133,853,145	33.50%
----	--	-------------	--------

注：以上信息依据中国证券登记结算有限公司提供的持有人信息编制。

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、名称：大成基金管理有限公司

2、法定代表人：张树忠

3、总经理：王颢

4、注册资本：贰亿元人民币

5、注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层

6、批准设立机关及设立批准文号：中国证券监督管理委员会证监基金字【1999】10 号

7、法人营业执照文号：440301102808319

8、经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务

9、股东及持股比例：公司股东为中泰信托有限责任公司、中国银河投资管理有限公司、光大证券股份有限公司和广东证券股份有限公司，各股东持股比例分别为 48%、25%、25%、2%。

10、内部组织结构及职能：大成基金管理有限公司设有股东会、董事会、监事会，下设二十个部门，分别是股票投资部、数量投资部、社保基金及机构投资部、固定收益部、委托投资部、研究部、交易管理部、产品开发与金融工程部、信息技术部、客户服务部、市场部、总经理办公室、董事会办公室、人力资源部、计划财务部、行政部、基金运营部、监察稽核部、风险管理部和国际业务部。公司在北京、上海、西安、成都、武汉、福州、沈阳、广州和南京等地设立了九家分公司，并在香港设立了子公司。此外，公司还设立了投资决策委员会、投资风险控制委员会和战略规划委员会等专业委员会。

公司以“责任、回报、专业、进取”为经营理念，坚持“诚实信用、勤勉尽责”的企业精神，致力于开拓基金及证券市场业务，以稳健灵活的投资策略和注重绩优、高成长的投资组合，力求为投资者获得更大投资回报。公司所有人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。

11、人员情况：截止 2013 年 2 月 26 日，公司共有员工 285 名，大学本科及以上学历 255 名，占员工总数 89%。

12、信息披露负责人及咨询电话：杜鹏，0755-83183388

13、基金管理业务情况简介：截至 2013 年 2 月 26 日，本基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金：景宏证券投资基金、景福证券投资基金，3 只 ETF 及 2 只 ETF 联接基金：深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金及大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金、大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金，1 只创新型基金：大成景丰分级债券型证券投资基金，1 只 QDII 基金：大成标普 500 等权重指数证券投资基金及 25 只开放式证券投资基金：大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成货币市场证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金、大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成强化收益债券型证券投资基金、大成策略回报股票型证券投资基金、大成行业轮动股票型证券投资基金、大成中证红利指数证券投资基金、大成核心双动力股票型证券投资基金、大成保本混合型证券投资基金、大成景恒保本混合型证券投资基金、大成内需增长股票型证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金、大成中证内地消费主题指数证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、大成优选股票型证券投资基金(LOF)、大成月添利理财债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场证券投资基金和大成理财 21 天债券型发起式证券投资基金。

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

（二）基金托管人

1、公司概况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

首次注册登记日期：1983 年 10 月 31 日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：肖钢

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

托管及投资者服务部总经理：李爱华

托管部门信息披露联系人：唐州徽

电话：（010）66594855

传真：（010）66594942

2、基金托管部门及主要人员情况

中国银行于 1998 年设立基金托管部，为进一步树立以投资者为中心的服务理念，中国银行于 2005 年 3 月 23 日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部，现有员工 120 余人。另外，中国银行在重点分行已开展托管业务。

目前，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险基金、QFII、QDII、券商资产管理计划、信托计划、年金基金、理财产品、私募基金、资金托管等门类齐全的托管产品体系。在国内，中国银行率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，为各类客户提供个性化的托管服务，托管资产规模居同业前列。

3、基金托管业务经营情况

截至 2012 年 12 月末，中国银行已托管长盛创新先锋混合、长盛同盛封闭、长盛同智优势混合（LOF）、大成 2020 生命周期混合、大成蓝筹稳健混合、大成优选 LOF、大成景宏封闭、工银大盘蓝筹股票、工银核心价值股票、国泰沪深 300 指数、国泰金鹿保本混合、国泰金鹏蓝筹混合、国泰区位优势股票、国投瑞银稳定增利债券、海富通股票、海富通货币、海富通精选贰号混合、海富通收益增长混合、海富通中证 100 指数（LOF）、华宝兴业大盘精选股票、华宝兴业动力组合股票、华宝兴业先进成长股票、华夏策略混合、华夏大盘精选混合、华夏回报二号混合、华夏回报混合、华夏行业股票（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实成长收益混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实沪深 300 指数（LOF）、嘉实货币、嘉实稳健混合、嘉实研究精选股票、嘉实增长混合、嘉实债券、嘉实主题混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票型、金鹰成份优选股票、金鹰行业优势股票、银河成长股票、易方达平稳增长混合、易方达策略成长混合、易方达策略成长二号混合、易方达积极成长混合、易方达货币、易方

达稳健收益债券、易方达深证 100ETF、易方达中小盘股票、易方达深证 100ETF 联接、万家 180 指数、万家稳健增利债券、银华优势企业混合、银华优质增长股票、银华领先策略股票、景顺长城动力平衡混合、景顺长城优选股票、景顺长城货币、景顺长城鼎益股票(LOF)、泰信天天收益货币、泰信优质生活股票、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、招商先锋混合、泰达宏利精选股票、泰达宏利集利债券、泰达宏利中证财富大盘指数、华泰柏瑞盛世中国股票、华泰柏瑞积极成长混合、华泰柏瑞价值增长股票、华泰柏瑞货币、华泰柏瑞量化现行业股票型、南方高增长股票(LOF)、国富潜力组合股票、国富强化收益债券、国富成长动力股票、宝盈核心优势混合、招商行业领先股票、东方核心动力股票、华安行业轮动股票型、摩根士丹利华鑫强收益债券型、诺德中小盘股票型、民生加银稳健成长股票型、博时宏观回报债券型、易方达岁丰添利债券型、富兰克林国海中小盘股票型、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接、上证中小盘交易型开放式指数、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接、长城中小盘成长股票型、易方达医疗保健行业股票型、景顺长城稳定收益债券型、上证 180 金融交易型开放式指数、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接、诺德优选 30 股票型、泰达宏利聚利分级债券型、国联安优选行业股票型、长盛同鑫保本混合型、金鹰中证技术领先指数增强型、泰信中证 200 指数、大成内需增长股票型、银华永祥保本混合型、招商深圳电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数、招商深证 TMT50 交易型开放式指数证券投资基金联接、嘉实深证基本面 120 交易型开放式指数证券投资基金联接、深证基本面 120 交易型开放式指数、上证 180 成长交易型开放式指数、华宝兴业上证 180 成长交易型开放式指数证券投资基金联接、易方达资源行业股票型、华安深证 300 指数、嘉实信用债券型、平安大华行业先锋股票型、华泰柏瑞信用增利债券型、泰信中小盘精选股票型、海富通国策导向股票型、中邮上证 380 指数增强型、泰达宏利中证 500 指数分级、长盛同禧信用增利债券型、银华中证内地资源主题指数分级、平安大华深证 300 指数增强型、嘉实安心货币市场、上投摩根健康品质生活股票型、工银瑞信睿智中证 500 指数分级、招商优势企业灵活配置混合型、国泰中小板 300 成长交易型开放式指数、国泰中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金联接、景顺长城优信增利债券型、诺德周期策略股票型、长盛电子信息产业股票型、诺安中证创业成长指数分级、信诚双盈分级债券型、嘉实沪深 300 交易型开放式指数、民生加银信用双利债券型、工银瑞信基本面量化策略股票型、信诚周期轮动股票型、富兰克林国海研究精选股票型、诺安汇鑫保本混合型、平安大华策略先锋混合型、华宝兴业中证短融 50 指数债券型、180 等权重交易型开放式指数、华安双月鑫短期理财债券型、大成

景恒保本混合型、景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接、上投摩根分红添利债券型、嘉实优化红利股票型、长盛同鑫二号保本混合型、招商信用增强债券型、华宝兴业资源优选股票型、中证 500 沪市交易型开放式指数、大成中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金联接、博时医疗保健行业股票型、诺德深证 300 指数分级、华夏安康信用优选债券型、汇添富多元收益债券型、广发双债添利债券型、长盛添利 30 天理财债券型、信诚理财 7 日盈债券型、长盛添利 60 天理财债券型发起式、平安大华添利债券型、大成理财 21 天债券型发起式、华泰柏瑞稳健收益债券型、信诚添金分级债券型、国泰现金管理货币市场、国投瑞银纯债债券型、银华中证中票 50 指数债券型、华安信用增强债券型、长盛同丰分级债券型、嘉实海外中国股票(QDII)、银华全球优选(QDII-FOF)、长盛环球景气行业大盘精选股票型(QDII)、华泰柏瑞亚洲领导企业股票型(QDII)、信诚金砖四国积极配置(QDII)、海富通大中华精选股票型(QDII)、招商标普金砖四国指数(LOF-QDII)、华宝兴业成熟市场动量优选(QDII)、大成标普 500 等权重指数(QDII)、长信标普 100 等权重指数(QDII)、博时抗通胀增强回报(QDII)、华安大中华升级股票型(QDII)、信诚全球商品主题(QDII)、上投摩根全球天然资源股票型、工银瑞信中国机会全球配置股票型(QDII)、易方达标普全球高端消费品指数增强型(QDII)、建信全球资源股票型(QDII)、恒生交易型开放式指数(QDII)、恒生交易型开放式指数证券投资基金联接(QDII)、广发纳斯达克 100 指数(QDII) 等 189 只证券投资基金，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

(三) 基金验资机构

- 1、名称：普华永道中天会计师事务所
- 2、住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大楼 6 楼
- 3、办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大楼 3 楼
- 4、法定代表人：杨绍信
- 5、经办注册会计师：薛竞、刘颖
- 6、电话：021-23238888
- 7、传真：021-23238800

六、基金合同摘要

详见本公告书附件。

七、基金财务状况

本基金募集期间发生的信息披露费、会计师费、律师费及其他费用由基金管理人承担，不从基金财产列支，其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率或佣金比例收取认购费。

本基金认购后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

大成中证100交易型开放式指数证券投资基金2013年2月26日资产负债表(未经审计)
如下：

单位：人民币元

项目	时间	2013年2月26日
资 产：		
银行存款		374,608,100.00
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产		23,460,204.00
其中：股票投资		23,460,204.00
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
衍生金融资产		-
买入返售金融资产		-
应收证券清算款		-
其他资产		159,744.28
资产总计		398,228,048.28
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债		-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		103,979.84
应付托管费		20,795.97
其他负债		14,775.41
负债合计		139,551.22
所有者权益：		
实收基金		399,285,812.00

未分配利润	-1,197,314.94
所有者权益合计	398,088,497.06
负债和所有者权益总计	398,228,048.28

附注：截至 2013 年 2 月 26 日本基金发行在外的基金份额为 399,285,812.00 份，基金份额净值为 0.997 元。

八、基金投资组合

截至 2013 年 2 月 26 日，本基金的投资组合如下：

（一）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	23,460,204.00	5.89
	其中：股票	23,460,204.00	5.89
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	374,608,100.00	94.07
6	其他资产	159,744.28	0.04
7	合计	398,228,048.28	100.00

（二）按行业分类的股票投资组合

1、指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	131,330.00	0.03
B	采掘业	3,928,564.00	0.99
C	制造业	10,046,063.00	2.52
C0	食品、饮料	5,381,041.00	1.35
C1	纺织、服装、皮毛	-	0.00
C2	木材、家具	-	0.00
C3	造纸、印刷	-	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	0.00
C5	电子	-	0.00
C6	金属、非金属	3,688,218.00	0.93

C7	机械、设备、仪表	976,804.00	0.25
C8	医药、生物制品	-	0.00
C99	其他制造业	-	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	1,505,273.00	0.38
E	建筑业	1,817,123.00	0.46
F	交通运输、仓储业	811,296.00	0.20
G	信息技术业	1,344,313.00	0.34
H	批发和零售贸易	74,670.00	0.02
I	金融、保险业	3,194,336.00	0.80
J	房地产业	447,216.00	0.11
K	社会服务业	160,020.00	0.04
L	传播与文化产业	-	0.00
M	综合类	-	0.00
	合计	23,460,204.00	5.89

2、积极投资按行业分类的股票投资组合

2013年2月26日，本基金未持有积极投资股票。

(三) 按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

1、指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	21,100	3,742,507.00	0.94
2	601318	中国平安	34,400	1,546,968.00	0.39
3	000858	五粮液	62,700	1,543,674.00	0.39
4	601600	中国铝业	308,000	1,484,560.00	0.37
5	601857	中国石油	142,200	1,264,158.00	0.32
6	601618	中国中冶	540,700	1,140,877.00	0.29
7	600900	长江电力	150,000	1,074,000.00	0.27
8	600050	中国联通	294,900	1,029,201.00	0.26
9	601899	紫金矿业	242,600	883,064.00	0.22
10	600019	宝钢股份	151,700	738,779.00	0.19

2、积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名股票投资明细

2013年2月26日，本基金未持有积极投资股票。

(四) 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

2013年2月26日，本基金未持有权证。

(五) 按债券品种分类的债券投资组合

2013年2月26日，本基金未持有债券。

(六) 按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

2013年2月26日, 本基金未持有债券。

(七) 按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

2013年2月26日, 本基金未持有资产支持证券。

(八) 投资组合报告附注

1、本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查, 在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

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

3、2013年2月26日其他资产构成:

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	142,351.28
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	17,393.00
9	合计	159,744.28

4、2013年2月26日持有的处于转股期的可转换债券明细

2013年2月26日, 本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5、2013年2月26日前十名股票中存在流通受限情况的说明

(1) 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

2013年2月26日, 本基金指数投资的前十名股票中不存在流通受限情况。

(2) 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

2013年2月26日, 本基金未持有积极投资股票。

6、投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因, 分项之和与合计可能有尾差。

九、重大事件揭示

无。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、《基金合同》的规定，设立专门的基金托管部，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。

（二）根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

（三）基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规规定的行为，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，督促基金管理人改正。

（四）基金托管人发现基金管理人重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

十二、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

十三、备查文件目录

（一）备查文件目录

- 1、中国证监会核准大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- 2、《大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3、《大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- 4、《大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 5、关于大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金募集之法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 8、中国证监会要求的其他文件

（二）存放地点：基金管理人和基金托管人的办公场所

（三）查阅方式：基金投资者可在营业时间免费查阅，或通过指定的信息披露媒体、本基金管理人网站（www.dcfund.com.cn）查阅，但应以基金合同正本为准。

大成基金管理有限公司
二〇一三年二月二十八日

附件：大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同摘要

以下内容摘自《大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

（一）基金份额持有人的权利与义务

1、基金管理人的权利

- （1）依法募集基金，办理基金备案手续；
- （2）依照法律法规和基金合同独立管理运用基金资产；
- （3）根据法律法规、基金合同、相关证券交易所及登记结算机构相关业务规则的规定，制订、修改并公布有关基金认购、申购、赎回、收益分配等方面的业务规则；
- （4）根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式，获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
- （5）根据法律法规和基金合同的规定销售基金份额；
- （6）在本合同的有效期内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本合同的情况进行必要的监督。如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金资产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会和中国银监会，以及采取其他必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；
- （7）根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议和有关法律法规对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；
- （8）自行担任基金登记结算机构或选择、更换基金登记结算机构，办理基金登记结算业务，并按照基金合同规定对基金登记结算机构进行必要的监督和检查；
- （9）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；
- （10）在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资融券和参与转融通；
- （11）依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益分配方案；
- （12）按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其他证券所产生的权利；
- （13）在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；
- （14）依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；

(15) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；

(16) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(17) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

2、基金管理人的义务

(1) 依法申请并募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

(2) 办理基金备案手续；

(3) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产；

(4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金资产；

(5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金资产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理、分别记账，进行证券投资；

(6) 按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

(7) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金资产；

(8) 进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；

(9) 依法接受基金托管人的监督；

(10) 编制季度、半年度和年度基金报告；

(11) 采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购价格、申购对价、赎回对价的方法符合基金合同等法律文件的规定；

(12) 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回对价，编制申购赎回清单；

(13) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

(14) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；

(15) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付投资者申购或赎回之基金份额的对价；

(16) 保存基金资产管理业务活动的记录、账册、报表、代表基金签订的重大合同及其

他相关资料；

(17) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(18) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

(19) 组织并参加基金资产清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；

(20) 因违反基金合同导致基金资产的损失或损害基金份额持有人的合法权益，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 基金托管人违反基金合同造成基金资产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 法律法规、基金合同及中国证监会规定的其它义务。

(二) 基金托管人的权利与义务

1、基金托管人的权利

(1) 依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金资产；

(2) 依照基金合同的约定获得基金托管费；

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作；

(4) 在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；

(5) 依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；

(6) 法律法规、基金合同规定的其它权利。

2、基金托管人的义务

(1) 安全保管基金资产；

(2) 设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金资产托管事宜；

(3) 按规定开设基金资产的资金账户和证券账户；

(4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得以基金资产为自己及任何第三人谋取非法利益，不得委托第三人托管基金资产；

(5) 对所托管的不同基金资产分别设置账户，确保基金资产的完整和独立；

(6) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(7) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

(8) 按照基金合同的约定，根据基金管理人的指令，及时办理清算、交割事宜；

(9) 保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金

信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；

(10) 根据法律法规及本合同的约定，办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(11) 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告的相关内容出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

(12) 保管基金份额持有人名册；

(13) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回对价的现金部分；

(14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(15) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回对价的现金部分；

(16) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

(17) 按照法律法规监督基金管理人的投资运作；

(18) 因过错违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其责任不因其退任而免除；

(19) 因基金管理人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿，除法律法规另有规定外，基金托管人不承担连带责任；

(20) 法律法规、基金合同及中国证监会规定的其它义务。

(三) 基金份额持有人的权利与义务

1、基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，基金投资者自依据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当事人。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。每份基金份额具有同等的合法权益。

2、基金份额持有人的权利

(1) 分享基金资产收益；

(2) 参与分配清算后的剩余基金资产；

(3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；

(4) 按照规定要求召开或自行召集基金份额持有人大会；

(5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金份额销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- (9) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

3、基金份额持有人的义务

- (1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- (2) 缴纳基金认购款项和认购股票、应付申购对价和赎回对价及基金合同规定的费用；
- (3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- (4) 不从事任何有损基金、其他基金份额持有人及其他基金合同当事人合法利益的活动；
- (5) 执行基金份额持有人大会的决议；
- (6) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (7) 遵守基金管理人、销售机构和登记结算机构的相关交易及业务规则；
- (8) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- (9) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

(一) 本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人组成。基金份额持有人可委托代理人参加会议并行使表决权。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

(二) 鉴于本基金和本基金的联接基金的相关性，本基金联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金的基金份额直接出席或者委派代表出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。在计算参会份额和计票时，联接基金持有人持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为，在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，联接基金持有本基金份额的总数乘以该持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。

联接基金的基金管理人不应以联接基金的名义代表联接基金的全体基金份额持有人以本基金的基金份额持有人的身份行使表决权，但可接受联接基金的特定基金份额持有人的委托以联接基金的基金份额持有人代理人的身份出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。

联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会的，须先遵照联接基金《基金合同》的约定召开联接基金的基金份额持有人大会，联接基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集本基金份额持有人大会的，由联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会。

（三）有以下情形之一时，应召开基金份额持有人大会：

- 1、终止基金合同；
- 2、转换基金运作方式；
- 3、提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- 4、更换基金管理人、基金托管人；
- 5、变更基金类别；
- 6、变更基金投资目标、范围或策略；
- 7、变更基金份额持有人大会议事程序、表决方式和表决程序；
- 8、本基金与其他基金合并；
- 9、终止基金上市，但被深圳证券交易所决定终止上市的除外；
- 10、对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；
- 11、法律法规或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

（四）有以下情形之一的，不需召开基金份额持有人大会：

- 1、调低基金管理费率、基金托管费率；
- 2、在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；
- 3、因相应的法律法规、相关证券交易所或者登记结算机构的相关业务规则发生变动以及中国证监会的相关规定，应当对基金合同进行修改；
- 4、对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生实质性变化；
- 5、对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- 6、基金管理人、相关证券交易所和登记结算机构在法律法规、基金合同规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、交易、转托管、非交易过户等业务的规则；
- 7、除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

（五）召集方式：

1、除法律法规或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

2、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

3、单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%，以基金管理人收到提议当日的基金份额数量计算，下同）的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。

基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，单独或合计代表基金份额 10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。

基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

4、单独或合计代表基金份额 10%的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。

5、基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

6、基金份额持有人大会的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

（六）通知

召开基金份额持有人大会，召集人应当于会议召开前 30 天在至少一种指定媒体上公告。基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

1、会议召开的时间、地点、方式；

2、会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；

3、授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份、代理权限等）、授权委托证明送达时间和地点；

4、出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

5、会务常设联系人姓名、电话；

6、权益登记日；

7、如采用通讯表决方式，还应载明具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容。

（七）开会方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会、通讯方式开会或法律法规及监管机构允许的其他开会方式。现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席；通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。会议的召开方式由召集人确定。

现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

1、亲自出席会议者持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、本基金合同和会议通知的规定；

2、经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，全部有效凭证所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50% 以上。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

1、召集人按基金合同规定公布会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；

2、召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见，基金管理人或基金托管人经通知拒不参加收取和统计书面表决意见的，不影响表决效力；

3、本人直接出具书面表决意见或授权他人代表出具书面表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50% 以上；

4、直接出具书面表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面表决意见的其他代表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与登记结算机构记录相符；

5、会议通知公布前已报中国证监会备案。

如果开会条件达不到上述的条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间（至少应在 25 个工作日后），且确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日应保持不变。

在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表

决。

（八）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

（1）议事内容限为本条前述第（三）款规定的基金份额持有人大会召开事由范围内的事项。

（2）基金管理人、基金托管人、单独或合计代表基金份额 10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

（3）对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

a、关联性。大会召集人认为基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

b、程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

（4）代表基金份额 10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获得基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

（5）基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

在现场开会的方式下，首先由召集人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议，报经中国证监会核准或备案后生效。在通讯表决开会的方式下，首先由召集人在会议通知中公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内由大会聘请的公证机关的公证员统计全部有效表决并形成决议，报经中国证监会核准或备案后生效。

（九）表决

1、基金份额持有人所持每份基金份额享有平等的表决权，基金份额持有人可以委托代理人出席基金份额持有人大会并行使表决权。

2、基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

(1) 特别决议

对于特别决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过。

(2) 一般决议

对于一般决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的 50%以上(不含 50%)通过。

更换基金管理人或者基金托管人、转换基金运作方式或终止基金合同应当以特别决议通过方为有效，除上述事项外，应当以一般决议通过即为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，符合法律法规、基金合同和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决；表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

(十) 计票

1、现场开会

(1) 基金份额持有人大会的主持人为召集人授权出席大会的代表，如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员(如果基金管理人为召集人，则监督员由基金托管人的授权代表担任；如基金托管人为召集人，则监督员由基金托管人在出席会议的基金份额持有人中指定)共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中推举三名基金份额持有人代表担任监票人。

(2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

(3) 如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或者基金份额持有人代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

(4) 在基金管理人或基金托管人担任召集人的情形下，如果在计票过程中基金管理人或者基金托管人拒不配合的，则参加会议的基金份额持有人有权推举三名基金份额持有人代表共同担任监票人进行计票。

(5) 计票过程应由公证机关予以公证。基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

2、通讯方式开会

在通讯方式开会的条件下，计票方式可采取如下方式：

由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

(十一) 生效与公告

1、基金份额持有人大会按照《基金法》有关法律法规规定表决通过的事项，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

2、生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有法律约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决定。

3、基金份额持有人大会决议应当自中国证监会核准或出具无异议意见后依照《信息披露办法》的有关规定，由基金份额持有人大会召集人在至少一种指定媒体上公告。

4、如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机关、公证员姓名等一同公告。

(十二) 法律法规或监管机关对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

三、基金收益分配原则、执行方式

(一) 基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

(二) 收益分配原则

- 1、基金收益分配采用现金方式；
- 2、本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- 3、基金收益评价日核定的基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1% 以上，

基金管理人可进行收益分配。基金管理人对基金份额净值增长率和标的指数同期增长率的计算方法参见本条第（三）款；

4、本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；

5、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多 12 次；若基金合同生效不满三个月，收益可不分配；

6、基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日；

7、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

（三）基金收益分配数额的确定

1、在收益评价日，基金管理人计算基金份额净值增长率和标的指数同期增长率，并计算基金份额净值增长率与标的指数同期增长率的差额，当差额超过 1% 时，基金管理人有权进行收益分配。

基金收益评价日基金份额净值增长率与标的指数同期增长率的差额 = 基金份额净值增长率 - 标的指数同期增长率

基金份额净值增长率 = (收益评价日基金份额净值 / 基金上市前一日基金份额净值 - 1) × 100%

标的指数同期增长率 = (收益评价日标的指数收盘值 / 基金上市前一日标的指数收盘值 - 1) × 100%

期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算上述指标。

2、根据前述收益分配原则确定收益评价日本基金的可分配收益、收益分配比例及收益分配数额。

（四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明收益分配基准日、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式及有关手续费等内容。

（五）收益分配方案的确定、公告与实施

基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核后确定，基金管理人按法律法规的规定向中国证监会备案并公告。

在分配方案公布后（依据具体方案的规定），基金管理人就支付的现金红利向基金托管

人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（六）收益分配中发生的费用

收益分配时发生的银行转账或其他手续费用由基金份额持有人自行承担。

四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

（一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、标的指数许可使用费；
- 4、因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）；
- 5、基金合同生效以后的信息披露费用；
- 6、基金份额持有人大会费用（含公证费）；
- 7、基金合同生效以后的会计师费和律师费；
- 8、基金资产的资金汇划费用；
- 9、基金上市费及年费；
- 10、按照国家有关法律法规规定和基金合同约定可以列入的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 0.5% 年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.5% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.1% 年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

3、基金合同生效后的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法支付指数许可使用费。其中，基金合同生效前的许可使用固定费不列入基金费用。

指数许可使用费的费率、收取下限、具体计算方法及支付方式请参见招募说明书。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应在招募说明书及其更新中披露基金最新适用的方法。

4、本条第（一）款第 4 至第 10 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入或摊入当期基金费用。

（三）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资产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他不从基金资产中支付的费用等不列入基金费用。

（四）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

（五）税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

五、基金财产的投资方向和投资限制

（一）投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。

为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非标的指数成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、新股、债券（含中期票据）、货币市场工具、银行存款、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

（二）投资禁止行为与限制

1、禁止用本基金资产从事以下行为

- （1）承销证券；
- （2）向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）买卖其他基金份额，但是法律法规或国务院另有规定的除外；
- （5）向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- （6）买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- （7）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- （8）依照法律、行政法规有关法律法规规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。对于因上述（5）、（6）项情形导致无法投资的标的指数成份股的，基金管理人应在严格控制跟踪误差的前提下，结合使用其他合理方法进行适当替代。

2、基金投资组合比例限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

- （1）本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%；
- （2）进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不得超过基金资产净值的 40%，在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；
- （3）本基金参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过基金总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- （4）本基金投资权证，在任何交易日买入的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。投资于其他权证的投资比例，遵从法律法规或监管部门的相关规定；

(5)在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的 10%;在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的 100%,其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;在任何交易日日终,持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%;在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。

(6) 法律法规和基金合同规定的其他限制。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。在符合相关法律法规规定的前提下,因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、基金申购或赎回带来现金等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述规定的投资比例的,基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的,从其规定。

3、若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更,致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消,基金管理人在依法履行相应程序后,本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

六、基金财产净值的计算方法和公告方式

(一) 基金资产净值

本基金的基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

(二) 基金资产净值、基金份额净值公告

基金合同生效后,在开始办理基金份额申购或者赎回前,基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回之后,基金管理人应当在每个开放日的次日,通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介,披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前述最后一个市场交易日的次日,将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算的方式

(一) 基金合同的终止

有下列情形之一的,本基金合同应当终止:

- 1、基金份额持有人大会决定终止；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；
- 3、法律法规和基金合同规定的其他情形。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金资产中获得补偿的权利。

（二）基金财产的清算

1、基金合同终止，基金管理人应当按法律法规和本基金合同的有关规定组织清算组对基金资产进行清算。

2、基金资产清算组

（1）自基金合同终止事由之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金资产清算组，在基金资产清算组接管基金资产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金资产安全的职责。

（2）基金资产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金资产清算组可以聘用必要的工作人员。

（3）基金资产清算组负责基金资产的保管、清理、估价、变现和分配。基金资产清算组可以依法进行必要的民事活动。

3、清算程序

- （1）基金合同终止情形发生后，由基金资产清算组统一接管基金资产；
- （2）基金资产清算组根据基金资产的情况确定清算期限；
- （3）基金资产清算组对基金资产进行清理和确认；
- （4）对基金资产进行评估和变现；
- （5）制作清算报告；
- （6）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- （7）将清算报告报中国证监会备案并公告；
- （8）对基金资产进行分配。

4、清算费用

清算费用是指基金资产清算组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金资产清算组优先从基金资产中支付。

5、基金剩余财产的分配

基金资产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；
- (4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金资产未按前款（1）、（2）、（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

对于基金缴存于中国证券登记结算有限责任公司的最低结算备付金和交易席位保证金等，在中国证券登记结算有限责任公司对其进行调整后方可收回。

6、基金资产清算的公告

基金资产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

7、基金资产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

八、争议解决方式

（一）本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

（二）本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可通过友好协商解决，但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，按照其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

（三）除争议所涉内容之外，本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。

九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

（一）本基金合同正本一式六份，除上报有关监管机构二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。

（二）基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同存放在基金管理人和基金托管人住所，投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件，基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。