

## 关于大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金根据沪市跨市场股票 ETF 交易结算模式调整相应修订基金招募说明书的公告

大成基金管理有限公司（以下简称“本公司”或“本基金管理人”）旗下的大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金（基金代码：515520，场内简称：“价值 100”），经中国证监会证监许可【2019】723 号文准予募集注册，《大成 MSCI 中国 A 股质优价值 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）于 2019 年 9 月 26 日正式生效。

2020 年 1 月 7 日，上海证券交易所（以下简称上交所）正式发布《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则（2020 年修订）》（以下简称“《实施细则》”），并自 1 月 20 日起施行，其中涉及到沪市跨市场股票 ETF 交易结算模式调整。本公司决定于 2020 年 1 月 20 日起，根据《实施细则》相应调整价值 100 的交易结算模式，调整的主要内容为将其申购、赎回涉及的深市组合证券的现金替代改为采用多边净额结算，纳入中国结算担保交收，投资者申购的基金份额当日起可卖出，投资者赎回获得的股票当日起可卖出，并对本基金《招募说明书》进行修改，主要修改如下：

### 1、《招募说明书》“重要提示”章节中原文为：

“投资人申购的基金份额当日可卖出，当日未卖出的基金份额在份额交收成功之前不得卖出和赎回。即在目前结算规则下，T 日申购的基金份额当日可卖出，T 日申购当日未卖出的基金份额，T+1 日不得卖出和赎回，T+1 日交收成功后 T+2 日可卖出和赎回。因此为投资人办理申购业务的申购赎回代理机构若发生交收违约，将导致投资人不能及时、足额获得申购当日未卖出的基金份额，投资人的利益可能受到影响”

### 修改为：

“投资者申购的基金份额当日起可卖出，投资者赎回获得的股票当日起可卖出。”

2、《招募说明书》中“十、基金份额的申购、赎回与转换”中“（四）申购与赎回的程序”中的“3、申购和赎回申请的清算交收与登记”原文为：

“本基金的申购业务采用净额结算和逐笔全额结算相结合的方式。其中上海证券交易所上市成份股的现金替代、申购并当日卖出的基金份额涉及的深圳证券交易所上市的成份股的现金替代采用净额结算，申购当日未卖出的基金份额涉及的深圳证券交易所上市的成份股的现金替代采用逐笔全额结算。本基金的赎回业务采用净额结算和代收代付相结合的方式。其中上海证券交易所上市的成份股的现金替代采用净额结算，深圳证券交易所上市的成份股的

现金替代采用代收代付。本基金申购赎回业务涉及的现金差额和现金替代退补款采用代收代付。

投资人 T 日申购成功后, 登记机构在 T 日收市后办理上海证券交易所上市成份股交收与申购当日卖出基金份额的交收登记以及现金替代的清算; 在 T+1 日办理现金替代的交收与申购当日未卖出基金份额的交收登记以及现金差额的清算; 在 T+2 日办理现金差额的交收, 并将结果发送给申购赎回代理机构、基金管理人和基金托管人。现金替代交收失败的, 该笔申购当日未卖出基金份额交收失败。

投资人 T 日赎回成功后, 登记机构在 T 日收市后办理上海证券交易所上市成份股交收与基金份额的注销以及现金替代的清算; 在 T+1 日办理上海证券交易所上市的成份股现金替代的交收以及现金差额的清算; 在 T+2 日办理现金差额的交收, 并将结果发送给申购赎回代理机构、基金管理人和基金托管人。基金管理人不迟于 T+3 日办理赎回的深圳证券交易所上市的成份股现金替代的交付。”

**修改为:**

“本基金的申购、赎回业务采用净额结算的方式, 基金份额、上交所上市的成份股的现金替代、深交所上市的成份股的现金替代采用净额结算的方式, 申购赎回业务涉及的现金差额和现金替代退补款采用代收代付。

投资者 T 日申购成功后, 注册登记机构在 T 日收市后办理上交所上市的成份股交收与基金份额的交收登记以及现金替代的清算; 在 T+1 日办理现金替代的交收以及现金差额的清算; 在 T+2 日办理现金差额的交收, 并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。

投资者 T 日赎回成功后, 注册登记机构在 T 日收市后办理上交所上市的成份股交收与基金份额的注销以及现金替代的清算; 在 T+1 日办理现金替代的交收以及现金差额的清算; 在 T+2 日办理现金差额的交收, 并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人”。

3、删除《招募说明书》中“十八、风险揭示”中“(四) 本基金的特定风险”中的“8、投资者申购失败的风险”的第二段内容, 原文为:

“投资者申购当日未卖出的基金份额在交收成功后方可卖出和赎回。因此为投资者办理申购业务的代理券商如发生交收违约, 将导致投资者不能及时、足额获得申购当日未卖出的基金份额, 投资者的利益可能受到影响”。

本基金招募说明书的修改自 2020 年 1 月 20 日起生效。本基金《基金合同》和《托管协议》不涉及前述内容, 无须修订。 本基金管理人将于公告当日将修订后的基金招募说明书

登载于公司网站等指定信息披露互联网网站，投资者欲了解基金信息，请仔细阅读本基金的招募说明书及相关法律文件。

投资者可通过以下途径咨询有关详情：

(1) 大成基金管理有限公司网站：[www.dcfund.com.cn](http://www.dcfund.com.cn)

(2) 大成基金管理有限公司客户服务热线：400-888-5558（免长途通话费用）

风险提示：本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。本公司提醒投资人在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。投资者投资基金时应认真阅读基金的《基金合同》、更新的《招募说明书》等文件。

特此公告。

大成基金管理有限公司

2020年1月17日