

# 大成沪深 300 指数证券投资基金(A 类份额)

## 基金产品资料概要更新

编制日期：2021 年 8 月 25 日

送出日期：2021 年 8 月 27 日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

### 一、产品概况

|            |   |                |                 |
|------------|---|----------------|-----------------|
| 基金简称       | 大成沪深 300 指数   | 基金代码           | 519300          |
| 下属基金简称     | 大成沪深 300 指数 A   | 下属基金交易代码       | 519300          |
| 下属基金前端交易代码 | 519300  | 下属基金后端交易代码     | 519301          |
| 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    |
| 基金合同生效日    | 2006 年 4 月 6 日  |                |                 |
| 基金类型       | 股票型   | 交易币种           | 人民币             |
| 运作方式       | 普通开放式   | 开放频率           | 每个开放日           |
| 基金经理       | 苏秉毅   | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2016 年 3 月 4 日  |
|            |   | 证券从业日期         | 2004 年 7 月 1 日  |
| 基金经理       | 张钟玉   | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2015 年 8 月 26 日 |
|            |   | 证券从业日期         | 2010 年 7 月 19 日 |
| 其他         | 基金存续期内，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式或与其他基金合并等，并召开基金份额持有人大会进行表决。 |                |                 |

### 二、基金投资与净值表现

#### (一) 投资目标与投资策略

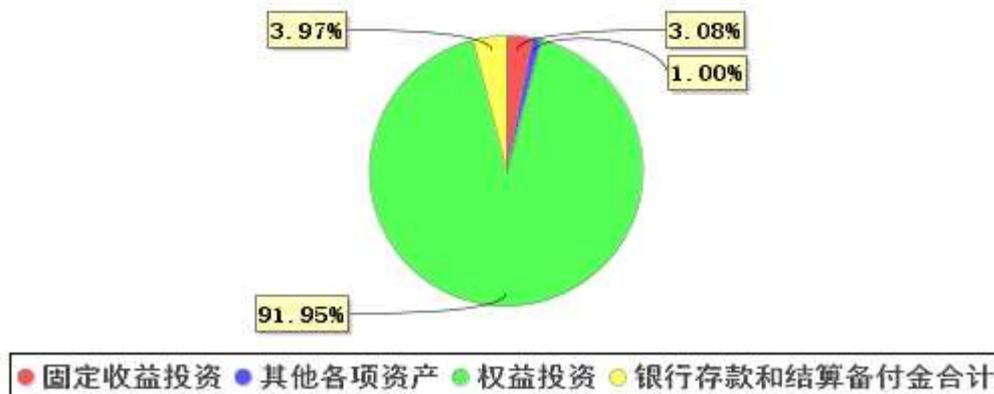
详见《大成沪深 300 指数证券投资基金招募说明书》第八部分“基金的投资”。

|      |  |
|------|--|
| 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%。   |
| 投资范围 | 本基金跟踪标的指数为：沪深 300 指数。<br>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（含存托凭证）、备选成份股（含存托凭证）、新股（一级市场初次发行或增发）、存托凭证等，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）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 |

|        |  |
|--------|--|
|        | <p>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。</p> <p>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%。</p>  |
| 主要投资策略 | <p>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。</p> <p>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。存托凭证投资策略，在控制风险的前提下，本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p>指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，综合考虑成份股的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响，据此制定成份股替代策略，并对投资组合进行相应调整。</p> |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率   |
| 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。   |

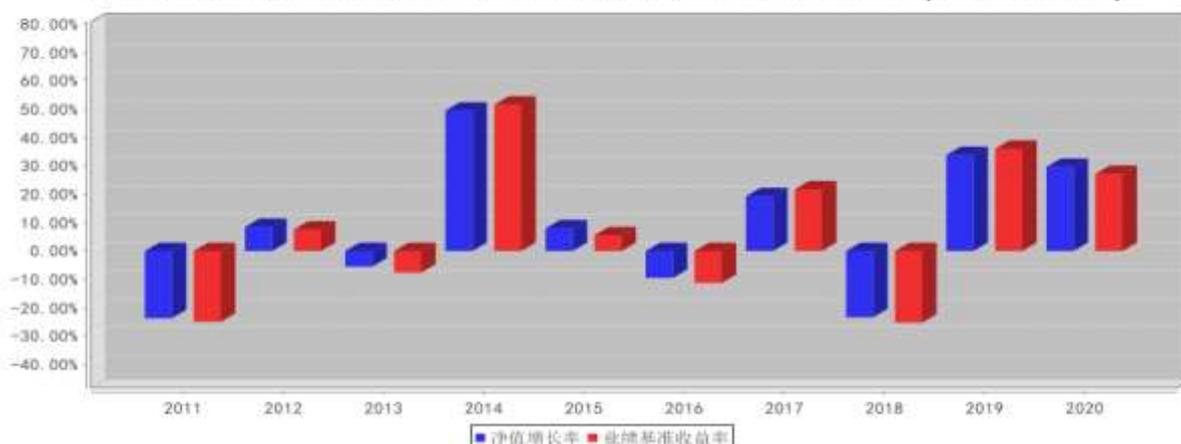
## (二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表(2021年6月30日)



## (三) 自基金合同生效以来/最近十年（孰短）基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

大成沪深300指数A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图(2020年12月31日)



- 注:1、基金的过往业绩不代表未来表现。  
2、如合同生效当年不满完整自然年度的,按实际期限计算净值增长率。

### 三、投资本基金涉及的费用

#### (一) 基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取:

| 费用类型         | 份额(S)或金额(M)<br>/持有期限(N) | 收费方式/费率  |
|--------------|-------------------------|----------|
| 申购费<br>(前收费) | M<50万元                  | 1.2%     |
|              | 50万元≤M<200万元            | 1%       |
|              | 200万元≤M<500万元           | 0.5%     |
|              | M≥500万元                 | 1,000元/笔 |
| 申购费<br>(后收费) | N<1年                    | 1.2%     |
|              | 1年≤N<2年                 | 0.8%     |
|              | 2年≤N<3年                 | 0.4%     |
|              | N≥3年                    | 0.0      |
| 赎回费          | N<7天                    | 1.5%     |
|              | 7天≤N<1年                 | 0.5%     |
|              | 1年≤N<2年                 | 0.15%    |
|              | N≥2年                    | 0.0      |

注:本基金份额后端认购费率(持有期限/N): N<1年, 1%; 1年≤N<2年, 0.5%; 2年≤N<3年, 0.25%; 3年≤N, 0。

#### (二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除:

| 费用类别 | 收费方式/年费率   |
|------|--|
| 管理费  | 0.75%  |
| 托管费  | 0.15%  |
| 其他费用 | 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用、会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费, 基金份额持有人大会费用, 基金的证券交易费用, 基金的银行汇划费用, 基金的 |

|  |   |
|--|---|
|  | 指数使用费,基金相关账户的开户及维护费用,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。 |
|--|---|

注:本基金交易证券等产生的费用和税负,按实际发生额从基金资产扣除。

#### 四、风险揭示与重要提示

##### (一) 风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。投资有风险,投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

1、本基金主要投资于证券市场,而证券市场价格受政治、经济、投资心理和交易制度等各种因素的影响会产生波动,从而对本基金投资产生潜在风险,导致基金收益水平发生波动。

2、本基金有关指数投资风险

- (1) 标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险。
- (2) 标的指数波动的风险。
- (3) 基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险。
- (4) 标的指数变更的风险。
- (5) 跟踪误差控制未达约定目标的风险。
- (6) 指数编制机构停止服务的风险。
- (7) 成份股停牌的风险。

##### (二) 重要提示

基金产品资料概要信息发生重大变更的,基金管理人将在三个工作日内更新,其他信息发生变更的,基金管理人每年更新一次。因此,本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后,如需及时、准确获取基金的相关信息,敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

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。

中国证监会对本基金募集的注册或核准,并不表明其对本基金的价值和收益作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。

本基金标的指数为沪深 300 指数,该指数的样本空间、选样方法等信息详见本基金招募说明书。

#### 五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[www.dcfund.com.cn]客服电话[4008885558]

1. 大成沪深 300 指数证券投资基金基金合同、大成沪深 300 指数证券投资基金托管协议、大成沪深 300 指数证券投资基金招募说明书
2. 定期报告,包括基金季度报告、中期报告和年度报告
3. 基金份额净值
4. 基金销售机构及联系方式
5. 其他重要资料