

Disclosure

大成沪深300指数证券投资基金更新的招募说明书摘要

(上接B17页) 基金管理人及基金托管人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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同规定,于2009年10月26日复核了本报告中涉及财务数据、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。

本招募说明书所载数据截至2009年6月30日,本报告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

Table with 3 columns: 序号, 项目, 占基金总资产的比例(%)

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

Table with 3 columns: 代码, 行业类别, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

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

4. 报告期末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

Table with 5 columns: 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(%)

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

Table with 5 columns: 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(%)

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/成交金额和卖出股票的收入/成交金额

Table with 2 columns: 买入股票成本(成交)总额, 卖出股票收入(成交)总额

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. 报告期末按债券种类分类的债券投资组合

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投资明细

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

8. 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

9. 投资组合报告附注 (1) 报告期内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的,或在报告编制日前一年

内受到公开谴责、处罚的情况

(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

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

(4) 报告期末基金持有的处于转股期的可转换债券明细

(5) 报告期末基金持有的处于转股期的可转换债券

(6) 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流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

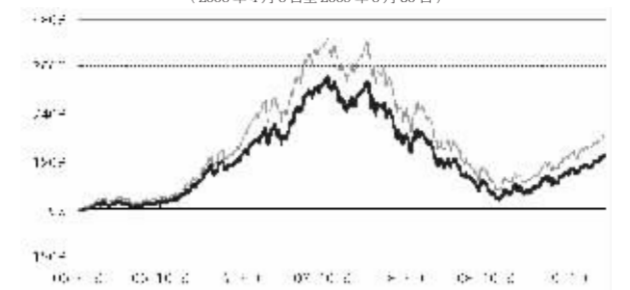
本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名流通受限情况的说明

Table with 6 columns: 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

(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(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表

(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) 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用

(5) 基金合同生效后与基金相关的会计师事务所、律师费

(6) 基金合同生效后与基金相关的其他费用

(7) 按照国家有关规定从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

本基金的管理费按基金资产净值的0.75%年费率计提。

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的0.75%年费率计提。计算方法如:

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

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、公休等,支付日期顺延。

(2) 基金托管人的基金托管费

本基金托管费按基金资产净值的0.15%年费率计提。

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。计算方法如:

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。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管理人。若遇法定节假日、公休等,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列入当期基金费用

3. 不列入基金费用的项目

基金管理人及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均不列入基金费用。

基金合同生效后,基金管理人和基金托管人各自承担应承担的费用,基金管理人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照相关法律法规执行。

(二) 与基金销售有关费用

本基金分为A类和B类两种收费模式,对A类和B类两种不同的份额

A类收费模式,即前收收费模式,指在本基金中,选择在(A)类基金份额时直接交纳(A)申购费,再以扣除(A)申购费后的净申购作为(A)申购金额

B类收费模式,即后收收费模式,指在本基金中,选择在(B)类基金份额时,在(A)申购费扣除(A)申购费后,再以扣除(A)申购费后的净申购作为(B)申购金额,但在赎回时再交纳(B)申购费

本基金A类与B类收费模式均有两类基金份额:A类基金份额和B类基金份额。A类基金份额选择A类收费方式(前收收费模式)的基金份额;B类基金份额选择B类收费方式(后收收费模式)的基金份额。

本基金A类与B类收费模式,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。

此分类对募集额的认购行为和基金合同生效后申购行为,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。

基金申购(基金合同生效后申购)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金额申购的方式。

(1) A类收费模式:前收收费模式

申购金额M 前收申购费率

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

前收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:后收收费模式

持有期限T 后收申购费率

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,投资者在申购时不需支付申购费用,但是赎回时需交纳申购费用。后收申购费用的计算方法如下:

后收申购费用 = 赎回份额 × 申购日基金份额净值 × 后收申购费率

2. 基金赎回(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,在基金赎回时从赎回基金份额的赎回款中扣除。

本基金的赎回费率按持有期限(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:

持有期限T 适用的赎回费率

T <= 1年 0.5%

1年 < T <= 2年 0.15%

T >= 2年 0%

注:1)按申购365天计算,2)按赎回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

本基金赎回费用由基金赎回人承担,在基金赎回时从赎回基金份额的赎回款中扣除。

本基金的赎回费率按持有期限(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:

持有期限T 适用的赎回费率

T <= 1年 0.5%

1年 < T <= 2年 0.15%

T >= 2年 0%

注:1)按申购365天计算,2)按赎回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

本基金赎回费用由基金赎回人承担,在基金赎回时从赎回基金份额的赎回款中扣除。

本基金的赎回费率按持有期限(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:

持有期限T 适用的赎回费率

T <= 1年 0.5%

1年 < T <= 2年 0.15%

T >= 2年 0%

注:1)按申购365天计算,2)按赎回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

本基金赎回费用由基金赎回人承担,在基金赎回时从赎回基金份额的赎回款中扣除。

本基金的赎回费率按持有期限(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:

持有期限T 适用的赎回费率

T <= 1年 0.5%

1年 < T <= 2年 0.15%

T >= 2年 0%

注:1)按申购365天计算,2)按赎回730天计算,其余同。

赎回费用的计算方法如下:

附表 金额单位:人民币元

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)

Table with 5 columns: 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(%)