

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：2024 年 6 月 3 日

送出日期：2024 年 6 月 28 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
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	李绍	开始担任本基金基金经理的日期	2023 年 04 月 14 日
		证券从业日期	2000 年 04 月 01 日
基金经理	刘淼	开始担任本基金基金经理的日期	2023 年 04 月 14 日
		证券从业日期	2008 年 04 月 01 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

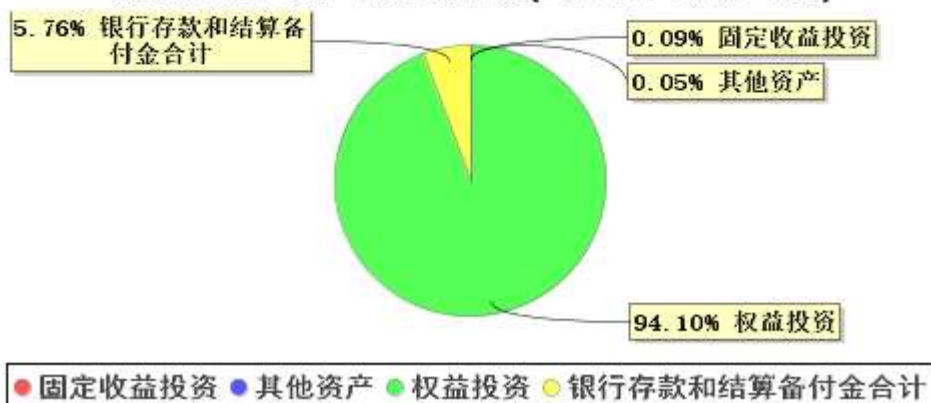
详见《大成沪深 300 指数证券投资基金更新招募说明书》第八部分“基金的投资”。

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。 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>本基金将根据法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。</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。</p> <p>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>1. 决策依据</p> <p>（1）有关法律、法规、基金合同和标的指数等的相关规定；</p> <p>（2）经济运行态势和证券市场走势。</p> <p>2. 投资管理体制</p> <p>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。</p> <p>3. 金融衍生产品投资管理</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>4. 融资及转融通证券出借业务投资策略</p> <p>本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借业务。参与融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。参与转融通证券出借业务时，本基金将从基金持有的融券标的股票中选择流动性好、交易活跃的股票作为转融通出借交易对象，力争为本基金份额持有人增厚投资收益。</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。

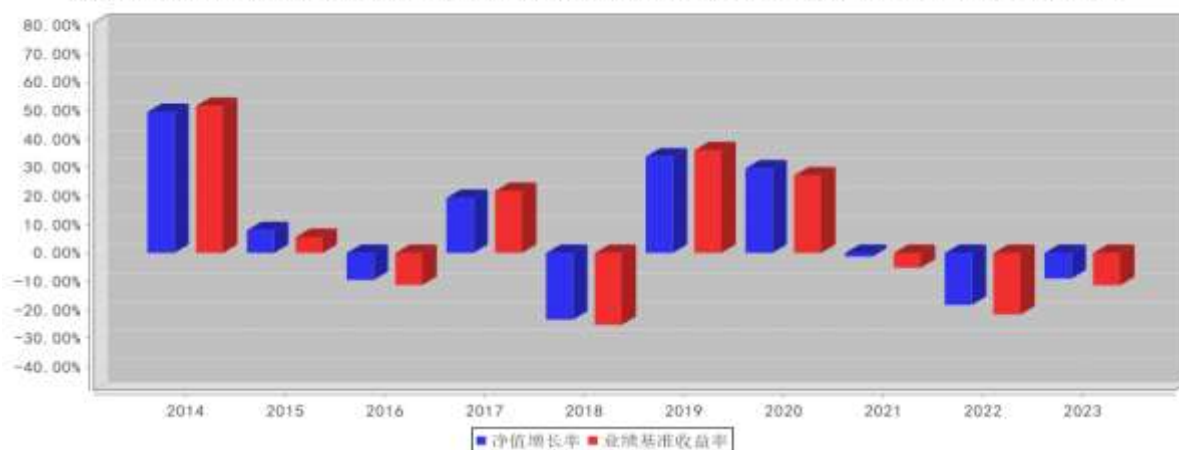
(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表(2024年3月31日)



(三) 最近十年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 (2023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) /持有期限 (N)	收费方式/费率
申购费 (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 (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：养老金客户在基金管理人直销中心办理账户认证手续后，可享受申购费率一折优惠，申购费为固定金额的，则按原费率执行，不再享有费率折扣。

(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/年费率或金额	收取方
管理费	0.75%	基金管理人和销售机构
托管费	0.15%	基金托管人
审计费用	90,000.00 元	会计师事务所
信息披露费	120,000.00 元	规定披露报刊
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的律师费、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：（1）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。

（2）审计费用、信息披露费为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

(三) 基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运费率如下表：

大成沪深 300 指数 A

基金运作综合费率（年化）
0.92%

注：基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

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