

(上接C63版) 传真:021-50710164 客服电话:400-799-1888 网址:www.s2fund.com.cn

(138)凤凰基金(银川)基金销售有限公司 注册地址:宁夏银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层1402-4办公用房

办公地址:北京市朝阳区紫月路18号院18号楼 法定代表人:张旭 联系人:汪莹 联系电话:010-58160084

客服电话:400-810-5919 网址:http://www.fengfd.com/ (139)上海联泰基金销售有限公司

注册地址:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室 办公地址:上海市长宁区福泉北路518号8座3层 邮编:200335

法定代表人:燕斌 联系人:兰敏 电话:021-52822063 传真:021-52975270

客服电话:400-166-6788 公司网址:www.66zichan.com (140)泰诚财富基金销售有限公司

注册地址:辽宁省大连市沙河口区星海广场103号 法定代表人:林卓 联系人:张瑞辉 电话:0411-88891212

传真:0411-84396536 客服电话:400-6411-999 网址:www.taichengcaifu.com

(141)上海基煜基金销售有限公司 住所:上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展区)

办公地址:上海市杨浦区昆明路518号41002室 法定代表人:王翔 联系人:安彬 客服电话:400-820-5369

网址:www.jiyufund.com.cn (142)上海凯石财富基金销售有限公司 注册地址:上海市黄浦区西藏南路765号602-115室

法定代表人:陈维武 客服电话:400-643-3889 联系人:葛佳蕊 电话:021-63333319

传真:021-63332523 网址:www.vstonewealth.com (143)上海中正达广基金销售有限公司

注册地址:上海市徐汇区龙腾大道2815号302室 办公地址:上海市徐汇区龙腾大道2815号3楼 法定代表人:黄欣 电话:021-3376-8132

客服电话:400-6767-523 网址:http://www.zhongzhengfund.com (144)北京虹点基金销售有限公司

注册地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元 办公地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元 法定代表人:胡伟 传真:010-65951887

客服电话:010-65951887 网址:www.hongdianfund.com (145)武汉市信赢基金销售有限公司

注册地址:湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城(一期)第7栋23层1号4号 联系人:杨帆 电话:027-87060003/87006009

网站:www.buyfunds.cn 公司传真:027-87066010 客服电话:400-027-9899

(146)上海陆金所基金销售有限公司 注册地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1333号14楼09单元 法定代表人:王之光 办公地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1333号14楼09单元

联系人:宁博宇 客服电话:4008219031 网址:www.lufunds.com (147)珠海盈米基金销售有限公司

注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491 法定代表人:肖雯 办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203

联系人:黄敏嫦 网站:www.yingmi.cn 客服电话:020-89629066

(148)和耕传承基金销售有限公司 注册地址:河南自贸试验区郑州片区(郑东)东风南路东康宁街北6号楼5楼 办公地址:北京市朝阳区酒仙桥路6号院国际电子城B座

法定代表人:王旋 客服电话:4000-555-671 网址:http://www.hgrsp.com/ (149)奕丰基金销售有限公司

注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司) 办公地址:深圳市南山区海德三路航天科技广场A座17楼1704室

法定代表人:TEO WEE HOWE 联系人:叶健 电话:0755-89460507 传真:0755-21674453

客服电话:400-684-0500 网址:www.ifastps.com.cn (150)北京肯瑞瑞基金销售有限公司

注册地址:北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06 办公地址:北京大兴区亦庄经济技术开发区科创十一街18号院京东集团总部 法定代表人:江卉 电话:个人业务:95118 400 098 8511 企业业务:400 088 8816

传真:010-89195666 网址:fund.jd.com (151)深圳市金斧子基金销售有限公司

注册地址:深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元11层 办公地址:深圳市南山区粤海街道科苑路科兴科学园B3单元7楼

法定代表人:赖任军 联系人:刘昕霞 电话:0755-29330513 传真:0755-26920530

客服电话:400-9302-888 网址:https://www.jfz.com/ (152)北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507 法定代表人:钟斐斐 客服电话:4000618518

联系人:袁永涛 电话:010-61840688 传真:010-61840699

网址:https://danjuanapp.com (153)上海华夏财富投资管理有限公司 注册地址:上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室

法定代表人:毛淮平 办公地址:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B8层 客服热线:400-817-5666 公司网址:www.amcfortune.com

基金管理人可根据有关法律、法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

(二)注册登记机构 名称:大成基金管理有限公司

住所:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层 办公地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦33层

法定代表人:吴光焰 电话:0755-83183388 传真:0755-83195229

联系人:黄慕平 (三)律师事务所和经办律师 名称:北京市金杜律师事务所

注册地址:北京市朝阳区东三环中路7号财富中心写字楼A座40层 办公地址:北京市朝阳区东三环中路7号财富中心写字楼A座40层 负责人:王玲 电话:0755-22163333 传真:0755-22163390

经办律师:沈娜、冯艾 联系人:冯艾 (四)会计师事务所和经办注册会计师

名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 住所:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址:上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼 执行事务合伙人:李丹 电话:021-23238888 传真:021-23238800

联系人:陈薇瑶 经办注册会计师:张振波、陈薇瑶 四、基金名称 大成中证红利指数证券投资基金

五、基金的类型 股票型指数基金 六、基金的运作方式 契约型开放式

七、基金的投资目标 通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,紧密跟踪标的指数,追求指数跟踪偏离度和跟踪误差最小化,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年化跟踪误差不超过4%。

八、基金的投资范围 本基金投资于具有良好流动性的金融工具,主要投资于标的指数的成份股及其备选成份股。此外,为更好的实现投资目标,本基金将适度投资于非标的指数成份

股、新股以及法律法规及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%,现金(不包括结存备付金、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资产净值的5%。

九、基金的投资策略 本基金主要采取完全复制法,即按照标的指数的成份股组成及其权重构建投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。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,以及其他特殊情况(如成份股流动性不足)对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,基金管理人可以使用其他适当的方法进行调整,以实现跟踪误差的有效控制。

1.投资组合构建 本基金股票资产投资采用完全复制法的指数的方法,按照成份股在标的指数中的基准权重构建投资组合。 2.投资组合调整 本基金为指数型基金,基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整;同时,本基金还将根据法律法规和基金合同规定的投资比例限制,申购赎回变动情况、新股增发等因素,对基金投资组合进行调整,追求跟踪误差和跟踪偏离度最小化。

(1)定期调整 本基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份股的定期调整,实施定期跟踪调整。 (2)不定期调整 1)与指数相关的调整 根据指数编制规则,当标的指数成份股需进行成份股权重临时调整时,本基金将根据标的指数编制机构发布的临时调整决定及其需调整的权重比例,进行相应调整。

2)限制性调整 根据法律法规的相关规定及基金合同的约定,如出现标的指数成份股为与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或有其他重大利害关系的公司发行的股票等情形,本基金将进行被动性调出调整,并相应地对其他资产类别或个股进行微调,保证基金合法合规运行。 3)根据申购和赎回情况调整 本基金将根据申购和赎回情况对投资组合进行调整,保证基金正常运行,从而有效跟踪标的指数。

4)其他调整 针对我国证券市场新股发行制度的特点,本基金将参与一级市场新股认购,由此得到的非成份股将在其规定持有期之后的一定时间内内卖出。 3.替代策略 通常情况下,本基金根据标的指数成份股在指数中的权重确定成份股的买卖数量。但在如标的指数成份股流动性严重不足或停牌、标的指数成份股为与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或有其他重大利害关系的公司发行的股票等特殊情况下,本基金可以选择其他股票或股票组合对标的指数中的成份股进行替换。

在选择替代股票时,为尽可能的降低跟踪误差,本基金将采用定性定量相结合的方法,在对替代与被替代股票上市企业主营业务、价格走势等指标相关性分析的基础上,优先从标的指数成份股及备选成份股中选择基本面良好,流动性充裕的股票进行替代投资。 (五)投资决策依据 1.法律、法规、基金合同和标的指数等的有关规定; 2.经济运行态势和证券市场走势。

(六)投资管理体制及程序 1.投资管理体制 基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会负责制定基金投资重大决策,基金管理人负责日常投资管理;基金经理根据投资决策委员会的决议,负责投资组合的构建、调整及日常管理等工作。 2.投资程序 (1)金融工程部门运用风险监测模型以及各种风险监控指标,结合公司内外部研究报告,对市场预期风险和指数化投资组合风险进行风险测算与归因分析,依此提出研究报告。

(2)投资决策委员会依据金融工程等部门提供的研究报告,定期召开或遇重大事件时召开投资决策会议,决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议,进行基金投资管理的日常决策。 (3)基金经理跟踪标的指数构成,结合相关研究报告,在基金合同规定的范围内,构建投资组合。在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下,采取适当的方法,降低交易成本,控制投资风险。 (4)交易管理部门根据基金经理下达的交易指令制定交易策略,完成具体证券品种的交易。

(5)金融工程等部门根据市场变化,定期和不定期进行投资绩效评估,并提供相关绩效评估报告。监察稽核部对投资计划的执行进行日常监督和实时监控。本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年化跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金经理应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 (6)基金经理跟踪标的指数的变动,结合成份股基本面情况、流动性状况、申购和赎回现金流情况、金融工程的绩效评估报告和监察稽核部对各种风险的监控和评估结果,对投资组合进行监控和调整,密切跟踪标的指数。

(7)基金管理人应在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据市场环境变化和实际需要调整上述投资程序,并予以公告。 十、基金的业绩比较基准 中证红利指数*95%+银行活期存款利率(税后)*5% 本基金的标的指数为中证红利指数。本基金投资范围规定投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,因此采用中证红利指数和银行活期存款利率(税后)加权的方法构建本基金的业绩比较基准。

中证红利指数由中证指数有限公司编制并发布。该指数精选在上海证券交易所和深圳证券交易所上市的现金股息率高、分红比较稳定、具有一定规模及流动性的100只股票作为样本,以反映沪深两市高股息股票的整体走势。 如果出现指数编制及发布机构停止本基金标的指数的编制及发布,或标的指数由其他指数替代,或由指数编制方法等重大变更导致原标的指数不宜继续作为本基金的标的指数等情形,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,与基金托管人协商一致并履行适当程序后变更本基金的业绩比较基准并及时公告。

十一、基金的风险收益特征 本基金属于股票基金,风险与收益水平高于混合基金、债券基金和货币市场基金。 十二、基金投资组合报告 基金管理人承诺本报告所载数据不存在虚假记载、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。 基金托管人中国建设银行根据基金合同规定,于2020年2月24日复核了本报告中的财务指标、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。 本投资组合报告所载数据取自本基金2019年第4季度报告,截至2019年12月31日。(财务数据未经审计)

1.报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 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 (1)报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

(2)报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

(3)基金的其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 本基金本报告期末未持有可转换债券。

(2)报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 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前十名股票投资明细 (1)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with 5 columns: 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(%)

(2)报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

Table with 5 columns: 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(%)

5.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

6.报告期末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

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

7.报告期末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 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资明细 本基金本报告期末未持有贵金属。 9.报告期末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 本基金本报告期末未持有权证。

10.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 (1)报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细 本基金本报告期末未投资股指期货。 (2)本基金投资股指期货的投资政策 本基金本报告期末未投资股指期货。 (3)股指期货投资情况说明 本基金本报告期末未投资股指期货。

11.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 (1)本期国债期货投资政策 本基金本报告期末未投资国债期货。 (2)报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 本基金本报告期末未投资国债期货。 (3)本期国债期货投资评价 本基金本报告期末未投资国债期货。

12.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出现本期被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。 (2)本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)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 本基金本报告期末未持有可转换债券。

(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 本基金指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。 (6)报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

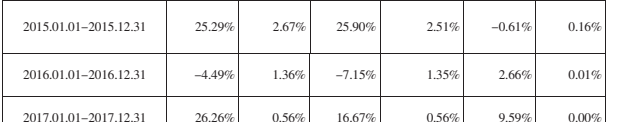
(7)投资组合报告附注的其他重要事项 由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。 十三、基金业绩 基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者有风险,投资者在做出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。 (一)基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较: 大成中证红利指数A

Table with 6 columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率基准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率基准差④, ①-③, ②-④

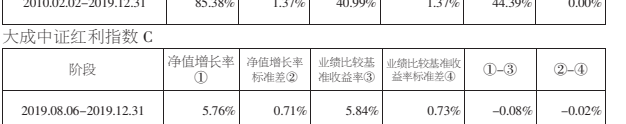
大成中证红利指数C

Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率基准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率基准差④, ①-③, ②-④

(二)自基金合同生效以来基金净值变动的情况,并与同期业绩比较基准的变动的比较 本基金份额累计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(2010年2月2日至2019年12月31日)



大成中证红利指数A累计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



大成中证红利指数C累计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



注:1、本基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期间,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。 2、自2019年8月2日起,大成中证红利指数证券投资基金增收销售服务费,具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明; 10.依法可以在基金财产中列支的其他费用。 (二)上述基金费用由基金管理人按法律法规规定的范围内参照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。 (三)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; 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。计算方法如下: H=E×年管理费率÷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。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3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、休息日,支付日期顺延。 2.基金托管人的托管费; 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。计算方法如下: H=E×年托管费率÷当年天数 H为每日应计提的基金托管费 E为前一日基金资产净值 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,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。 3.销售服务费 本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.10%年费率计提。计算方法如下: H=E×0.10%÷当年天数 H为C类基金份额每日应计提的销售服务费 E为C类基金份额前一日基金资产净值 C类基金份额销售服务费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人双方核对无误后,基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,由基金管理人代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。 4.除管理费和托管费之外的基金费用,由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定,按费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。 (四)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而导致的费用支出或基金财产的损失,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费用不从基金财产中支付。 (五)基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率、销售服务费率及基金托管费率。基金管理人应于新的费率实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。 (六)基金税收 基金份额持有人根据国家法律法规的规定,履行纳税义务。 十五、对招募说明书更新部分的说明 本更新的招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其他有关法律法规的要求,并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动,对2019年10月23日公布的《大成中证红利指数证券投资基金更新招募说明书》进行了内容补充和更新,本更新的招募说明书主要更新的内容如下: 根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》,更新了“重要提示”、“三、基金管理人”、“四、基金托管人”、“五、相关服务机构”、“八、基金的投资”、“九、基金的业绩”、“二十二、其他应披露的事项”、“二十三、招募说明书更新部分的说明”。

大成基金管理有限公司 二〇二〇年三月二日