深证成长40交易型开放式指数证券投资基金招募说明书

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

重要提示

深证成长40交易型开放式指数证券投资基金经中国证监会2010年10月27日证监许可【2010】1478号文核准募集。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明中国证监会对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

证券投资基金(以下简称"基金")是一种长期投资工具,其主要功能是分散投资,降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具,投资者购买基金,既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益,也可能承担基金投资所带来的损失。

基金分为股票基金、混合基金、债券基金、货币市场基金等不同类型,投资者投资不同类型的基金将获得不同的收益预期,也将承担不同程度的风险。一般来说,基金的收益预期越高,投资者承担的风险也越大。

深证成长40交易型开放式指数证券投资基金是股票基金,预期风险收益水平高于混合基金、债券基金和货币市场基金,同时本基金为指数型基金,紧密跟踪标的指数,具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征,属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资者在投资本基金前,需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者根据所持有份额享受基金的收益,但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括:标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险以及基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、基金的退市风险、投资者申购、赎回失败的风险以及基金份额赎回对价的变现风险等等。

基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产,但不保证本基金一定盈利,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,基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险,投资人认购(或申购)基金时,请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同。基金管理人提醒投资者基金投资的"买者自负"原则,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,由投资者自行负担。

一、绪 言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》)、其他有关规定及《深证成长40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)编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据《深证成长40交易型开放式指数证券投资基金基金合同》编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。投资者取得依基金合同所发行的基金份额,即成为基金份额持有人和本基金基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务;基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅《深证成长40交易型开放式指数证券投资基金基金合同》。

二、释 义

在本基金合同中,除非文意另有所指,下列词语或简称具有如下含义:

1.基金或本基金:指深证成长40交易型开放式指数证券投资基金

2.基金管理人或本基金管理人:指大成基金管理有限公司

3.基金托管人或本基金托管人:指中国农业银行股份有限公司

4.基金合同或本合同:指《深证成长40交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充

5.托管协议或本托管协议:指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《深证成长40交易型开放式指数证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6.招募说明书:指《深证成长40交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》,及其定期的更新

7.基金份额发售公告:指《深证成长40交易型开放式指数证券投资基金份额发售公告》

8.法律法规:指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、司法解释、部门规章、地方性法规、地方政府规章及其他对基金合同当事人有约束力的规范性文件及对该等法律法规不时作出的修订

10.《销售办法》:指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过,自2004年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时作出的修订

11.《信息披露办法》:指中国证监会2004年6月25日颁布,同年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及对其不时作出的修订

12.《运作办法》:指中国证监会2004年6月29日颁布,同年7月1日实施的《证券投资基金运作管理办法》及对其不时作出的修订

13.中国:指中华人民共和国,就本基金合同而言,不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区

14.中国证监会:指中国证券监督管理委员会

15.中国银监会:指中国银行业监督管理委员会

16.基金合同当事人:指受基金合同约束,根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体,包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

17.个人投资者:指符合法律法规规定的条件可以投资证券投资基金的自然人

18.机构投资者:指符合法律法规规定可以投资证券投资基金的在中华人民共和国注册登记或经政府有关部门批准设立的机构

19.合格境外机构投资者:指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》及其他相关法律法规规定的条件,经中国证监会批准可投资于中国证券市场,并取得国家外汇管理局额度批准的中国境外的机构投资者

20.基金投资者:指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者,以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者

21.基金份额持有人:指依招募说明书和基金合同合法取得基金份额的基金投资者

22.深交所:指《深圳证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》

23.销售机构:指直销机构和代销机构

24.直销机构:指大成基金管理有限公司

25.代销机构:指发售代理机构及申购赎回代理券商

26.基金销售网点:指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点

27.发售代理机构:指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,由基金管理人指定的代理本基金发售业务的机构

28.申购赎回代理券商:指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,由基金管理人指定的办理本基金申购、赎回业务的证券公司,又称为代办证券公司

29.注册登记业务:指根据《中国证券登记结算有限责任公司关于深圳证券交易所上市的交易型开放式指数基金登记结算业务实施细则》以及相关业务规则定义的基金份额的登记、托管和结算业务

30.登记结算机构:指中国证券登记结算有限责任公司

31.深圳证券账户:指在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开设的深圳证券交易所人民币普通股票账户(简称"A股账户"或证券投资基金账户(简称"基金账户")

32.基金合同生效日:指基金募集期结束后达到法律法规规定及基金合同约定的备案条件,基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕,并收到其书面确认的日期

33.基金合同终止日:指基金合同规定的基金合同终止事由出现后,按照基金合同规定的程序终止基金合同的日期

34.基金募集期限:指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间,最长不得超过3个月

35.存续期:指基金合同生效至终止之间的不定期期限

36.工作日:指深圳证券交易所的正常交易日

37.日:指公历日

38.月:指公历月

39.T日:指销售机构在规定时间受理基金投资者有效申请工作日

40.T+n日:指自T日起第n个工作日(不包含T日)

41.开放日:指为基金投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

42.认购:指在基金募集期间,基金投资者申请购买基金份额的行为

43.申购:指在基金存续期内,基金投资者申请购买基金份额的行为

44.赎回:指在基金存续期内基金份额持有人按基金合同规定的条件卖出基金份额的行为

45.交易型开放式指数基金:指《深圳证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》定义的"交易型开放式指数基金",即指经依法募集的,以跟踪特定证券指数为目标的开放式基金,其基金份额用组合证券进行申购、赎回,并在深圳证券交易所上市交易

46.ETF联接基金:指将其绝大部分基金财产投资于跟踪同一标的指数的ETF(以下简称"目标ETF"),紧密跟踪标的指数表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化,采用开放式运作方式的基金。简称联接基金

47.申购赎回清单:指由基金管理人编制的用以公告申购对价、赎回对价等信息的文件

48.申购对价:指投资者申购基金份额时,按基金合同和招募说明书规定应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价

49.赎回对价:指投资者赎回基金份额时,基金管理人按基金合同和招募说明书规定应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价

50.标的指数:指深证成长40价格指数及其未来可能发生的变更

51.完全复制法:指一种构建跟踪指数的投资组合的方法。通过购买标的指数中的所有成份证券,并且按照每种成份证券在标的指数中的权重确定购买的比例,以达到复制指数的目的

52.最小申购赎回单位:指本基金申购份额、赎回份额的最低数量,投资者申购或赎回的基金份额应为最小申购赎回单位的整数倍

53.现金替代:指申购或赎回过程中,投资者按基金合同和招募说明书的规定,用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金

54.现金差额:指最小申购赎回单位的资产净值与按当日收盘价计算的最小申购赎回单位中的组合证券市值和现金替代之差;投资者申购或赎回时应支付或应获得的现金差额根据最小申购赎回单位对应的现金差额、申购或赎回的基金份额数计算

55.预估现金差额:指由基金管理人估计并在T日申购赎回清单中公布的当日现金差额的估计值,预估现金差额由申购赎回代理券商预先冻结

56.基金份额参考净值:指在交易时间内根据基金管理人提供的计算依据及计算方法计算并在深圳证券交易所发布的基金份额参考净值,简称IOPV

57.基金份额折算:基金管理人根据本基金合同规定将投资者的基金份额进行变更登记的行为

58.元:指人民币元

59.基金利润:指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

60.收益评价日:基金管理人对本基金相对标的指数的超额收益率进行评估之日

61.基金资产总值:指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

62.基金资产净值:指基金资产总值减去基金负债后的价值

63.基金份额净值:指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数的数值

64.基金资产估值:指计算评估基金资产和负债的价值,以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

65.指定媒体:指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、基金管理人、基金托管人的互联网网站及其他媒体

66.不可抗力:指本基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服、且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的,使本基金合同当事人无法全部或部分履行本基金合同的任何事件,包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易

三、基金管理人

(一)基金管理人概况

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32层

设立日期:1999年4月12日

注册资本:贰亿元人民币

股权结构:公司股东为中泰信托投资有限公司(持股比例48%)、中国银河投资管理有限公司(持股比例25%)、光大证券股份有限公司(持股比例25%)、广东证券股份有限公司(持股比例2%)四家公司。

法定代表人:张树忠

电话:0755-83183388

传真:0755-83199588

联系人:肖冰

大成基金管理有限公司设有股东会、董事会、监事会、下设十七个部门,分别是股票投资部、固定收益部、委托投资部、研究部、交易管理部、金融工程部、信息技术部、客户服务部、市场部、总经理办公室、董事会办公室、人力资源部、计划财务部、行政部、基金运营部、监察稽核部和国际业务部。公司在北京、上海、西安、成都、武汉、福州、沈阳和广州等地设立了八家分公司,并在香港设立了子公司。此外,公司还设立了投资决策委员会、投资风险控制委员会和战略规划委员会等专业委员会。

公司以"稳健、高效"为经营理念,坚持"诚实信用、勤勉尽责"的企业精神,致力于开拓基金及证券市场业务,以稳健灵活的投资策略和注重绩优、高成长的投资组合,力求为投资者获得更大投资回报。公司所有人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。

(二)证券投资基金管理情况

截至2010年9月30日,本基金管理人共管理3只封闭式证券投资基金:基金景宏、基金景福、大成优选股票型证券投资基金,及15只开放式证券投资基金:大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成货币市场证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、大成财富管理2020生命周期证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成创新成长股票型证券投资基金(LOF)、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成强化收益债券型证券投资基金、大成策略回报股票型证券投资基金、大成行业轮动股票型证券投资基金、大成中证红利指数证券投资基金和大成核心双动力股票型证券投资基金等。

(三)主要人员情况

1.公司高级管理人员

董事会:

张树忠先生,董事长,经济学博士。1989年7月—1993年2月,任中央财经大学财政系讲师;1993年2月—1997年3月,任华夏证券股份有限公司投资银行总部总经理、研究发展部总经理;1997年3月—2003年7月,任光大证券股份有限公司总裁助理兼北方总部总经理、资产管理总监;2003年7月—2004年6月,任光大保德信基金管理公司董事、副总经理;2004年6月—2006年12月,任大通证券股份有限公司副总经理;2007年1月—2008年1月,任大通证券股份有限公司总经理;2008年1月—2008年4月,任职中国人保资产管理股份有限公司;2008年4月起任中国人保资产管理股份有限公司副总裁、党委委员;2008年11月起同时担任大成基金管理有限公司董事长。

王颖先生,董事总经理,国际工商管理专业博士。2000年12月—2002年9月,任招商证券股份有限公司深圳管理总部副总经理、机构管理部副总经理;2002年9月加入大成基金管理有限公司,历任助理总经理、副总经理;2008年11月起担任大成基金管理有限公司总经理。

刘虹先生,董事,博士,高级经济师。1985年7月—1998年11月,任国家计委国土局主任科员、副处长(挂持工作);1998年11月—2000年9月,任中国农业发展银行资金计划部计划处副处长(挂持工作);2000年9月—2004年9月,任中国人寿保险(集团)公司战略规划部战略研究与规划处处长;2004年9月—2006年2月,任中国人寿保险(集团)公司战略规划部副总经理;2006年2月—2007年6月,任中国人寿保险股份有限公司发展改革部总经理;2007年6月—2007年8月,任中国人民保险集团公司高级专家;2007年8月至今,任人保投资控股有限公司总裁,党委书记;2009年11月起,兼任中国华闻投资控股有限公司总裁、党委书记。

杨亦忠先生,董事,大学本科。历任深圳蓝天基金管理公司投资与研究部经理;长盛基金管理有限公司研究部副总监、基金经理;大成基金管理有限公司研究总监;光大证券证券投资部总经理。现任光大证券助理总裁。

孙学林先生,董事,博士研究生在读,中国注册会计师,注册资产评估师。1997年5月—2000年4月,任职于中国长城信托投资公司;2000年4月—2007年2月,任职于中国银河证券有限公司审计与合规管理部;现任中国银河投资管理有限公司资产管理部总经理。

阚春林先生,独立董事,大学本科。1970—1971年,解放军信阳坦克师锻炼;1971—1987年,任兵器部5107、5137厂生产会计员、财务处长;1987年—1998年,任湖北省财政厅中央企业财务处长、财政部驻湖北省专员助理;1998年—2005年,任财政部驻江西专员办专员助理、副专员、专员、党组书记;2005年8月,任中央纪委、中组部金融巡视组局长;2007年1月退休。

于绪刚先生,独立董事,法学博士,环太平洋律师协会会员、全国律协金融证券委员会委员、华中科技大学兼职教授及研究生导师、北京工商大学客座教授、华北电力大学客座教授。1990年—1995年,任河北省保定市中级人民法院助理审判员;1995年—1998年,北京大学法学硕士学习;1999年,香港大学法律学院访问学者、香港法律教育信托基金访问学者;1999年—2001年,北京大学法学博士学习;2001年起任大成律师事务所律师、高级合伙人、管委会委员。

万曾炜先生,独立董事,经济学博士,研究员,曾任上海市政府发展研究中心处长,上海市浦东新区综合规划土地局党组书记、局长,浦东新区发展计划局党组书记,上海浦东发展集团和上海浦东投资建设有限公司筹建负责人和法人代表,上海市公积金管理中心党委书记、主任,上海市政府特聘决策咨询专家,现任浦东改革与发展研究院院长。

刘大为先生,独立董事,国家开发银行顾问,高级经济师,享受政府特殊津贴专家。中国人民银行研究生部硕士生指导老师,首都经济贸易大学兼职教授,清华大学中国经济研究中心高级研究员。先后在北京市人民政府研究室(副处长、处长)、北京市第一商业局(副局长)、中国建设银行信托投资公司(总经理)、中国投资银行(行长)、国家开发银行(总会计师)工作。

监事会:

胡学光先生,监事长,硕士,高级经济师,广东省高级经济师评审委员会委员。曾在湖北金融高等专科学校任教,广州金融高等专科学校任金融系副主任;1992年—2003年4月,在广东证券股份有限公司先后任"广证基金"、"广证受益"经理、部门总经理、总裁助理、副总裁,兼任中山大学岭南学院兼职教授、中天证券研究院副院长、广东证券博士后科研工作站指导导师;2003年5月至2008年8月任大成基金管理有限公司董事长。

宁加岭先生,监事,大学本科。1983年2月—1987年6月,任财政部人教司副处长、处长;1987年6月—1994年6月,任财政部行政司副司长、司长;1994年6月—1999年6月,任财政部德宝实业总公司总经理、法人代表;1999年6月起,任职于财政部离退休老干部局。

黄建农先生,监事,大学本科。曾任中国银河证券有限责任公司上海江苏北路营业部总经理,中国银河证券有限责任公司资产管理总部副总经理,总经理,中国银河投资管理公司投资管理部总经理。现任中国银河投资管理公司上海投资部董事总经理。

其他高级管理人员:

刘彩翠女士,副总经理,管理学硕士。1999年—2002年,历任江南信托投资有限公司投资银行部副总经理、总经理;2002年—2006年,历任江南证券有限公司总裁助理、投资银行部总经理、机构管理部总经理,期间还任江南宏富基金管理公司筹备组副组长;2006年1月—7月任深圳中航集团公司人力资源部副总经理;2006年8月—2008年5月,任大成基金管理有限公司助理总经理;2008年5月起任大成基金管理有限公司副总经理。

杜鹏女士,督察长,研究生学历。1992年—1994年,历任原中国银行陕西省信托咨询公司证券部驻上交所出市代表、上海业务部负责人;1994年—1998年,历任广东省南方金融服务总公司投资基金管理部证券投资部副经理、广东华侨信托投资公司证券总部资产管理部经理;1998年9月参与大成基金管理有限公司的筹建;1999年3月起,任大成基金管理有限公司督察长兼监察稽核部总监。

杨春明先生,副总经理,经济学学士。曾先后任职于长春税务学院、吉林省国际信托投资公司、招商证券股份有限公司。2005年6月加入大成基金管理有限公司,历任基金运营部总监、市场部总经理、公司助理总经理。2010年11月起任大成基金管理有限公司副总经理。

肖冰先生,副总经理,工商管理硕士。曾任联合证券有限责任公司国际业务部总经理助理、鹏华基金管理有限公司市场部总监、泰达宏利基金管理有限公司市场部总监、景顺长城基金管理有限公司营销主管。2004年3月加入大成基金管理有限公司,历任市场部总监、综合管理部总监、公司董事会秘书。2010年11月起任大成基金管理有限公司副总经理。

2.拟任基金经理

何光明先生,基金经理,工学硕士,14年证券从业经历。1999年加入大成基金管理有限公司,历任研究员、策略分析师、大成精选增值混合型证券投资基金基金经理2004年12月15日至2006年1月20日)大成价值增长证券投资基金基金经理助理、大成积极成长股票基金基金经理助理。2008年01月12日起担任大成价值增长证券投资基金基金经理。

3.公司投资决策委员会

公司投资决策委员会由9名成员组成,设主席1名,其他委员8名。名单如下:

刘明,助理总经理,投资总监,大成优选股票型证券投资基金基金经理,投资决策委员会主席;杨建华,股票投资部总监,负责公司股票投资业务,大成策阳领先股票型证券投资基金、大成核心双动力股票型证券投资基金基金经理,投资决策委员会委员;陈尚前,固定收益部总监,负责公司固定收益证券投资业务,大成强化收益债券型证券投资基金、大成景丰分级债券型证券投资基金基金经理,投资决策委员会委员;曹隆飞,研究部总监,大成财富管理2020生命周期证券投资基金基金经理,投资决策委员会委员;邓韶勇,交易管理部总监,投资决策委员会委员;施永辉,股票投资部副总监,大成蓝筹稳健证券投资基金基金经理,投资决策委员会委员;王立,大成债券投资基金、大成货币市场证券投资基金基金经理,投资决策委员会委员;曹志刚,金融工程部首席金融工程师,投资决策委员会委员;孙蓉林,研究部总监助理,投资决策委员会委员。

上述人员之间不存在亲属关系。

(四)基金管理人的职责

1.依法募集基金,办理或者委托经由证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和注册登记事宜;

2.办理基金备案手续;

3.自基金合同生效之日起,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产;

4.配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;

5.建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金财产分别管理,分别记账,进行证券投资;

6.除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;

7.依法接受基金托管人的监督;

8.计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回对价;

9.采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回对价的方法符合基金合同等法律文件的规定;

10.按规定受理基金份额的申购和赎回申请,及时、足额支付赎回对价;

11.进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

12.编制定期报告;

13.严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

14.保守基金商业秘密,不得泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不得向他人泄露;

15.按照基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配收益;

16.依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;

17.保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;

18.以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;

19.组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

20.因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

21.基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时,应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

22.按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料;

23.建立并保存基金份额持有人名册;

24.面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;

25.执行生效的基金份额持有人大会的决定;

26.不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法权益的活动;

27.依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利,为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利,不谋求对上市公司的控股和直接管理;

28.法律法规、基金合同规定的以及中国证监会要求的其他义务。

(五)基金管理人承诺

1.基金管理人承诺严格遵守《证券法》,并建立健全的内部控制制度,采取有效措施,防止违反《证券法》行为的发生;

2.基金管理人承诺严格遵守《基金法》、《运作办法》,建立健全的内部控制制度,采取有效措施,防止以下《基金法》、《运作办法》禁止的行为发生:

①将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资;

②不公平地对待其管理的不同基金财产;

③利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益;

④向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;

⑤法律法规和中国证监会禁止的其他行为。

4.本基金管理人将根据基金合同的规定,按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制等全权处理本基金的投资。

5.本基金管理人不从事违反《基金法》的行为,并建立健全内部控制制度,采取有效措施,保证基金财产不用于下列投资或者活动:

①承销证券;

②向他人贷款或者提供担保;

③从事承担无限责任的投资;

④买卖其他基金份额,但是国务院另有规定的除外;

⑤向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;

⑥买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券;

⑦从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

⑧依照法律法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他活动。

若法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,履行适当程序后,本基金投资可不受上述规定限制。

(六)基金经理的承诺

1.依照有关法律法规和基金合同的规定,本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益;

2.不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益;

3.不违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定,泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密,亦不依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息;

4.不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

(七)基金管理人的内部控制制度

本基金管理人为加强内部控制,促进公司诚信、合法、有效经营,保障基金份额持有人利益,维护公司及公司股东的合法权益,依据《证券法》、《证券投资基金公司管理办法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》等法律法规,并结合公司实际情况,制定《大成基金管理有限公司内部控制大纲》。

(下转D10版)

深证成长40交易型开放式指数证券投资基金份额发售公告

大成基金管理有限公司

重要提示

1.深证成长40交易型开放式指数证券投资基金(以下简称"本基金")的募集申请已获中国证监会证监许可【2010】1478号文核准。

2.本基金是交易型开放式指数证券投资基金。

3.本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司(以下简称"本公司"),基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称"农业银行"),登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司(以下简称"中登")。

4.本基金将自2010年11月23日起到2010年12月13日公开发售。投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购3种方式。其中,网下现金认购和网上现金认购的日期为2010年11月23日起到2010年12月13日,网下股票认购的日期为2010年12月7日起到2010年12月13日。

5.本基金销售对象为中国境内的个人投资者和机构投资者、合格境外机构投资者及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

6.网下现金认购由本基金管理人办理。

7.本基金网上现金认购通过具有基金代销业务资格及深圳证券交易所会员资格的证券公司办理:国信证券、招商证券、平安证券、长城证券、光大证券、方正证券、华泰联合、华泰证券、广发证券、广州证券、世纪证券、华西证券、国海证券、联讯证券、南京证券、华鑫证券、华林证券、厦门证券、民族证券、中银万国、中信万通、海通证券、山西证券、民生证券、兴业证券、广发华福、长江证券、东莞证券、国联证券、国金证券、东北证券、恒泰证券、华安证券、东海证券、中信证券、东吴证券、中山证券、第一创业、大同证券、宏源证券、西藏证券、湘财证券、中金公司、东方证券、国泰君安、西南证券、银河证券、西部证券、渤海证券、上海证券、华龙证券、万联证券、齐鲁证券、国元证券、国都证券、中银证券、华宝证券、红塔证券、中信金通、日信证券、浙商证券、财富证券、金元证券、国盛证券、中原证券、德邦证券、财通证券、新时代证券、江海证券、中投证券、中信建投、安信证券、银泰证券、瑞银证券、中航证券等(排序不分先后)。

8.网下股票认购代理机构为:渤海证券、银河证券、中信建投、信达证券、西南证券、国联证券、华泰证券、国泰君安、中银万国、国信证券、招商证券、长城证券、安信证券、平安证券、东莞证券、广州证券、广发证券、华泰联合、长江证券、方正证券、中原证券、中信证券、齐鲁证券、光大证券、海通证券、东吴证券等(排序不分先后)。

9.投资者认购本基金时需具有深圳证券交易所A股账户或证券投资基金账户。

10.本基金认购费用或认购佣金不高于1.0%。

11.网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额需为1,000份或其整数倍,最高不得超过99,999,000份。网下现金认购以基金份额申请。投资者通过基金管理人办理网下现金认购,每笔认购份额须在10万份以上(含10万份)。网下股票认购以单只股票股数申报,用以认购的股票必须是深证成长40指数成份股和已公告的备选成份股。单只股票最低认购申报股数为1,000股,超过1,000股的部分须为100股的整数倍。投资者可以多次提交认购申请,累计申报股数不设上限。

12.网上现金认购本基金时,投资者需按发售代理机构的规定备足认购资金,办理认购手续。投资者可多次申报,不可撤单,申报一经确认,认购资金即被冻结。网下现金认购本基金时,投资者需按基金管理人的规定办理相关认购手续,并备足认购资金。网下现金认购申请提交后不得撤销。网下股票认购本基金时,投资者需按发售代理机构的规定,到发售代理机构网点办理认购手续,并备足认购股票。网下股票认购申请提交后不得撤销,发售代理机构对投资者申报的股票进行冻结。

13.基金销售机构认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记结算机构或基金管理人公司的确认结果为准。

14.募集期间现金认购资金全部存入本基金募集专户,投资者现金认购款项在募集期间所产生的利息归投资者所有,在本基金募集结束后,折算为基金份额计入投资者的账户。募集股票在网下股票认购日至登记结算机构进行股票过户日的冻结期间所产生的权益归投资者所有。

15.本公告仅对本基金募集发售的有关事项和规定予以说明。投资者欲了解本基金详细情况,请阅读《深证成长40交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。本基金的招募说明书、基金合同及基金份额发售公告将发布在基金管理人的网站(www.dcfund.com.cn)。投资者可以在相关网站下载业务申请表格或相关法律文件。

16.募集期内,本公司可能新增代销机构,请留意近期本公司及各代销机构的公告或通知,或按打本公司及各代销机构的公司服务电话咨询。

17.代销机构代销本基金的城市名称、销售网点、联系方式以及开户和认购等具体事项,本基金份额发售公告未有说明的,请查阅该代销机构的公告。

18.本公司已开通了网上开户和认购服务,有关基金网上交易的具体业务规则请登录本公司网站(www.dcfund.com.cn)查询。

19.投资者如有任何问题,可按打本公司客户服务电话400-888-5558,中国农业银行股份有限公司客服电话95599或其他代销机构的客服电话进行咨询。

20.本基金管理人可根据各种具体情况对本次募集安排做适当调整,并予以公告。

21.基金募集期结束后,基金管理人确定本基金的申购赎回代理券商名单,经深圳证券交易所等有关部门认可后,予以公告。本基金上市后,未登记在申购赎回代理券商的基金份额只能进行二级市场买卖,如投资者需进行上述份额的赎回交易,须转托管到本基金的申购赎回代理券商。

22.风险提示

证券投资基金(以下简称"基金")是一种长期投资工具,其主要功能是分散投资,降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具,投资者购买基金,既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益,也可能承担基金投资所带来的损失。

基金分为股票基金、混合基金、债券基金、货币市场基金等不同类型,投资者投资不同类型的基金将获得不同的收益预期,也将承担不同程度的风险。一般来说,基金的收益预期越高,投资者承担的风险也越大。

深证成长40交易型开放式指数证券投资基金是股票基金,预期风险收益水平高于混合基金、债券基金和货币市场基金,同时本基金为指数型基金,紧密跟踪标的指数,具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征,属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资者在投资本基金前,需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者根据所持有份额享受基金的收益,但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括:标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险以及基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、基金的退市风险、投资者申购、赎回失败的风险以及基金份额赎回对价的变现风险等等。

基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产,但不保证本基金一定盈利,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,基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险,投资人认购(或申购)基金时,请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同。基金管理人提醒投资者基金投资的"买者自负"原则,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,由投资者自行负担。

23.本基金管理人拥有对本基金份额发售公告的最终解释权。

一、本次募集基本情况

(一)基金名称:深证成长40交易型开放式指数证券投资基金

场内简称:深成长

场外简称:大成深证成长40ETF

(二)基金代码:159906

(三)基金类别:股票型指数基金

(四)基金运作方式:交易型开放式

(五)基金存续期限:不定期

(六)基金份额初始面值:人民币1.00元

(七)募集对象

中国境内的个人投资者和机构投资者、合格境外机构投资者及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

(八)销售机构

1.网下现金认购代理机构

大成基金管理有限公司

2.网下股票认购代理机构

渤海证券、银河证券、中信建投、信达证券、西南证券、国联证券、华泰证券、国泰君安、中银万国、国信证券、招商证券、长城证券、安信证券、平安证券、东莞证券、广州证券、广发证券、华泰联合、长江证券、方正证券、中原证券、中信证券、齐鲁证券、光大证券、海通证券、东吴证券等(排序不分先后)

3.网上现金认购代理机构

国信证券、招商证券、平安证券、长城证券、光大证券、方正证券、华泰联合、广发证券、广州证券、世纪证券、华西证券、国海证券、联讯证券、南京证券、华鑫证券、华林证券、厦门证券、民族证券、中银万国、中信万通、海通证券、山西证券、民生证券、兴业证券、广发华福、长江证券、东莞证券、国联证券、国金证券、东北证券、恒泰证券、华安证券、东海证券、中信证券、东吴证券、中山证券、第一创业、大同证券、宏源证券、西藏证券、湘财证券、中金公司、东方证券、国泰君安、西南证券、银河证券、西部证券、渤海证券、上海证券、华龙证券、万联证券、齐鲁证券、国元证券、国都证券、中银证券、华宝证券、红塔证券、中信金通、日信证券、浙商证券、财富证券、金元证券、国盛证券、中原证券、德邦证券、财通证券、新时代证券、江海证券、中投证券、中信建投、安信证券、银泰证券、瑞银证券、中航证券等(排序不分先后)

(九)募集期限与发售募集期

本基金的募集期限自本基金发售之日起最长不超过3个月。

本基金的发售募集期(或称募集期、首次募集期、首次发行期等)为2010年11月23日至2010年12月13日。

基金管理人有权根据基金募集的实际情况依照相关程序延长或缩短发售募集期。基金发售募集期若经延长,最长不得超过前述募集期限。

部分销售机构在本基金发售募集期内对于机构或个人的发售日以及每日具体业务办理时间可能不同,具体安排详见各销售机构公告或通知。

如遇突发事件及其他特殊情况,以上基金募集期的安排可以适当调整。

(十)基金合同生效

1.基金募集期限届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书决定