大成中证500深市交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书

基金管理人：大成基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司
上市地点：深圳证券交易所
上市日期：2013年10月21日
公告日期：2013年10月16日

一、重要声明与提示

《大成中证500深市交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》（以下简称“本公告书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号〈上市交易公告书的内容与格式〉》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，大成基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）的董事会及董事保证本公告书所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

大成中证500深市交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）托管人中国银行股份有限公司保证本公告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和深圳证券交易所（以下简称“深交所”）对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

凡本公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在2013年8月14日《证券时报》、《中国证券报》及大成基金管理有限公司网站（www.dcfund.com.cn）上的《大成中证500深市交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）。

二、基金概览

1、基金名称：大成中证500深市交易型开放式指数证券投资基金
2、基金类型：股票型
3、基金运作方式：交易型开放式
4、基金场内简称：500深ETF
5、基金代码：159932
6、标的指数简称：中证500深市指数
7、标的指数代码：399802
8、基金份额总额：293,606,145份（截至：2013年10月14日）
9、基金份额净值：1.138元（截至：2013年10月14日）
10、本次上市交易份额：293,606,145份（截至：2013年10月14日）
11、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
12、上市交易日期：2013年10月21日
13、基金管理人：大成基金管理有限公司（网站：www.dcfund.com.cn）
14、基金托管人：中国银行股份有限公司
15、登记结算机构：中国证券登记结算有限责任公司
16、申购赎回代办券商：中国银河证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、中国民族证券有限责任公司、上海证券有限责任公司、东海证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、华鑫证券有限责任公司

三、基金份额的募集与上市交易

（一）上市前基金募集情况
1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会证监许可【2013】780号
2、基金合同生效日：2013年9月12日
3、基金运作方式：交易型开放式
4、基金合同期限：不定期
5、发售日期：2013年8月19日至2013年9月6日。其中，网下现金认购和网上现金认购的日期为2013年8月19日起到2013年9月6日，网下股票认购的日期为2013年9月2日起到2013年9月6日
6、发售价格：1.00元人民币
7、份额发售方式：网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购3种方式
8、发售机构：
（1）网上现金发售代理机构
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
（2）网下现金及网下股票发售机构
大成基金管理有限公司
（3）网下股票发售代理机构
中信证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、国都证券有限责任公司、渤海证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投股份有限公司、民生证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、爱建证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、上海证券有限责任公司、中银万国证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中信证券（浙江）有限责任公司、东海证券有限责任公司、浙商证券有限责任公司、财富证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、江海证券有限公司、招商证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、长城证券有限责任公司、广州证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、东莞证券有限责任公司、广发证券股份有限公司、金元证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、华安证券有限责任公司、国元证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、方正证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、中原证券股份有限公司、中航证券有限公司。
9、验资机构名称：安永华明会计师事务所
10、募集资金总额及人账情况：
本次募集的净认购金额为333,486,098.00元人民币（含所募集股票市值），认购款项在本基金验资确认日之前产生的银行利息共计22,864.19元人民币。本次募集的净认购金额已于2013年9月12日全额划入本基金在基金托管人中国银行股份有限公司开立的大成中证500深市交易型开放式指数证券投资基金托管专户。网上现金认购在募集期间产生的利息22156.00元已由中国证券登记结算有限公司于银行季度结息日后，由认购账户划入托管账户，网下现金认购在募集期间产生的利息708.19元，已于2013年9月12日划至托管账户。

本次募集有效认购户数为4,413户，按照每份基金份额面值1.00元人民币计算，本次募集资金及其产生的利息结转的基金份额共计333,508,962.00份，已全部计入各基金份额持有人的基金账户。
11、本基金募集备案情况：本基金于2013年9月12日验资完毕，2013年9月12日向中国证监会提交了验资报告，办理基金备案手续，并于2013年9月12日获得书面确认，本基金合同自该日起正式生效。
12、基金合同生效日：2013年9月12日
13、基金合同生效日的基金份额总额：333,508,962.00份。
（二）本基金日常申购、赎回情况
基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理申购、赎回。基金管理人在申购开始日、赎回开始日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。
（三）本基金日常申购、赎回安排
本基金日常申购、赎回开放日：2013年10月21日。
（四）基金份额折算
为了提高本基金的交易便利，便于投资者使用本基金和大成中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“中证500沪市ETF”）配对模拟中证500指数表现，根据《大成中证500深市交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定和《关于大成中证500深市交易型开放式指数证券投资基金份额折算的公告》，本基金管理人于2013年10月11日对本基金进行了基金份额折算。当日中证500指数深市成份股权重是47.09%，中证500指数沪市成份股权重是52.91%；大成中证500沪市ETF基金资产净值为34,590,972.08元，中证500沪市ETF基金总份额27,058,261.00份；大成中证500深市ETF折算前基金资产净值为334,058,397.55元，中证500深市ETF折算前基金总份额333,508,962.00份。

根据《关于大成中证500深市交易型开放式指数证券投资基金份额折算的公告》定义的折算基准日基金份额折算比例计算公式，折算基准日基金份额折算比例为0.88036156，折算后中证500深市ETF基金份额总额为293,606,145份，折算后中证500深市ETF基金份额净值为1.138元。

本基金管理人已根据上述折算比例，对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算，并由中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司于2013年10月14日进行了变更登记。折算后的基金份额保留到整数位，小数部分舍去，由此产生的误差计入基金财产。
（五）本基金上市交易的主要内容
1、基金上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上【2013】359号
2、上市交易日期：2013年10月21日
3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。
投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。
4、基金场内简称：500深ETF
5、基金交易代码：159932
6、本次上市交易的基金份额：293,606,145份
7、未上市交易份额的流通规定：本基金上市交易后，所有的基金份额均可进行交易，不存在未上市交易的基金份额。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）截至2013年10月14日，本基金持有人户数为4,413户，平均每户持有的基金份额：66,532份
截至2013年10月14日，机构投资者持有的基金份额为29,955,153份，占基金总份额的比例为10.2025%；个人投资者持有的基金份额为263,650,992份，占基金总份额的比例为89.7975%。
（二）基金份额前十名持有人情况：
截至2013年10月14日，本基金前十名基金份额持有人情况

序号	持有人名称(全称)	持有基金份额（份）	占基金总份额的比例
1	中信证券股份有限公司	8,725,263.00	2.97%
2	招商证券股份有限公司	7,043,097.00	2.40%
3	邓润香	4,508,415.00	1.54%
4	上海诺毅投资管理有限公司	4,402,705.00	1.50%
5	东兴证券-光大-东兴1号优选基金集合资产管理计划	4,401,550.00	1.50%
6	周彩珍	3,786,400.00	1.29%
7	李珍	2,922,884.00	1.00%
8	肇恒艺	2,641,237.00	0.90%
9	刘海涛	2,641,161.00	0.90%
10	姜松梅	2,639,400.00	0.90%
合计		43,712,112.00	14.89%

注：以上信息依据中国证券登记结算有限公司提供的持有人信息编制。

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人
1、名称：大成基金管理有限公司
2、法定代表人：张树忠
3、总经理：王颖
4、注册资本：贰亿元人民币
5、注册地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
6、批准设立机关及设立批准文号：中国证券监督管理委员会证监基金字【1999】10号
7、法人营业执照文号：440301102808319
8、经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务
9、股东及持股比例：公司股东为中泰信托有限责任公司、中国银河投资管理有限公司、光大证券股份有限公司和广东证券股份有限公司，各股东持股比例分别为48%、25%、25%、2%。
10、内部组织结构及职能：大成基金管理有限公司设有股东会、董事会、监事会，下设二十个部门，分别是股票投资部、数量投资部、社保基金及机构投资部、固定收益部、委托投资部、研究部、交易管理部、产品开发与金融工程部、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、风险管理部和国际业务部。公司在北京、上海、西安、成都、武汉、福州、沈阳、广州和南京等地设立了九家分公司，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“责任、回报、专业、进取”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。
11、人员情况：截止2013年9月30日，公司共有员工294名，大学本科及以上学历268名，占员工总数91%。
12、信息披露负责人及咨询电话：杜鹏，0755-83183388
13、基金管理业务情况简介：截至2013年9月30日，本基金管理人共管理2只封闭式证券投资基金：景宏证券投资基金、景福证券投资基金，4只ETF及2只ETF联接基金：大成中证100交易型开放式指数证券投资基金、深证成长40交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金及大成中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中证500深市交易型开放式指数证券投资基金，1只创新型基金：大成景丰分级债券型证券投资基金，1只QDII基金：大成标普500等权重指数证券投资基金及29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、大成创新成长混合型证券投资基金(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、大成核心双动力股票型证券投资基金、大成保本混合型证券投资基金、大成景恒保本混合型证券投资基金、大成内需增长股票型证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金、大成中证内地消费主题指数证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、大成优选股票型证券投资基金（LOF）、大成月添利理财债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场基金、大成理财21天债券型发起式证券投资基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、大成景安短融债券型证券投资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金和大成景旭纯债债券型证券投资基金。
14、本基金基金经理：谌湛先生，金融工程硕士，4年证券从业经历。2009年加入大成基金管理有限公司，历任金融工程师、数量投资分析师。2013年1月4日起担任深证成长40交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理。2013年9月12日起担任大成中证500深市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。
（二）基金托管人
1、公司概况
名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）
住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期：1983年10月31日
注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整
法定代表人：田国立
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号
托管及投资者服务部总经理：李爱华
托管部门信息披露联系人：唐州徽
电话：（010）66594855
传真：（010）66594942
2、基金托管部门及主要人员情况
中国银行于1998年设立基金托管部，为进一步树立以投资者为中心的服务理念，中国银行于2005年3月23日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部，现有员工120余人。另外，中国银行在重点分行已开展托管业务。
目前，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险基金、QFII、QDII、券商资产管理计划、信托计划、年金基金、理财产品、私募基金、资金托管等门类齐全的托管产品体系。在国内，中国银行率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，为各类客户提供个性化的托管服务，托管资产规模居同业前列。
3、基金托管业务经营情况
截至2013年6月末，中国银行已托管长盛创新先锋混合、长盛同盛封闭、长盛同智优势混合（LOF）、大成2020生命周期混合、大成蓝筹稳健混合、大成优选LOF、大成景宏封闭、工银大盘蓝筹股票、工银核心价值股票、国泰沪深300指数、国泰金鹿保本混合、国泰金鹏蓝筹混合、国泰区位优势股票、国投瑞银稳定增利债券、海富通股票、海富通货币、海富通精选或号混合、海富通精选或号混合、海富通收益增长混合、海富通中证100指数（LOF）、华宝兴业大盘精选股票、华宝兴业动力组合股票、华宝兴业先进成长股票、华夏策略混合、华夏大盘精选混合、华夏回报二号混合、华夏回报混合、华夏行业股票(LOF)、嘉实超短债债券、嘉实成长收益混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实沪深300指数(LOF)、嘉实货币、嘉实稳健混合、嘉实研究精选股票、嘉实增长混合、嘉实债券、嘉实主题混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票型、金鹰成份优选股票、金鹰行业优势股票、银河成长股票、易方达平稳增长混合、易方达策略成长混合、易方达策略成长二号混合、易方达积极成长混合、易方达货币、易方达稳健收益债券、易方达深证100ETF、易方达中小盘股票、易方达深证100ETF联接、万家180指数、万家稳健增利债券、银华优势企业混合、银华优质增长股票、银华领先策略股票、景顺长城动力平衡混合、景顺长城优选股票、景顺长城货币、景顺长城鼎益股票(LOF)、泰信天天收益货币、泰信优质生活股票、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、招商先锋混合、泰达宏利精选股票、泰达宏利集利债券、泰达宏利中证财富大盘指数、华泰柏瑞盛世中国股票、华泰柏瑞积极成长混合、华泰柏瑞价值增长股票、华泰柏瑞货币、华泰柏瑞量化现行股票型、南方高增长股票(LOF)、国富潜力组合股票、国富强化收益债券、国富成长动力股票、宝盈核心优势混合、招商行业领先股票、东方核心动力股票、华安行业轮动股票型、摩根士丹利华鑫强收益债券型、诺德中小盘股票型、民生加银稳健成长股票型、博时宏观回报债券型、易方达岁丰添利债券型、富兰克林国海中小盘股票型、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接、上证中小盘交易型开放式指数、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接、长城中小盘成长股票型、易方达医疗保健行业股票型、景顺长城稳定收益债券型、上证180金融交易型开放式指数、国泰上证180金融交易型开放式指数证券投资基金联接、诺德优选30股票型、泰达宏利聚利分级债券型、国联安优选行业股票型、长盛同鑫保本混合型、金鹰中证技术领先指数增强型、泰信中证200指数、大成内需增长股票型、银华永祥保本混合型、招商深圳电子信息传媒产业（TMT）50交易型开放式指数、招商深证TMT50交易型开放式指数证券投资基金联接、嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接、深证基本面120交易型开放式指数、上证180成长交易型开放式指数、华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接、易方达资源行业股票型、华安深证300指数、嘉实信用债券型、平安大华行业先锋股票型、华泰柏瑞信用增利债券型、泰信中小盘精选股票型、海富通国策导向股票型、中邮上证380指数增强型、泰达宏利中证500指数分级、长盛同禧信用增利债券型、银华中证内地资源主题指数分级、平安大华深证300指数增强型、嘉实安心货币市场、上投摩根健康品质生活股票型、工银瑞信睿智中证500指数分级、招商优势企业灵活配置混合型、国泰中小板300成长交易型开放式指数、国泰中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金联接、景顺长城优信增利债券型、诸德周期策略股票型、长盛电子信息产业股票型、诺安中证创业成长指数分级、信诚双盈分级债券型、嘉实沪深300交易型开放式指数、民生加银信用双利债券型、工银瑞信基本面量化策略股票型、信诚周期轮动股票型、富兰克林国海研究精选股票型、诺安汇鑫保本混合型、平安大华策略先锋混合型、华宝兴业中证短融50指数债券型、180等权重交易型开放式指数、华安双月鑫短期理财债券型、大成景恒保本混合型、景顺长城上证180等权重交易型开放式指数证券投资基金联接、上投摩根分红添利债券型、嘉实优化红利股票型、长盛同鑫二号保本混合型、招商信用增强债券型、华宝兴业资源优选股票型、中证500沪市交易型开放式指数、大成中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金联接、博时医疗保健行业股票型、诺德深证300指数分级、华夏安康信用优选债券型、汇添富多元收益债券型、广发双债添利债券型、长盛添利30天理财债券型、信诚理财7日益债券型、长盛添利60天理财债券型发起式、平安大华添利债券型、大成理财21天债券型发起式、华泰柏瑞稳收益债券型、信诚添金分级债券型、国泰现金管理货币市场、国投瑞银纯债债券型、银华中证中票50指数债券型、华安信用增强债券型、长盛同丰分级债券型、汇添富理财21天债券型发起式、国泰国证房地产业指数分级、招商央视财经50指数、嘉实中证中期企业债指数、大成中证100交易型开放式指数、长盛纯债债券型、华夏双债增强债券型、泰达宏利信用合利定期开放债券型、招商安润保本混合型、长盛上证市值百强交易型开放式、长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接、南方中债中期票据指数债券型发起式、嘉实中证金边中期国债交易型开放式、嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金联接、国投瑞银中高等级债券型、上投摩根成长动力混合型、嘉实丰益纯债定期开放债券型、大成景兴信用债债券型、海富通养老收益混合型、广发聚鑫债券型、泰达宏利高票息定期开放债券型、长盛季季红1年期定期开放债券型、诺安信用债券一年定期开放债券型、嘉实海外中国股票(QDII)、银华全球优选(QDII-FOF)、长盛环球景气行业大盘精选股票型(QDII)、华泰柏瑞亚洲领导企业股票型(QDII)、信诚金砖四国积极配置(QDII)、海富通大中华精选股票型（QDII）、招商标普金砖四国指数（LOF-QDII）、华宝兴业成熟市场动量优选（QDII）、大成标普500等权重指数（QDII）、长信标普100等权重指数（QDII）、博时抗通胀增强回报（QDII）、华安大中华升级股票型（QDII）、信诚全球商品主题（QDII）、上投摩根全球天然资源股票型、工银瑞信中国机会全球配置股票型（QDII）、易方达标普全球高端消费品指数增强型（QDII）、建信全球资源股票型（QDII）、恒生交易型开放式指数（QDII）、恒生交易型开放式指数证券投资基金联接（QDII）、广发纳斯达克100指数（QDII）、工银瑞银标普全球自然资源指数证券投资基金（LOF-QDII）、嘉实美国成长股票型证券投资基金（QDII）等214只证券投资基金，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。
（三）基金验资机构
名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
执行事务合伙人：Ng Albert Kong Ping 吴港平
电话：（010）58153000、（0755）25028288
传真：（010）85188298、（0755）25026188
签章注册会计师：昌华、王华
联系人：李妍明

六、基金合同摘要

详见本公告书附件。

七、基金财务状况

本基金募集期间发生的信息披露费、会计师费、律师费及其他费用由基金管理人承担，不从基金财产列支，其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率或佣金比例收取认购费。
本基金认购后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。
大成中证500深市交易型开放式指数证券投资基金2013年10月14日资产负债表（未经审计）如下：
单位：人民币元

项目 \ 时间	2013年10月14日
资 产：	
银行存款	324,596,596.42
结算备付金	3,157,894.74
存出保证金	2,353.62
交易性金融资产	6,414,239.00
其中：股票投资	6,414,239.00
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
其他资产	36,668.21
资产总计	334,207,751.99
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	64,013.49
应付托管费	12,802.70
应付交易费用	7,586.09
其他负债	41,867.14
负债合计	126,269.42
所有者权益：	
实收基金	333,508,962.00
未分配利润	572,520.57
所有者权益合计	334,081,482.57
负债和所有者权益总计	334,207,751.99

附注：截至2013年10月14日本基金发行在外的基金份额为293,606,145.00份，基金份额净值为1.138元。

八、基金投资组合

截至2013年10月14日，本基金的投资组合如下：
（一）基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	6,414,239.00	1.92
	其中：股票	6,414,239.00	1.92
2	固定收益投资	-	0.00
	其中：债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
3	金融衍生品投资	-	0.00
4	买入返售金融资产	-	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
5	银行存款和结算备付金合计	327,754,491.16	98.07
6	其他资产	39,021.83	0.01
7	合计	334,207,751.99	100.00

（二）按行业分类的股票投资组合
1、指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	8,580.00	0.00
B	采矿业	1,227,725.00	0.37
C	制造业	3,333,995.00	1.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	225,830.00	0.07
E	建筑业	14,660.00	0.00
F	批发和零售业	345,683.00	0.10
G	交通运输、仓储和邮政业	452,568.00	0.14
H	住宿和餐饮业	181,200.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	0.00
J	金融业	-	0.00
K	房地产业	573,148.00	0.17
L	租赁和商务服务业	26,130.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	-	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	24,720.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	-	0.00
	合计	6,414,239.00	1.92

2、积极投资按行业分类的股票投资组合
2013年10月14日，本基金未持有积极投资股票。
（三）按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细
1、指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

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(%)
1	000697	炼石有色	80,000	869,600.00	0.26
2	000959	首钢股份	202,600	453,824.00	0.14
3	000518	四环生物	105,100	379,411.00	0.11
4	000900	现代投资	56,000	375,200.00	0.11
5	000683	远兴能源	73,100	301,903.00	0.09
6	000541	佛山照明	41,400	259,164.00	0.08
7	000762	西藏矿业	19,400	232,412.00	0.07
8	002601	佰利联	11,000	231,000.00	0.07
9	000932	华菱钢铁	111,500	209,620.00	0.06
10	000608	阳光股份	35,000	186,200.00	0.06

2、积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名股票投资明细
2013年10月14日，本基金未持有积极投资股票。
（四）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
2013年10月14日，本基金未持有权证。
（五）按债券品种分类的债券投资组合
2013年10月14日，本基金未持有债券。
（六）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
2013年10月14日，本基金未持有债券。
（七）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
2013年10月14日，本基金未持有资产支持证券。
（八）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被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。
2、本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。
3、2013年10月14日其他资产构成：

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,353.62
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	36,668.21
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	
9	合计	39,021.83

4、2013年10月14日持有的处于转股期的可转换债券明细
2013年10月14日，本基金未持有处于转股期的可转换债券。
5、2013年10月14日前十名股票中存在流通受限情况的说明
（1）期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明
2013年10月14日，本基金指数投资的前十名股票中不存在流通受限情况。
（2）期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明
2013年10月14日，本基金未持有积极投资股票。
6、投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

九、重大事件揭示

以2013年10月11日为基金份额折算日，本基金进行了份额折算，具体内容详见第三章的“（四）基金份额折算”。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺：
（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。
（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。
（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：
（一）严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、《基金合同》的规定，设立专门的基金托管部，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。
（二）根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。
（三）基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规规定的行为，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，督促基金管理人改正。
（四）基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

十二、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

十三、备查文件目录

（一）备查文件目录
1、中国证监会核准大成中证500深市交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
2、《大成中证500深市交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
3、《大成中证500深市交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
4、《大成中证500深市交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
5、关于大成中证500深市交易型开放式指数证券投资基金募集之法律意见书
6、基金管理人业务资格批件和营业执照
7、基金托管人业务资格批件和营业执照
8、中国证监会要求的其他文件
（二）存放地点：基金管理人和基金托管人的办公场所
（三）查阅方式：基金投资者可在营业时间免费查阅，或通过指定的信息披露媒体、本基金管理人网站（www.dcfund.com.cn）查阅，但应以基金合同正本为准。

大成基金管理有限公司
二〇一三年十月十六日

附件：大成中证500深市交易型开放式指数证券投资基金基金合同摘要

以下内容摘自《大成中证500深市交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务
（一）基金管理人的权利与义务
1、基金管理人的权利
（1）依法募集基金；
（2）自基金合同生效之日起，根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产；
（3）依照基金合同收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
（4）销售基金份额；
（5）召集基金份额持有人大会；
（6）依据基金合同及有关法律规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了基金合同及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
（7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
（8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
（9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金注册登记机构办理基金登记业务并获得基金合同规定的费用；
（10）依据基金合同及有关法律规定决定基金收益的分配方案；
（11）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
（12）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；
（13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；
（14）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
（15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
（16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回和非交易过户的业务规则，决定基金的除调高托管费和管理费之外的费率结构和收费方式；
（17）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。
2、基金管理人的义务
（1）依法募集基金，办理或者委托经中国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、谨慎勤勉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，不得利用基金财产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）采取适当合理的措施使计算基金份额认购价格、申购对价和赎回对价的方法符合基金合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购对价、赎回对价，编制申购赎回清单；
（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
（10）编制季度、半年度和年度基金报告；
（11）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；
（12）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、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，不向他人泄露；
（13）按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基金收益；
（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回对价；
（15）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；
（16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上；
（17）确保需要向基金投资人提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资人能够按照基金合同规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；
（18）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；
（19）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；
（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时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
（21）监督基金托管人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
（22）当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任，但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失，而基金管理人首先承担了责任的情况下，基金管理人有权向第三方追偿；
（23）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实施其他法律行为；
（24）基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，基金合同不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人，发售代理机构将已冻结的股票解冻；
（25）执行生效的基金份额持有人大会的决议；
（26）建立并保存基金份额持有人名册；
（27）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。
（二）基金托管人的权利与义务
1、基金托管人的权利
（1）自基金合同生效之日起，依法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；
（2）依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规