（上接B87版）

（83）国盛证券有限责任公司
注册地址：江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦
办公地址：江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦4楼
法定代表人：曾小普
联系人：徐美云
电话：0791-6285337
传真：0791-6282293
网址：www.gsstock.com
（84）华鑫证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01（b）单元
办公地址：上海市肇嘉浜路750号
法定代表人：洪家新
联系人：陶敏
网站：www.cfsc.com.cn
客户服务电话：021-32109999；029-68918888；4001099918
(85)中山证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层
法定代表人：吴永良
客服电话：400-1022-011
网址：www.zszq.com.cn
（86）国泰君安证券股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区商城路618号
法定代表人：杨德红
客服电话：95521
联系人：芮敏祺
电话：021-38676666
传真：021-38670161
网址：www.gtja.com
(87)中信建投股份有限公司
注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼
法定代表人：王常青
客服电话：4008888108
联系人：权唐
电话：010-85130577
传真：010-65182261
网址：www.csc108.com
（88）华融证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街8号
法定代表人：祝献忠
联系人：黄恒
联系电话：010-58568062
传真：010-58568062
客户服务电话：010-58568118
网址：www.hrsec.com.cn
（89）和讯信息科技有限公司
注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人：王莉
联系人：常春艳
联系电话：0755-82721122
传真：0755-82029055
客户服务电话：4009200022
网址：http://licaike.hexun.com
（90）上海天天基金销售有限公司
注册地址：上海市徐汇区龙田路195号3C座9楼
法人代表：其实
联系人：高莉莉
电话：021-54509988
传真：021-64383798
客户服务电话：400-1818-188
网址：www.1234567.com.cn
（91）杭州数米基金销售有限公司
注册地址：杭州市余杭区仓前街文一西路1218号1栋202室
法人代表：陈柏青
联系人：张裕
电话：0571-2882935
传真：0571-26698533
客户服务电话：4000-766-123
网址：www.fund123.cn
（92）中国民族证券有限责任公司
注册地址：北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼40层-43层
法人代表：赵大建
联系人：李微
客户服务电话：400-889-5618
网址：www.e5618.com
（93）联讯证券股份有限公司
注册地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
法人代表：徐刚
联系人：彭莲
客户服务电话：95564
网址：www.lxzq.com.cn
（94）北京钱景财富投资管理有限公司
注册地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
办公地址：北京市海淀区丹棱街6号中关村金融大厦（丹棱soho）1008
法定代表人：赵荣春
联系人：魏争
网站：www.qianjing.com
客户服务电话：400-893-6885
(95)诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司?
注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
法定代表人：汪静波
办公地址：上海市杨浦区昆明路508号北美广场B座12楼 ?
联系人：张裕
网站：www.noah-fund.com
客户服务电话：400-821-5399
（96）浙江同花顺基金销售有限公司?
注册地址：浙江省杭州市文二西路1号元茂大厦903
法定代表人：凌顺平
办公地址：浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼?@ 联系人：林海明 @ 网站：www.5ifund.com@ 客户服务电话：4008-773-772

3. 场内代销机构

场内代销机构是指具有开放式基金代销资格，经上海证券交易所和本基金管理人认可的，可通过上海证券交易所场内“上证基金通”办理开放式基金的申购与赎回业务的会员单位，详见上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）。

本基金管理人可以根据相关法律法规要求，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：中国证券登记结算有限责任公司
注册地址：北京市西城区金融大街27号投资广场23层
办公地址：北京市西城区金融大街27号投资广场23层
法定代表人：陈耀先
电话：010-58598839
传真：010-58598907
联系人：朱立元

（三）律师事务所和经办律师

律师事务所名称：通力律师事务所
注册地址：上海市浦东南路528号上海证券大厦南塔21楼
办公地址：上海市浦东南路528号上海证券大厦南塔21楼
经办律师：秦悦民、傅轶
电话：021-68818100
传真：021-68816880

（四）会计师事务所和经办注册会计师

公司名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册地址：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
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
法定代表人：Ng Albert Kong Ping 吴港平
经办注册会计师：昌华、王华
电话：（010）58153000、（0755）25028288
传真：（010）85188298、（0755）25026188
联系人：李妍

四、基金的名称

大成沪深300指数证券投资基金

五、基金类别

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，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%。

八、基金的投资范围

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、备选成份股、新股（如一级市场初次发行或增发）等，现金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。

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%。

九、基金的投资策略

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。

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。

1. 决策依据

（1）有关法律、法规、基金合同和标的指数等的相关规定；

（2）经济运行态势和证券市场走势。

2. 投资管理体制

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。

3. 投资程序

（1）金融工程部运用风险监测模型以及各种风险监控指标，结合公司内外研究报告，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，依此提出研究分析报告。

（2）投资决策委员会依据金融工程部等部门提供的研究报告，定期召开或遇重大事项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）根据标的指数，结合研究报告，基金经理原则上依据指数成份股的权重构建组合。在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下，基金经理将采取适当的方法，以降低交易成本、控制投资风险。

（4）交易管理部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）金融工程部等部门根据市场变化定期和不定期对基金进行投资绩效评估，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风险控制。

（6）基金经理跟踪标的指数变动，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况、金融工程部和监察稽核部的绩效评估报告和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）本基金管理人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。

4. 金融衍生产品投资管理

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。

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。

十、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为沪深300指数。

如果沪深300指数被停止编制及发布，或沪深300指数由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致沪深300指数不宜继续作为业绩比较基准，本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则，变更本基金的业绩比较基准。

本基金由于上述原因变更业绩比较基准，基金管理人需报中国证监会核准后，应于正式实施变更前2日内在至少一种中国证监会指定的媒体上予以公告。

十一、基金的风险收益特征

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。

十二、基金投资组合报告（截至2015年6月30日）

基金管理人的董事会及董事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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据基金合同规定，于2015年10月14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截至2015年6月30日，本报告中所列财务数据已经审计。

1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	3,058,973,307.14	92.18
	其中：股票	3,058,973,307.14	92.18
2	固定收益投资	50,270,000.00	1.51
	其中：债券	50,270,000.00	1.51
	资产支持证券	-	0.00
3	贵金属投资	-	0.00
4	金融衍生品投资	-	0.00
5	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
6	银行存款和结算备付金合计	152,140,314.12	4.58
7	其他各项资产	56,985,267.87	1.72
8	合计	3,318,368,889.13	100.00

2. 报告期末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	9,402,281.76	0.29
B	采矿业	139,942,832.70	4.28
C	制造业	1,045,899,376.93	32.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	133,717,050.52	4.09
E	建筑业	147,471,862.70	4.51
F	批发和零售业	70,966,126.23	2.17
G	交通运输、仓储和邮政业	154,779,614.88	4.74
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	164,959,783.77	5.05
J	金融业	930,123,035.77	28.46
K	房地产业	157,378,521.88	4.82
L	租赁和商务服务业	31,056,099.66	0.95
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	20,503,216.16	0.63
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	3,814,712.74	0.12
R	文化、体育和娱乐业	39,653,113.95	1.21
S	综合	9,305,677.49	0.28
	合计	3,058,973,307.14	93.60

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

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	601318	中国平安	1,154,466	94,596,944.04	2.89
2	600036	招商银行	4,358,848	81,597,634.56	2.50
3	600030	中信证券	1,799,209	48,416,714.19	1.48
4	601939	建设银行	6,789,886	48,411,887.18	1.48
5	601166	兴业银行	2,742,319	47,305,002.75	1.45
6	601398	工商银行	8,817,938	46,558,712.64	1.42
7	600016	民生银行	4,319,321	42,934,050.74	1.31
8	601988	中国银行	8,426,902	41,207,550.78	1.26
9	601766	中国南车	2,108,332	38,708,975.52	1.18
10	600837	海通证券	1,672,293	36,455,987.40	1.12

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	50,270,000.00	1.54
	其中：政策性金融债	50,270,000.00	1.54
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	-	0.00
6	中期票据	-	0.00
7	可转债	-	0.00
8	其他	-	0.00
9	合计	50,270,000.00	1.54

5. 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

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（%）
1	150202	15国开02	500,000	50,270,000.00	1.54

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投资。

7. 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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投资。

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

9. 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

本基金本报告期末投资股指期货。

10. 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

本基金本报告期末投资国债期货。

12. 投资组合报告附注

（1）报告期内基金投资的前十名证券的发行主体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、处罚的情形。

1、本基金投资的前十名证券之一中信证券，2015年1月16日因“违规为到期融资融券合约展期，受过处理仍未改正，且涉及客户数量较多”被中国证券监督管理委员会处罚“暂停新开融资融券客户信用账户3个月”。本基金认为，对中信证券的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

2、本基金投资的前十名证券之一海通证券，2015年1月16日因“违规为到期融资融券合约展期，受过处理仍未改正，且涉及客户数量较多”被中国证券监督管理委员会处罚“暂停新开融资融券客户信用账户3个月”。本基金认为，对海通证券的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

（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）报告期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,726,639.99
2	应收证券清算款	47,480,098.24
3	应收股利	-
4	应收利息	760,347.67
5	应收申购款	7,018,181.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	56,985,267.87

（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处于转股期的可转换债券。

（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中无流通受限情况。

（6）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。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

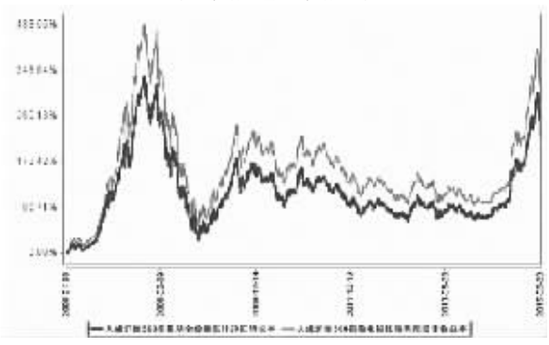
（一）本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较；

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
2006.04.06-2006.12.31	68.66%	1.41%	85.01%	1.52%	-16.35%	-0.11%
2007.01.01-2007.12.31	133.11%	2.18%	161.57%	2.30%	-28.46%	-0.12%
2008.01.01-2008.12.31	-64.77%	2.90%	-65.95%	3.05%	1.18%	-0.15%
2009.01.01-2009.12.31	90.08%	1.95%	96.71%	2.06%	-6.63%	-0.11%
2010.01.01-2010.12.31	-12.67%	1.51%	-12.51%	1.58%	-0.16%	-0.07%
2011.01.01-2011.12.31	-23.77%	1.22%	-25.01%	1.30%	1.24%	-0.08%
2012.01.01-2012.12.31	8.49%	1.20%	7.55%	1.28%	0.94%	-0.08%
2013.01.01-2013.12.31	-5.51%	1.29%	-7.65%	1.39%	2.14%	-0.10%
2014.01.01-2014.12.31	49.51%	1.10%	51.66%	1.21%	-2.15%	-0.11%
2015.01.01-2015.06.30	27.32%	2.13%	26.58%	2.26%	0.74%	-0.13%
2006.04.06-2015.06.30	242.01%	1.78%	305.44%	1.88%	-63.43%	-0.10%

（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2015年6月30日）



注：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。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

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示

（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）基金合同生效后的信息披露费用；

（5）基金份额持有人大会费用；

（6）基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费；

（7）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。

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

本基金的基金管理费按基金财产净值的0.75%年费率计提。

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

H＝E×0.75%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金财产净值

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、公休假等，支付日期顺延。

（2）基金托管人的基金托管费

本基金的基金托管费按基金财产净值的0.15%年费率计提。

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

H=E×0.15%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金财产净值

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托管人。若遇法定节假日、公休假等，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支付，列入当期基金费用。

3. 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。

基金合同生效前的相关费用，包括但不限于律师费、会计师费、验资费、信息披露费用等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据相关法律法规执行。

（二）与基金销售等相关费用

本基金分为A类和B类两种收费模式，对应A类和B类两种不同的份额。

A类收费模式，即前端收费模式，指在本基金中，选择在认（申）购本基金时直接交纳认（申）购费，再以扣除认（申）购费后的净额作为认（申）购份额的收费模式。

B类收费模式，即后端收费模式，指在本基金中，选择在认（申）购时不交纳认（申）购费，以认（申）购总额直接作为认（申）购金额，但在赎回时交纳认（申）购费的收费模式。

本基金因不同的收费模式而有两类基金份额：A类基金份额和B类基金份额。A类基金份额是选择A类收费方式（前端收费模式）的基金份额；B类基金份额是选择B类收费方式（后端收费模式）的基金份额。

本基金将来若增加新的收费模式，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。

此分类对募集期的认购行为和基金合同生效后的申购行为，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类之一种。

1. 基金申购（基金合同生效后购买本基金）

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全额缴款的申购方式。

（1）A类收费模式：前端收费模式

	申购金额M	前端申购费率
A类：前端收费模式	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

前端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：后端收费模式

	持有期限T	后端申购费率
B类：后端收费方式	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，投资者在申购时无须支付申购费用，但是赎回时需交纳申购费用。后端申购费用的计算方法如下：

后端申购费用＝赎回份数×申购日基金份额净值×后端申购费率

2. 基金赎回（对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，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。

本基金的赎回费率按持有期（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T	适用的赎回费率
赎回费率	T<1年	0.5%
	1≤T<2年	0.15%
	T≥2年	0%

注：1年按照365天计算，2年按照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

本基金赎回费在扣除手续费后，余额不得低于赎回费总额的25%，并应当归入基金财产。

3. 基金转换

本基金转换费用详见本基金开放转换业务公告、最新的更新的招募说明书或其他刊登在指定媒体上的公告。

（三）费率调整

基金管理人和基金托管人可根据实际情况分别调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。调高基金管理费率和基金托管费率，原则上须召开基金份额持有人大会审议，除非法律法规另有规定，或基金合同另有约定，或获得监管机关的豁免等。

基金管理人等可根据市场情况在不违背有关法律法规之规定和基金合同之约定的情况下调整本基金的认购费率、申购费率、赎回费率等。调低前述相关费率，或在不增加整体费率水平的情况下改变收费模式，无须召开基金份额持有人大会。

若将来法律法规或监管机构许可本基金或本类型的基金采取持续性销售服务费模式，则本基金可以依法引入持续性销售服务费收费模式；若引入该类收费模式，并设有增加现有投资者的费用负担，则无须召开基金份额持有人大会，法律法规或监管机关另有规定的除外。

基金管理人或其授权或认可的机构，在不违背相关法律法规之规定和基金合同之约定的情况下，有权仅对场外或者仅对场内的费率结构进行调整。

费率的调整，最迟在调整生效前2日内在至少一种中国证监会指定媒体上公告。

（四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，应按国家法律、法规履行其纳税义务。

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》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，对2015年5月21日公布的《大成沪深300指数证券投资基金更新的招募说明书》（2015年第1期）进行了补充和更新，主要修改内容如下：

1. 根据最新资料，更新了“三、基金管理人”部分。
2. 根据最新资料，更新了“四、基金托管人”部分。
3. 根据最新资料，更新了“五、相关服务机构”部分。
4. 根据最新数据，更新了“八、基金的投资”部分。
5. 根据最新数据，更新了“九、基金的业绩”部分。
6. 根据最新公告，更新了“二十二、其他应披露的事项”。
7. 根据最新情况，更新了“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
二〇一五年十一月二十日

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整，对公告的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏负连带责任。

中航工业机电系统股份有限公司（以下简称“中航机电”）于2014年10月8日因筹划重大事项申请停牌，于2014年11月26日公告《非公开发行A股股票预案》，并于2015年11月19日公告《非公开发行A股股票预案（修订稿）》，中航机电本次非公开发行认购对象共计8家，其权益结构情况如下：

一、中航航空产业投资有限公司

（一）基本情况

公司名称：中航航空产业投资有限公司
注册地址：北京市顺义区顺西南路50号1幢3层303室
法定代表人：孟祥泰
注册资本：30,000万元
成立日期：2013年4月25日
经营范围：项目投资；投资咨询。

（二）股权控制关系

二、“中航机电振兴1号”集合资产管理计划

（一）基本情况

“中航机电振兴1号”集合资产管理计划（以下简称“机电振兴1号”）由中航证券有限责任公司设立和管理，其份额由中航机电及其全资、控股子公司、托管企业员工（含本公司董事、监事和高级管理人员）以人民币15,190万元认购，其中上述部分员工以设立有限合伙企业的形式参与认购，部分员工直接参与认购。

（二）“机电振兴1号”委托人情况

“机电振兴1号”的委托人为共青城航鹏投资管理合伙企业（有限合伙）、共青城航兴投资管理合伙企业（有限合伙）及111名自然人，经穿透计算共计175名自然人，具体情况如下。

1、共青城航鹏投资管理合伙企业（有限合伙）

共青城航鹏投资管理合伙企业（有限合伙）的《合伙协议》中明确，普通合伙人2名，有限合伙人27人，共计29人，具体情况如下：

序号	合伙人	身份证号码	出资方式	认缴出资额（万元）	承担责任方式
普通合伙人					
1	韩枫	320982198208XXXXXX	货币	60	无限责任
2	周跃进	513101198803XXXXXX	货币	60	无限责任
有限合伙人					
3	张军厚	140621197912XXXXXX	货币	60	有限责任
4	王永粤	610202197205XXXXXX	货币	60	有限责任
5	李静	411023197604XXXXXX	货币	60	有限责任
6	周宇峰	659001197601XXXXXX	货币	60	有限责任
7	苏士安	110105195710XXXXXX	货币	60	有限责任
8	王鹏	420601197311XXXXXX	货币	60	有限责任
9	相海东	210222197102XXXXXX	货币	60	有限责任
10	巢青	110105196905XXXXXX	货币	60	有限责任
11	李惠海	120223197211XXXXXX	货币	60	有限责任
12	白希纯	320102196112XXXXXX	货币	60	有限责任
13	顾永	231027197508XXXXXX	货币	60	有限责任
14	李茂林	513101195910XXXXXX	货币	60	有限责任
15	张俊	420111197006XXXXXX	货币	30	有限责任
16	马民	110108196911XXXXXX	货币	30	有限责任
17	方汉桥	510212195510XXXXXX	货币	30	有限责任
18	郭泽发	110108196505XXXXXX	货币	60	有限责任
19	朱晓光	420106196308XXXXXX	货币	60	有限责任
20	王通远	110108196408XXXXXX	货币	60	有限责任
21	朱业平	513101195608XXXXXX	货币	60	有限责任
22	邢景强	610103196410XXXXXX	货币	60	有限责任
23	王天成	513101197106XXXXXX	货币	60	有限责任
24	陈建凯	513101198810XXXXXX	货币	60	有限责任
25	周彩善	411223196002XXXXXX	货币	30	有限责任
26	李继民	411223196901XXXXXX	货币	60	有限责任
27	牛雪平	411223197711XXXXXX	货币	60	有限责任
28	何明辉	411223197504XXXXXX	货币	60	有限责任
29	魏巍	411282197007XXXXXX	货币	60	有限责任

2、共青城航兴投资管理合伙企业（有限合伙）

共青城航兴投资管理合伙企业（有限合伙）的《合伙协议》中明确，普通合伙人2名，有限合伙人33人，共计35人，具体情况如下：

序号	合伙人	身份证号码	出资方式	认缴出资额（万元）	承担责任方式
普通合伙人					
1	杨海	610421197104XXXXXX	货币	60	无限责任
2	胡娜金	513101195912XXXXXX	货币	60	无限责任
有限合伙人					
3	史佑民	610103196512XXXXXX	货币	30	有限责任
4	杨世彦	610103196612XXXXXX	货币	30	有限责任
5	董亚梅	610104196312XXXXXX	货币	60	有限责任
6	顾卫平	610104197310XXXXXX	货币	60	有限责任
7	王文山	610113197404XXXXXX	货币	60	有限责任
8	王慈校	610422196001XXXXXX	货币	60	有限责任
9	王卓岗	610121197010XXXXXX	货币	30	有限责任
10	何卫红	612124197109XXXXXX	货币	60	有限责任
11	邓雪杰	610104196112XXXXXX	货币	60	有限责任
12	戴筠	610104196207XXXXXX	货币	30	有限责任
13	张佩京	610104196202XXXXXX	货币	60	有限责任
14	孙民	610121197109XXXXXX	货币	30	有限责任
15	祖宁贤	610104196201XXXXXX	货币	60	有限责任
16	南博丽	610103196510XXXXXX	货币	30	有限责任
17	徐建明	110108196905XXXXXX	货币	60	有限责任
18	邓兴民	610101197012XXXXXX	货币	60	有限责任
19	王萍	610104196306XXXXXX	货币	60	有限责任
20	娄克麟	610104196512XXXXXX	货币	30	有限责任
21	王鹏红	610104196809XXXXXX	货币	30	有限责任
22	刘辉	610102195609XXXXXX	货币	60	有限责任
23	朱志宏	610421195905XXXXXX	货币	60	有限责任
24	李忠祥	610421196311XXXXXX	货币	30	有限责任
25	肖体学	410703195510XXXXXX	货币	60	有限责任
26	高大金	410703196402XXXXXX	货币	60	有限责任
27	郑大贵	610103197501XXXXXX	货币	30	有限责任
28	杨国龙	320103196802XXXXXX	货币	60	有限责任
29	朱望花	410711196409XXXXXX	货币	60	有限责任
30	吴涛	610103196510XXXXXX	货币	60	有限责任
31	曹青生	410702195807XXXXXX	货币	60	有限责任
32	李季节	410782197810XXXXXX	货币	30	有限责任
33	孟祥忠	410702196912XXXXXX	货币	30	有限责任
34	王贵新	410702197203XXXXXX	货币	30	有限责任
35	王红杰	410702197404XXXXXX	货币	30	有限责任

3、直接参与“机电振兴1号”的委托人

直接参与“机电振兴1号”的委托人情况如下：

序号	委托人	身份证	出资方式	认购金额（万元）
1	王坚	320103196111XXXXXX	货币	150
2	孟军	320103196801XXXXXX	货币	130
3	韩丽丽	110105196905XXXXXX	货币	130
4	周春华	210104196510XXXXXX	货币	130
5	李开贵	610421196109XXXXXX	货币	130
6	王伟	210103196702XXXXXX	货币	130
7	李伟	110108196602XXXXXX	货币	130
8	白伟加	110102195902XXXXXX	货币	120
9	马国林	340111196301XXXXXX	货币	120
10	周勇	110101196505XXXXXX	货币	120
11	王学柏	102010196404XXXXXX	货币	120
12	李鹏	110108197910XXXXXX	货币	100
13	于庆伟	210222197701XXXXXX	货币	100
14