

关于大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金变更为大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金并相应修订法律文件的公告

大成基金管理有限公司（以下简称“本公司”）旗下的大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金经中国证监会 2024 年 10 月 18 日证监许可【2024】1445 号文注册募集。《大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）于 2024 年 11 月 12 日正式生效。

为更好地满足投资者理财需求，根据《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》等法律法规的规定和《基金合同》的相关约定“若将来本基金管理人推出同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），则基金管理人在履行适当程序后有权决定将本基金转换为该基金的联接基金，并相应修改《基金合同》。此项调整经基金管理人与基金托管人协商一致，无需召开基金份额持有人大会，在履行适当程序后及时公告”，本公司经与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致，对大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金作出如下变更：将大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金变更为大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金。

本公司旗下的大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金已于 2024 年 11 月 22 日正式成立。本公司决定于 2024 年 11 月 29 日起，将大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金变更为大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金。

届时，大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金的登记机构将进行基金份额变更登记，即将“大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金 A 类基金份额”变更为“大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 A 类基金份额”，将“大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金 C 类基金份额”变更为“大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 C 类基金份额”，将“大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金 E 类基金份额”变更为“大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 E 类基金份额”。各类基金份额净值分开计算，前述变更不影响各类基金份额净值的计算。基金变更后，各类基金份额的申购费率、赎回费率及销售服务费率保持不变。

本公司经与基金托管人协商一致，对《基金合同》、《大成中证 A500 指数型发起式证券

投资基金托管协议》（以下简称“《托管协议》”）中涉及基金变更的相关内容进行修改，并根据最新法律法规以及《基金合同》的有关规定对相关内容进行修订和补充。上述修改事项对原有基金份额持有人的利益无实质性不利影响，经与基金托管人协商一致，无需召开基金份额持有人大会。

本公司将于公告当日在网站上同时公布经修订后的《大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》、《大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》，并依照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定在规定媒介上公告。《基金合同》的修订内容详见附件《<大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同>修订前后对照表》。

重要提示：

1、修订后的《大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》、《大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》自 2024 年 11 月 29 日起生效。

2、本公告仅对本次法律文件修改的事项予以说明，最终解释权归本公司。投资者欲了解本公司旗下基金的详细情况，请登录本公司网站（www.dcfund.com.cn）查询或拨打本公司客户服务电话 400-888-5558 进行咨询。

3、基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分，并提出适当性匹配意见。投资者在投资基金前应认真阅读基金合同、招募说明书和基金产品资料概要等信息披露文件，全面认识基金产品的风险收益特征，在了解产品情况及销售机构适当性意见的基础上，根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标，对基金投资作出独立决策，选择合适的基金产品。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

特此公告。

大成基金管理有限公司

2024 年 11 月 26 日

附件：《大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》修

订前后对照表

大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金基金合同	大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同 (本基金由大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金转型而来)
<p>第一部分 前言</p> <p>三、大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)注册。</p> <p>中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。</p>	<p>第一部分 前言</p> <p>三、大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金由大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金变更而来，大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)注册。</p> <p>中国证监会对大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金(转型更名前)募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。</p>
<p>第二部分 释义</p> <p>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：</p> <p>1、基金或本基金：指大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金</p> <p>4、基金合同或本基金合同：指《大成中证 A500 指数型发起式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</p> <p>5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《大成中证 A500 指数型发起式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</p> <p>6、招募说明书：指《大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新</p> <p>7、基金份额发售公告：指《大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金基金份额发售公告》</p> <p>8、基金产品资料概要：指《大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金基金产品资料概要》及其更新</p> <p>24、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务</p> <p>29、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申</p>	<p>第二部分 释义</p> <p>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：</p> <p>1、基金或本基金：指大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金，本基金由大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金变更而来</p> <p>4、基金合同或本基金合同：指《大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充</p> <p>5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充</p> <p>6、招募说明书：指《大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书》及其更新</p> <p>7、基金产品资料概要：指《大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金产品资料概要》及其更新</p> <p>23、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务</p>

<p>购、赎回等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户</p> <p>30、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期</p> <p>32、基金募集期：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</p> <p>40、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为</p> <p>48、基金收益：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</p> <p>49、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</p> <p>55、基金份额类别：本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式等的不同，将基金份额分为不同的类别。其中A类基金份额为在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用，且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额；C类基金份额、E类基金份额为从本类别基金资产中计提销售服务费，且不收取认购/申购费用的基金份额</p> <p>60、发起资金提供方：指以发起资金认购本基金且承诺以发起资金认购的基金份额持有期限自基金合同生效日起不少于3年的基金管理人的股东、基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员</p>	<p>28、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理申购、赎回等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户</p> <p>29、基金合同生效日：指《大成中证A500交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》生效日，原《大成中证A500指数型发起式证券投资基金基金合同》自同一日失效</p> <p>45、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、投资目标ETF基金份额所得收益、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</p> <p>46、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、目标ETF基金份额、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和</p> <p>52、基金份额类别：本基金根据申购费用、销售服务费收取方式等的不同，将基金份额分为不同的类别。其中A类基金份额为在投资人申购时收取前端申购费用，且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额；C类基金份额、E类基金份额为从本类别基金资产中计提销售服务费，且不收取申购费用的基金份额</p> <p>56、目标ETF：指大成中证A500交易型开放式指数证券投资基金，简称为“大成中证A500ETF”</p> <p>57、ETF联接基金：指将绝大多数基金财产投资于跟踪同一标的指数的目标ETF，紧密跟踪业绩基准表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作的基金，简称“联接基金”</p> <p>59、发起资金提供方：指以发起资金认购大成中证A500指数型发起式证券投资基金且承诺以发起资金认购的基金份额持有期限自《大成中证A500指数型发起式证券投资基金基金合同》生效日起不少于3年的基金管理人的股东、基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员</p>
<p>第三部分 基金的基本情况</p> <p>一、基金名称 大成中证A500指数型发起式证券投资基金</p> <p>二、基金的类别</p>	<p>第三部分 基金的基本情况</p> <p>一、基金名称 大成中证A500交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金</p>

<p>股票型、发起式证券投资基金</p> <p>四、基金的投资目标</p> <p>本基金通过被动的指数化投资管理，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金力争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%。</p> <p>五、基金的最低募集份额总额</p> <p>本基金为发起式基金，基金募集份额总额不少于 1000 万份，基金募集金额不少于 1000 万元，其中，发起资金提供方认购本基金的总金额不少于 1000 万元，且持有期限自基金合同生效日起不少于 3 年。</p> <p>六、基金份额发售面值和认购费用</p> <p>本基金基金份额发售面值为人民币 1.00 元。</p> <p>本基金 A 类基金份额收取认购费用，认购费率按招募说明书及基金产品资料概要的规定执行。本基金 C 类基金份额、E 类基金份额不收取认购费用。</p> <p>七、发起资金的来源</p> <p>本基金为发起式基金，发起资金来源于基金管理人股东的资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员的资金。发起资金认购本基金的金额不低于 1000 万元，且发起资金认购的基金份额持有期限不低于三年。期间上述基金份额不能赎回。认购份额的高级管理人员或基金经理等人员在上述期限内离职的，其持有期限的承诺不受影响。</p> <p>法律法规或监管规则另有规定的，从其规定。</p> <p>九、基金份额类别</p> <p>本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式等的不同，将基金份额分为不同的类别。其中 A 类基金份额为在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用，且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额；C 类基金份额、E 类基金份额为从本类别基金资产中计提销售服务费，且不收取认购/申购费用的基金份额。</p> <p>本基金 A 类、C 类和 E 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额、C 类基金份额和 E 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。</p> <p>有关基金份额类别的具体设置、费率水平等由基金管理人确定，并在招募说明书及基金产品资料概要中公告。在不违反法律法规、基金合同的规定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，经与基金托管人协商一致，基金管理人可在履行适当程序后调整基金份额类别设</p>	<p>二、基金的类别</p> <p>ETF 联接基金、发起式证券投资基金</p> <p>四、基金的投资目标</p> <p>本基金主要投资于目标 ETF，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。</p> <p>六、基金份额类别</p> <p>本基金根据申购费用、销售服务费收取方式等的不同，将基金份额分为不同的类别。其中 A 类基金份额为在投资人申购时收取前端申购费用，且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额；C 类基金份额、E 类基金份额为从本类别基金资产中计提销售服务费，且不收取申购费用的基金份额。</p> <p>本基金 A 类、C 类和 E 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额、C 类基金份额和 E 类基金份额将分别计算基金份额净值。</p> <p>有关基金份额类别的具体设置、费率水平等由基金管理人确定，并在招募说明书及基金产品资料概要中公告。在不违反法律法规、基金合同的规定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，经与基金托管人协商一致，基金管理人可在履行适当程序后调整基金份额类别设置、对基金份额分类办法及规则进行调整，</p>
--	---

<p>置、对基金份额分类办法及规则进行调整，并在调整实施之日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告，不需要召开基金份额持有人大会。</p> <p>十、未来条件许可情况下的模式转换</p> <p>若将来本基金管理人推出同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），则基金管理人在履行适当程序后有权决定将本基金转换为该基金的联接基金，并相应修改《基金合同》。此项调整经基金管理人与基金托管人协商一致，无需召开基金份额持有人大会，在履行适当程序后及时公告。</p>	<p>并在调整实施之日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告，不需要召开基金份额持有人大会。</p> <p>七、本基金与目标 ETF 的联系与区别</p> <p>本基金为目标 ETF 的联接基金。本基金主要投资于目标 ETF 以求达到投资目标，目标 ETF 的标的指数和本基金的标的指数一致，投资目标相似。</p> <p>在投资方法上，本基金为目标 ETF 的联接基金，主要通过投资于目标 ETF 来跟踪标的指数；本基金的目标 ETF 主要采用复制法来跟踪标的指数。</p> <p>在交易方式上，本基金投资者目前只能通过场外销售机构以现金的方式申购、赎回；本基金的目标 ETF 属于交易型开放式指数证券投资基金，目标 ETF 的投资者可以在二级市场上买卖 ETF，也可以根据申购赎回清单按照申购、赎回对价通过申购赎回代理机构申购、赎回 ETF。</p> <p>本基金与目标 ETF 业绩表现可能出现差异，可能引发差异的因素主要包括：</p> <p>1、法律法规对投资比例的要求。本基金作为普通的开放式基金，需在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，将不低于基金资产净值 5% 的资产投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券；目标 ETF 不受上述投资比例的限制。</p> <p>2、申购赎回的影响。本基金申赎采取现金方式，大额申赎可能会对基金净值产生一定影响；目标 ETF 申购赎回根据申购赎回清单按照申购、赎回对价办理，申购赎回对基金净值的影响较小。</p>
<p>第四部分 基金份额的发售</p> <p>一、基金份额的发售时间、发售方式、发售对象</p> <p>1、发售时间</p> <p>自基金份额发售之日起最长不得超过 3 个月，具体发售时间见基金份额发售公告。</p> <p>2、发售方式</p> <p>通过各销售机构的基金销售网点公开发售，各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告</p>	<p>第四部分 基金的历史沿革与存续</p> <p>一、基金的历史沿革</p> <p>大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金由大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金变更而来，大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金经中国证监会 2024 年 10 月 18 日证监许可【2024】1445 号文注册募集，基金管理人为大成基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金自 2024 年 10 月 25 日</p>

或基金管理人网站公示。

3、发售对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、发起资金提供方、合格境外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人。

二、基金份额的认购

1、认购费用

本基金 A 类基金份额的认购费率由基金管理人决定，并在招募说明书及基金产品资料概要中列示。基金认购费用不列入基金财产。本基金 C 类基金份额、E 类基金份额不收取认购费用。

2、募集期利息的处理方式

有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额以登记机构的记录为准。

3、基金认购份额的计算

基金认购份额具体的计算方法在招募说明书中列示。

4、认购份额余额的处理方式

认购份额的计算保留到小数点后 2 位，小数点 2 位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

5、认购申请的确认

基金销售机构对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。认购的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

三、基金份额认购金额的限制

1、投资人认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款。

2、基金管理人可以对每个基金交易账户的单笔最低认购金额进行限制，具体限制请参看招募说明书或相关公告。

3、如本基金单个投资人（基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理作为发起资金提供方除外）累计认购的基金份额数达到或者超过基金总份额的 50%，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的认购申请进行限制。基金管理人接受某笔或者某些认购申请有可能导致投资者变相规避前述 50%比例要求的，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分认购申请。法律法规另有规定的除外。投资人认购的基金份额数以基金合同生效后登记机构的确认为准。

4、除前述外，基金管理人可以对募集期间的单个投资人的累计认购金额进行限制，具体限制和处理方法请参看招募说明书或相关公告。

5、投资人在基金募集期内可以多次认购基金份额。认购申请一经受理不得撤销。

第五部分 基金备案

至 2024 年 11 月 8 日进行公开募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认，《大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金基金合同》于 2024 年 11 月 12 日正式生效。

2024 年 11 月 22 日，基金管理人管理的大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金正式成立。基金管理人根据《大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金基金合同》的约定，决定将大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金变更为大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金，即本基金。

自 2024 年 11 月 29 日起，大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金正式变更为大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金，《大成中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》生效。

<p>一、基金备案的条件</p> <p>本基金自基金份额发售之日起3个月内，使用发起资金认购本基金的金额不少于1000万元，且发起资金认购方承诺认购的基金份额持有期限自基金合同生效日起不少于3年的条件下，基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在10日内聘请法定验资机构验资，验资报告需对发起资金提供方及其持有份额进行专门说明，自收到验资报告之日起10日内，向中国证监会办理基金备案手续。</p> <p>基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。</p> <p>二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式</p> <p>如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用； 2、在基金募集期限届满后30日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期存款利息； 3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。 <p>三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模</p> <p>基金合同生效之日起3年后的对应日，若基金资产净值低于2亿元，基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。若届时的法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充时，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。</p> <p>《基金合同》生效满3年后继续存续的，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，基金管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在6个月内召集基金份额持有人大会。</p> <p>法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。</p>	<p>二、基金的存续</p> <p>《大成中证A500指数型发起式证券投资基金基金合同》生效之日起3年后的对应日，若基金资产净值低于2亿元，基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。若届时的法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充时，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。</p> <p>《大成中证A500指数型发起式证券投资基金基金合同》生效满3年后本基金继续存续的，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，基金管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决。</p> <p>法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。</p>
<p>第六部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>五、申购和赎回的数量限制</p>	<p>第五部分 基金份额的申购与赎回</p> <p>五、申购和赎回的数量限制</p>

<p>3、单一投资者（基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理作为发起资金提供方除外）持有基金份额的比例不得达到或者超过基金总份额的 50%，或者以其他方式变相规避 50%集中度限制；在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过 50%的以及法律法规另有规定的情形除外。</p> <p>七、拒绝或暂停申购的情形 发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：</p> <p>7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过基金总份额的 50%，或者变相规避 50%集中度的情形。</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6、9、10 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。发生上述第 7、8 项情形时，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。如果法律法规、监管要求调整导致上述第 7 项内容取消或变更的，基金管理人履行适当程序后，可修改该内容，不需召开基金份额持有人大会。</p> <p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形 发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：</p> <p>7、所投资的目标 ETF 暂停估值，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>8、所投资的目标 ETF 暂停申购、暂停上市或二级市场交易停牌，基金管理人认为有必要暂停本基金申购的情形。</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6、7、8、10、11 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。发生上述第 10 项情形时，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。</p> <p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：</p> <p>5、所投资的目标 ETF 暂停估值，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>6、投资的目标 ETF 暂停赎回、暂停上市、二级市场交易停牌或延缓支付赎回对价时，基金管理人认为有必要暂停本基金赎回的情形。</p>
<p>第七部分 基金合同当事人及权利义务</p> <p>（二） 基金管理人的权利与义务</p> <p>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：</p> <p>（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、转换和非交易过户等业务规则；</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：</p> <p>（1）依法募集资金，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、</p>	<p>第六部分 基金合同当事人及权利义务</p> <p>（二） 基金管理人的权利与义务</p> <p>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：</p> <p>（16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金申购、赎回、转换和非交易过户等业务规则；</p> <p>（17）代表基金份额持有人的利益行使因基金财产投资于目标 ETF 所产生的权利，基金合同另有约定的除外；</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：</p> <p>（1）依法募集资金，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申</p>

<p>申购、赎回和登记事宜：</p> <p>（8）采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；</p> <p>（24）基金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；</p> <p>三、基金份额持有人</p> <p>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：</p> <p>（5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：</p> <p>（4）交纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；</p> <p>（9）发起资金提供方使用发起资金认购的金额不少于 1000 万，且持有认购的基金份额的期限自基金合同生效之日起不少于 3 年；</p>	<p>购、赎回和登记事宜：</p> <p>（8）采取适当合理的措施使计算基金份额申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；</p> <p>三、基金份额持有人</p> <p>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：</p> <p>（5）出席或者委派代表出席本基金或目标 ETF 的基金份额持有人大会，对本基金或目标 ETF 的基金份额持有人大会审议事项行使表决权；</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：</p> <p>（4）交纳基金申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；</p> <p>（9）发起资金提供方使用发起资金认购的金额不少于 1000 万，且持有认购的基金份额的期限自《大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金基金合同》生效之日起不少于 3 年；</p>
<p>第八部分 基金份额持有人大会</p> <p>一、召开事由</p> <p>1、除法律法规和中国证监会另有规定外，当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：</p> <p>2、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：</p>	<p>第七部分 基金份额持有人大会</p> <p>一、召开事由</p> <p>1、除法律法规和中国证监会另有规定外，当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：</p> <p>（13）基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标 ETF 基金份额持有人大会；</p> <p>2、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：</p> <p>（6）由于目标 ETF 交易方式变更、终止上市、基金合同终止或与其他基金合并而变更为直接投资该标的指数的指数基金；</p>

	<p>十一、鉴于本基金是目标 ETF 的联接基金，本基金的基金份额持有人可以凭所持有的本基金基金份额出席或者委派代表出席目标 ETF 的基金份额持有人大会并参与表决，其持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为在目标 ETF 的基金份额持有人大会的权益登记日，本基金持有目标 ETF 基金份额的总数乘以该基金份额持有人所持有的本基金份额占本基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。</p> <p>本基金的基金管理人不应以本基金的名义代表本基金的全体基金份额持有人以目标 ETF 的基金份额持有人的身份行使表决权，但可接受本基金的特定基金份额持有人的委托以本基金的基金份额持有人代理人的身份出席目标 ETF 的基金份额持有人大会并参与表决。</p> <p>本基金的基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标 ETF 的基金份额持有人大会的，须先遵照本基金基金合同的约定召开本基金的基金份额持有人大会，本基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集目标 ETF 的基金份额持有人大会的，由本基金基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标 ETF 的基金份额持有人大会。</p>
<p>第十二部分 基金的投资</p> <p>一、投资目标</p> <p>本基金通过被动的指数化投资管理，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金力争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%。</p> <p>二、投资范围</p> <p>本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股（含存托凭证，下同）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括主板、科创板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。</p> <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。未来在法律法规允许的前提下，本基金可根据相关法律法规规定参与融券业务。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种（包括但不限于股指期货等金融衍生品），</p>	<p>第十一部分 基金的投资</p> <p>一、投资目标</p> <p>通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。</p> <p>二、投资范围</p> <p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以目标 ETF 基金份额、标的指数的成份股及其备选成份股（均含存托凭证，下同）为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括主板、科创板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。</p> <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。未来在法律法规允许的前提下，本基金可根据相关法律法规规定参与融券业务。</p>

基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：投资于股票（含存托凭证）资产的比例不低于基金资产的 90%；投资于标的指数的成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如果法律法规对该比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，本基金的投资比例相应调整。

三、投资策略

本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。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，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。

由于标的指数编制方法调整、成份股及其权重发生变化（包括配送股、增发、临时调入及调出成份股等）的原因，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，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或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，力求降低跟踪误差。

如果标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。

（一）股票投资策略

1、股票投资组合构建

本基金采用完全复制标的指数的方法，按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合。由于跟踪组合构建与标的指数组合构建存在差异，若出现较为特殊的情况（例如成份股停牌、股票流动性不足以及其他影响指数复制效果的因素），本基金将采用替代性的方法构建组合，使得跟踪组合尽可能近似于全复制组合，以减少对标的指数的跟踪误差。

2、股票投资组合的调整

本基金所构建的股票投资组合将根据中证

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种（包括但不限于股指期货等金融衍生品），基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如果法律法规对该比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，本基金的投资比例相应调整。

三、投资策略

在正常市场情况下，本基金与业绩比较基准的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%。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，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

（一）目标 ETF 投资策略

本基金主要通过交易所买卖或申购赎回的方式投资于目标 ETF。根据投资者申购、赎回的现金流情况，本基金将综合目标 ETF 的流动性、折溢价率、标的指数成份股流动性等因素分析，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申购赎回的方式或二级市场买卖的方式对目标 ETF 进行投资。

（二）股票投资策略

根据投资者申购、赎回的现金流情况，本基金将综合目标 ETF 的流动性、折溢价率、标的指数成份股流动性等因素分析，对投资组合进行监控和调整，也可以通过买入标的指数成份股、备选成份股紧密跟踪标的指数。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的个券时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，包括通过投资其他股票进行替代，以降低跟踪误差，优化投资组合的配置结构。

A500 指数成份股及其权重的变动而进行相应调整,本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况等,对其进行适时调整,以保证基金净值增长率与基准指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

(1) 定期调整

根据标的指数的调整规则和备选股票的预期,对股票投资组合及时进行调整。

(2) 不定期调整

A 当成份股发生配送股、增发、临时调入及调出成份股等情况而影响成份股在指数中权重的行为时,本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合;

B 根据本基金的申购和赎回情况,对股票投资组合进行调整,从而有效跟踪标的指数;

C 根据法律法规和基金合同的规定,成份股在标的指数中的权重因其他特殊原因发生相应变化的,本基金可以对投资组合管理进行适当变通和调整,力求降低跟踪误差。

在正常市场情况下,力争控制本基金的份额净值与业绩比较基准的收益率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%。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,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

四、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

(1) 本基金股票(含存托凭证)资产占基金资产的比例不低于 90%,其中,投资标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%;

(10) 本基金投资股指期货遵守下列要求:本基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的 10%;在任何交易日日终,持有的买入股指期货、国债期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的 100%,其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;本基金在任何交易日日终,持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%;本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%;基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)应当不低于基金资产的 90%;

(11) 本基金投资国债期货遵守下列要求:

四、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

(1) 本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%;

(10) 本基金投资股指期货遵守下列要求:本基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的 10%;在任何交易日日终,持有的买入股指期货、国债期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的 100%,其中,有价证券指股票、目标 ETF、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;本基金在任何交易日日终,持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%;本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%;基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;

(11) 本基金投资国债期货遵守下列要求:本基金在任何交易日日终,持有的买入国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的 15%;在任

本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；在任何交易日日终，持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 30%；

除上述第（2）、（7）、（13）、（16）、（17）项外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

（4）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；

六、风险收益特征

本基金是股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；在任何交易日日终，持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指股票、目标 ETF、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 30%；

除上述第（1）、（2）、（7）、（13）、（16）、（17）项外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、基金规模变动、目标 ETF 暂停申购、赎回或二级市场交易停牌等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。因证券、期货市场波动、上市公司合并、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、基金规模变动、目标 ETF 暂停申购、赎回或二级市场交易停牌等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述第（1）项规定的比例的，基金管理人应当在 20 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

（4）买卖除目标 ETF 以外的其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；

六、风险收益特征

本基金为大成中证 A500ETF 的联接基金，主要投资于目标 ETF，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与中证 A500 指数及目标 ETF 的表现密切相关。本基金的预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

八、目标 ETF 发生相关变更情形时的处理

目标 ETF 出现下述情形之一的，本基金在履行适当程序后将由投资于目标 ETF 的联接基金变更为直接投资该标的指数的指数基金，无需召开基金份额持有人大会审议。

1、目标 ETF 交易方式发生重大变更致使本基金的投资策略难以实现；

2、目标 ETF 终止上市；

3、目标 ETF 基金合同终止；

4、目标 ETF 与其他基金进行合并；

	<p>5、目标 ETF 的基金管理人发生变更（但变更后的本基金与目标 ETF 的基金管理人相同的除外）；</p> <p>6、中国证监会规定的其他情形。</p>
<p>第十三部分 基金的财产</p> <p>一、基金资产总值</p> <p>基金资产总值是指购买各类证券及票据价值、目标银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。</p>	<p>第十二部分 基金的财产</p> <p>一、基金资产总值</p> <p>基金资产总值是指购买各类证券及票据价值、目标 ETF 份额、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。</p>
<p>第十四部分 基金资产估值</p> <p>二、估值对象</p> <p>基金所拥有的股票、债券、资产支持证券、股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。</p> <p>四、估值方法</p> <p>七、暂停估值的情形</p> <p>九、特殊情形的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按估值方法第 10 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；</p>	<p>第十三部分 基金资产估值</p> <p>二、估值对象</p> <p>基金所拥有的目标 ETF 份额、股票、债券、资产支持证券、股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。</p> <p>四、估值方法</p> <p>7、目标 ETF 采用估值日该基金基金份额净值估值；若估值日为非证券交易所营业日，以该基金最近估值日的基金份额净值估值。</p> <p>七、暂停估值的情形</p> <p>4、所投资的目标 ETF 暂停估值、暂停公告基金份额净值时；</p> <p>九、特殊情形的处理</p> <p>1、基金管理人或基金托管人按估值方法第 11 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；</p>
<p>第十五部分 基金费用与税收</p> <p>一、基金费用的种类</p> <p>二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1、基金管理人的管理费</p> <p>本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：</p> $H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$ <p>H 为每日应计提的基金管理费 E 为前一日的基金资产净值</p> <p>基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致</p>	<p>第十五部分 基金费用与税收</p> <p>一、基金费用的种类</p> <p>9、基金投资目标 ETF 的相关费用（包括但不限于目标 ETF 的交易费用、申赎费用等）；</p> <p>二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1、基金管理人的管理费</p> <p>基金管理人对本基金投资组合中投资于目标 ETF 部分的基金资产净值不计提基金管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：</p> $H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$ <p>H 为每日应计提的基金管理费 E 为前一日的基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后的剩余部分；</p>

<p>的方式于次月前 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。</p> <p>2、基金托管人的托管费 本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05%年费率计提。托管费的计算方法如下： $H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的基金托管费 E 为前一日的基金资产净值 基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。</p> <p>上述“一、基金费用的种类”中第 4-9 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。</p> <p>三、不列入基金费用的项目</p> <p>3、《基金合同》生效前的相关费用； 4、标的指数许可使用费。标的指数许可使用费由基金管理人承担，不从基金财产中列支；</p>	<p>若为负数，则 E 取 0</p> <p>基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 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。</p> <p>2、基金托管人的托管费 基金托管人对本基金投资组合中投资于目标 ETF 部分的基金资产净值不计提基金托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.05%年费率计提。托管费的计算方法如下： $H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的基金托管费 E 为前一日的基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后的剩余部分；若为负数，则 E 取 0</p> <p>基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。</p> <p>上述“一、基金费用的种类”中第 4-10 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。</p> <p>三、不列入基金费用的项目</p> <p>3、《基金合同》生效前的相关费用根据《大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金基金合同》的约定执行；</p>
<p>第十七部分 基金的会计与审计</p> <p>2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于 2 个月，可以并入下一个会计年度披露；</p>	<p>第十六部分 基金的会计与审计</p> <p>2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；</p>
<p>第十八部分 基金的信息披露</p> <p>五、公开披露的基金信息 公开披露的基金信息包括： （一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要</p> <p>2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响</p>	<p>第十七部分 基金的信息披露</p> <p>五、公开披露的基金信息 公开披露的基金信息包括： （一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要</p> <p>2、基金招募说明书应当最大限度地披露影</p>

基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在规定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金份额发售公告、基金招募说明书提示性公告和《基金合同》提示性公告登载在规定报刊上，将基金份额发售公告、基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》和基金托管协议登载在规定网站上，并将基金产品资料概要登载在基金销售机构网站或营业网点；基金托管人应当同时将《基金合同》、基金托管协议登载在规定网站上。

（二）基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在基金份额发售的三日前，登载于规定媒介上。

（三）《基金合同》生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在规定媒介上登载《基金合同》生效公告。基金合同生效公告中将说明基金募集情况及基金管理人、基金管理人高级管理人员、基金经理等人员以及基金管理人股东持有的基金份额、承诺持有的期限等情况。

（六）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

《基金合同》生效不足2个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

（七）临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在2日内编制临时报告书，并登载在规定报刊和规定网站上。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：

24、本基金变更标的指数；

响基金投资者决策的全部事项，说明基金申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在规定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

（四）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

（七）临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在2日内编制临时报告书，并登载在规定报刊和规定网站上。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：

24、目标 ETF 变更或标的指数变更；

（十一）投资目标 ETF 的信息披露

基金管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露所持目标 ETF 的以下相关情况，包括：

	<p>1、投资政策、持仓情况、损益情况、净值披露时间等；</p> <p>2、交易及持有目标 ETF 产生的费用，招募说明书中应当列明计算方法并举例说明；</p> <p>3、本基金持有的目标 ETF 发生的重大影响事件，如转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同以及召开基金份额持有人大会等。</p>
<p>第二十二部分 基金合同的效力</p> <p>《基金合同》是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。</p> <p>1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字或盖章并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续，并经中国证监会书面确认后生效。</p>	<p>第二十一部分 基金合同的效力</p> <p>《基金合同》是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。</p> <p>1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字或盖章，于 2024 年 11 月 29 日生效，原《大成中证 A500 指数型发起式证券投资基金基金合同》失效。</p>