

关于大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）修改基金合同、新增风险揭示内容的公告

根据中国证监会近期下发《通过港股通机制参与香港股票市场交易的公募基金注册审核指引》、《关于进一步加强对通过港股通机制参与香港股票市场交易的基金产品的监管的函》（机构部函[2017]1487号）以及深圳证监局下发的《深圳证监局关于参与港股通交易相关事项的通知》（深证局机构字【2017】80号）的相关要求，对通过港股通机制参与香港股票市场交易的证券投资基金提出了新的监管要求。

大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）（以下简称本基金）于2016年12月2日募集成立，可通过港股通机制参与香港股票市场交易。根据相关监管要求，我司拟修改基金合同，在本基金基金合同的前言部分，新增以下风险揭示内容（作为前言的第六款，具体详见附件《大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）基金合同》修订对照表）：

六、本基金可以通过港股通机制投资于港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行T+0回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比A股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。

本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%，投资于以标的指数为跟踪标的的公募基金、上市交易型基金、结构性产品的比例不超过基金资产净值的10%。基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，但在极端情况下（如为应对巨额赎回时），可能存在不投资港股的风险。

相关风险揭示内容详见本基金招募说明书。

本次基金合同修订的内容符合基金合同、法律法规及中国证监会的相关规定，对原有基金份额持有人的利益无实质性影响，不需召开基金份额持有人大会，已经

基金托管人确认。

修订后的基金合同自本公告发布之日起生效。基金管理人将在后续最近一期更新的《大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）招募说明书》中对风险揭示章节内容作相应调整。

本公告仅对本次基金合同修改的事项予以说明，最终解释权归本公司。本公司将于公告当日，将修改后的本基金基金合同登载于公司网站。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）查询或拨打大成基金管理有限公司客户服务热线 400-888-5558（免长途通话费用）咨询有关详情。

特此公告。

附件：《大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）基金合同》修订对照表

大成基金管理有限公司

2017年7月13日

附件 1、《大成恒生综合中小型股指数证券投资基金（QDII-LOF）基金合同》修订对照表

章节 原《基金合同》条款 修改后《基金合同》条款 说明

《基金合同》前言 原《基金合同》无相关内容 六、本基金可以通过港股通机制投资于港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。

本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%，投资于以标的指数为跟踪标的的公募基金、上市交易型基金、结构性产品的比例不超过基金资产净值的 10%。基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，但在极端情况下（如为应对巨额赎回时），可能存在不投资港股的风险。

相关风险揭示内容详见本基金招募说明书。 新增基金参与港股通交易风险揭示