

大成深证基准做市信用债交易型开放式指数证券投资
基金基金份额发售公告

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

目录

重要提示.....	3
一、本次发售基本情况.....	6
二、投资者开户.....	11
三、网上现金认购的程序.....	12
四、网下现金认购的程序.....	13
五、网下债券认购的程序.....	15
六、清算与交割.....	16
七、基金的验资与基金合同生效.....	17
八、本次发售当事人或中介机构.....	18
九、网下债券认购清单.....	21

重要提示

1、大成深证基准做市信用债交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）已获中国证监会2024年12月31日证监许可【2024】1968号文准予注册。

2、本基金为交易型开放式、债券型证券投资基金。

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”），基金托管人为兴业银行股份有限公司，登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

4、本基金的募集对象为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、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。

5、投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下债券认购3种方式认购本基金。基金管理人可以根据具体情况调整本基金的发售方式，并在本公告或相关公告中列明。本基金基金份额初始面值为1.00元，认购价格为1.00元。

网上现金认购是指投资人通过基金管理人指定的发售代理机构用深圳证券交易所网上系统以现金进行的认购；网下现金认购是指投资人通过基金管理人及其指定的发售代理机构以现金进行的认购；网下债券认购是指投资人通过基金管理人及其指定的发售代理机构以债券进行的认购。

6、本基金自2025年1月7日起至2025年1月20日（含当日），通过网上现金认购、网下现金认购和网下债券认购三种认购方式公开发售。基金的募集期限不超过3个月，自基金份额开始发售之日起计算。本公司可根据基金销售情况在募集期限内适当延长或缩短基金发售时间，并及时公告。基金管理人可合理调整发售期并公告。

7、投资人认购本基金时需具有深圳证券交易所人民币普通股票账户（即A股账户）或深圳证券交易所证券投资基金账户（以下简称“基金账户”）。

1) 已有深圳证券账户的投资人不必再办理开户手续。

2) 尚无深圳证券账户的投资人，需在认购前持本人身份证到中国证登结算有限责任公司深圳分公司的开户代理机构办理深圳证券账户的开户手续。有关开设深圳证券账户的具体程序和办法，请到各开户网点详细咨询有关规定。

深圳证券账户使用注意事项：

1) 深圳证券交易所基金账户只能进行基金的现金认购和二级市场交易，如投资者要参与网下债券认购或基金的申购、赎回，则应开立深圳证券交易所A股账户。

2) 已购买过基金管理人担任登记机构的其他开放式基金的投资人，其持有的由基金管理人开立的开放式基金账户不能用于认购本基金。

投资者应保证用于认购的资金来源合法，投资者应有权自行支配，不存在任何法律上、合约上或其他方面的障碍。投资者已提交的身份证件或身份证明文件如已过有效期，请及时办理相关更新手续，以免影响认购。投资者在认购时还应遵守销售机构有关反洗钱的相关要

求，配合提供必要的客户身份信息与资料。

8、投资者在基金管理人直销机构办理网下现金认购和网下债券认购时需缴纳认购费。发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购、网下债券认购时可参照上述费率结构收取一定的认购费用/佣金。

9、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。投资人可以多次认购，基金管理人可以对募集期间的单个投资人的累计认购份额进行限制。

网下现金认购以基金份额申请。投资人通过发售代理机构办理网下现金认购的，每笔认购份额须为1,000份或其整数倍；投资人通过基金管理人办理网下现金认购的，每笔认购份额须在10万份以上（含10万份）。

网下债券认购以单只债券张数申报，用以认购的债券必须是标的指数成份券或已公告的备选成份券，且在管理人公告的《网下债券认购清单》中。单只债券最低认购申报张数为100张，超过100张的部分须为10张的整数倍。投资者通过基金管理人办理网下债券认购的，单笔认购份额须在50万份以上（含50万份）。

投资者可以多次提交认购申请，但需符合相关法律法规、业务规则以及本基金发售规模控制方案的规定。如深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司、基金管理人修改或更新上述业务规则并适用于本基金的，则按照新的业务规则执行。

10、网上现金认购本基金时，投资人需按发售代理机构的规定，备足认购资金，办理认购手续。投资人可多次申报，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，投资人需按销售机构的规定，到销售网点办理相关认购手续，并备足认购资金。网下现金认购申请提交后在销售机构规定的时间之后不得撤销。网下债券认购本基金时，需按销售机构的规定，到销售网点办理认购手续，并备足认购债券。网下债券认购申请提交后在销售机构规定的时间之后不得撤销。

11、募集规模上限

本基金首次募集规模上限为30亿元人民币（含网下债券认购所募集的债券按基金合同约定的估值方法计算的价值，不包括募集期利息和认购费用）。

12、基金份额发售机构（发售代理机构和/或直销机构）受理认购申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了认购申请。申请是否有效应以登记机构的确认为准。投资者应主动在本基金合同生效后到其办理认购业务的销售网点查询认购确认情况，基金管理人及发售代理机构不承担对确认结果的通知义务。

13、本公告仅对本基金发售的有关事项和规定予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况，请仔细阅读《大成深证基准做市信用债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》《大成深证基准做市信用债交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。本基金的基金合同、托管协议、招募说明书、基金产品资料概要及本公告将同时发布在本公司网站（www.dcfund.com.cn）。投资者如有疑问，可拨打本公司客户服务电话（400-888-5558）及各发售代理机构客户服务电

话。

14、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。

基金分为债券型基金、混合型基金、股票型基金、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。本基金属于债券型基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金与股票型基金。

本基金属于指数基金，采用分层抽样复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的债券市场组合相似的风险收益特征。同时，投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达到约定目标、指数编制机构停止服务、成份券违约或停牌等潜在风险。基金的特定风险详见本基金的招募说明书“风险揭示”章节。

本基金投资于证券市场，基金净值会因证券市场波动等因素产生波动。投资者在投资本基金前，应仔细阅读本基金的招募说明书、基金合同及基金产品资料概要，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对申购基金的意愿、时机、数量等投资行为做出独立、谨慎决策，获得基金投资收益，亦承担基金投资中出现的各类风险。基金管理人在基金管理实施过程中产生的操作或技术风险、本基金的特定风险等。

本基金投资中的风险包括但不限于：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的积极管理风险，本基金的特定风险等。

本基金可投资于资产支持证券，因此可能面临资产支持证券的信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险等。

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、基金合同及基金产品资料概要。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，由投资者自行承担。

15、本基金管理人可综合各种情况对发售安排做适当调整。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、本次发售基本情况

（一）基金的基本情况

基金名称：大成深证基准做市信用债交易型开放式指数证券投资基金

基金简称：大成深证基准做市信用债ETF

场内简称：信用债ETF大成

基金代码：159395

（二）基金运作方式和类别

基金的运作方式：交易型开放式

基金的类别：债券型证券投资基金、指数基金

（三）存续期限

存续期限：不定期。

（四）基金份额面值

每份基金份额初始面值为 1.00 元人民币，认购价格为 1.00 元。

（五）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、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。

（六）募集规模上限

本基金首次募集规模上限为30亿元人民币（含网下债券认购所募集的债券按基金合同约定的估值方法计算的价值, 不包括募集期利息和认购费用，下同）。

在募集期内任何一天（含第一天）当日募集截止时间后累计有效认购申请份额总额超过30亿份（折合为金额30亿元人民币），基金管理人将采取末日比例确认的方式实现规模的有效控制。当发生末日比例确认时，基金管理人将及时公告比例确认情况与结果。未确认部分的认购款项将在募集期结束后退还给投资者。

当发生部分确认时，本基金登记结算机构按照末日认购申请确认比例对末日每笔有效认购申请份额进行部分确认处理，因对每笔认购明细处理的精度等原因，最终确认的本基金累计有效认购份额（不包括募集期利息和认购费用）可能会略微超过30亿份。末日认购申请确认份额不受认购最低限额的限制。最终认购申请确认结果以本基金登记结算机构的计算并确认的结果为准。

基金合同生效后不受此募集规模的限制。

（七）基金份额发售机构

1、网上现金发售代理机构

网上现金发售代理机构为具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位，具体名单详见本公告“八、本次发售当事人或中介机构”中“（三）销售机构”相关内容。

2、网下现金及网下债券发售直销机构

大成基金管理有限公司

3、网下现金及网下债券发售代理机构

详见本公告“八、本次发售当事人或中介机构”中“（三）销售机构”内容及基金管理人后续发布的调整发售机构的相关公告或基金管理人网站。

（八）发售时间安排

本基金于2025年1月7日起至2025年1月20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债券认购3种方式。基金管理人可根据认购的情况及市场情况适当调整发售时间，但最长不超过法定募集期限，并及时公告。

（九）发售方式及相关规定

投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下债券认购3种方式认购本基金。

网上现金认购是指投资人通过基金管理人指定的发售代理机构用深圳证券交易所网上系统以现金进行的认购；网下现金认购是指投资人通过基金管理人及其指定的发售代理机构以现金进行的认购；网下债券认购是指投资人通过基金管理人及其指定的发售代理机构以债券进行的认购。

投资人应当在基金管理人及发售代理机构办理基金发售业务的营业场所，或者按基金管理人或发售代理机构提供的方式办理基金份额的认购。基金管理人、发售代理机构办理基金发售业务的具体情况和联系方式，请参见本基金份额发售公告、后续调整发售机构的公告或基金管理人网站相关公示。

基金管理人可以根据具体情况调整本基金的发售方式，并在后续相关公告中列明。

（十）认购限额

1、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。投资人可以多次认购，但需符合相关法律法规、业务规则。

2、网下现金认购以基金份额申请。投资人通过发售代理机构办理网下现金认购的，每笔认购份额须为1,000份或其整数倍；投资人通过基金管理人办理网下现金认购的，每笔认购份额须在10万份以上（含10万份）。投资人在募集期内可多次认购，但需符合相关法律法规、业务规则。

3、网下债券认购以单只债券张数申报，用以认购的债券必须是标的指数成份券或已公告的备选成份券，且在管理人公告的《网下债券认购清单》中。单只债券最低认购申报张数为100张，超过100张的部分须为10张的整数倍。投资者通过基金管理人办理网下债券认购的，单笔认购份额须在50万份以上（含50万份）。投资者可以多次提交认购申请，但需符合相关法律法规、业务规则以及本基金发售规模控制方案的规定。

(十一) 认购费用

1、募集期投资人可以多次认购本基金，按每笔认购份额确定认购费率，以每笔认购申请单独计算费用。基金投资人认购本基金基金份额时将被收取认购费用。

本基金基金份额的认购费率如下表所示。

认购份额 (S)	认购费率
$S < 50$ 万份	0.40%
50 万份 $\leq S < 100$ 万份	0.20%
$S \geq 100$ 万份	每笔 1,000 元

基金管理人办理网下现金认购和网下债券认购时，可按照上表所示费率收取认购费用。

发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购和网下债券认购时，可参照上述费率结构收取一定的佣金，通过基金管理人或发售代理机构进行网下债券认购的投资者，在基金管理人或发售代理机构允许的条件下，可选择以现金或基金份额的方式支付认购费用（或佣金）。

基金认购费用不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、登记等基金募集期间发生的各项费用。

2、认购费用/佣金和认购金额的计算公式和收取方式

本基金基金份额初始面值为 1.00 元，认购价格为 1.00 元。

(1) 通过发售代理机构进行网上现金认购的认购金额的计算：

通过发售代理机构进行网上现金认购的投资者，认购以基金份额申请，认购佣金、认购金额的计算公式为：

$$\text{认购佣金} = \text{认购份额} \times \text{认购价格} \times \text{佣金比率}$$

(若适用固定费用的，认购佣金=固定费用)

$$\text{认购金额} = \text{认购份额} \times \text{认购价格} \times (1 + \text{佣金比率})$$

(若适用固定费用的，认购金额=认购价格×认购份额+固定费用)

$$\text{利息折算的份额} = \text{利息} / \text{认购价格}$$

$$\text{认购总份额} = \text{认购份额} + \text{利息折算的份额}$$

认购佣金由发售代理机构收取，投资人需以现金方式交纳认购佣金。现金认购款项在基金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，具体份额以登记机构的记录为准。利息折算的基金份额保留至整数位，小数部分舍去，舍去部分计入基金财产。

例：某投资人通过某发售代理机构采用网上现金方式认购 10,000 份本基金，假设该发售代理机构确认的佣金比率为 0.4%，则需准备的资金金额计算如下：

$$\text{认购佣金} = 10,000 \times 1.00 \times 0.4\% = 40.00 \text{ 元}$$

$$\text{认购金额} = 10,000 \times 1.00 \times (1 + 0.4\%) = 10,040.00 \text{ 元}$$

$$\text{利息折算的份额} = 2.00 / 1.00 = 2 \text{ 份}$$

即：即投资人需准备 10,040.00 元资金，方可认购到 10,000 份本基金基金份额，加

上募集期间利息折算的份额后一共可以得到 10,002 份基金份额。

(2) 通过基金管理人进行网下现金认购的投资人，认购以基金份额申请，认购费用、认购金额的计算公式为：

$$\text{认购费用} = \text{认购份额} \times \text{认购价格} \times \text{认购费率}$$

(若适用固定费用的，认购费用=固定费用)

$$\text{认购金额} = \text{认购份额} \times \text{认购价格} \times (1 + \text{认购费率})$$

(若适用固定费用的，认购金额=认购价格×认购份额+固定费用)

$$\text{利息折算的份额} = \text{利息} / \text{认购价格}$$

$$\text{认购总份额} = \text{认购份额} + \text{利息折算的份额}$$

认购费用由基金管理人收取，投资人需以现金方式交纳认购费用。通过基金管理人进行网下现金认购的有效认购资金在基金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，其中利息转份额的具体数额以基金管理人的记录为准。利息折算的份额保留至整数位，小数部分舍去，舍去部分计入基金财产。

例：某投资人通过基金管理人以网下现金认购方式认购 100,000 份本基金，认购费率为 0.4%，假设认购资金募集期间产生的利息为 20.00 元，则需准备的认购资金金额及募集期间利息折算的份额计算如下：

$$\text{认购费用} = 1.00 \times 100,000 \times 0.4\% = 400.00 \text{ 元}$$

$$\text{认购金额} = 1.00 \times 100,000 \times (1 + 0.4\%) = 100,400.00 \text{ 元}$$

$$\text{利息折算的份额} = 20.00 / 1.00 = 20 \text{ 份}$$

即投资人需准备 100,400.00 元资金，方可认购到 100,000 份本基金基金份额，加上募集期间利息折算的份额后一共可以得到 100,020 份基金份额。

(3) 通过发售代理机构进行网下现金认购的认购金额的计算：同通过发售代理机构进行网上现金认购的认购金额的计算。

(4) 网下债券认购份额的计算公式

$$\text{认购份额} = \sum_i^n (\text{第 } i \text{ 只债券的价值} * \text{有效认购数量}) / \text{基金份额面值} (1.00 \text{ 元})$$

如投资人选择以现金支付认购费用/佣金则其可得到的基金份额和需支付的认购费用/佣金如下：

$$\text{认购费用/佣金} = \text{认购份额} * \text{基金份额面值} * \text{认购费率或佣金比率}$$

$$\text{净认购份额} = \text{认购份额}$$

如投资人选择以基金份额的方式缴纳认购费用/佣金，则其可得到的认购份额和需支付的认购费用/佣金如下：

$$\text{认购费用/佣金} = \text{基金份额面值} * \text{认购份额} / (1 + \text{认购费率或佣金比率}) * \text{认购费率或佣金比率}$$

$$\text{净认购份额} = \text{认购份额} - \text{认购费用或佣金} / \text{基金份额面值}$$

其中：

1) i 代表投资人提交认购申请的第 i 只债券, n 代表投资人提交的债券总只数。如投资人仅提交了 1 只债券的申请, 则 $n=1$ 。

2) T 日为网下债券认购期最后一日。

3) D 日为债券过户日。

4) “第 i 只债券的价值” = 第 i 只债券在 T 日的估值价 (注: 如无特别所指, 则为估值净价) + 截至 $(D-1)$ 日应计利息。

若某一债券在 T 日至登记机构进行债券过户日 (D 日) 的冻结期间发生利息兑付等权益变动情况, 则由于投资人获得了相应的权益, 基金管理人将相应调整应计利息的计算。

5) “有效认购数量” 是指由基金管理人确认的并据以进行清算交收的债券数量。其中, 若基金管理人在网下债券认购日前公告了限制认购规模的个券名单, 则对于经公告限制认购规模的个券, 基金管理人可确认的认购数量上限的确认方法在届时公告中列示。

若某一债券在网下债券认购日至登记机构进行债券过户日 (D 日) 的冻结期间发生司法执行, 则基金管理人将根据登记机构发送的调账数据对投资人的有效认购数量进行相应调整。

6) 认购份额、净认购份额和以基金份额的方式支付认购佣金的计算保留到整数位, 小数点后部分舍去。

二、投资者开户

（一）投资人认购本基金时需具有深圳证券交易所人民币普通股票账户（即A股账户）或深圳证券交易所证券投资基金账户（以下简称“基金账户”）。

（1）已有深圳证券账户的投资人不必再办理开户手续。

（2）尚无深圳证券账户的投资人，需在认购前持本人身份证到中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的开户代理机构办理深圳证券账户的开户手续。有关开设深圳证券账户的具体程序和办法，请到各开户网点详细咨询有关规定。

（二）深圳证券账户使用注意事项

（1）深圳证券交易所基金账户只能进行基金的现金认购和二级市场交易，如投资者要参与网下债券认购或基金的申购、赎回，则应开立深圳证券交易所A股账户。

（2）已购买过基金管理人担任登记机构的其他开放式基金的投资人，其持有的由基金管理人开立的开放式基金账户不能用于认购本基金。

三、网上现金认购的程序

(一) 业务办理时间：2025年1月7日起至2025年1月20日（含）9：30~11：30和13：00~15：00（周六、周日及法定节假日不受理）。

(二) 认购手续：

- 1、开立深圳证券交易所A股账户或深圳证券交易所证券投资基金账户。
- 2、在认购前向资金账户中存入足够的认购资金。
- 3、投资者网上现金认购流程、需提交的文件等应遵循发售代理机构及深圳证券交易所的有关规定。

四、网下现金认购的程序

（一）直销机构

1、业务办理时间：2025年1月7日起至2025年1月20日（含）8：30~17：00（周六、周日及法定节假日不受理）。

2、认购手续：投资人到基金管理人直销网点提供下列资料办理基金的认购手续：

（1）个人投资者提供身份证件（原件及复印件）；

（2）机构投资者提供企业营业执照正本或副本原件及加盖单位公章的复印件；事业法人、社会团体或其他组织提供民政部门或主管部门颁发的注册登记证书原件及加盖单位公章的复印件；法人及业务经办人有效身份证件原件及复印件以及基金业务授权委托书；法定代表人授权委托书；印鉴卡一式二份；

（3）深圳证券交易所A股股东代码卡或证券投资基金账户代码卡，个人及机构投资者并需提供有效的账户凭证，以证明所提交的有效身份证件与其开立深圳证券交易所A股账户或深圳证券交易所基金账户时登记的证件一致；

（4）投资者填写认购申请单，机构投资者还须经经办人签字并加盖预留印鉴；

（5）盖银行受理章的汇款凭证回单原件及复印件。

3、投资人办理认购前应将足额资金汇入大成基金管理有限公司指定的直销专户：

户名	开户行	账号	开户地
大成基金管理有限公司	交通银行深圳红荔支行	443066041018002247518	深圳
大成基金管理有限公司	招商银行深圳蛇口支行	811289006810001	深圳
大成基金管理有限公司	中国建设银行深圳市分行营业部	44201507300052506349	深圳
大成基金管理有限公司	中信银行深圳罗湖口岸支行	8110301413400007388	深圳
大成基金管理有限公司	中国工商银行深圳上步支行	4000020129200457739	深圳

4、注意事项：

（1）投资人在认购时不能使用大成基金管理有限公司开放式基金账户，而需使用深圳证券交易所A股账户卡或证券投资基金账户卡。

（2）投资者应在“汇款人”栏中填写其开立深圳证券交易所A股账户或深圳证券交易所基金账户时登记的名称。

（3）投资者汇款时，可提示银行柜台人员务必准确完整地传递汇款信息。

为了确保投资者资金及时准确的入账，建议投资者将加盖银行业务受理章的汇款单据传真至大成基金管理有限公司直销中心。传真号码：0755-83199588

（二）发售代理机构

1、业务办理时间：2025年1月7日起至2025年1月20日（含），具体业务办理时间由发售代理机构确定。

2、认购手续：

（1）开立深圳证券交易所A股账户或深圳证券交易所证券投资基金账户。

(2) 按发售代理机构的规定，在认购前向资金账户中存入足够的认购资金。

(3) 投资者填写认购委托单，同时填写委托该发售代理机构代为办理网上现金认购的委托申请书。申报一经确认，认购资金即被冻结。具体办理流程及需要提交的文件等应遵循发售代理机构的相关规定。

五、网下债券认购的程序

（一）直销机构

1、业务办理时间：2025年1月7日起至2025年1月20日，上午9：30-11：30 和下午13：00-15：00（周六、周日及节假日不受理）。

2、直销机构办理网下债券认购的程序：

（1）投资人以深圳证券交易所上市交易的本基金标的指数成份债券或备选成份债券进行网下债券认购的，应开立并使用A股账户。

（2）在A股账户中具备足够的符合要求的标的指数成份债券和已公告的备选成份债券。

（3）投资者填写认购委托单。如登记机构办理过户业务时，投资者可用债券余额不足，则投资者的该笔债券认购申请无效，但不影响该证券账户其他债券换购本基金份额。

3、特别提示：投资者应根据法律法规及证券交易所相关规定进行债券认购。

（二）发售代理机构

1. 认购时间：2025年1月7日起至2025年1月20日，上午9：30-11：30 和下午13：00-15：00（周六、周日及节假日不受理），具体业务办理时间由发售代理机构确定。

2. 发售代理机构办理网下债券认购的程序：

（1）开立深圳证券交易所A 股账户

投资人以深圳证券交易所上市交易的本基金标的指数成份债券或备选成份债券进行网下债券认购的，应开立并使用A股账户。

（2）在A股账户中具备足够的符合要求的标的指数成份债券或备选成份债券。

（3）投资者填写认购委托单。申报一经确认，认购债券即被冻结。

具体认购程序以发售代理机构的规定为准。

特别提示：投资者应根据法律法规及证券交易所相关规定进行债券认购。

（三）特殊情形

（1）已公告的将被调出标的指数的成份券不得用于认购本基金。

（2）限制个券认购规模：基金管理人可根据网下债券认购日前3个月个券的交易量、价格波动及其他异常情况，决定是否对个券认购规模进行限制，并在网下债券认购日前公告限制认购规模的个券名单。

（3）临时拒绝个券认购：对于在网下债券认购期间价格波动异常或认购申报数量异常的个券，基金管理人可不经公告，全部或部分拒绝该债券的认购申报。

六、清算与交割

（一）基金募集期间募集的现金认购资金应当存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。募集的债券由登记机构予以冻结。

网下现金认购及网上现金认购的有效认购资金在募集期间产生的利息将折算为基金份额归投资人所有，利息折算的份额以基金管理人及登记机构的记录为准。投资人以债券认购的，在债券认购日至登记机构进行债券过户日的冻结期间的权益归投资人所有。

（二）本基金权益登记由登记机构在基金募集结束后完成过户登记。

七、基金的验资与基金合同生效

(一) 本基金自基金份额发售之日起3个月内，在基金募集份额总额不少于2亿份，基金募集金额不少于2亿元人民币（含网下债券认购所募集的债券按基金合同约定的估值方法计算的价值）且基金认购人数不少于200人的条件下，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，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。

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，网下债券认购募集的债券根据《业务规则》予以冻结，上述资金及网下债券认购募集的债券在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

(二) 基金合同不能生效时募集资金及债券的处理方式

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：

- 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，并加计银行同期活期存款利息；对于基金募集期间网下债券认购所募集的债券，登记机构应予以解冻，基金管理人不承担相关债券冻结期间交易价格波动的责任。发售代理机构将协助基金管理人、登记机构完成相关资金和证券的退还工作；
- 3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及发售代理机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和发售代理机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

八、本次发售当事人或中介机构

（一）基金管理人

大成基金管理有限公司

住所：广东省深圳市南山区海德三道1236号大成基金总部大厦5层、27-33层

办公地址：广东省深圳市南山区海德三道1236号大成基金总部大厦27层

法定代表人：吴庆斌

电话：0755-83183388

传真：0755-83199588

联系人：吴海灵

公司网址：www.dcfund.com.cn

大成基金客户服务热线：400-888-5558（免长途固话费）

（二）基金托管人

名称：兴业银行股份有限公司

注册地址：福建省福州市台江区江滨中大道398号兴业银行大厦

办公地址：上海市银城路167号

邮政编码：200120

法定代表人：吕家进

客户服务电话：95561

公司网址：www.cib.com.cn

（三）销售机构

1、网上现金发售代理机构

网上现金发售通过具有基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单位办理：爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财通证券、财信证券、长城证券、长江证券、川财证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方财富、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、方正证券、光大证券、广发证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国融证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰长财、恒泰证券、红塔证券、宏信证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华金证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、九州证券、开源证券、联储证券、民生证券、南京证券、平安证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申万宏源证券、申万宏源西部证券、世纪证券、首创证券、太平洋证券、天风证券、万和证券、万联证券、网信证券、西部证券、西南证券、长城国瑞、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、

英大证券、甬兴证券、粤开证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金财富、中金公司、中山证券、中泰证券、中天证券、中信建投、中信山东、中信证券、中信证券华南、中银证券、中邮证券、中原证券（排名不分先后）。

如果会员单位有所增加或减少，请以深圳证券交易所的具体规定为准，本基金管理人将不就此事项进行公告。

2、网下现金和网下债券发售直销机构

大成基金管理有限公司

住所：广东省深圳市南山区海德三道1236号大成基金总部大厦5层、27-33层

办公地址：广东省深圳市南山区海德三道1236号大成基金总部大厦27层

法定代表人：吴庆斌

电话：0755-83183388

传真：0755-83199588

联系人：吴海灵

公司网址：www.dcfund.com.cn

大成基金客户服务热线：400-888-5558（免长途固话费）

3、网下现金和网下债券发售代理机构

本公司可以根据情况变化调整网下现金和网下债券发售机构，投资者可登录本公司官网查询。各销售机构具体业务办理情况以其各自规定为准。

4、基金管理人可根据有关法律法规要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更上述发售代理机构，并及时在基金管理人网站公示。

（四）登记结算机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所、办公地址：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：于文强

联系人：赵亦清

电话：（010）50938782

传真：（010）50938907

（五）出具法律意见书的律师事务所和经办律师

名称：上海源泰律师事务所

地址：上海市浦东南路256号华夏银行大厦14楼

负责人：廖海

联系电话：021-51150298

传真：021-51150398

联系人：刘佳

经办律师：刘佳、张雯倩

（六）审计基金财产的会计师事务所和经办注册会计师

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：毛鞍宁

电话：（010）58153000、（0755）25028288

传真：（010）85188298、（0755）25026188

签章注册会计师：高鹤、林恩丽

联系人：高鹤

九、网下债券认购清单

本基金募集期间，网下债券认购名单如下表所示，但是募集期结束前已公告的将被调出标的指数成份券不得用于认购本基金。基金管理人可根据网下债券认购日前3个月个券的交易量、价格波动及其他异常情况，决定是否对个券认购规模进行限制，并在网下债券认购日前公告限制认购规模的个券名单。对于在网下债券认购期间价格波动异常或认购申报数量异常的个券，基金管理人可不经公告，全部或部分拒绝该债券的认购申报。

如遇深证基准做市信用债指数成份券调整，则最终确认可接受网下债券认购的清单以最终调整公告的成份券清单为准。

深市代码	证券简称	深市代码	证券简称
111077	19 深能 G1	148810	24 陕投 K3
111090	20SZMC01	148818	24 中航 K5
111100	20 川交 01	148819	24 中航 K6
111116	24 穗铁 02	148821	24 川能 K1
148012	22 深投 05	148826	24 风电 GVK2
148015	22 广电 01	148829	24 深担 01
148018	22 招路 01	148833	24 重发 03
148021	22 湘路 06	148844	24 深投 04
148052	22 招港 01	148855	24 粤财 01
148071	22 天山 01	148861	24 陕投 K4
148073	22 南网 01	148863	24 工控 K2
148074	22 广铁 G2	148872	24 川投 K1
148075	22 深铁 07	148873	24 中航 K7
148089	22 越租 G1	148874	24 中航 K8
148092	22 深担 02	148877	24 招港 K1
148096	22 吉电 G2	148886	24 鞍钢集 K1
148114	22 粤桥 01	148894	24 粤环保 K3
148158	22 广电 02	148897	24 陕投 K5
148201	23 鄂交 K2	148899	24 深投 06
148256	23 深铁 02	148910	24 招租 G1
148258	23 陕投 01	148916	24 重发 04
148264	23 深业 01	148931	24 深业 03
148308	23 鄂交 K4	148939	24 深投 08
148314	23 深铁 03	148946	24 鲲鹏 04
148321	23 风电 GK01	148954	24 深投 10
148343	23 深铁 05	148957	24 鞍钢集 K3
148350	23 深投 02	148958	24 鞍钢集 K4
148360	23 川投 K1	148962	24 工控 K4
148372	23 国际 P1	148968	24 赣水 K1
148374	23 深铁 06	149099	20HBIS01

148398	23 国际 P3	149181	20HBIS02
148413	23 深铁 10	149249	20 深铁 G4
148415	23 越租 G1	149293	20 穗交 01
148417	23 中航 K1	149316	20 珠华 01
148422	23 徐工 01	149376	21 珠华 01
148431	23 招路 K1	149399	21 珠华 G1
148436	23 中建国投 G1	149424	21 广铁 02
148438	23 珠华 01	149435	21 嘉投 02
148442	23 长新 02	149455	21 广铁 01
148452	23 深铁 12	149457	21 粤桥 01
148463	23 深投 05	149461	21 粤高 01
148465	23 国际 P7	149474	21 深投 02
148470	23 深投 06	149489	21 广铁 03
148476	23 深铁 15	149516	21 建能 01
148490	23 长轨 G3	149533	21 嘉城 01
148543	23 穗城 01	149576	21 深投 03
148577	24 招租 K1	149623	21 中旅 02
148581	24HBIS01	149624	21 深 G11
148595	24 重发 01	149625	21 深 G12
148611	24 深铁 02	149647	21 青城 09
148615	24 穗城 03	149651	21 粤海 02
148617	24 圆融 01	149697	21 穗交 04
148621	24 深创投 02	149737	21 青城 11
148624	24 深铁 04	149763	21 嘉投 03
148627	24 广州数字科技 K1	149765	22 焦能 01
148629	24 广晟 K01	149780	22 广铁 01
148641	24 深铁 06	149813	22 陕投 01
148643	24 鲲鹏 02	149816	22 广金 01
148644	24 深业 01	149843	22 广晟 01
148646	24 穗城 04	149845	22 深投 01
148655	24 粤海 01	149848	22 吉电 G1
148664	24 深铁 07	149865	22 广晟 03
148685	24 中航 K2	149875	22 深铁 G3
148687	24 深能 01	149881	22 厦港 01
148693	24 深港 02	149888	22 鲲鹏 02
148702	24 深铁 08	149896	22 深资 01
148712	24 天山 K1	149912	22 广新 02
148716	24 中航 K3	149918	22 创投 01
148733	24 深铁 09	149936	22 深铁 G5
148738	24 路桥 K3	149953	22 创投 02
148741	24 风电 KV01	524002	24 华能资 01
148744	24 越租 G2	524004	24 湘路 D1
148759	24 天材 K3	524012	24 川投 K2
148760	GC 风电 KV01	524019	24 深担 02
148765	24 广州数字科技 K2	524022	24 深环 01

148775	24 珠华 01	524025	24 深投 12
148777	24 招路 K1	524050	24 鞍钢集 K6
148778	24 路桥 K4	524054	24 深环水 02
148792	24 拱国控 01	524075	24 深环水 03

大成基金管理有限公司

2025年1月3日