

关于大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金根据更 新的中证 100 指数编制方案修订基金合同的公告

中证指数有限公司于 2022 年 5 月 18 日发布了《关于修订中证 100 指数编制方案的公告》，此次修订内容包括：（1）样本空间修订为同中证全指样本空间；（2）增加过去一年日均成交额位于样本空间前 90%的流动性筛选条件；（3）选样方法修订为，选取经中证 ESG 评价筛选后总市值在前 300 名且属于沪深股通范围的证券作为待选样本，从中优先选取各二级行业自由流通市值最大且总市值位于样本空间前 100 名的证券作为指数样本，再从各一级行业内按自由流通市值高低依次选入一定数量证券，以使样本数达到 100 只，且各一级行业自由流通市值占比与样本空间尽可能保持一致；（4）增加单个样本权重不超过 10%的限制；（5）样本调整比例上限修订为 20%；（6）取消快速进入规则，增加样本因不满足互联互通资格而临时调整的规则。编制方案其余部分保持不变。

大成基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“本公司”）旗下大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金（基金代码：159923，场内简称：中证 100ETF）的标的指数为中证 100 指数。经与基金托管人中国银行股份有限公司（以下简称“托管人”）协商一致，本公司将据此修订《大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）。现将相关情况公告如下：

一、关于《大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的修改及说明

1、关于《基金合同》的修改

《基金合同》十五章“基金的投资”中第（六）点“标的指数和业绩比较基准”

原文为：

“本基金的标的指数及业绩比较基准为：中证 100 指数。

中证 100 指数是从沪深 300 指数样本股中挑选规模最大的 100 只股票组成样本股，以综合反映沪深证券市场中最具市场影响力的一批大市值公司的整体状况。

未来若出现标的指数不符合《指数基金指引》要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求及法律法规、监管机构另有规定的除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、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。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。

标的指数更换后，业绩比较基准随之变更，基金管理人可根据需要替换或删除基金名称中与原标的指数相关的商号或字样。”

修改为：

“本基金的标的指数及业绩比较基准为：中证 100 指数。

未来若出现标的指数不符合《指数基金指引》要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求及法律法规、监管机构另有规定的除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、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。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。

标的指数更换后，业绩比较基准随之变更，基金管理人可根据需要替换或删除基金名称中与原标的指数相关的商号或字样。”

2、关于修订《基金合同》的说明

本公司经与托管人协商一致，对《基金合同》中涉及上述相关内容进行修改。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，并已向证监会履行备案手续，无需召开基金份额持有人大会。修订后的《基金合同》自本公告发布之日起生效。

本公司于本公告日在网站上同时公布经修改后的基金合同，大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金的招募说明书涉及前述内容的，将一并修改，并依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

二、重要提示

1、本公告仅对配合中证 100 指数编制方案的修订相应调整基金的投资组合，并修订《大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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《大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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，或拨打本公司客户服务电话（400-888-5558）进行咨询。

2、风险提示：本公司承诺以诚实信用、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。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。本公司提醒投资人在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。投资者投资基金时应认真阅读基金的《基金合同》、更新的《招募说明书》及《产品资料概要》等文件。

特此公告。

大成基金管理有限公司

2022年6月11日