

# 关于大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金落实中证 100 指数编制方案修订相关安排的公告

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》，中证 100 指数将修订指数编制方案（以下简称“编制方案”），并于 2022 年 6 月 13 日正式实施，编制方案修订内容主要包括：（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），于 2013 年 2 月 7 日成立，本基金跟踪的标的指数为中证 100 指数（以下简称“标的指数”）。基于本次标的指数编制方案的修订，根据《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”）的约定，本基金管理人将更新招募说明书中关于标的指数编制方案的内容，并调整本基金投资组合等相关安排，具体事宜公告如下：

## 一、《大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》更新

因《大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）对标的指数编制方案进行了较为详细的介绍，为了保证相关信息的准确性，本基金管理人拟对招募说明书中涉及标的指数编制方案的相关内容进行相应更新。

## 二、基金的投资

根据基金合同的相关约定，本基金投资于标的指数成份股（含存托凭证）和

备选成份股（含存托凭证）的资产比例不低于基金资产净值的 90%。本基金管理人将依据基金合同约定完成基金投资组合的调整。

### 三、相关业务规则

本基金的申购、赎回及定期定额投资业务规则保持不变，调整期间不暂停申购、赎回。

### 四、其他需要提示的事项

1、本公告仅对本基金落实标的指数编制方案修订相关安排的有关事宜予以说明，投资者欲了解本基金的详细情况，请仔细阅读本基金的基金合同和招募说明书及其更新等基金法律文件。

2、由于标的指数修订了编制方案，本基金在相应的组合调整中可能产生跟踪偏离度与跟踪误差。本基金有关指数投资等风险请详见本基金招募说明书的“风险揭示”章节。

3、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](http://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。

#### 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