

大成恒生指数证券投资基金（LOF）

基金产品资料概要更新

编制日期：2023 年 7 月 26 日

送出日期：2023 年 8 月 26 日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

基金简称	大成恒生指数（QDII-LOF）	基金代码	160924
基金管理人	大成基金管理有限公司	基金托管人	中国工商银行股份有限公司
境外托管人	法国巴黎银行全球托管行		
上市交易所及上市日期	深圳证券交易所		2017 年 8 月 28 日
基金合同生效日	2017 年 8 月 10 日		
基金类型	股票型	交易币种	人民币
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	冉凌浩	开始担任本基金基金经理的日期	2017 年 8 月 10 日
		证券从业日期	2003 年 4 月 1 日
其他	基金合同生效后，连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续六十个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。		

注：本基金份额场内简称：恒生指数 LOF

二、基金投资与净值表现

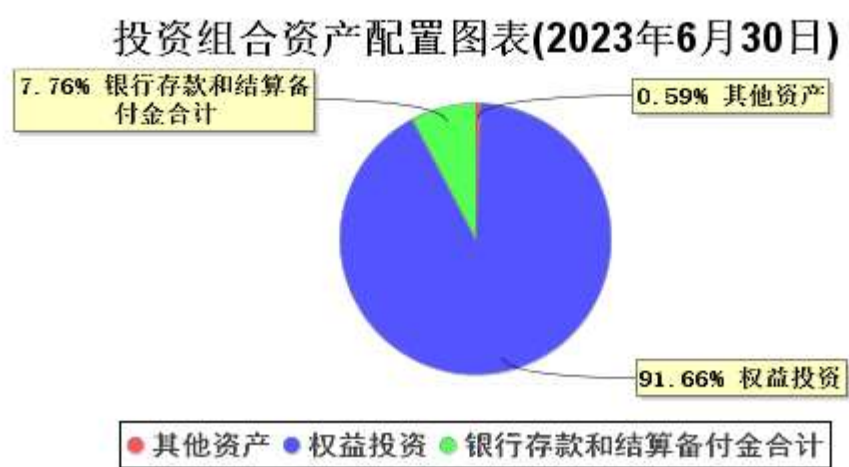
(一) 投资目标与投资策略

详见《大成恒生指数证券投资基金(LOF)更新招募说明书》第十部分“基金的投资”。

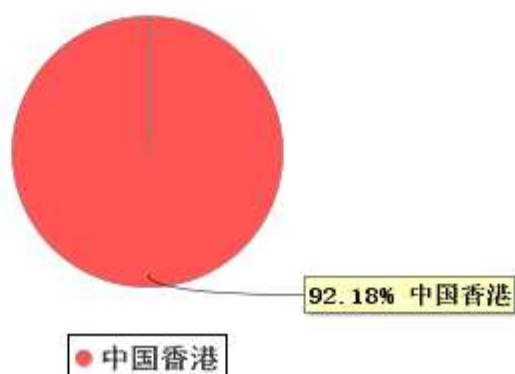
投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资范围	本基金跟踪标的指数为：恒生指数。 本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。此外，为了更好地实现本基金的投资目标，本基金可通过沪港股票市场交易互联互通机制(以下简称“沪港通”)投资于沪港通允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票，以及银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭

	<p>证、房地产信托凭证；在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品以及法律法规或监管机构允许本基金投资的其他产品或金融工具。</p> <p>基金的投资组合比例为：股票占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于港股通标的股票占基金资产的比例为 0—95%；投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于基金非现金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；权证、股指期货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。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p>
主要投资策略	<p>本基金主要按照标的指数的成份股及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况（如股票停牌、流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。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，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，综合考虑成份股的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响，据此制定成份股替代策略，并对投资组合进行相应调整。</p>
业绩比较基准	恒生指数收益率*95%+人民币活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	<p>本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金基金资产将投资于香港市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。</p>

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表



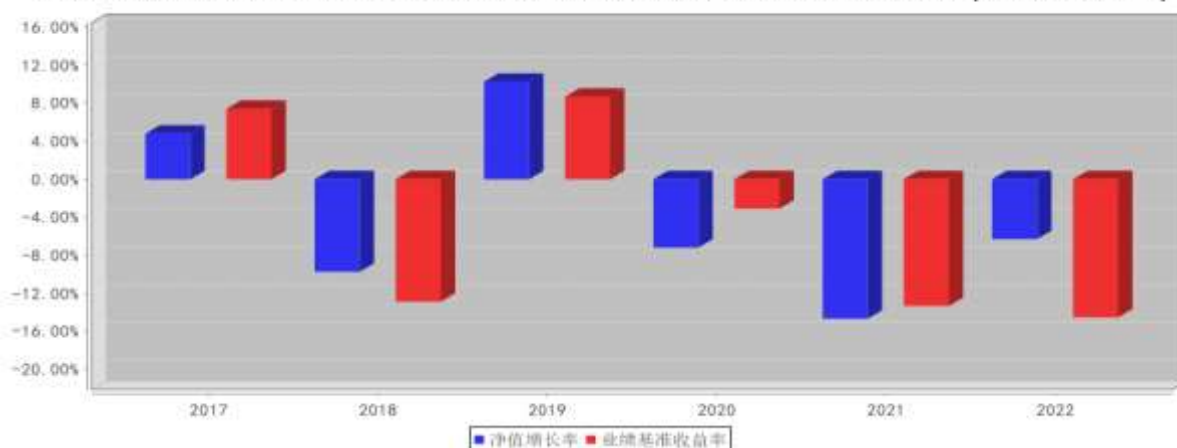
## 区域配置图表(2023年6月30日)



注: 图中比例为本基金季度报告中披露的报告期末本基金在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布情况。

## (三) 自基金合同生效以来/最近十年(孰短)基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

大成恒生指数（QDII-LOF）基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图(2022年12月31日)



注: 1、基金的过往业绩不代表未来表现。

2、如合同生效当年不满完整自然年度的, 按实际期限计算净值增长率。

## 三、投资本基金涉及的费用

## (一) 基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取:

费用类型	份额(S)或金额(M) /持有期限(N)	收费方式/费率	备注
申购费 (前收费)	M<100 万元	1.2%	—
	100 万元≤M<200 万元	0.8%	—
	200 万元≤M<500 万元	0.5%	—
	M≥500 万元	1,000 元/笔	—
赎回费	N<7 天	1.5%	场外份额
	7 天≤N<1 年	0.5%	场外份额
	1 年≤N<2 年	0.25%	场外份额
	N≥2 年	0.0	场外份额

	N<7 天	1.5%	场内份额
	N≥7 天	0.5%	场内份额

注:场内交易费用以证券公司实际收取为准。养老金账户在基金管理人直销中心办理账户认证手续后,可享受申购费率优惠,具体情况可详见公司相关公告。

## (二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除:

费用类别	收费方式/年费率
管理费	1%
托管费	0.2%
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用、会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费,基金份额持有人大会费用,基金的证券交易费用,基金的银行汇划费用,基金上市费及年费,基金的指数使用费,基金相关账户的开户及维护费用,按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

注:本基金交易证券等产生的费用和税负,按实际发生额从基金资产扣除。

## 四、风险揭示与重要提示

### (一) 风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。投资有风险,投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

#### 1、本基金特有风险

- (1) 指数授权风险。
- (2) 金融模型风险。
- (3) 跟踪误差风险。
- (4) 跟踪误差控制未达约定目标的风险。
- (5) 指数编制机构停止服务的风险。
- (6) 成份股停牌的风险。
- (7) 衍生品投资风险。
- (8) 证券借贷和正回购/逆回购风险
- (9) 港股通特定业务风险
- (10) 单一投资者集中度较高的风险。

#### 2、本基金还面临证券投资基金投资共有的风险,如市场风险、管理风险、流动性风险、其他风险等。

### (二) 重要提示

基金产品资料概要信息发生重大变更的,基金管理人将在三个工作日内更新,其他信息发生变更的,基金管理人每年更新一次。因此,本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后,如需及时、准确获取基金的相关信息,敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

大成恒生指数证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)经中国证监会2015年11月25日证监许可【2015】2748号文予以注册。

中国证监会对本基金募集的注册或核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

基金投资者自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

本基金标的指数为恒生指数，该指数的样本空间、选样方法等信息详见本基金招募说明书。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[[www.dcfund.com.cn](http://www.dcfund.com.cn)]客服电话[4008885558]

1. 大成恒生指数证券投资基金（LOF）基金合同、大成恒生指数证券投资基金（LOF）托管协议、大成恒生指数证券投资基金（LOF）招募说明书
2. 定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
3. 基金份额净值
4. 基金销售机构及联系方式
5. 其他重要资料