

大成恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(C类份额)

基金产品资料概要更新

编制日期：2024年6月3日

送出日期：2024年6月28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	大成恒生科技 ETF 发起式联接	基金代码	012979
下属基金简称	大成恒生科技 ETF 发起式联接 C	下属基金交易代码	012980
基金管理人	大成基金管理有限公司	基金托管人	中国银行股份有限公司
基金合同生效日	2021年09月09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	2021年09月09日
		证券从业日期	2003年4月1日
其他	基金合同生效之日起3年后的对应日，若基金资产净值低于2亿元，基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。若届时法律法规或证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充时，则本基金可以参照届时有效的法律法规或证监会规定执行。 《基金合同》生效满3年后继续存续的，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、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。 法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。		

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

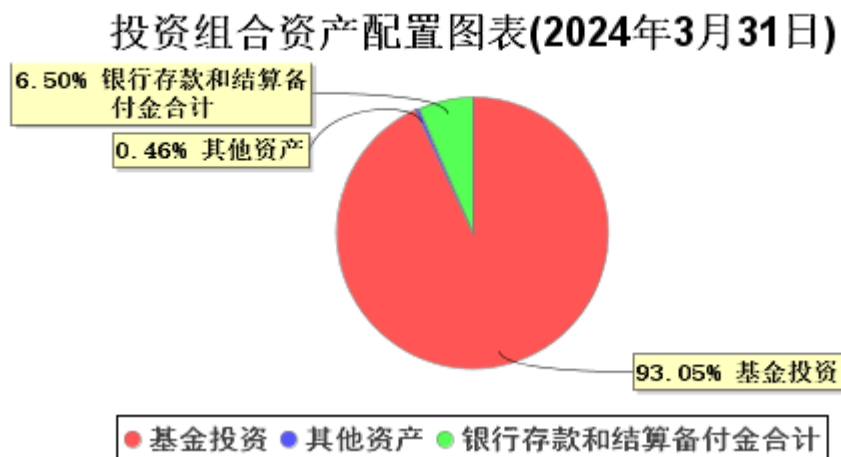
详见《大成恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金更新招募说明书》第四部分“基金的投资”。

投资目标	通过主要投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数即恒生科技指数的表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资范围	本基金的标的指数为恒生科技指数。本基金主要投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股（含存托凭证）、备选成份股（含存托凭证）。此外，为更好地实现投资目标，本基金还可投资于依法发行或上市的其他股票（含存托

	<p>凭证)、债券、资产支持证券、银行存款、同业存单、货币市场工具、金融衍生工具(包括期货、期权等)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中在投资香港市场时,本基金可通过合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度或内地与香港股票市场交易互联互通机制进行投资。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。</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> <p>基金的投资组合比例为:投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%。每个交易日日终保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p> <p>如果法律法规或监管机构对基金的投资组合比例要求有变更的,以变更后的比例为准,在履行适当程序后,本基金的投资比例会做相应调整。</p>
<p>主要投资策略</p>	<p>本基金以目标ETF作为其主要投资标的,方便特定的客户群通过本基金投资目标ETF。本基金并不参与目标ETF的管理。在正常市场情况下,本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>为实现投资目标,本基金将以不低于基金资产净值90%的资产投资于目标ETF。为更好地实现投资目标,本基金还可少量投资于非成份股、债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、金融衍生品以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。</p> <p>2、目标ETF投资策略</p> <p>(1)组合的投资方式</p> <p>在投资运作过程中,本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上,决定采用一级市场申购赎回的方式或二级市场买卖的方式投资于目标ETF。本基金投资于目标ETF的方式以申购和赎回为主,但在目标ETF二级市场流动性较好的情况下,为了更好地实现本基金的投资目标,减小与业绩比较基准的跟踪偏离度和跟踪误差,也可以通过二级市场交易买卖目标ETF。</p> <p>(2)组合的调整方式</p> <p>本基金将根据开放日申购和赎回情况,决定投资目标ETF的时间和方式。</p> <p>3、成份股、备选成份股投资策略</p> <p>本基金对成份股、备选成份股的投资目的是为准备构建股票组合以申购目标ETF。因此对可投资于成份股、备选成份股的资金头寸,主要采取完全复制策略,即完全按照标的指数的成份股组成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而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。</p> <p>4、债券投资策略</p> <p>5、资产支持证券的投资策略</p> <p>6、金融衍生品投资策略</p> <p>7、融资及转融通证券出借投资策略</p> <p>8、存托凭证投资策略</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>本基金的业绩比较基准为:恒生科技指数收益率\times95%+银行活期存款税后利率\times5%</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金属于股票ETF的联接基金,主要通过投资于目标ETF来实现对业绩比较基准的紧</p>

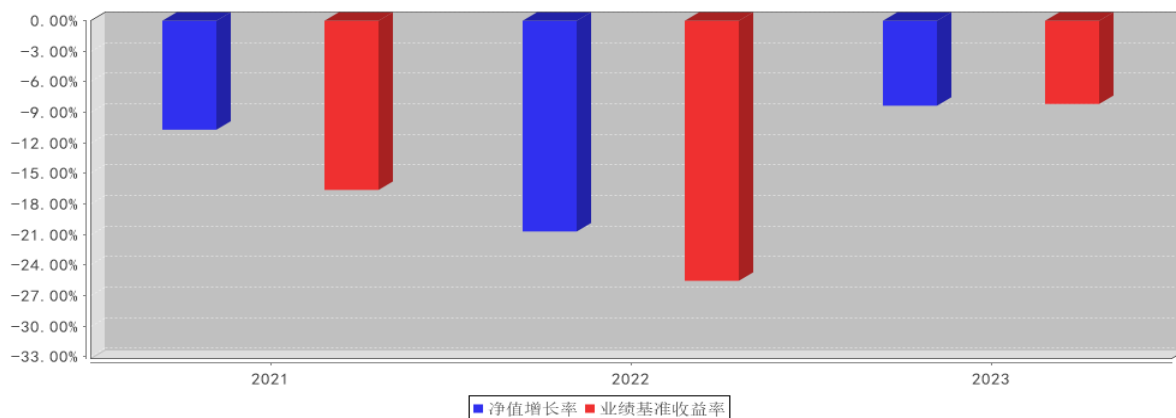
密跟踪。因此，本基金的业绩表现与恒生科技指数及目标ETF的表现密切相关，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。
此外，本基金投资香港市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，还面临汇率风险以及香港市场的投资风险。

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表



(三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

大成恒生科技ETF发起式联接C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（2023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
赎回费	N < 7天	1.50%
	7日 ≤ N < 30日	0.1%
	N ≥ 30天	0

注：本基金份额不收取申购费。按照持有期限收取赎回费。

(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/年费率或金额	收取方
管理费	0.5%	基金管理人和销售机构
托管费	0.1%	基金托管人
销售服务费	0.4%	销售机构
审计费用	40,000.00 元	会计师事务所
信息披露费	120,000.00 元	规定披露报刊
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的律师费、仲裁费和诉讼费，基金份额持有人大会费用；基金的证券、期货交易费用，基金的银行汇划费用，基金的开户费用、账户维护费用，（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、融资融券费、证券相关账户费用及其他类似性质的费用等）；基金财产投资运营过程中的增值税；外币兑换交易相关费用；因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；基金投资目标 ETF 的相关费用（包括但不限于目标 ETF 的交易费用、申赎费用等）；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：（1）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。

（2）审计费用、信息披露费为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

（3）本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费、托管费。

(三) 基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

大成恒生科技 ETF 发起式联接 C

基金运作综合费率（年化）
1.11%

注：基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

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。

本基金特有风险：

1、指数波动的风险

目标 ETF 标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证）的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动。由于本基金主要投资于目标 ETF，基金收益水平会因为目标 ETF 标的指数的波动发生变化，从而产生风险。

- 2、跟踪误差控制未达约定目标的风险
- 3、指数编制机构停止服务的风险
- 4、成份股停牌的风险
- 5、指数编制的风险
- 6、基金收益率与业绩比较基准收益率偏离的风险
- 7、由于本基金在投资限制、运作机制和投资策略等方面与目标 ETF 不同，因此本基金可能具有与目标 ETF 不同的风险收益特征及净值增长率。
- 8、本基金属于联接基金，主要投资于目标 ETF，因此目标 ETF 面临的风险可能直接或间接成为本基金的风险，投资者应知悉并关注目标 ETF 招募说明书等文件中的风险揭示内容。
- 9、基金由目标 ETF 的联接基金变更为直接投资目标 ETF 标的指数成份股的指数基金的风险。
- 10、赎回资金到账时间较晚的风险
- 11、引入境外托管人的相关风险
- 12、通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的特有风险
- 13、基金合同直接终止的风险
- 14、参与转融通证券出借业务的风险
- 15、存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险

(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。

大成恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2021 年 6 月 28 日证监许可【2021】2232 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。

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]客服电话[4008885558]

1. 大成恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同、大成恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议、大成恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书
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