

大成中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金

基金产品资料概要更新

编制日期：2024 年 5 月 17 日

送出日期：2024 年 5 月 30 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	大成中证上海环交所碳中和ETF	基金代码	159642
基金管理人	大成基金管理有限公司	基金托管人	招商银行股份有限公司
上市交易所及上市日期	深圳证券交易所		2022 年 7 月 21 日
基金合同生效日	2022 年 7 月 13 日		
基金类型	股票型	交易币种	人民币
运作方式	交易型、开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	刘淼	开始担任本基金基金经理的日期	2022 年 7 月 13 日
		证券从业日期	2008 年 4 月 1 日
基金经理	李绍	开始担任本基金基金经理的日期	2023 年 3 月 20 日
		证券从业日期	2000 年 4 月 1 日
其他	场内简称：碳中和 100ETF 《基金合同》生效后，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（包括但不限于法律法规或中国证监会规定发生变化，上述规定被取消、更改或补充等），从其规定。		

二、基金投资与净值表现

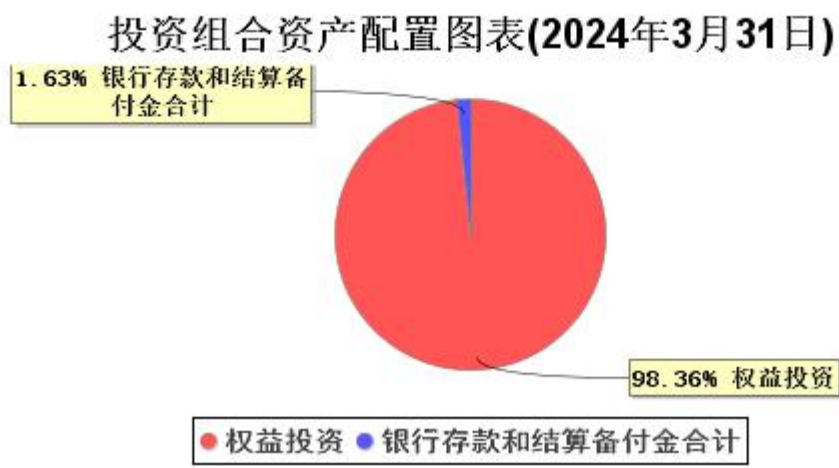
（一）投资目标与投资策略

详见《大成中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书》第十一部分“基金的投资”。

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，本基金的日均跟踪偏离度的绝对值争取不超过 0.2%，年跟踪误差争取不超过 2%。
投资范围	本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。 为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非标的指

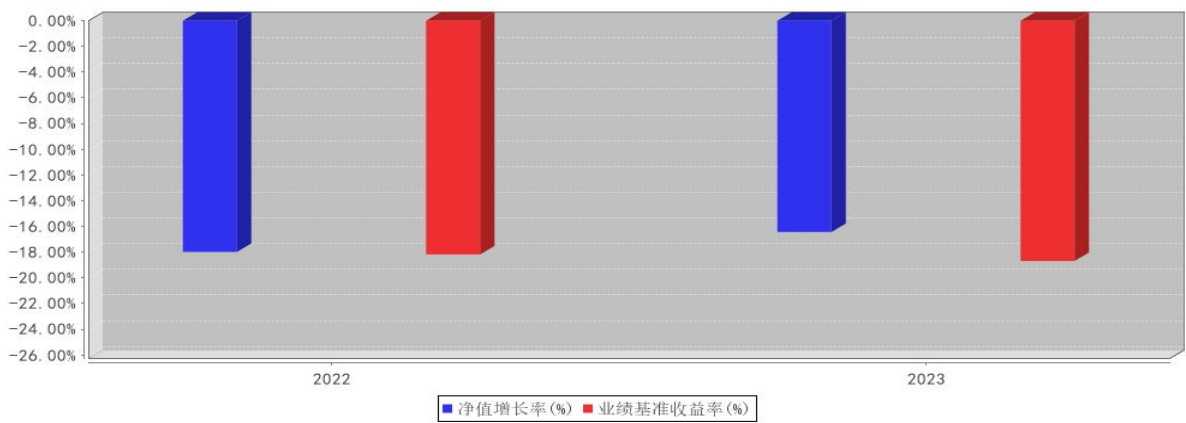
	数成份股（包括主板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会注册或核准上市的股票）、衍生工具（股指期货、股票期权）、债券资产（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、货币市场工具、债券回购、资产支持证券、银行存款、同业存单以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。 本基金可根据法律法规的规定参与融资业务和转融通证券出借业务。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人可在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。 基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。 如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人可在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。
主要投资策略	本基金的投资策略 （一）完全复制策略 本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。 如果标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，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。 在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值争取不超过 0.2%，年跟踪误差争取不超过 2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。 （二）衍生金融产品投资策略 （三）债券投资策略 （四）资产支持证券投资策略 （五）融资及转融通证券出借策略 （六）存托凭证投资策略
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，本基金的标的指数为中证上海环交所碳中和指数。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪中证上海环交所碳中和指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

（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

大成中证上海环交所碳中和ETF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

注：投资人参与本基金基金份额的现金申购、赎回，申购赎回代理机构可按照不超过 0.5%的标准收取佣金。

(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
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、诉讼费和仲裁费；基金份额持有人大会费用；基金的证券/期货/期权交易、结算费用；基金的银行汇划费用、账户开户及维护费用；基金上市费及年费；基金收益分配中发生的费用；基金登记费用；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：（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。

（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：

基金运作综合费率（年化）
0.70%

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、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险
- 2、标的指数波动的风险
- 3、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离：

（1）由于标的指数调整成份股或变更编制方法，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度与跟踪误差。

（2）由于标的指数成份股发生送配股、增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差。

（3）成份股派发现金红利、成份股增发、送配等所获收益可能导致基金收益率偏离标的指数收益率，从而产生跟踪偏离度。

（4）由于成份股停牌、摘牌或流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生跟踪偏离度和跟踪误差。

（5）由于基金投资过程中的证券交易成本，以及基金管理费和托管费等费的存在，使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差。

（6）在本基金指数化投资过程中，基金管理人的管理能力，例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对标的指数的跟踪程度。

（7）其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同；因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大；因基金申购与赎回带来的现金变动；因指数发布机构指数编制错误等，由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

4、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

尽管本基金将通过有效的套利机制使基金份额二级市场交易价格的折溢价控制在一定范围内，但基金份额在证券交易所的交易价格受诸多因素影响，存在不同于基金份额净值的情形，即存在价格折溢价的风险。

5、IOPV 计算错误的风险

- 6、投资人申购失败的风险
- 7、投资人赎回失败的风险
- 8、上海证券交易所上市的成份股可以现金替代方式的风险

在通过深圳证券交易所申购赎回的模式中，上海证券交易所上市的成份股可以现金替代方式不同于现有其他现金替代方式，可能给申购和赎回投资者带来价格的不确定性，从而间接影响本基金二级市场价格的折溢价水平。极端情况下，如果使用上海证券交易所可以现金替代证券的权重增加，该方式带来的不确定性可能导致本基金的二级市场价格折溢价处于相对较高水平。

基金管理人不对“时间优先、实时申报”原则的执行效率做出任何承诺和保证，现金替代退补款的计算以实际成交价格 and 基金招募说明书的约定为准。若因技术系统、通讯链路或其他原因导致基金管理人无法遵循“时间优先、实时申报”原则对上交所可以现金替代的证券进行处理，投资者的利益可能受到影响。

- 9、基金份额赎回对价的变现风险
- 10、第三方机构服务的风险
- 11、基金退市风险
- 12、投资股指期货的风险。
- 13、资产支持证券投资风险
- 14、转融通证券出借风险
- 15、指数编制机构停止服务的风险
- 16、成份股停牌的风险
- 17、跟踪误差控制未达约定目标的风险

(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。

大成中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金基金（以下简称“本基金”）经中国证监会【2022】1354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. 大成中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金基金合同、大成中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金托管协议、大成中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金招募说明书
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