大成恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

基金产品资料概要更新

编制日期：2025 年 4 月 21 日

送出日期：2025 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	大成恒生科技 ETF（QDII）	**基金代码**	159740
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
境外托管人	中国银行（香港）有限公司		
上市交易所及上市日期	深圳证券交易所		2021 年 5 月 27 日
基金合同生效日	2021 年 5 月 18 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	冉凌浩	**开始担任本基金基金经理的日期**	2021 年 5 月 18 日
		证券从业日期	2003 年 4 月 1 日
其他	《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，从其规定。		

注：本基金份额场内简称：恒生科技 ETF

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

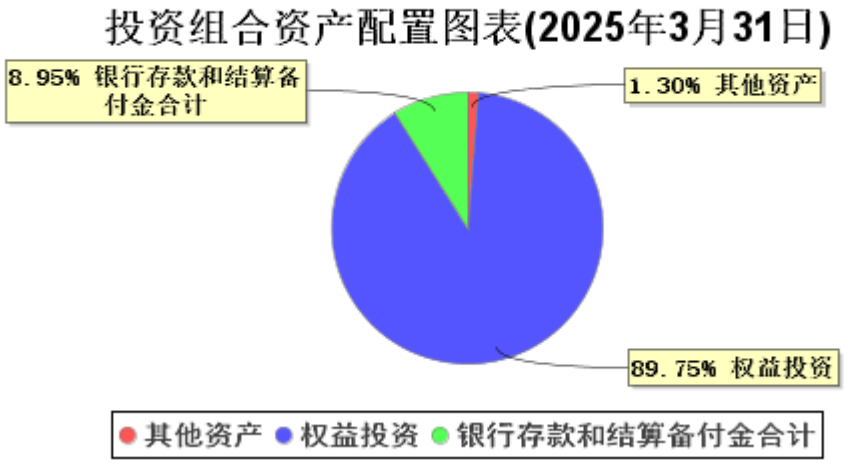
详见《大成恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）更新招募说明书》第四部分“基金的投资”。

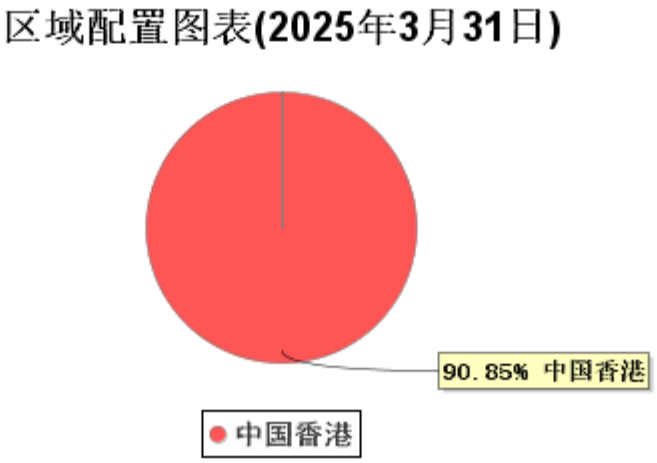
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资范围	本基金的跟踪标的为：恒生科技指数。 本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。 为更好地实现投资目标，本基金还可投资于以下金融工具： 针对境内市场，本基金的投资范围包括境内具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、

	可分离交易可转债、可交换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款等）、同业存单、衍生工具（股指期货、国债期货、股票期权等）、现金以及法律法规或中国证监会许可的其他金融工具。 针对境外市场，本基金的投资范围包括法律法规允许的、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（包括开放式基金和交易型开放式指数基金（ETF））；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公开发行和挂牌交易的普通股、优先股、存托凭证、房地产信托凭证；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；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；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。 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。 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%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 如果法律法规或监管机构对该比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，本基金做相应调整。
主要投资策略	1、股票投资策略 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。但因特殊情况导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将通过投资其他成份股、非成份股以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具进行替代，或者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。 2、股指期货的投资策略 本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，参与股指期货的投资。此外，本基金还将运用股指期货来管理特殊情况下的流动性风险，如预期大额申购赎回、大量分红等。 3、国债期货投资策略 本基金投资国债期货将根据风险管理原则，以套期保值为目的，以回避市场风险，故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。 4、股票期权投资策略 在法律法规允许的范围内，本基金应当按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，基于谨慎原则运用股票期权对基金投资组合进行管理，以控制投资组合风险、提高投资效率，从而更好地实现本基金的投资目标。本基金将在有效控制风险的前提下，选择流动性好、交易活跃的期权合约进行投资。本基金将基于对证券市场的预判，并结合期权定价模型，选择估值合理的期权合约。 5、债券投资策略

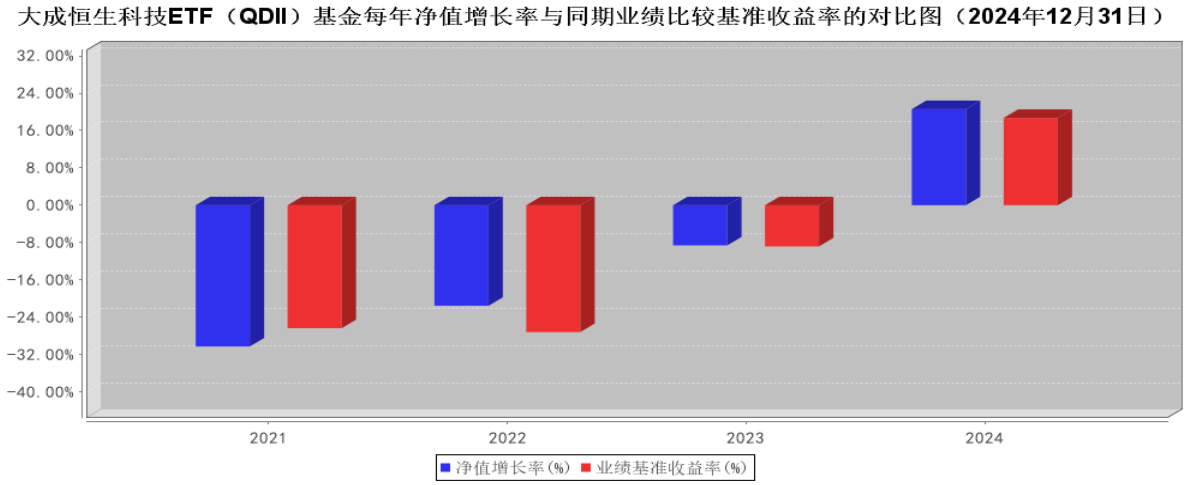
	本基金将主要以降低跟踪误差和投资组合流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，构建本基金债券投资组合。 6、可转换债券及可交换债券投资策略 可转换债券具有债权和股权的双重特性。一般情况下，在权益市场熊市的中后期和熊牛转换初期时，可转债这类资产相对股票而言，具备较好的风险收益比特征。对个股而言，当可转债估值合理时，用可转债替代股票投资可以起到下行风险有限，而上涨空间接近的效果。本基金在合理地给出可转换债券估值的基础上，尽量有效地挖掘出投资价值较高的可转换债券。 7、资产支持证券投资策略 本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。本基金将通过对资产支持证券基础资产及结构设计的研究，结合多种定价模型，严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。 8、融资及转融通证券出借投资策略 为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与融资和转融通证券出借业务。参与融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。参与转融通证券出借业务时，本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为恒生科技指数收益率。
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。同时本基金为交易型开放式指数基金，采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票相似的风险收益特征。

(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



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

（1）投资人在申购或赎回本基金时，申购赎回代理机构可按照不超过 0.50%标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记机构等收取的相关费用。

（2）场内交易费用以证券公司实际收取为准。

(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	80,000.00 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；基金的银行汇划费用；基金收益分配中发生的费用； 基金的开户费用；账户维护费用；基金的证券/期货交易费用、结算费用（包括但不限于在境外市场开户、交易、结算、登记等各项费用以及为了加快清算向券商支付的费用等）；因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；基金上市费及年费；基金收益分配中发生的费用；基金依照有关法律法规应当缴纳的、购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花税、交易及其他税收及预扣提税（以及与前述各项有关的任何利息、罚金及费用）以及相关手续费、汇款费、基金的税务代理费等；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。

(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）
0.61%

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：

一）指数化投资的风险

本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%且不低于基金资产净值的 90%，业绩表现将会随着标的指数的波动而波动； 同时本基金在多数情况下将维持较高的股票仓位，在股票市场下跌的过程中，可能面临基金净值与标的指数同步下跌的风险。

二）标的指数的风险

1、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

标的指数并不能代表整个股票市场。标的指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

2、标的指数波动的风险

标的指数成份股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，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

3、标的指数编制方案带来的风险

标的指数因为编制方案的缺陷有可能导致标的指数的表现与总体市场表现存在差异，因标的指数编制方案的不成熟也可能导致指数调整较大，增加基金投资成本，并有可能因此增加跟踪误差，影响投资收益。

4、标的指数变更的风险

根据基金合同约定，如出现变更标的指数的情形，本基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资政策将会改变，投资组合将随之调整，基金的收益风险特征将与新的标的指数保持一致，投资者须承担此项调整带来的风险。

5、跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35%以内，年化跟踪误差控制 4%以内，但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

6、指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护，未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护，本基金将根据基金合同的约定自该情形发生之日起十个工作日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。投资人将面临更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等风险。

7、成份股停牌的风险

三）基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

四）基金管理人代理申赎投资者买券卖券的风险

五）基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

六）IOPV 计算错误的风险

深圳证券交易所发布基金份额参考净值（IOPV），供投资人交易、申购、赎回基金份额时参考。IOPV 与实时的基金份额净值可能存在差异，IOPV 计算也可能出现错误。投资人若参考 IOPV 进行投资决策可能导致损失，需投资人自行承担后果。

七）退市风险

八）申购及赎回风险

九）第三方机构服务的风险

十）管理风险

十一）引入境外托管人的风险

十一）参与融资及转融通证券出借业务的风险

(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（QDII）（以下简称“本基金”）经中国证监会【2021】1543 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（QDII）基金合同、大成恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）托管协议、大成恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）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