

大成有色金属期货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	大成有色金属期货 ETF	基金代码	159980
基金管理人	大成基金管理有限公司	基金托管人	中国农业银行股份有限公司
上市交易所及上市日期	深圳证券交易所		2019年12月24日
基金合同生效日	2019年10月24日		
基金类型	其他类型	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	李绍	开始担任本基金基金经理的日期	2019年10月24日
		证券从业日期	2000年4月1日
基金经理	刘淼	开始担任本基金基金经理的日期	2023年03月20日
		证券从业日期	2008年04月01日
其他	本基金的基金类型具体为商品基金。《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：有色ETF

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

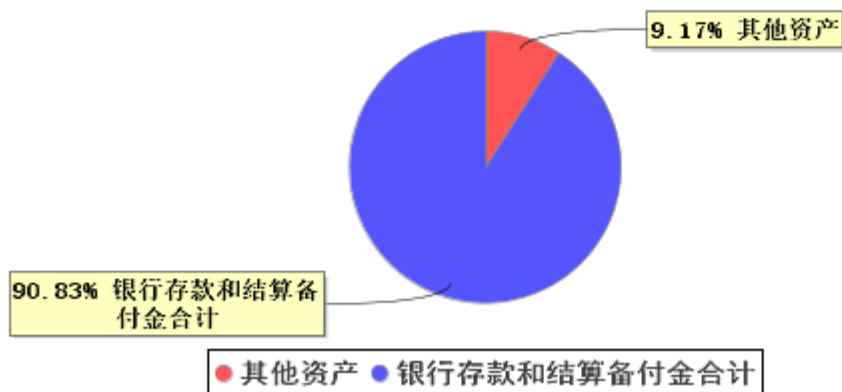
详见《大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书》第十部分“基金的投资”。

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资范围	本基金跟踪标的指数为：上海期货交易所有色金属期货价格指数。本基金主要投资于标的指数的成份商品期货合约及备选商品期货合约。为更好地实现基金的投资目标，本基金还可以投资于货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具。如上海期货交易所以后推出与有色金属期货指数相关的期货合约（例如有色金属期货指数期货合约），在履行相关程序后，也纳入投资范围并受相关投资比例的限制。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。基金的投资组合比例为：本基金持有的标的指数成份商品期货合约的价值合计(买入、卖出轧差计算)不低于基金资产净值的 90%、不高于基金资产净值的 110%；除支付商品期货合约保证金以外的基金财产投资于货币市场工具不少于 80%。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	<p>一般情况下，本基金采用完全复制法进行投资，按照标的指数的成份期货合约组成及其权重构建投资组合，并根据标的指数成份期货合约及其权重的变动对投资组合进行相应调整。</p> <p>当预期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，或因交易成本、交易制度、个别成份期货合约流动性不足或限仓等原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，力求降低跟踪误差。在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。</p> <p>本基金将根据基金资产净值确定所投资的合约数量。通常情形下，本基金将跟随有色金属期货指数成份期货合约调整规则进行展期操作，但也可根据成份期货合约的期限结构、合约流动性状况等因素灵活安排展期窗口。</p> <p>同时，为了避免在展期期间被市场操纵的风险，本基金可以根据市场的实际情况采用技术性移仓的方式，如换约至远月非主力合约，进而一定程度规避展期过程中被市场操纵的风险。</p>
业绩比较基准	上海期货交易所有色金属期货价格指数收益率
风险收益特征	本基金为商品期货基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

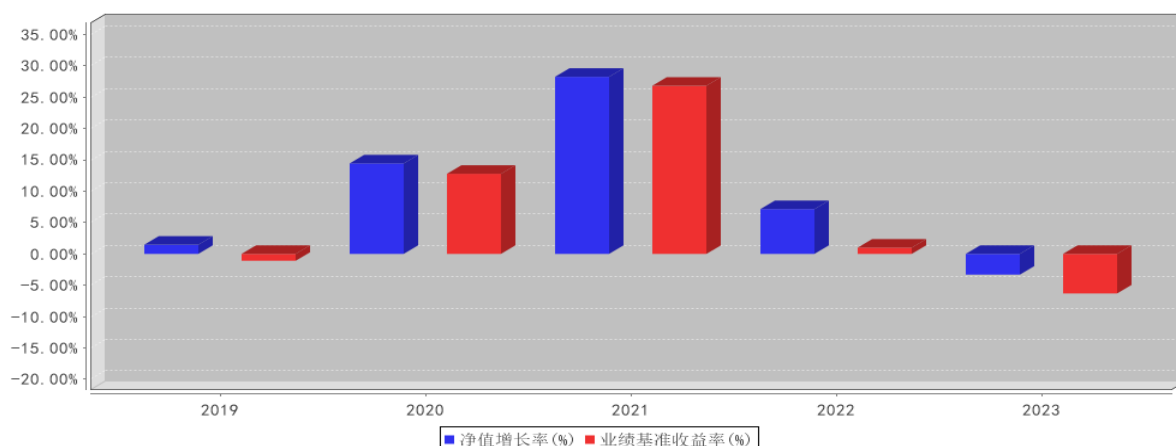
(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表(2024年3月31日)



(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

大成有色金属期货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

无。

（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	0.6%	基金管理人和销售机构
托管费	0.1%	基金托管人
审计费用	60,000.00 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：（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）
0.79%

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。

1、本基金的特定风险

(1) 投资期货合约的风险。(2) 商品期货基金跟踪标的的特有风险。(3) 逐日盯市风险。(4) 合约展期风险。(5) 持仓上限风险。(6) 强制平仓风险。(7) 期限结构风险。(8) 涨跌停板风险。(9) ETF 二级市场交易价格涨跌幅与标的指数涨跌幅发生偏离的风险。(10) 指数投资特有风险；(11) 参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险；(12) 申购赎回清单差错风险；(13) 退市风险；(14) 投资人赎回失败的风险；(15) 基金收益分配后基金份额净值低于面值的风险；(16) 标的指数变更的风险；(17) 第三方机构服务的风险

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。

大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2019 年 8 月 22 日证监许可【2019】1531 号文注册募集。

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. 大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金基金合同、大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金托管协议、大成有色金属期货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