

建信易盛郑商所能源化工期货交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

(A 类份额)

基金产品资料概要更新

编制日期：2024 年 9 月 20 日

送出日期：2024 年 9 月 25 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	建信易盛郑商所能源化工期货 ETF 联接	基金代码	008827
下属基金简称	建信易盛郑商所能源化工期货 ETF 联接 A	下属基金交易代码	008827
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	基金托管人	中国农业银行股份有限公司
基金合同生效日	2020 年 10 月 16 日	上市交易所及上市日期	-
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	朱金钰	开始担任本基金基金经理的日期	2020 年 10 月 16 日
		证券从业日期	2011 年 6 月 29 日
基金经理	亢豆	开始担任本基金基金经理的日期	2023 年 5 月 19 日
		证券从业日期	2016 年 7 月 11 日
其他	本基金为商品基金。《基金合同》生效满 3 年后的对应日，若基金资产净值低于 2 亿元，《基金合同》应当终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。		

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

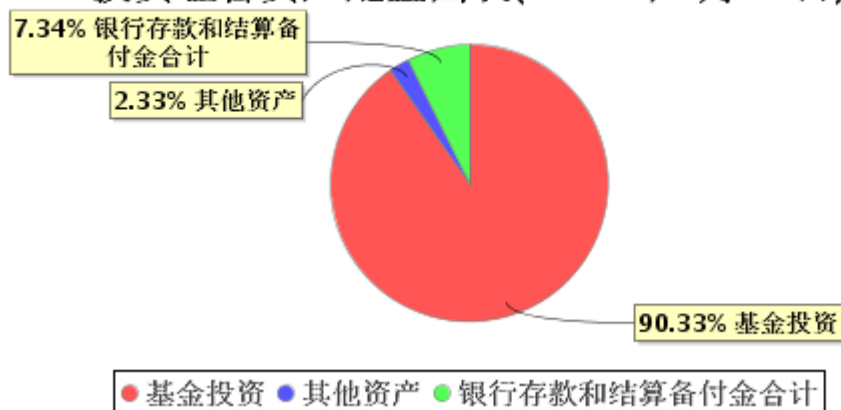
请投资者阅读《招募说明书》第九部分了解详细情况

投资目标	通过主要投资于目标 ETF，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	本基金主要投资于目标 ETF、标的指数的成份期货合约和备选成份期货合约、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、地方政府债、金融债、央行票据、企业债、公司债、次级债、分离交易可转债的纯债部分、中期票据、短期融资券、超短期融资券）、资产支持证券、货币市场工具、债券回购、银行存款、同业存单、及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。 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。 本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%，每个交易日日终在扣除

	<p>期货合约需缴纳的交易保证金后,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>
主要投资策略	<p>本基金主要投资于目标 ETF,方便特定的客户群通过本基金投资目标 ETF。本基金不参与目标 ETF 的投资管理。</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,其余资产可投资于标的指数的成份期货合约和备选成份期货合约、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、地方政府债、金融债、央行票据、企业债、公司债、次级债、分离交易可转债的纯债部分、中期票据、短期融资券、超短期融资券)、资产支持证券、货币市场工具、债券回购、银行存款、同业存单、及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具,其目的是为了为了使本基金在保障日常申购赎回的前提下,更好地跟踪标的指数。</p> <p>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收益率之间的日均跟踪偏离度不超过 0.50%,年跟踪误差不超过 6%。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>2、基金投资策略</p> <p>本基金投资目标 ETF 的两种方式如下:</p> <p>(1) 申购和赎回:目标 ETF 开放申购赎回后,按照目标 ETF 法律文件的约定的方式申购目标 ETF;</p> <p>(2) 二级市场方式:目标 ETF 上市交易后,在二级市场进行目标 ETF 的交易。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,减小与标的指数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>当目标 ETF 申购、赎回或交易模式进行了变更或调整,本基金也将作相应的变更或调整,无须召开基金份额持有人大会。</p> <p>3、商品期货投资策略</p> <p>本基金可投资于标的指数的成份期货合约和备选成份期货合约,根据期限结构、相关合约流动性状况等因素,合理地投资组合持仓进行优化。对于出现特殊情况(比如流动性不足等情况)导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可通过投资标的指数的成份期货合约和备选成份期货合约,从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。</p>
业绩比较基准	易盛郑商所能源化工指数 A 收益率×95%+银行活期存款税后收益率×5%
风险收益特征	本基金为 ETF 联接基金,通过投资于目标 ETF 跟踪标的指数表现,具有与标的指数所表征的市场组合相似的风险收益特征,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金。

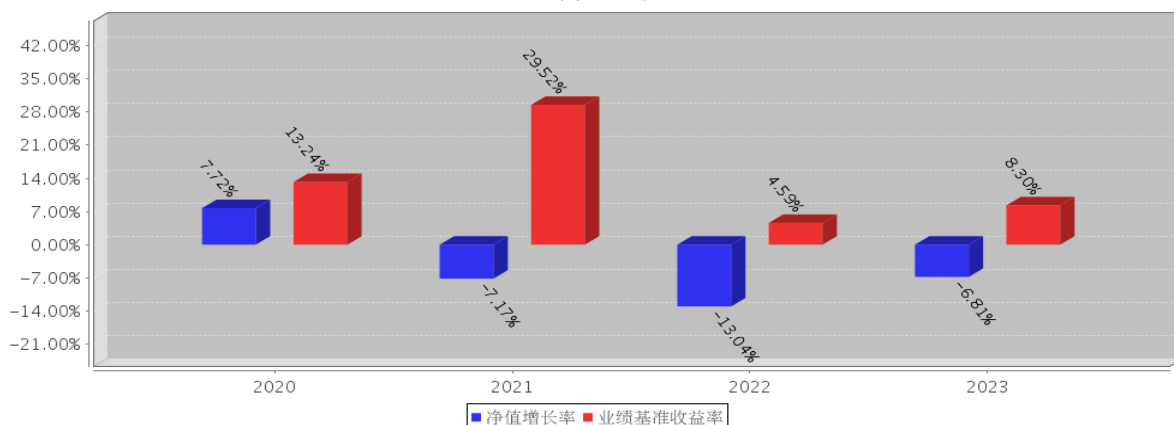
(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表(2024年6月30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

建信易盛郑商所能源化工期货ETF联接A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：基金的过往业绩不代表未来表现。基金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
认购费	0万元 ≤ M < 100万元	1.20%
	100万元 ≤ M < 200万元	1.00%
	200万元 ≤ M < 500万元	0.60%
	M ≥ 500万元	1,000.00元/笔
申购费 (前收费)	0万元 ≤ M < 100万元	1.50%
	100万元 ≤ M < 200万元	1.20%
	200万元 ≤ M < 500万元	0.80%
	M ≥ 500万元	1,000.00元/笔
赎回费	0天 ≤ N < 7天	1.50%

	7天 \leq N $<$ 180天	0.50%
	N \geq 180天	0.00%

(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	按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF基金份额部分基金资产后的余额（若为负数，则取0）的1.00%年费率计提。	基金管理人和销售机构
托管费	按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF基金份额部分基金资产后的余额（若为负数，则取0）的0.10%的年费率计提。	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	本基金其他费用详见本基金合同或招募说明书费用章节。	相关服务机构

注：1、本基金交易证券、基金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、指数许可使用费（若有）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：

建信易盛郑商所能源化工期货ETF联接A

基金运作综合费率（年化）
1.17%

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、目标ETF的风险

本基金属于ETF联接基金，主要投资于目标ETF，因此目标ETF面临的风险（例如目标ETF的管理风险、操作风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险和技术风险等风险）可能直接或间接成为本基金的风险。

在本基金目标ETF未能符合基金备案条件时，本基金将不能设立，面临募集失败的风险。

本基金为目标ETF的联接基金，但不能保证本基金的表现与目标ETF的表现完全一致，产生差异的原因包括以下几个方面：

（1）投资管理方式的不同，如在指数化投资过程中，不同的管理方式会导致跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等的不同，会导致两只基金的业绩有差异；

(2) 现金比例及现金管理方式的不同,会导致两只基金的业绩有差异。目标ETF作为一种特殊的基金品种,可将全部或接近全部的基金资产,用于跟踪标的指数的表现;而本基金作为普通的开放式基金,持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不得低于基金资产净值的5%。

2、投资期货合约的风险

持有期货合约实质上是将期货价格的波动由一方转移给另一方,这意味着每一份期货合约的盈利都对应着一份期货合约的亏损,期货合约本身没有内在价值。期货合约的条款设置,如交易单位、报价单位、涨跌停板幅度、合约交割月份等条款出现变化也可能对基金的运作产生影响。

(二) 重要提示

中国证监会对本基金募集的注册,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。

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。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人官方网站 [www.ccbfund.cn] [客服电话:400-81-95533]

- 基金合同、托管协议、招募说明书
- 定期报告,包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 基金份额净值
- 基金销售机构及联系方式
- 其他重要资料