华夏饲料豆粕期货交易型开放式证券投资基金基金产品资料概要更新

编制日期：2021年5月28日

送出日期：2021年5月31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	华夏饲料豆粕期货 ETF	基金代码	159985
基金管理人	华夏基金管理有限公司	基金托管人	中国建设银行股份有限公司
基金合同生效日	2019-09-24	上市交易所及上市日期	深圳证券交易所 2019-12-05
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	荣膺	开始担任本基金基金经理的日期	2019-09-24
		证券从业日期	2010-07-12
其他	场内简称：豆粕 ETF		
其他	商品基金		

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资范围	本基金的标的指数为大连商品交易所豆粕期货价格指数。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括交易所挂牌交易的豆粕期货合约、货币市场工具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相关规定）。 基金的投资组合比例为：本基金持有豆粕期货合约价值合计（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（含未被占用保证金）以外的基金财产，应当投资于货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，其中投资于货币市场工具应当不少于80%。
主要投资策略	本基金主要采取被动式管理策略，根据标的指数编制方法，通过买入持有标的指数成份期货合约即豆粕期货主力合约以达到投资目标，其余资产将主要投资于高流动性的固定收益类资产以获取收益增强。主要投资策略包括组合复制策略、货币市场工具投资策略等。
业绩比较基准	大连商品交易所豆粕期货价格指数收益率。
风险收益特征	本基金为商品基金，以交易所挂牌交易的商品期货合约为主要投资标

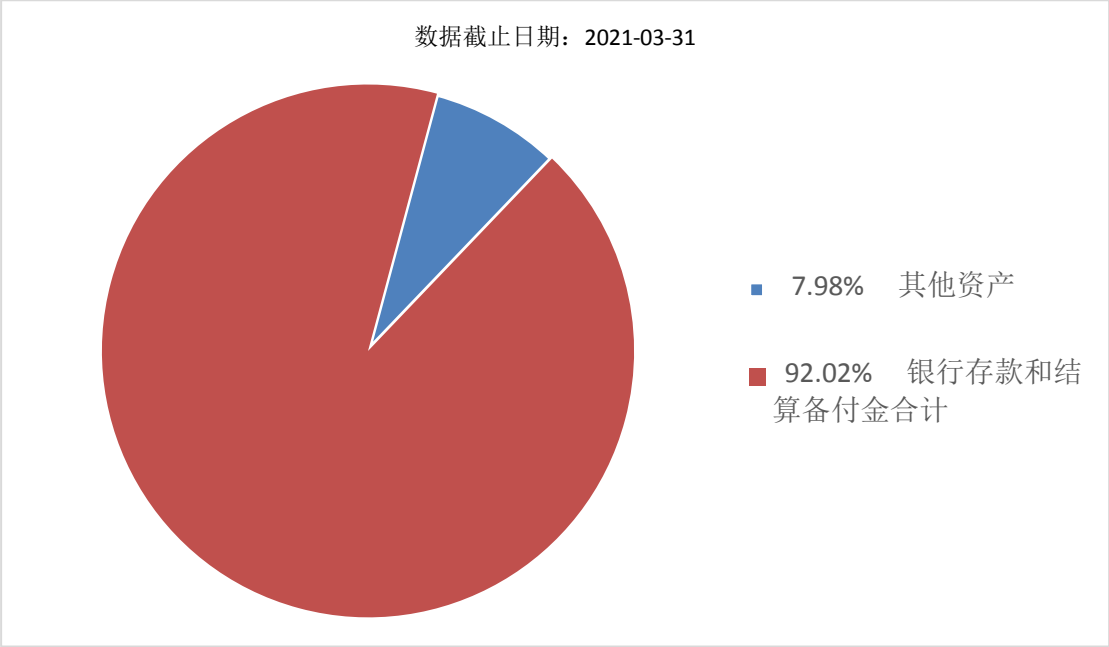
	的，跟踪商品期货价格指数，其预期风险和预期收益高于债券基金和货币基金，属于较高风险品种。

①投资者请认真阅读《招募说明书》“基金的投资”章节了解详细情况。

②根据 2017 年施行的《证券期货投资者适当性管理办法》，基金管理人和销售机构已对本基金重新进行风险评级，基金的风险收益特征不代表基金的风险评级，具体风险评级结果参见基金管理人、销售机构提供的评级结果。

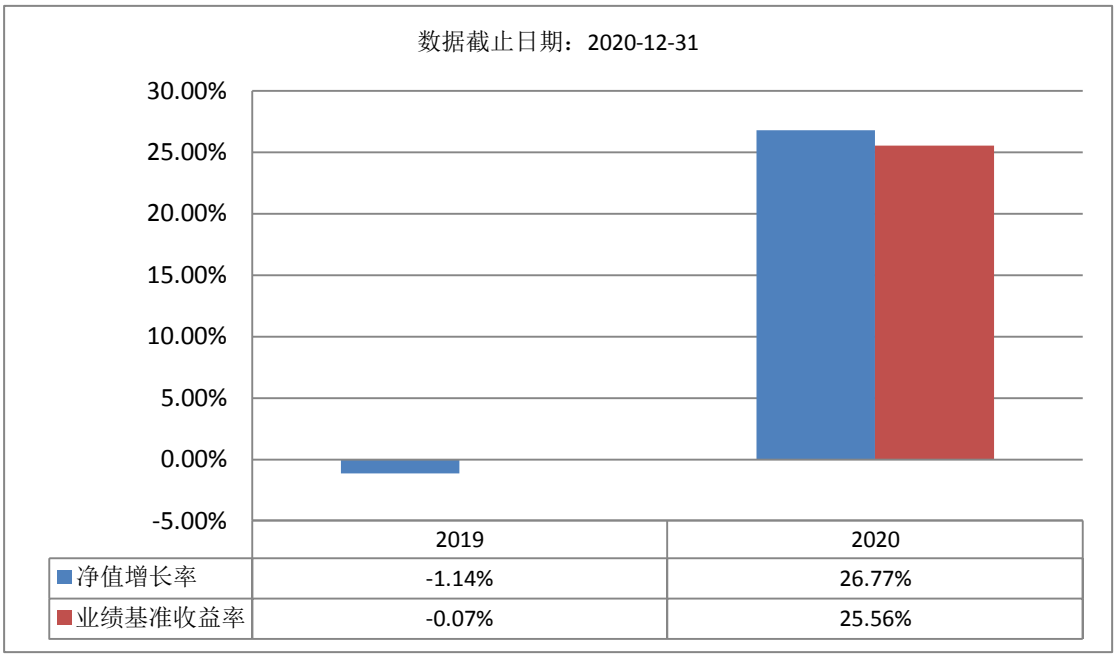
（二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表



注：图示比例为定期报告期末基金投资组合中各类资产金额占基金总资产的比例。

（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本基金合同于2019年9月24日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。
②基金的过往业绩不代表未来表现。

三、投资本基金涉及的费用

（一）基金销售相关费用

①投资者在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理机构可按照一定的标准收取佣金，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
管理费	固定费率 0.50%
托管费	固定费率 0.10%
其他费用	基金合同生效后与本基金相关的信息披露费、会计师费、律师费、基金份额持有人大会费用等可以在基金财产中列支的其他费用按照国家有关规定和《基金合同》约定在基金财产中列支。费用类别详见本基金基金合同及招募说明书或其更新。

注：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。

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。

投资本基金可能遇到的风险包括但不限于：市场风险、信用风险、流动性风险、管理风险、资产支持证券投资风险，其他风险等。本基金特有的风险包括但不限于：投资期货合约的风险，逐日盯市风险，合约展期风险，涨跌停板风险，持仓上限风险，强行平仓风险，强制减仓风险等。

本基金的特定风险还包括：期货市场波动的风险，基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险，标的指数变更的风险，基金份额二级市场交易价格折溢价的风险，申购赎回清单差错风险，参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险，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，退市风险，申购与赎回风险，基金收益分配后基金份额净值低于面值的风险等。

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。

本基金持有期货合约的目的通常是获得豆粕的风险暴露，而不是用于交割，投资者赎回本基金无法获得实物豆粕。另外，持有期货合约还意味着市场上与基金持仓方向相反的市场参与者对豆粕价格的预期可能与基金相反。

（二）重要提示

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。

基金的过往业绩不代表未来表现。

基金销售相关费用中的认购/申购金额含认购/申购费。

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。

基金投资人请认真阅读基金合同的争议处理相关章节，充分了解本基金争议处理的

相关事项。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[www.ChinaAMC.com][400-818-6666]：

1、基金合同、托管协议、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