

华安CES半导体芯片行业指数型发起式证券投资基金 (华安CES半导体芯片行业指数发起A) 基金产品资料

概要

编制日期: 2021年7月13日

送出日期: 2021年7月14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 | 华安 CES 半导体芯片行业指数发起 | 基金代码 | 012837 |
| 下属基金简称 | 华安 CES 半导体芯片行业指数发起 A | 下属基金代码 | 012837 |
| 基金管理人 | 华安基金管理有限公司 | 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | - | | |
| 基金类型 | 股票型 | 交易币种 | 人民币 |
| 运作方式 | 开放式(普通开放式) | 开放频率 | 每个开放日 |
| 基金经理 | 刘璇子 | 开始担任本基金基金经理的日期 | - |
| | | 证券从业日期 | 2014-07-07 |

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

详情请阅读《招募说明书》中“基金的投资”章节的相关内容。

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金通过被动的指数化投资管理,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。 |
| 投资范围 | 本基金主要投资于标的指数成份股(含存托凭证)及其备选成份股(含存托凭证),把接近全部的基金资产用于跟踪标的指数的表现。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股(包括创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、股指期货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)。 本基金将根据法律法规的规定参与融资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,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。 |

| | |
|--------|--|
| | <p>基金的投资组合比例为：投资于股票资产的比例不低于基金资产的90%；投资于标的指数的成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。</p> <p>如果法律法规对该比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，本基金的投资比例相应会做调整。</p> |
| 主要投资策略 | <ol style="list-style-type: none"> 1、完全复制策略 2、替代性策略 3、股票投资策略 4、债券投资策略 5、股指期货投资策略 6、资产支持证券投资策略 7、融资及转融通证券出借业务投资策略 8、存托凭证投资策略 |
| 业绩比较基准 | 中华交易服务半导体芯片行业指数收益率×95%+商业银行税后活期存款利率×5% |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数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

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 | 备注 |
|-----------|-----------------------------|-----------|---------------|
| 认购费 | M < 100 万元 | 0.50% | 非养老金客户 |
| | 100 万元 ≤ M < 500 万元 | 0.20% | 非养老金客户 |
| | M ≥ 500 万元 | 每笔 1000 元 | 非养老金客户 |
| | - | 每笔 500 元 | 养老金客户 (直销) |
| 申购费 (前收费) | M < 100 万元 | 0.50% | 非养老金客户 |
| | 100 万元 ≤ M < 500 万元 | 0.20% | 非养老金客户 |
| | M ≥ 500 万元 | 每笔 1000 元 | 非养老金客户 |

| | | | |
|-----|-------------------------------|----------|---------------|
| | - | 每笔 500 元 | 养老金客户 (直销) |
| 赎回费 | $N < 7$ 天 | 1.50% | |
| | $7 \text{ 天} \leq N < 30$ 天 | 0.50% | |
| | $30 \text{ 天} \leq N < 180$ 天 | 0.10% | |
| | $N \geq 180$ 天 | 0.00% | |

注：本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取，其中对持续持有期少于7日的投资者收取的赎回费将全额计入基金财产；对持续持有期不少于7日的投资者，本基金将赎回费总额的25%归基金财产，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

（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 | 0.50% |
| 托管费 | 0.10% |

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

（一）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。

（二）本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：市场风险、管理风险、流动性风险、合规性风险、操作和技术风险、本基金的特定风险等等。本基金是股票型基金，预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金；本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

（三）本基金的特定风险

1、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

标的指数并不能完全代表整个股票市场。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、投资人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、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

由于标的指数调整成份股或变更编制方法、标的指数成份股发生配股或增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化、成份股派发现金红利、新股市值配售、成份股停牌或摘牌、流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合以及与基金运作相关的费用等因素使本基金产生跟踪偏离度和跟踪误差。

4、跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，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。

5、成份股停牌的风险

标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌,发生成份股停牌时可能面临如下风险:

(1) 基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

(2) 在极端情况下,标的指数成份股可能大面积停牌,基金可能无法及时卖出成份股以获取足额的符合要求的赎回款项,由此基金管理人可能设置较低的赎回份额上限或者采取暂停赎回的措施,投资者将面临无法赎回全部或部分基金份额的风险。

6、成份股退市的风险

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,基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则,综合考虑成份股的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响,据此制定成份股替代策略,并对投资组合进行相应调整。

7、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内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,基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的,基金合同终止。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。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定并实施前,基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作,该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异,影响投资收益。

8、股指期货投资风险

9、资产支持证券投资风险

10、参与融资业务的风险

11、参与转融通证券出借业务的风险

12、存托凭证的投资风险

13、基金合同自动终止的风险

(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做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、诚实守信、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,也不得保证最低收益。

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。

各方当事人同意,因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议,如经友好协商未能解决的,应提交上海金融仲裁院,根据该院当时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为上海市,仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力。

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网站: www.huaan.com.cn; 客户服务电话: 40088-50099

(一) 基金合同、托管协议、招募说明书

(二) 定期报告、包括基金季度报告、中期报告、年度报告

(三) 基金份额净值

(四) 基金销售机构及联系方式

(五) 其他重要资料