

大成中证全指医疗保健设备与服务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：2021年08月12日

送出日期：2021年08月13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	医服 ETF	基金代码	516610
基金管理人	大成基金管理有限公司	基金托管人	上海银行股份有限公司
上市交易所及上市日期	上海证券交易所		2021年5月13日
基金合同生效日	2021年4月29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	每个开放日开放申购、赎回。
基金经理	刘淼	开始担任本基金基金经理的日期	2021年4月30日
		证券从业日期	2008年4月1日
基金经理	夏高	开始担任本基金基金经理的日期	2021年4月29日
		证券从业日期	2011年1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个月内召开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：扩位简称：医疗服务ETF；基金认购代码：516613；基金申购代码：516611

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

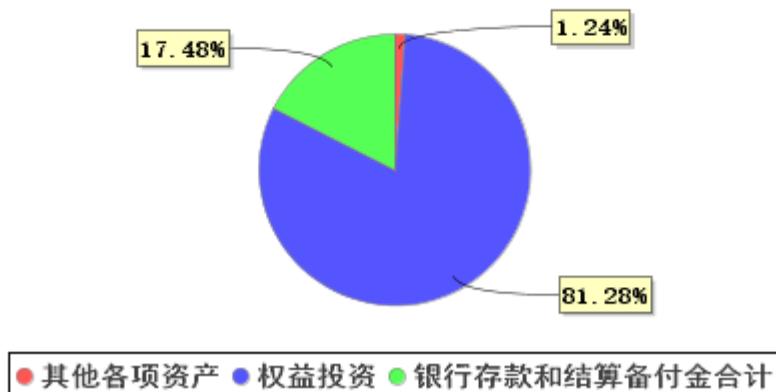
详见《大成中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金》第十一部分“基金的投资”。

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	本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。 为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非成份股（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、货币市场工具、债券回

	<p>购、资产支持证券、银行存款（包括协议存款、定期存款）、同业存单、股指期货、国债期货、股票期权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的相关规定）。</p> <p>本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。</p> <p>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> <p>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%。每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货、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。</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，本基金做相应调整。</p>
<p>主要投资策略</p>	<p>1、股票投资策略</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>2、股指期货的投资策略</p> <p>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。</p> <p>3、国债期货投资策略</p> <p>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。</p> <p>4、股票期权投资策略</p> <p>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。</p> <p>5、债券投资策略</p> <p>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。</p> <p>6、可转换债券及可交换债券投资策略。</p> <p>7、资产支持证券投资策略。</p> <p>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。</p> <p>8、融资及转融通证券出借投资策略。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>本基金的业绩比较基准为中证全指医疗保健设备与服务指数收益率。</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>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。</p>

(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(2021年6月30日)



(三) 自基金合同生效以来/最近十年(孰短)基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图
截至本文件编制日, 本基金尚未披露年度报告。

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	S<50万份	0.8%
	50万份≤S<100万份	0.5%
	S≥100万份	1,000元/笔

注:(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
管理费	0.5%
托管费	0.1%
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用、会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费;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;基金的开户费用、账户维护费用;基金上市费及年费;场内份额收益分配中发生的费用;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: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。

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：

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。4、标的指数变更的风险。5、跟踪误差控制未达约定目标的风险。6、指数编制机构停止服务的风险。7、成份股停牌的风险。8、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险。9、IOPV 计算错误的风险。10、退市风险。11、投资者申购失败的风险。12、投资人赎回失败的风险。13、基金份额赎回对价的变现风险。14、套利风险。15、申购赎回清单差错风险。16、二级市场流动性风险。17、第三方机构服务的风险。18、退出现金替代方式的风险。19、资产支持证券投资风险。20、投资股指期货与国债期货的风险。21、股票期权投资风险。22、投资流通受限证券的风险。23、参与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。

大成中证全指医疗保健设备与服务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 2021 年 2 月 3 日证监许可【2021】402 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。

本基金标的指数为中证全指医疗保健与服务指数，该指数的样本空间、选样方法等信息详见本基金招募说明书。

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. 大成中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金基金合同、大成中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金托管协议、大成中证全指医疗保健设备与服务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