

## 财通资管中证有色金属指数型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新

编制日期：2021年09月02日

送出日期：2021年09月06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	财通资管中证有色金属指数发起式	基金代码	013437
基金简称A	财通资管中证有色金属指数发起式A	基金代码A	013437
基金简称C	财通资管中证有色金属指数发起式C	基金代码C	013438
基金管理人	财通证券资产管理有限公司	基金托管人	中国农业银行股份有限公司
基金合同生效日	2021年09月01日	上市交易所及上市日期	暂未上市
基金类型	股票型	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	开始担任本基金基金经理的日期	证券从业日期	
辛晨晨	2021年09月01日		2012年07月17日
其他	《基金合同》生效满三年之日，若基金资产净值低于2亿元，本基金将根据《基金合同》的约定进行基金财产清算并终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。《基金合同》生效满三年后继续存续的，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6个月内召集基金份额持有人大会。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。		

### 二、基金投资与净值表现

#### (一) 投资目标与投资策略

(请阅读《招募说明书》第九章了解详细情况)

投资目标	本基金采用指数化投资，密切跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资范围	本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以中证有色金属指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，含主板、创业板及

	<p>其他经中国证监会允许上市的股票)、存托凭证、银行存款、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、公开发行的二级资本债、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)、债券回购、股指期货、资产支持证券、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本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>本基金可以根据相关法律法规的规定参与融资和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>基金的投资组合比例为:本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的90%,投资于中证有色金属指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或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、存出保证金和应收申购款等。</p> <p>如法律法规或中国证监会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。</p>
主要投资策略	1、股票投资策略;2、债券投资策略;3、可转换债券和可交换债券投资策略;4、资产支持证券投资策略;5、参与融资及转融通证券出借业务策略;6、股指期货投资策略;7、存托凭证投资策略
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:中证有色金属指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×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。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,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

无

## (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

无

## 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:

财通资管中证有色金属指数发起式A

费用类型	份额(S)或金额(M)/持有期限(N)	收费方式/费率	备注
申购费(前收费)	M<500万	1.00%	非养老金客户
	M<500万	0.40%	养老金客户
	M≥500万	1000.00元/笔	
赎回费	N<7天	1.50%	

	7天 $\leq$ N $<$ 30天	0.75%	
	30天 $\leq$ N $<$ 365天	0.50%	一年为365天
	N $\geq$ 365天	0.00	

#### 财通资管中证有色金属指数发起式C

费用类型	份额(S)或金额(M)/持有期限(N)	收费方式/费率	备注
赎回费	N $<$ 7天	1.50%	
	N $\geq$ 7天	0.00	

**申购费 A:** 本基金的申购费用应在投资人申购 A 类基金份额时收取, 申购费用由投资人承担, 不列入基金财产, 主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。投资人可以多次申购本基金, 申购费用按每笔申购申请单独计算。因红利再投资而产生的基金份额, 不收取相应的申购费用。

**赎回费 A:** 投资者在一天之内如果有多笔赎回, 适用费率按单笔分别计算。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。对持续持有期少于 30 日的 A 类基金份额持有人收取的赎回费全额计入基金财产; 对持续持有期不少于 30 日但少于 3 个月的 A 类基金份额持有人收取的赎回费总额的 75% 计入基金财产; 对持续持有期不少于 3 个月但少于 6 个月的 A 类基金份额持有人收取的赎回费总额的 50% 计入基金财产; 对持续持有期不少于 6 个月但少于 1 年的基金份额持有人, 将赎回费总额的 25% 计入基金财产。上述未纳入基金财产的赎回费用用于支付登记费和其他必要的手续费。

**赎回费 C:** 对持续持有期少于 7 日的 C 类基金份额持有人收取的赎回费全额计入基金财产。

## (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	0.20%
托管费	0.10%
销售服务费C	0.10%
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、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, 基金的开户费用、账户维护费用, 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

## 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、本基金特有的风险

(1) 本基金是股票型指数基金，原则上采用完全复制法跟踪本基金的标的指数，基金在多数情况下将维持较高的股票投资比例，在股票市场下跌的过程中，可能面临基金净值与标的指数同步下跌的风险；

### (2) 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。

### (3) 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、投资者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。

### (4) 跟踪误差控制未达到约定目标的风险

在正常市场情况下，本基金力争控制本基金的份额净值与业绩比较基准的收益率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，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离：

1) 由于标的指数调整成份股或变更编制方法，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度与跟踪误差。

2) 由于标的指数成份股在标的指数中的权重发生变化，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差。

3) 由于成份股流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生跟踪偏离度和跟踪误差。

4) 由于基金投资过程中的证券交易成本，以及基金管理费和托管费等费用的存在，使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差。

5) 在本基金指数化投资过程中，基金管理人的管理能力，例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对标的指数的跟踪程度。

6) 其他因素产生的偏离。因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大；因基金申购与赎回带来的现金变动；因指数发布机构指数编制错误等，由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

### (5) 标的指数值计算出错的风险

尽管指数编制机构将采取一切必要措施以确保指数的准确性，但不对此作任何保证，亦不因指数的任何错误对任何人负责。因此，如果标的指数值出现错误，投资人参考指数值进行投资决策，则可能导致损失。

### (6) 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。

### (7) 成份股停牌或违约的风险

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。

#### (8) 成份股退市的风险

标的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。

#### (9) 基金合同提前终止风险

本基金为发起式基金，基金合同生效满三年之日，若基金资产净值低于2亿元，本基金将根据基金合同的约定进行基金财产清算并终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。因此，投资人将面临基金合同可能终止的不确定性风险。

#### (10) 参与融资和转融通证券出借业务的风险

本基金可根据法律法规的规定参与融资，可能存在杠杆风险和对手方交易风险等融资业务特有风险。

本基金可参与转融通证券出借业务，面临的的风险包括但不限于：

1) 流动性风险：面临大额赎回时，可能因证券出借原因发生无法及时变现支付赎回款项的风险；

2) 信用风险：证券出借对手方可能无法及时归还证券、无法支付相应权益补偿及借券费用的风险；

3) 市场风险：证券出借后可能面临出借期间无法及时处置证券的市场风险。

#### 2、投资资产支持证券的特定风险

本基金可投资资产支持证券，投资资产支持证券可能面临资产支持证券的标的信用风险、流动性风险，及证券化过程中的法律风险等，由此可能导致基金或基金份额持有人利益受损。

#### 3、投资股指期货的特定风险

投资股指期货所面临的风险主要是市场风险、流动性风险、基差风险、保证金风险、信用风险和操作风险。

#### 4、本基金参与债券回购的风险

债券回购为提升整体基金组合收益提供了可能，但也存在一定的风险。债券回购的主要风险包括信用风险、投资风险及波动性加大的风险，其中，信用风险指回购交易中交易对手在回购到期时，不能偿还全部或部分证券或价款，造成基金净值损失的风险；投资风险是指在进行回购操作时，回购利率大于债券投资收益而导致的风险以及由于回购操作导致投资总量放大，致使整个组合风险放大的风险；而波动性加大的风险是指在进行回购操作时，在对基金组合收益进行放大的同时，也对基金组合的波动性（标准差）进行了放大，即基金组合的风险将会加大。回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对基金净值造成损失的可能性也就越大。

#### 5、投资存托凭证的特定风险

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与存托凭证发行机制相关的风险，由此可能导致基金或基金份额持有人利益受损。存托凭证发行机制相关的风险包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭

证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

#### 6、实施侧袋机制对投资者的影响

侧袋机制是一种流动性风险管理工具，是将特定资产分离至专门的侧袋账户进行处置清算，并以处置变现后的款项向基金份额持有人进行支付，目的在于有效隔离并化解风险，但基金启用侧袋机制后，侧袋账户份额将停止披露基金份额净值，并不得办理申购、赎回和转换，仅主袋账户份额正常开放赎回，因此启用侧袋机制时持有基金份额的持有人将在启用侧袋机制后同时拥有主袋账户份额和侧袋账户份额，侧袋账户份额不能赎回，其对应特定资产的变现时间具有不确定性，最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损失。

实施侧袋机制期间，基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时以主袋账户资产为基准，不反映侧袋账户特定资产的真实价值及变化情况。本基金不披露侧袋账户份额的净值，即便基金管理人在基金定期报告中披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，也不作为特定资产最终变现价格的承诺，对于特定资产的公允价值和最终变现价格，基金管理人不承担任何保证和承诺的责任。

基金管理人将根据主袋账户运作情况合理确定申购政策，因此实施侧袋机制后主袋账户份额存在暂停申购的可能。

#### 7、开放式基金共有的风险如市场风险、管理风险、流动性风险和其他风险。

## （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。

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，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照该会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费由败诉方承担。

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

以下资料详见财通证券资产管理有限公司网站[[www.ctzg.com](http://www.ctzg.com)][客服电话:95336]

财通资管中证有色金属指数型发起式证券投资基金基金合同、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

## 六、其他情况说明

无