

建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题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9月15日

送出日期：2021年9月30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 | 建信大湾区发展主题ETF | 基金代码 | 159978 |
| 基金管理人 | 建信基金管理有限责任公司 | 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2020年3月6日 | 上市交易所及上市日期 | 深圳证券交易所 2020年4月14日 |
| 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 | 龚佳佳 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2020年3月6日 |
| | | 证券从业日期 | 2012年7月9日 |
| 其他 | 场内简称：大湾区ETF 因不再具备上市条件而应当终止上市的情形时，本基金将由交易型开放式基金变更为跟踪标的指数的非上市的开放式基金，变更后基金名称为“建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题指数证券投资基金”，而无需召开基金份额持有人大会。 | | |

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

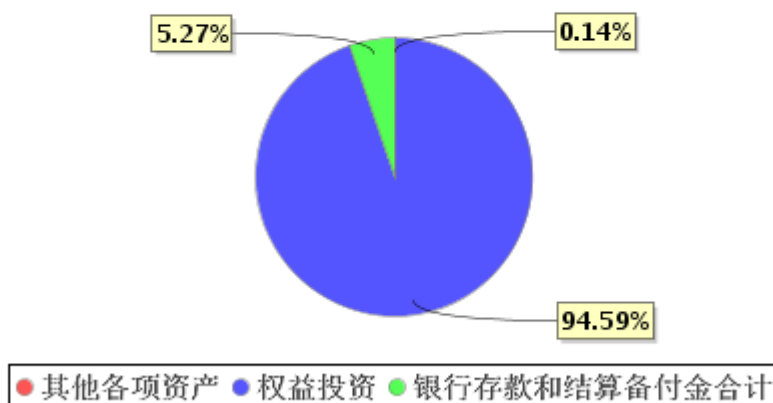
请投资者阅读《招募说明书》第十一部分了解详细情况

| | |
|------|---|
| 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 | <p>本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包含中小板、创业板、其他港股通标的股票及其他经中国证监会核准发行的股票）、衍生工具（股指期货、股票期权）、债券资产（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、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。</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：本基金投资于标的指数成份股、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%。</p> <p>本基金可根据法律法规的规定参与融资业务和转融通证券出借业务。</p> |

| | |
|--------|---|
| | 本基金不主动投资上述范围以外的资产，但因投资港股通股票而被动获得相关权证的，本基金将秉持持有人利益最大化原则，在该权证可变现或处置的 10 个港股通交易日内卖出或处置。 |
| 主要投资策略 | <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。但因特殊情况（比如流动性不足、港股通额度受限等）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非成份股以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具进行替代，或者对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。</p> <p>由于本基金申购赎回采取现金替代的方式，考虑到申购赎回资金流动冲击以及资金划转等操作问题，本基金将会保留一定的现金头寸用于满足赎回及证券交收要求。现金头寸的增加将导致跟踪误差的扩大，因此基金管理人将通过投资以标的指数为基础资产的衍生产品以更好地跟踪标的指数，实现投资目标。</p> <p>在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值争取不超过 0.35%，年跟踪误差争取不超过 4%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证沪港深粤港澳大湾区发展主题指数收益率 |
| 风险收益特征 | 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。本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪中证沪港深粤港澳大湾区发展主题指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金投资标的包括香港联合交易所上市的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。 |

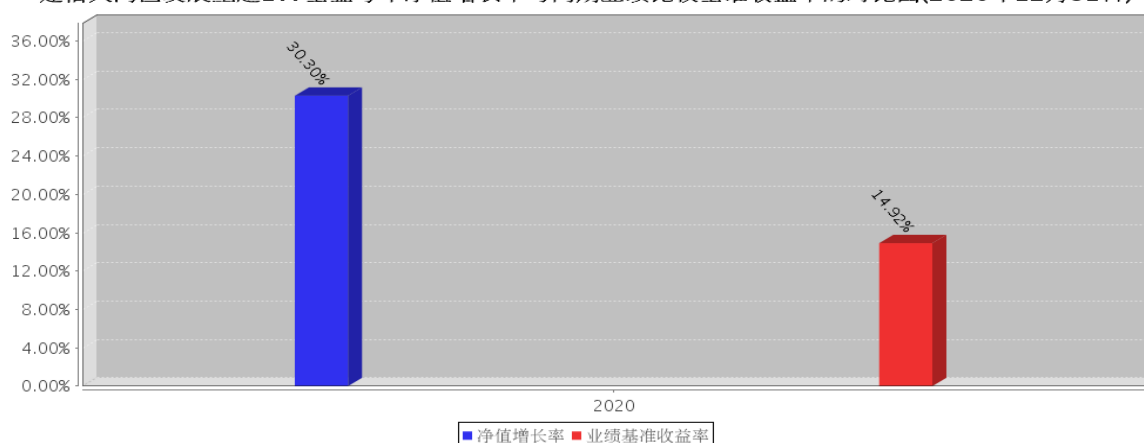
(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

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

建信大湾区发展主题ETF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(2020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 | 备注 |
|--------------|-------------------------|---------|--|
| 申购费 (前收费) | - | 0 | 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不超过0.5%的标准收取佣金 |
| 赎回费 | - | 0 | 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不超过0.5%的标准收取佣金 |

注: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 | 0.30% |
| 托管费 | 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,基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费,持有人大会费用,证券/期货交易、结算费用,银行汇划费用、账户开户及维护费用,上市费及年费,因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用,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。指数许可使用费的收取下限为每季度人民币50,000元,计费期间不足一季度的,根据实际天数按比例计算 |

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。

1、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

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送配股、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、成份股增发、送配等所获收益,成份股停牌、摘牌或流动性差等,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的存在,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,受到最低买入股数的限制,缺乏卖空、对冲机制及其他工具,基金申购与赎回带来的现金变动,指数发布机构指数编制错误等,均可能带来基金投资组合回报与标的指数回报偏离。

2、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

基金份额在证券交易所的交易价格受诸多因素影响,可能存在不同于基金份额净值的情形,即存在价格折溢价的风险。

3、投资人赎回失败的风险

基金管理人可能根据成份股市值规模变化等因素调整最小申购、赎回单位,由此可能导致投资人按原最小申购、赎回单位申购并持有的基金份额,可能无法按照新的最小申购、赎回单位全部赎回,而只能在二级市场卖出全部或部分基金份额。

4、港股投资风险

基金将会投资香港市场股票,投资将受到香港市场宏观经济运行情况、货币政策、财政政策、产业政策、交易规则、结算、托管、汇率以及其他运作风险等多种因素的影响,上述因素的波动和变化可能会使基金资产面临潜在风险。

5、本基金可能遇到的风险还包括指数编制机构停止服务的风险、成份股停牌风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险等。

(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