

大成中证 A100 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：2024 年 10 月 17 日

送出日期：2024 年 10 月 28 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 | 大成中证 A100ETF | 基金代码 | 159923 |
| 基金管理人 | 大成基金管理有限公司 | 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 |
| 上市交易所及上市日期 | 深圳证券交易所 | | 2013 年 3 月 5 日 |
| 基金合同生效日 | 2013 年 2 月 7 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 | 刘淼 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2021 年 9 月 2 日 |
| | | 证券从业日期 | 2008 年 4 月 1 日 |
| 其他 | 本基金的基金合同生效后，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，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式或与其他基金合并等，并召开基金份额持有人大会进行表决。 | | |

注：本基金份额场内简称：中证 A100ETF 基金

二、基金投资与净值表现

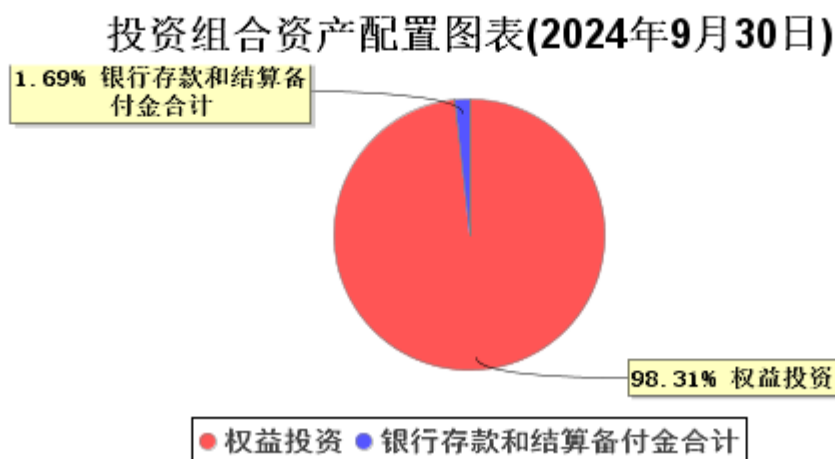
(一) 投资目标与投资策略

详见《大成中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书》第九部分“基金的投资”。

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金进行被动式指数化投资，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 | 本基金跟踪标的指数为：中证 A100 指数。 本基金主要投资于标的指数成份股（含存托凭证）和备选成份股（含存托凭证）。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标的指数成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、新股、债券（含中期票据）、货币市场工具、银行存款、权证、股指期货、资产支持证券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）。 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。 本基金投资于标的指数成份股（含存托凭证）和备选成份股（含存托凭证）的资产比例 |

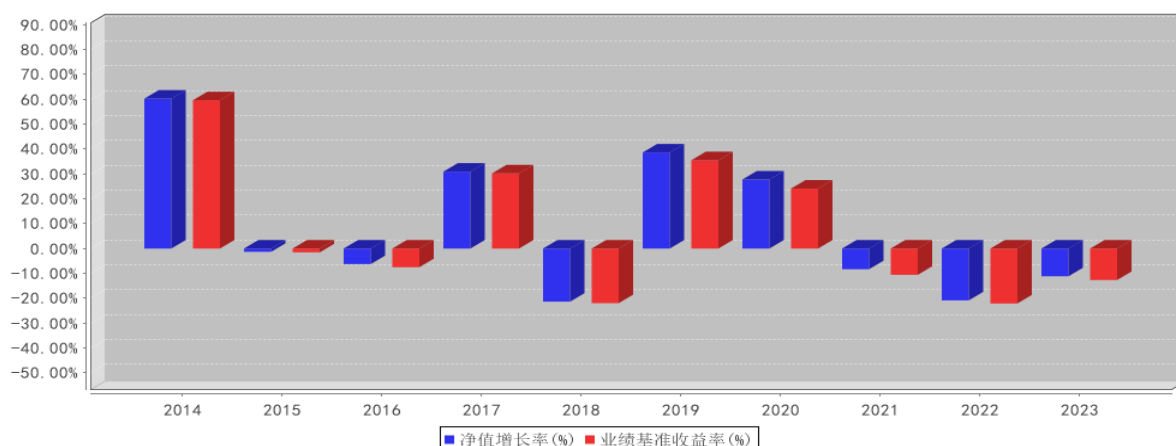
| | |
|---------------|--|
| | 不低于基金资产净值的 90%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。 |
| 主要投资策略 | <p>本基金为被动式指数基金，采取完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。</p> <p>当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。</p> <p>本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。</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不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。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。在控制风险的前提下，本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</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> |
| 业绩比较基准 | 中证 A100 指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场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) 最近十年基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

大成中证100ETF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（2023年12月31日）



- 注：1、基金的过往业绩不代表未来表现。
2、如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

投资者在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不高于 0.5% 的标准收取费用，其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。

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/年费率或金额 | 收取方 |
|---------|--|------------|
| 管理费 | 0.5% | 基金管理人和销售机构 |
| 托管费 | 0.1% | 基金托管人 |
| 审计费用 | 20,000.00 元 | 会计师事务所 |
| 信息披露费 | 0.00 元 | 规定披露报刊 |
| 指数许可使用费 | 0.03% | 指数编制公司 |
| 其他费用 | 《基金合同》生效后与基金相关的律师费、诉讼费和仲裁费，基金份额持有人大会费用，基金的证券交易费用，基金的银行汇划费用，基金上市费及年费，基金的指数使用费，基金相关账户的开户及维护费用，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。 | |

注：（1）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。

（2）审计费用、信息披露费为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

（3）基金合同生效后的指数许可使用费，按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法支付指数许可使用费。指数使用许可费按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提。基金合同生效后的指数许可使用费按日计提，按季支付。若本基金当季日均基金资产

净值大于人民币 5000 万元时，许可使用费的收取下限为每季度人民币 3.5 万元，不足 3.5 万元时按照 3.5 万元收取；若本基金当季日均基金资产净值小于或等于人民币 5000 万元时，无许可使用费的收取下限。若计费期间不足一季度的，则根据实际天数按比例计算该计费期间的收取下限。

(三) 基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

| 基金运作综合费率（年化） |
|--------------|
| 0.79% |

注：基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

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) 本基金作为指数型基金的特定风险
- (1) 标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险
- (2) 标的指数波动的风险
- (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

2、本基金作为交易型开放式基金的特定风险

- (1) 基金份额二级市场交易价格折溢价的风险
- (2) 参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险
- (3) 退市风险
- (4) 投资者申购失败的风险
- (5) 投资者赎回失败的风险
- (6) 基金份额赎回对价的变现风险。
- (7) 基金份额场外实物申赎模式的特殊风险
- (8) 成份股停牌的风险

3、单一投资者集中度较高的风险

4、本基金还面临其他风险，如市场风险、政策风险、经济周期风险、利率风险、购买力风险、上市公司经营风险、第三方机构服务的风险、信用风险、科创板股票投资及相关风险、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，本基金还可能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，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、管理风险、操作或技术风险、合规性风险、不可抗力风险、风险声明。

(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 100 交易型开放式指数证券投资基金经中国证监会 2012 年 12 月 19 日证监许可【2012】1699 号文核准募集，基金合同于 2013 年 2 月 7 日正式生效。大成中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金由大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金更名而来。

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 A100 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 A100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同、大成中证 A100 交易型开放式指数证券投资基金托管协议、大成中证 A100 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