大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金招募说明书

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

二〇一九年八月

重 要 提 示

大成有色金属期货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2019年8月22日证监许可【2019】1531号文注册募集。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明中国证监会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。

证券投资基金(以下简称“基金”)是一种长期投资工具,其主要功能是分散投资,降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具,投资者购买基金,既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益,也可能承担基金投资所带来的损失。

本基金属于商品期货基金,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,主要采用完全复制策略,跟踪上海期货交易所有色金属期货价格指数,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。

本基金投资于证券期货市场,基金净值会因证券期货市场波动等因素产生波动。投资者在投资本基金前,应仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同,全面认识本基金的风险收益特征和产品特性,并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购(或申购)本基金的意愿、时机、数量等投资行为做出独立、谨慎决策,获得基金投资收益,亦承担基金投资中出现的各类风险。基金管理人在基金管理实施过程中产生的操作或技术风险、本基金的特有风险等。

本基金为跟踪商品期货指数的商品期货指数型基金,投资本基金面临商品期货基金跟踪标的的特有风险、逐日盯市风险、合约展期风险、持仓上限风险、强制平仓风险、其他风险,等等,上述因素可能影响本基金份额净值表现及跟踪误差,并对投资者申购赎回本基金带来一定程度的影响。

本基金的投资目标为跟踪上海期货交易所有色金属期货价格指数表现,本基金持有的标的指数成份商品的期货合约的价值合计(买入、卖出轧差计算)不低于基金资产净值的90%、不高于基金资产净值的110%,除支付商品期货合约保证金以外的基金财产投资于货币市场工具不少于80%,投资者投资本基金不具备直接投资期货合约时的高杠杆效应。

基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现,基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险,投资入认购(或申购)基金时,请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负担。

在目前结算规则下,投资者当日申购的基金份额,清算交收完成后方可卖出和赎回。

一、绪 言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)、《公开募集证券投资基金运作指引第1号——商品期货交易型开放式基金指引》(以下简称“《商品期货基金指引》”)、其他有关规定及《大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下或简称基金合同)编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据《大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金基金合同》编写,并经中国证监会注册。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。投资者取得依基金合同所发行的基金份额,即成为基金份额持有人和本基金基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务;基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅《大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金基金合同》。

二、释 义

在本招募说明书中,除非文意另有所指,下列词语或简称具有如下含义:

1、基金或本基金:指大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金

2、基金管理人:指大成基金管理有限公司

3、基金托管人:指中国农业银行股份有限公司

4、基金合同:指《大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充

5、托管协议:指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书:指《大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其定期的更新

7、基金份额发售公告:指《大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》

8、上市交易公告书:指《大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金基金上市交易公告书》

9、法律法规:指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等

10、《基金法》:指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过,经2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订,自2013年6月1日起实施,并经2015年4月24日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

11、《销售办法》:指中国证监会2013年3月15日颁布、同年6月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

12、《信息披露办法》:指中国证监会2004年6月8日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

13、《运作办法》:指中国证监会2014年7月7日颁布、同年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

14、《流动性风险管理规定》:指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订

15、《商品期货基金指引》:指中国证监会2014年12月16日颁布并实施的《公开募集证券投资基金运作指引第1号——商品期货交易型开放式基金指引》及颁布机关对其不时做出的修订

16、中国证监会:指中国证券监督管理委员会

17、银行业监督管理机构:指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会

18、基金合同当事人:指受基金合同约束,根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体,包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

19、个人投资者:指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

20、机构投资者:指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

21、合格境外机构投资者:指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

22、人民币合格境外机构投资者:指按照《人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》及相关法律法规规定,运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外法人

23、投资人、投资者:指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

24、基金份额持有人:指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

25、ETF:指《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》定义的“交易型开放式基金”

26、ETF联接基金:指将其绝大部分基金财产投资于跟踪同一标的指数的ETF(以下简称“目标ETF”),紧密跟踪标的指数表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化,采用开放式运作方式的基金,简称联接基金

27、基金销售业务:指基金管理人或销售机构宣传推介基金,发售基金份额,办理基金份额的申购、赎回等业务

28、销售机构:指大成基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议,办理基金销售业务的机构,包括发售代理机构及申购赎回代理券商

29、发售代理机构:指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,由基金管理人指定的代理本基金发售业务的机构

30、申购赎回代理券商:指基金管理人指定的办理本基金申购、赎回业务的证券公司,又称为代办证券公司

31、登记业务:指根据《中国证券登记结算有限责任公司关于深圳证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》以及相关业务规则定义的基金份额的登记、存管和结算及相关业务

32、登记机构:指办理登记业务的机构。本基金的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司或基金管理人指定的其他机构

33、深圳证券账户:指投资人在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的深圳证券交易所人民币普通股票账户(即A股账户)或深圳证券交易所证券投资基金账户

34、基金交易账户:指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户

35、基金合同生效日:指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件,基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕,并获得中国证监会书面确认的日期

36、基金合同终止日:指基金合同规定的基金合同终止事由出现后,基金财产清算完毕,清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

37、基金募集期:指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间,最长不得超过3个月

38、存续期:指基金合同生效至终止之间的不定期期限

39、工作日:指上海期货交易所、深圳证券交易所的正常交易日

40、T日:指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

41、T+n日:指自T日起第n个工作日(不包含T日)

42、开放日:指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

43、开放时间:指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

44、《业务规则》:指深圳证券交易所发布实施的《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》、中国证券登记结算有限责任公司发布实施的《中国证券登记结算有限责任公司关于深圳证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》及深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司发布的其他相关规则和规定

45、认购:指在基金募集期内,投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

46、申购:指基金合同生效后,投资人根据基金合同和招募说明书的规定,以申购赎回清单规定的申购对价申请购买基金份额的行为

47、赎回:指基金合同生效后,基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为申购赎回清单所规定的赎回对价的行为

48、申购赎回清单:指由基金管理人编制的用以公告申购对价、赎回对价等信息的文件

49、申购对价:指投资人申购基金份额时,按基金合同和招募说明书规定应交付的现金替代、现金差额及其他对价

50、赎回对价:指投资人赎回基金份额时,基金管理人按基金合同和招募说明书规定应交付给基金份额持有人的现金替代、现金差额及其他对价

51、标的指数:指上海期货交易所有色金属期货价格指数及其未来可能发生的变更,或基金管理人根据需要更换的其他指数

52、组合期货合约:指本基金标的指数所包含的全部或部分期货合约

53、现金替代:指申购、赎回过程中,投资人按基金合同和招募说明书的规定,用于替代组合期货合约中全部或部分期货合约的一定数量的现金

54、现金差额:指最小申购、赎回单位的资产净值与按T日结算价计算的最小申购、赎回单位中的组合期货合约价值和现金替代之差;投资人申购、赎回时应支付或应获得的现金差额根据最小申购、赎回单位对应的现金差额、申购或赎回的基金份额数计算

55、最小申购、赎回单位:指本基金申购份额、赎回份额的最低数量,投资人申购、赎回的基金份额应为最小申购、赎回单位的整数倍

56、基金份额参考净值:指基金管理人或基金管理人委托的机构在开市后根据当日的申购赎回清单和组合期货合约内各只期货合约的实时成交数据等,计算并通过深圳证券交易所发布的基金份额参考净值,简称IOPV

57、预估现金部分:指由基金管理人估计并在T日申购赎回清单中公布的当日现金差额的估计值,预估现金部分由申购赎回代理券商(代办证券公司)预先冻结

58、基金份额折算:指基金管理人根据基金合同的规定将基金份额持有人的基金份额进行变更登记的行为

59、元:指人民币元

60、基金利润:指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额

61、基金资产总值:指基金拥有的期货合约、各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

62、基金资产净值:指基金资产总值减去基金负债后的价值

63、基金份额净值:指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

64、基金资产估值:指计算评估基金资产和负债的价值,以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

65、指定媒介:指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒介

66、流动性受限资产:指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产,包括但不限于到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款(含协议约定有条件提前支取的银行存款)等

67、货币市场工具:包括现金、期限在1年以内(含1年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单;剩余期限在397天以内(含397天)且信用等级在AA+以上(含)的债券、非金融企业债务融资工具;中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具

68、不可抗力:指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件。

三、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:大成基金管理有限公司
住所:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
办公地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
设立日期:1999年4月12日
注册资本:贰亿元人民币
股权结构:公司股东为中泰信托有限责任公司(持股比例50%)、中国银河投资管理有限公司(持股比例25%)、光大证券股份有限公司(持股比例25%)三家公司。
法定代表人:刘卓
电话:0755-83183388
传真:0755-83199588
联系人:肖剑

(二)主要人员情况

1、董事会成员:

刘卓先生,董事长,工学学士。曾任职于共青团哈尔滨市委、哈尔滨银行股份有限公司、中泰信托有限责任公司;2007年6月,任哈尔滨银行股份有限公司执行董事;2008年8月,任哈尔滨银行股份有限公司董事会秘书;2012年4月,任哈尔滨银行股份有限公司副董事长;2012年11月至今,任中泰信托有限责任公司监事会主席。2014年12月15日起任大成基金管理有限公司董事长。

靳天鹏先生,副董事长,国际法学硕士。1991年7月至1993年2月,任职于共青团河南省委;1993年3月至12月,任职于深圳市国际经济与法律咨询公司;1994年1月至6月,任职于深圳市蛇口律师事务所;1994年7月至1997年4月,任职于蛇口招商港务股份有限公司;1997年5月至2015年1月,先后任光大证券有限责任公司南方总部研究部研究员,南方总部机构管理部副总经理,光大证券股份有限公司债券业务部总经理助理,资产管理总部投资部副总经理(主持工作),法律合规部副总经理,零售交易业务总部副总经理;2014年10月,任大成基金管理有限公司副董事;2015年1月起任大成基金管理有限公司副董事长。

谭晓岚先生,董事、总经理,哈佛大学公共管理硕士。曾在财政部、世界银行、全国社保基金理事会任职。2016年7月加入大成基金管理有限公司,2016年12月至2019年8月任大成国际资产管理有限公司总经理,2017年2月至2019年6月任大成基金管理有限公司副总经理,2019年7月起任大成基金管理有限公司总经理,2019年8月起任大成国际资产管理有限公司董事长。

吴庆斌先生,董事,清华大学法学及工学双学士。先后任职于西南证券飞虎网、北京国际信托有限责任公司、广联(南宁)投资股份有限公司等机构。2012年7月至今,任广联(南宁)投资股份有限公司董事长;2012年任职于中泰信托有限责任公司,2013年6月至今,任中泰信托有限责任公司董事长。

孙学林先生,董事,硕士研究生。具注册会计师、注册资产评估师资格。现任中国银河投资管理有限公司党委委员、总裁助理,兼任投资二部总经理兼行政负责人、投资决策委员会副主任。2012年6月起,兼任镇江银河创业投资有限公司总经理、投资决策委员会委员。

黄隽女士,独立董事,经济学博士。现任中国人民大学经济学院教授、博士生导师,中国人民大学艺术品金融研究所副所长。

叶林先生,独立董事,法学博士。现任中国人民大学法学院教授、民商法教研室主任,博士研究生导师、国家社会科学重点基地中国民商事法律科学研究中心兼职教授。

吉敏女士,独立董事,金融学博士,现任东北财经大学讲师,教研室主任,东北财经大学金融学国家级教学团队成员,东北财经大学开发金融研究中心助理研究员,主要从事金融业产业组织结构、银行业竞争方面的研究。参与两项国家自然科学基金、三项国家社科基金、三项教育部人文社会科学一般项目、多项省级创新团队项目,并负责撰写项目总结报告,在国内财经类期刊发表多篇学术论文。

金李先生,独立董事,博士。现任英国牛津大学商学院终身教职正教授(博士生导师)和北京大学光华管理学院讲席教授(博士生导师),金融系联合系主任,院长助理,北京大学国家金融研究中心主任。曾在美国哈佛大学商学院任教十多年,并兼任哈佛大学费正清东亚研究中心执行理事。

2. 监事会成员:

许国平先生,监事会主席,中国人民大学国民经济学博士。1987年至2004年先后任中国人民银行国际司处长,东京代表处代表,研究局调研员,金融稳定局体改处处长;2005年6月至2008年1月任中央汇金投资有限责任公司建行股权管理部主任;2005年8月至2016年11月任中国银河金融控股有限责任公司董事、副总经理、党委委员;2007年2月至2016年11月任中国银河投资管理有限公司董事长、总裁、党委书记;2010年6月至2014年3月兼任北京银河吉星创业投资有限责任公司董事长;2007年1月至2015年6月任中国银河证券股份有限公司董事;2014年1月至2017年6月任银河基金管理有限公司党委书记;2014年3月至2018年1月任银河基金管理有限公司董事长(至2017年11月)及法定代表人;2018年3月加入大成基金管理有限公司,任监事会主席。

蒋卫强先生,职工监事,经济学硕士。1997年7月至1998年10月任杭州益和电脑公司开发部软件工程师。1998年10月至1999年8月任杭州新利电子技术有限公司电子商务部高级程序员。1999年8月加入大成基金管理有限公司,历任信息技术部系统开发员、金融工程部高级工程师、监察稽核部总监助理、信息技术部副总监、风险管理部副总监、风险管理部总监,现任信息技术部总监。

吴萍女士,职工监事,文学学士,中国注册会计师协会非执业会员。曾任职于中国农业银行深圳分行、日本三和银行深圳分行、普华永道会计师事务所深圳分所。2010年6月加入大成基金管理有限公司,历任计划财务部高级会计师、总监助理,现任计划财务部副总监。2016年10月起兼任大成国际资产管理有限公司董事。

3、高级管理人员情况:

刘卓先生,董事长。简历同上。

谭晓岚先生,总经理。简历同上。

肖剑先生,副总经理,哈佛大学公共管理硕士。曾任深圳市南山区委(政府)办公室副主任,深圳市广聚能源股份有限公司副总经理兼广聚投资控股公司执行董事、总经理,深圳市人民政府国有资产监督管理委员会副处长、处长。2014年11月加入大成基金管理有限公司,2015年1月起任公司副总经理,2019年8月起任大成国际资产管理有限公司总经理。

温智敏先生,副总经理,哈佛大学法学博士。曾任职于美国Hunton & Williams国际律师事务所纽约州执业律师。中银国际投行业务副总裁,香港三山投资公司董事总经理,标准银行亚洲有限公司董事总经理兼中国投行业务主管。2015年4月加入大成基金管理有限公司,任首席战略官,2015年8月起任公司副总经理。

周立新先生,副总经理兼首席信息官,大学本科学历。曾任新疆精河县党委办公室机要员、新疆精河县团委副书记、新疆精河县人民政府体改委副主任、新疆精河县八家户农场党委书记、新疆博尔塔拉蒙古自治州团委副书记及少工委主任、江苏省铁路发展股份有限公司办公室主任、江苏省铁路发展股份有限公司控股企业及江苏省铁路实业集团有限公司控股企业负责人、中国华闻投资控股有限公司燃气战略管理部项目经理。2005年1月加入大成基金管理有限公司,历任客户服务中心总监助理、市场部副总经理、上海分公司副总经理、客户服务部总监兼上海分公司总经理、公司助理总经理,2015年8月起任公司副总经理,2019年5月起兼任首席信息官。

姚余栋先生,副总经理,英国剑桥大学经济学博士。曾任职于原国家经贸委企业司、美国花旗银行伦敦分行。曾任世界银行咨询顾问,国际货币基金组织国际资本市场部和非洲部经济学家,原黑龙江省招商局副局长,黑龙江省商务厅副厅长,中国人民银行货币政策二司副巡视员,中国人民银行货币政策司副司长,中国人民银行金融研究所所长。2016年9月加入大成基金管理有限公司,任首席经济学家,2017年2月起任公司副总经理。

陈翔凯先生,副总经理,香港中文大学工商管理硕士。曾任职于广发证券海南分公司,平安保险集团公司。曾任华安财产保险有限公司高级投资经理,国投瑞银基金管理有限公司固定收益部总监,招商证券资产管理有限公司副总经理。2016年11月加入大成基金管理有限公司,2017年2月起任公司副总经理。

赵冰女士,督察长,清华大学工商管理硕士。曾供职于中国证券业协会资格管理部、专业联络部、基金公司会员部,曾任中国证券业协会分析师委员会委员、基金销售专业委员会委员。曾参与基金业协会筹备组的筹备工作。曾先后任中国证券投资基金业协会投教与媒体公关部负责人、理财及服务机构部负责人。2017年7月加入大成基金管理有限公司,2017年8月起任公司督察长。

4、本基金基金经理

李绍,经济学硕士,2015年5月加入大成基金管理有限公司,现任大成基金期货投资部总监。18年证券、期货从业经历,曾先后任职于大连商品交易所、中国金融期货交易所和中国期货市场监控中心,曾负责中国证监会期货市场运行监测监控系统建设,获证券期货科技进步评比一等奖;主持编制发布中国商品期货指数、农产品期货指数等系列指数。

5、公司投资决策委员会

公司量化投资决策委员会由7名成员组成,设量化投资决策委员会主席1名,其他委员6名。名单如下:

温智敏,公司副总经理,量委化投资决策委员会主席;黎新平,基金经理,数量与指数投资部总监,量化投资决策委员会委员;李绍,期货投资部总监,量化投资决策委员会委员;苏秉毅,基金经理,数量与指数投资部副总监,量化投资决策委员会委员;冉凌浩,基金经理,量化投资决策委员会委员;夏高,基金经理,现任数量与指数投资部总监助理,量化投资决策委员会委员;张钟玉,基金经理,量化投资决策委员会委员。

上述人员之间不存在亲属关系。

(四)基金管理人的职责

按照《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人必须履行以下职责:

(1)依法募集资金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;

(2)办理基金备案手续;

(3)自《基金合同》生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;

(4)配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;

(5)建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;

(6)除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;

(7)依法接受基金托管人的监督;

(8)采取适当合理的措施使计算基金份额认购价格、申购、赎回对价的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回对价,编制申购赎回清单;

(9)进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

(10)编制季度、半年度和年度基金报告;

(11)严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

(12)保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向他人泄露;

(13)按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;

(14)按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回对价;

(15)依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;

(16)按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上;

(17)确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件;

(18)组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

(19)面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;

(20)因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

(21)监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

(22)当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;

(23)以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;

(24)基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件,《基金合同》不能生效,基金管理人承担全部募集费用,将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人;

(25)执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(26)建立并保存基金份额持有人名册;

(27)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(五)基金管理人承诺

1、基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》,并建立健全的内部控制制度,采取有效措施,防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生;

2、基金管理人承诺严格遵守《基金法》、《运作办法》,建立健全的内部控制制度,采取有效措施,防止以下《基金法》、《运作办法》禁止的行为发生:

(1)将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资;

(2)不公平地对待其管理的不同基金财产;

(3)利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益;

(4)向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;

(5)法律法规和中国证监会禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺加强人员管理,强化职业操守,督促和约束员工遵守国家有关法律法规及行业规范,诚实信用、勤勉尽责,不从事以下活动:

(1)越权或违规经营;

(2)违反基金合同或托管协议;

(3)损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益;

(4)在向中国证监会报送的资料中弄虚作假;

(5)拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管;

(6)玩忽职守、滥用职权;

(7)泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密,尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息;

(下转A18版)

大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

【重要提示】

1. 大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)已经中国证券监督管理委员会证监许可[2019]1531号文准予注册募集。中国证监会对本基金募集的注册并不代表中国证监会对本基金的风险和收益作出实质性判断、推荐或者保证。

2. 本基金类别为商品期货基金,运作方式为交易型开放式。

3. 本基金的管理人为大成基金管理有限公司(以下简称“本公司”)。

4. 本基金的托管人为中国农业银行股份有限公司。

5. 本基金的基金登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

6. 本基自 2019 年9月3日至 2019 年10月18日通过本公司的直销中心和发售代理机构公开发售。投资者可选择网上现金认购和网下现金认购 2 种方式。

其中,网上现金认购的发售日期为 2019 年9月3日至 2019 年10月18日,网下现金认购的发售日期为2019年9月3日至 2019年10月18日。基金管理人可根据募集情况适当缩短或延长本基金的募集期限并及时公告。本基金的募集期限不超过 3 个月。

7. 本基金的网上现金认购通过基金管理人指定的发售代理机构办理,发售代理机构为具有基金销售业务资格及深圳证券交易所会员资格的证券公司。投资者可以通过基金管理人和发售代理机构办理网下现金认购。

8. 投资者投资本基金时需具有证券账户,证券账户是指深圳证券交易所 A股账户或基金账户。但需注意,使用深圳证券交易所基金账户只能进行基金的现金认购和二级市场交易,如投资者需参与基金的申购、赎回,则应开立深圳证券交易所 A 股账户。

9. 本基金发售对象为符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

10. 本基金募集期内不设募集目标上限。

11. 网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额需为 1,000 份或其整数倍。投资者可以多次认购,累计认购份额不设上限。

网下现金认购以基金份额申请。投资人通过发售代理机构办理网下现金认购,每笔认购份额须为 1000份或其整数倍。投资者通过基金管理人办理网下现金认购的,每笔认购份额须在 5万份以上(含 5万份),超过部分须为 1万份的整数倍。

12. 投资者可以多次认购,累计认购份额不设上限。

13. 网上现金认购投资者可多次申报,不可撤单,申报一经确认,认购资金即被冻结。网下现金认购申请提交后不得撤销。

14. 销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况,投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

15. 投资者不得非法利用他人账户或资金进行认购,也不得违规融资或帮助他人违规进行认购。投资者应保证用于认购的资金来源合法,对于投资者用于认购的资金,投资者应有权自行支配,不存在任何法律上、合约上或其他障碍。

16. 本公告仅对本基金募集的有关事项和规定予以说明,投资者欲了解本基金的详细情况,请阅读《大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。

17. 销售机构销售本基金的城市名称、网点名称、联系方式以及开户和认购等具体事项详见各销售机构的相关业务公告。

18. 在募集期间,除本公告所列示的销售机构外,如出现增加销售机构的情况,本公司将及时公告。

19. 对未开设销售网点的地区的投资者,请拨打本公司全国统一客户服务电话400-888-5558(国内免长途话费)咨询购买相关事宜。

20. 基金管理人可综合各种情况依法对本基金募集安排做适当调整。

21. 基金募集期结束后,基金管理人确定本基金的申购赎回代理机构名单,报深圳证券交易所,经有关部门认可后,由基金管理人公告。本基金上市后,未登记在申购赎回代理机构的投资者只能进行本基金的二级市场买卖,如投资者需进行本基金的申购赎回交易,须转托管到本基金的申购赎回代理机构。

22. 风险提示

基金管理人提示投资者充分了解基金投资的风险和收益特征,根据自身的风险承受能力,审慎选择适合自己的基金产品。

证券投资基金(以下简称“基金”)是一种长期投资工具,其主要功能是分散投资,降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具,投资者购买基金,既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益,也可能承担基金投资所带来的损失。

本基金属于商品期货基金,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,主要采用完全复制策略,跟踪上海期货交易所有色金属期货价格指数,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。

本基金投资于证券期货市场,基金净值会因证券期货市场波动等因素产生波动。投资者在投资本基金前,应仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同,全面认识本基金的风险收益特征和产品特性,并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购(或申购)本基金的意愿、时机、数量等投资行为做出独立、谨慎决策,获得基金投资收益,亦承担基金投资中出现的各类风险。基金管理人在基金管理实施过程中产生的操作或技术风险、本基金的特有风险等。

本基金为跟踪商品期货指数的商品期货指数型基金,投资本基金面临商品期货基金跟踪标的的特有风险、逐日盯市风险、合约展期风险、持仓上限风险、强制平仓风险、其他风险,等等,上述因素可能影响本基金份额净值表现及跟踪误差,并对投资者申购赎回本基金带来一定程度的影响。

本基金的投资目标为跟踪上海期货交易所有色金属期货价格指数表现,本基金持有的标的指数成份商品的期货合约的价值合计(买入、卖出轧差计算)不低于基金资产净值的90%、不高于基金资产净值的110%,除支付商品期货合约保证金以外的基金财产投资于货币市场工具不少于80%,投资者投资本基金不具备直接投资期货合约时的高杠杆效应。

基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险,投资人认购(或申购)基金时,请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负担。

在目前结算规则下,投资者当日申购的基金份额,清算交收完成后方可卖出和赎回。

23. 本基金管理人可综合各种情况对发售安排做适当调整。本基金管理人拥有对本基金份额发售公告的最终解释权。

一、本次募集基本情况

(一)基金名称

大成有色金属期货交易型开放式指数证券投资基金

(二)场内简称及基金认购代码

场内简称:有色期货

基金代码:159980

(三)基金运作方式和类型

交易型开放式、商品期货基金

(四)基金存续期限

不定期

(五)基金份额初始面值(认购价格)

本基金基金份额发售面值为人民币1.00元。

(六)募集对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

(七)基金发售机构

1、网下现金发售机构

大成基金管理有限公司

2、网上现金发售代理机构

投资者可直接通过以下具有基金代销业务资格及深圳证券交易所会员资格的证券公司办理网上现金认购业务(排序不分先后):

爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财富里昂、财通证券、长城证券、长江证券、网信证券、川财证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、方正证券、光大证券、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰长财、恒泰证券、红塔证券、申万宏源西部证券、宏信证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰联合、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、开源证券、联储证券、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证券、平安证券、中泰证券、国融证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申万宏源证券、世纪证券、首创证券、太平洋证券、天风证券、九州证券、万和证券、万联证券、西部证券、西藏东方财富证券、西南证券、长城国瑞、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中投证券、中天证券、中信建投、中信浙江、中信山东、中信证券、中银证券、中邮证券、中原证券(排名不分先后)。

本基金募集期结束前获得基金代销资格的深交所会员可通过深交所开放式基金销售系统办理本基金的认购业务。如有新增具有基金销售业务资格及深圳证券交易所会员资格的证券公司以销售机