

融通创业板指数增强型证券投资基金(C类份额)

基金产品资料概要更新(2024年第1号)

编制日期: 2024年06月06日

送出日期: 2024年06月07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 | 融通创业板指数 | 基金代码 | 161613 |
| 下属基金简称 | 融通创业板指数C | 下属基金交易代码 | 004870 |
| 基金管理人 | 融通基金管理有限公司 | 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2012年4月6日 | 上市交易所及上市日期 | - |
| 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 | 蔡志伟 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2016年11月19日 |
| | | 证券从业日期 | 2011年6月15日 |
| 基金经理 | 吕寒 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2023年09月12日 |
| | | 证券从业日期 | 2018年07月01日 |

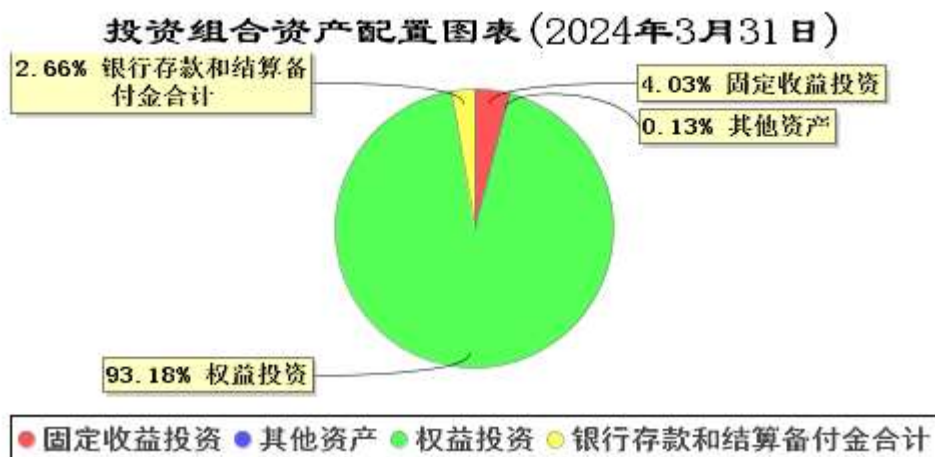
二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

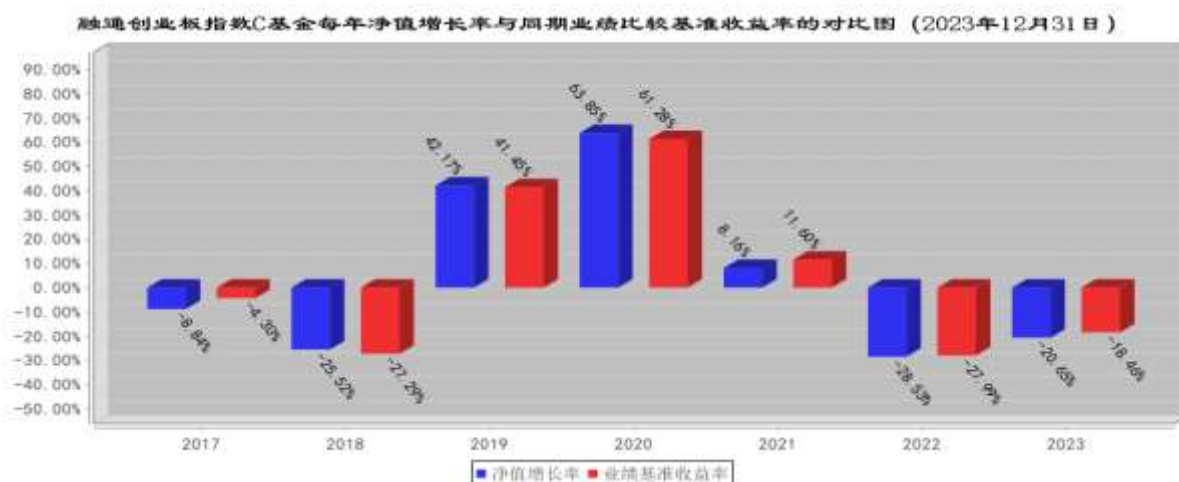
| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本基金在基金合同规定的范围内,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,结合增强收益的主动投资,力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均偏离度控制在0.5%以内、年化跟踪误差控制在7.75%以内、基金总体投资业绩超越创业板指数的表现。 |
| 投资范围 | 本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。投资于股票资产不低于基金资产净值的90%,其中投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于80%,现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。如以后法律法规及中国证监会允许基金投资上述品种之外的其他金融工具,本基金可以依照法律法规或监管机构的规定,基金管理人履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。 |
| 主要投资策略 | 本基金为增强型指数基金,对指数投资部分,采用完全复制指数的投资策略,按照成份股在标的指数中的基准权重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。本基金对主动投资部分采取积极配置策略,力争在跟踪误差控制范围 |

| | |
|--------|--|
| | 内, 获取超越基准的业绩表现。 |
| 业绩比较基准 | 创业板指数收益率×95%+银行活期存款利率×5% |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型指数基金, 属于高风险高收益的基金品种, 其收益和风险均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。 |

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表



(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



- 注: (1) 基金的过往业绩不代表未来表现。
 (2) 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。
 (3) 本基金于 2017 年 7 月 5 日增设 C 类份额。

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 |
|------|-------------------------|---------|
| 赎回费 | N < 7 日 | 1.5% |
| | 7 日 ≤ N < 30 日 | 0.5% |

| | | |
|--|-------|-----|
| | N≥30日 | 0.0 |
|--|-------|-----|

申购费

本基金C类基金份额不收取申购费用。

(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 | 1% | 基金管理人和销售机构 |
| 托管费 | 0.2% | 基金托管人 |
| 销售服务费 | 0.4% | 销售机构 |
| 审计费用 | 45,000.00元 | 会计师事务所 |
| 信息披露费 | 120,000.00元 | 规定披露报刊 |
| 其他费用 | 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按实际发生额从基金资产扣除。 费用类别详见本基金《基金合同》及《招募说明书》或其更新。 | |

注：1、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；

2、审计费、信息披露费和指数许可使用费（若有）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。

(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：

融通创业板指数C

| | 基金运作综合费率（年化） |
|------|--------------|
| 持有期间 | 1.63% |

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。

本基金面临的投资风险主要包括：市场风险（含政策风险、经济周期风险、利率风险、上市公司经营风险、通货膨胀风险、债券收益率曲线变动的风险、再投资风险）、信用风险、管理风险、流动性风险、操作和技术风险、合规性风险及特有风险。

本基金特有风险包括：

1、规则差异风险

创业板市场发行、上市等业务规则与现有的主板、中小企业板市场的相关业务规则存在一定差别。

2、上市公司经营风险

与主板市场上市公司相比，创业板市场上市公司一般处于发展初期，经营历史较短，规模较小，经营稳定性相对较低，抵抗市场风险和行业风险的能力相对较弱。创业板市场上市公司发展潜力虽然可能巨大，但新技术的先进性与可靠性、新模式的适用面与成熟度、新行业的市场容量与成长空间等都具有较大不确定性，投资者对创业板市场上市公司高成长的预期并不一定会实现，风险较主板大。

3、上市公司退市的风险

创业板市场上市公司具有业绩不稳定、经营风险较高、退市风险相对较大等特点。由于本基金主要投资于创业板指数成份股,如果创业板指数成份股公司退市,本基金基金资产可能遭受损失。

4、上市公司技术失败风险

创业板市场上市公司高科技转化为现实的产品或劳务具有不确定性,相关产品和技術更新换代较快,存在出现技术失败而造成损失的风险。

5、标的指数下跌的风险

标的指数成份股的价格可能由于政治因素、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。当创业板指数下跌时,本基金面临基金净值与创业板指数同步下跌的风险。

6、标的指数成份股公司股价大幅波动风险

以下原因可能导致创业板市场上市公司股价发生大幅波动:公司经营历史较短,规模较小,抵抗市场风险和行业风险的能力相对较弱;公司流通股本较少,盲目炒作会加大股价波动,也相对容易被操纵;公司业绩可能不稳定,传统的估值判断方法可能不尽适用,投资者的价值判断可能存在较大差异。

7、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。

8、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

由于基金投资过程中存在流动性风险、交易成本和创业板指数成份股调整等情况导致基金投资组合回报与标的指数回报存在跟踪偏离风险。本基金将进行被动型的股票投资并通过多项风险控制工具降低跟踪风险。

9、跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争将净值增长率与业绩比较基准之间的日均偏离度控制在0.5%以内、年化跟踪误差控制在7.75%以内,但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致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。

10、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内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。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。

11、成份股停牌的风险

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的风险。

12、本基金如投资于科创板股票,会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险,包括但不限于市场风险、流动性风险、信用风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。本基金可根据投资策略需要或市场环境的变化,选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票,本基金并非必然投资于科创板股票。

(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。

本基金标的指数为创业板指数。有关标的指数具体编制方案详见招募说明书“二十五、指数编制方案”,

编制方案后续更新及成份股信息详见国证指数网，网址：www.cnindex.com.cn。

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。

销售机构（包括直销机构和其他销售机构）对基金产品进行风险评价，不同的销售机构采用的评价方法不同，因此不同销售机构对基金的风险等级评价结果可能存在不同，且销售机构的风险评价结果与本基金法律文件的风险收益特征表述也可能不一致。

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。

另请投资者注意：与本基金有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站 www.rtfund.com，客服电话 400-883-8088（免长途话费）。

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