

富国纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 基金产品资料概要更新

2024 年 08 月 05 日 (信息截至: 2024 年 08 月 02 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	富国纳斯达克 100ETF (QDII)	基金代码	513870
场内简称	纳指 ETF 富国 (纳指指数)		
上市交易所	上海证券交易所	上市日期	2023 年 11 月 2 日
基金管理人	富国基金管理有限公司	基金托管人	招商银行股份有限公司
基金合同生效日	2023 年 10 月 25 日	基金类型	股票型
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日
交易币种	人民币	境外托管人	花旗银行
基金经理	田希蒙	任职日期	2023 年 10 月 25 日
		证券从业日期	2017 年 05 月 22 日

二、基金投资与净值表现

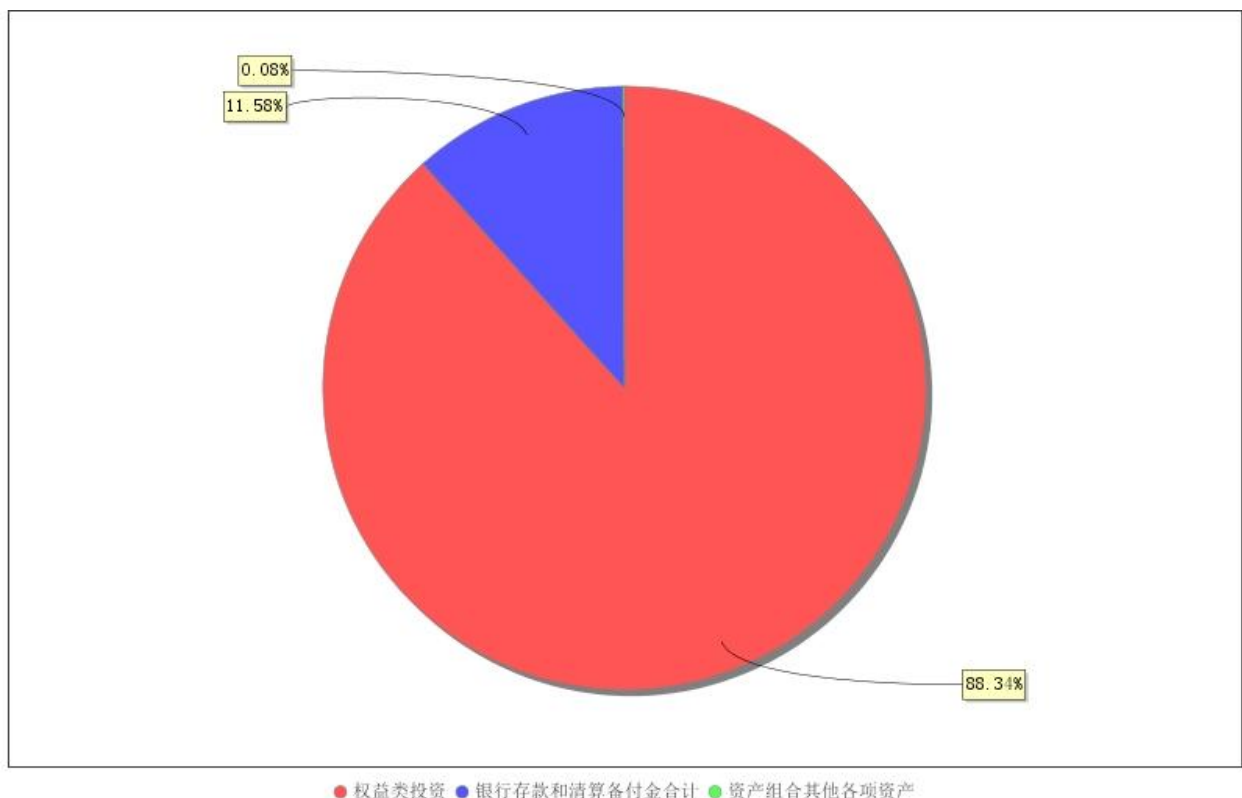
(一) 投资目标与投资策略

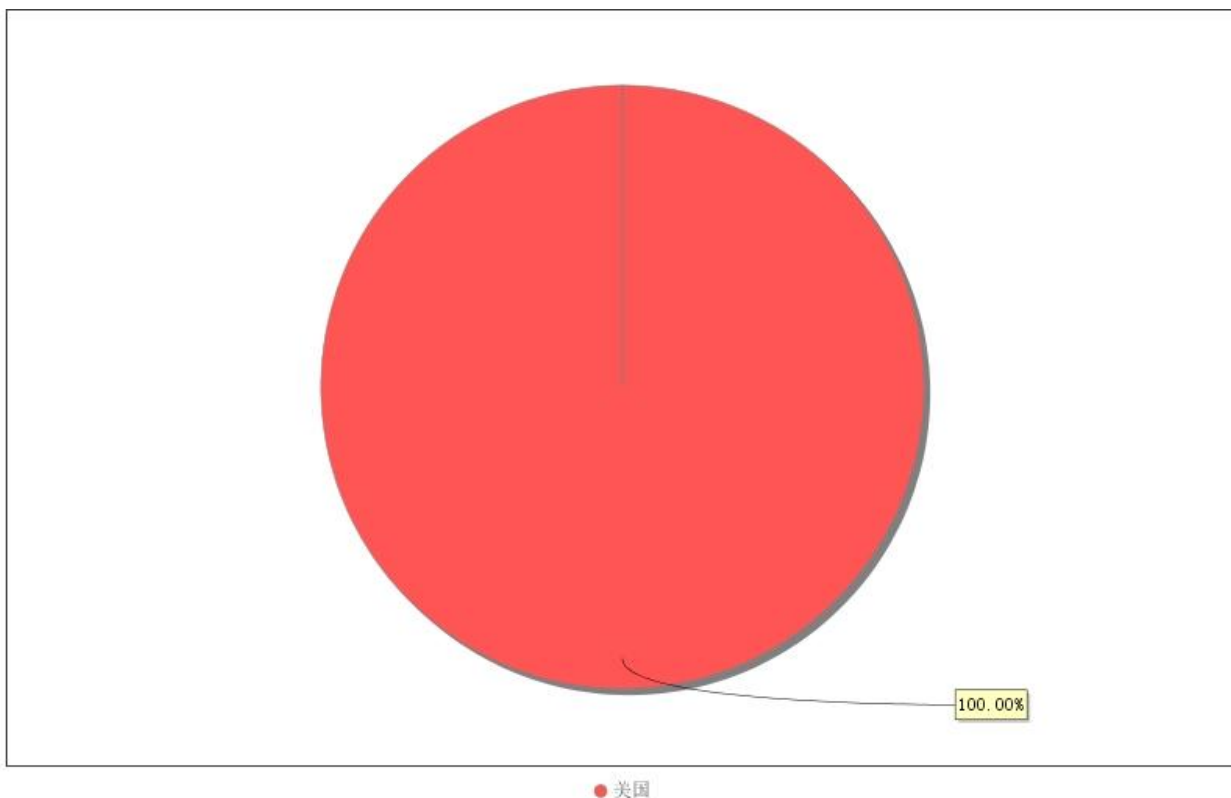
投资目标	紧密跟踪标的指数, 追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资范围	<p>本基金的投资范围主要为标的指数成份股、备选成份股 (均含存托凭证)。为更好地实现投资目标, 本基金可以少量投资于境内、境外市场的其他资产, 包括但不限于其他非成份股的股票、存托凭证。</p> <p>针对境内投资, 本基金可少量投资于国内依法发行上市的股票 (包含主板、科创板、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票)、存托凭证、债券 (国债、央行票据、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券 (含超短期融资券)、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生工具 (股指期货、股票期权等)、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 (但须符合中国证监会相关规定)。</p> <p>本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。</p> <p>针对境外投资, 本基金可投资于下列金融产品或工具:</p> <ol style="list-style-type: none">1、在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金 (含交易型开放式指数基金 ETF);2、已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证;3、政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券;4、银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具;5、远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品;6、与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构化投资产品;7、本基金可以进行境外证券借贷交易、境外正回购交易、逆回购交易。有关证

	<p>券借贷交易的内容以专门签署的三方或多方协议约定为准；</p> <p>8、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。</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和备选成份股（均含存托凭证）的比例不得低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。</p> <p>如法律法规对该比例要求有变更的，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。</p>
主要投资策略	<p>本基金采用完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 3%。本基金的资产配置策略、存托凭证投资策略、可转换债券（含分离交易可转债）及可交换债券投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略、股票期权投资策略、境外市场基金投资策略、境外金融衍生品投资策略详见法律文件。</p>
业绩比较基准	纳斯达克 100 指数收益率（经汇率调整后）
风险收益特征	<p>本基金属于股票型基金，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。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金为投资境外证券的基金，主要投资于美国市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、美国市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。</p>

注：详情请阅读《招募说明书》中“基金的投资”章节的相关内容。

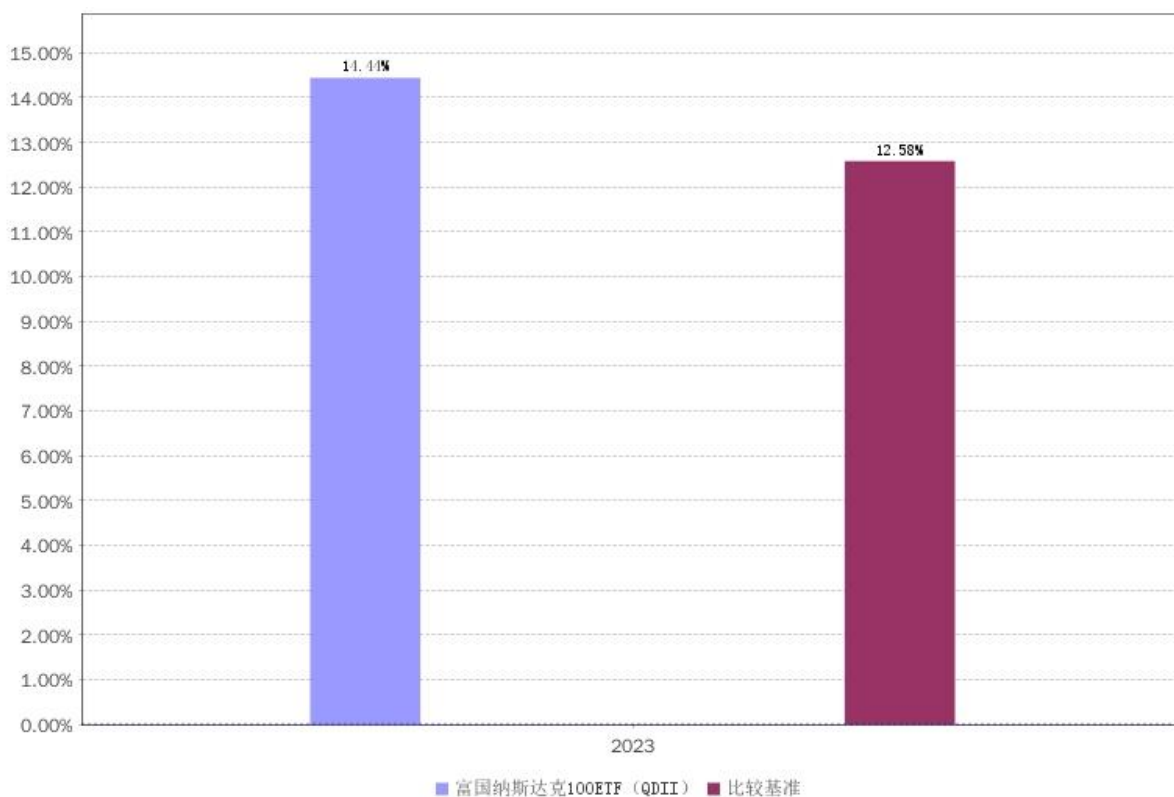
（二）投资组合资产配置图表





注：截止日期 2024 年 06 月 30 日。本基金全球配置图仅指全球权益投资分布情况，权益资产占基金资产净值的比例为 99.06%，其中美国占比为 99.06%。

(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：本基金合同生效日 2023 年 10 月 25 日。业绩表现截止日期 2023 年 12 月 31 日。基金过往业绩不代表未来表现。

三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

注：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超过 0.5% 的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记机构等收取的相关费用。

（二）基金运作相关费用

费用类别	年费率/收费方式	收取方
管理费	0.50%	基金管理人、销售机构
托管费	0.10%	基金托管人
审计费用	13,000.00 元/年	会计师事务所
信息披露费	102,500.00 元/年	规定披露报刊

注：以上费用将从基金资产中扣除；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。审计费用、信息披露费为基金整体承担的年费用金额，非单个份额类别费用。年费用金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。除上述费用外的其他运作费用，详见《招募说明书》中的“基金费用与税收”章节。

（三）基金运作综合费用测算

基金运作综合费率（年化）
1.13%

注：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上表所示。基金管理费率、托管费率为基金现行费率，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。

本基金投资中的风险包括：本基金投资中的风险详见招募说明书“风险揭示”章节，包括因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险。

本基金的特定风险包括：1、投资于境内外市场并以 ETF 方式运作的风险

本基金为境内募集和上市交易、投资于境内外证券市场、跟踪特定指数的交易型开放式指数基金，涉及到境内外多个证券市场（本基金主要投资于美国市场），境外证券交易所、期货交易所、证券与期货登记结算机构的交易规则、业务规则和市场惯例与境内有较大差异，基金管理人和相关市场参与主体涉及跨境业务的处理能力、经验、系统等有待验证，从而导致本基金的运作可能受到影响而带来风险。

2、指数化投资的风险

本基金投资于标的指数成份券和备选成份券（均含存托凭证）的比例不得低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，业绩表现将会随着标的指数的波动而波动；同时本基金在多数情况下将维持较高的股票仓位，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。

3、标的指数的风险

- （1）标的指数波动的风险
- （2）标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险
- （3）标的指数值计算出错的风险
- （4）标的指数编制方案带来的风险
- （5）标的指数变更的风险

4、跟踪误差控制未达约定目标的风险

在正常市场情况下,本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%,年跟踪误差不超过 3%,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。

5、终止清盘风险

未来若出现标的指数不符合要求(因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外)、指数编制机构退出等情形,基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决,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。因而,本基金存在着无法存续的风险。

除以上风险外,本基金还可能存在成份股停牌的风险、指数编制机构停止服务的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、申购赎回清单差错风险、申购及赎回风险、基金管理人代理申赎投资者买券卖券的风险、退市风险、第三方机构服务的风险、本基金投资特定品种的特有风险、参与融资业务的风险、参与转融通证券出借业务的风险、境内发行的存托凭证投资风险、境外(主要为美国市场)投资风险、证券借贷/正回购/逆回购风险、引入境外托管人的风险等。

(二) 重要提示

中国证监会对本基金募集的注册/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。

与本基金或基金合同相关的一切争议将提交位于深圳的深圳国际仲裁院仲裁,仲裁裁决是终局的,对仲裁各方当事人均具有约束力。

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、定期公告等披露文件。

五、 其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站(www.fullgoal.com.cn),客户服务热线:95105686,4008880688(全国统一,免长途话费)

1. 基金合同、托管协议、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