

西藏东财创业板综合增强策略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：2025年09月17日

送出日期：2025年09月18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    | 创业板综指增强ETF                                                                                                                                                                                     | 基金代码       | 159290                 |
| 基金管理人   | 东财基金管理有限公司                                                                                                                                                                                     | 基金托管人      | 金融街证券股份有限公司            |
| 基金合同生效日 | 2025年09月09日                                                                                                                                                                                    | 上市交易所及上市日期 | 深圳证券交易所<br>2025年09月17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    | 开始担任本基金基金经理的日期                                                                                                                                                                                 |            | 证券从业日期                 |
| 杨路炜     | 2025年09月09日                                                                                                                                                                                    |            | 2016年07月18日            |
| 赵肖萌     | 2025年09月09日                                                                                                                                                                                    |            | 2014年07月02日            |
| 其他      | 《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5,000万元情形的，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，基金管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、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。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。 |            |                        |

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

投资者可阅读本基金招募说明书“第十一部分基金的投资”了解详细情况

|      |                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 本基金为增强型指数基金，在力求有效跟踪标的指数的基础上，通过主动化投资管理，力争获取超越指数表现的投资收益。                                                                                                                                                                                                                           |
| 投资范围 | 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，基金还可少量投资于其他股票（非标的指数成份股或其备选成份股，包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、公开发行的次级债、可转换债券（包括分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括定期存款、协议存款等）、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金 |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。</p> <p>本基金可以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>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，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金所持有的股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例不低于80%，投资于标的指数成份股和备选成份股的比例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。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p> <p>如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。</p> <p>本基金跟踪的标的指数为创业板综合指数（399102.SZ）。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 主要投资策略 | <p>本基金作为增强型的指数基金，一方面采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数，另一方面采用主动量化模型调整投资组合力求超越标的指数表现。</p> <p>（1）指数化被动投资策略</p> <p>指数化被动投资策略参照标的指数的成份股、备选成份股及其权重，初步构建投资组合，并按照标的指数的调整规则作出相应调整。</p> <p>（2）量化增强策略</p> <p>量化增强策略主要借鉴国内外成熟的组合投资策略，运用数量化的策略体系构建投资组合，实现在偏离度控制的基础上获取超额收益，主要包括多因子选股策略、事件驱动策略和风险优化策略。基金管理人通过考察市场风格的变化趋势，可选择适宜的策略进行配置。</p> <p>1）多因子选股策略</p> <p>本基金的多因子选股策略通过对上市公司的股价走势、财务报告、卖方分析师研究报告、大数据舆情及投资者行为等信息的跟踪，综合测试各类因子在股票长期表现上所产生的超额收益，构建价值因子、盈利因子、成长因子、动量因子、流动性因子、投资者行为及大数据舆情数据因子等几大类因子。基金管理人可依据特定因子在个股选择上的有效性及因子间的相关性，并且基于市场状态，进行股票筛选，构建和优化投资组合，通过对投资组合进行定期或不定期调整，在合理的偏离度水平下追求超额收益。</p> <p>2）事件驱动策略</p> <p>事件驱动策略是通过分析特定事件对上市公司价值和股价表现的影响，获取特定事件影响所带来的投资回报。基金管理人可根据对特定事件的定性和定量分析，调整成份股及个股权重，从而优化组合获得超额收益的能力。</p> <p>3）风险优化策略</p> <p>本基金为指数增强型基金，在追求超额收益的同时，需要控制跟踪偏离过</p> |

|        |                                                                                                                          |
|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | 大的风险。本基金将根据投资组合相对标的指数的偏离度等因素的分析，对组合跟踪效果进行预估，及时调整投资组合，力求将跟踪误差控制在目标范围内。<br>在正常市场情况下，本基金追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过6.5%。 |
| 业绩比较基准 | 创业板综合指数收益率                                                                                                               |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时，本基金属于指数增强型基金，跟踪标的指数，具有与标的指数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

无。

## （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

无。

## 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：

注：1、投资者在申购基金份额时，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。

2、投资者在赎回基金份额时，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。

3、场内交易费用以证券公司实际收取为准。

4、投资者可阅读本基金招募说明书“第十部分基金份额的申购与赎回”了解基金费用详细情况。

### （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   | 0.50%             | 基金管理人和销售机构 |
| 托管费   | 0.10%             | 基金托管人      |
| 审计费用  | 28,800.00         | 会计师事务所     |
| 信息披露费 | 40,000.00         | 规定披露报刊     |
| 其他费用  | 详见招募说明书的基金费用与税收章节 | 相关服务机构     |

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。

## 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最新公告的招募说明书等销售文件。

基金份额持有人须了解并承受的风险主要有：市场风险；管理风险；流动性风险；本基金的特定风险；投资可转换债券和可交换债券的特定风险；投资资产支持证券的特定风险；投资股指期货的特定风险；投资股票期权的特定风险；参与融资及转融通证券出借业务的特定风险；投资流通受限证券的特定风险；投资国债期货的特定风险；投资存托凭证的特定风险；基金管理人职责终止风险；本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险；投资本基金的其他风险等。

其中，本基金的特定风险主要为：

1、指数化投资风险。2、跟踪偏离风险。3、跟踪误差控制未达约定目标的风险。4、指数编制机构停止服务的风险。5、成份股停牌的风险。6、增强策略失效的风险。7、潜在抢先交易的风险。8、成份股退市的风险。9、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险。10、参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险。11、基金退市的风险。12、申购、赎回风险。13、基金收益分配后基金份额净值低于面值的风险。14、第三方机构服务的风险。

本基金采用证券公司交易结算模式，即本基金将通过基金管理人选定的证券经纪商进行场内交易，并由选定的证券经纪商作为结算参与人代理本基金进行结算。

投资者可阅读本基金招募说明书“第十八部分风险揭示”了解风险提示详细情况。

## （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。

与本基金、本基金基金合同相关的争议解决方式为仲裁。因本基金产生的或与本基金基金合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会根据该会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为上海市。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站：[www.dongcaijijin.com](http://www.dongcaijijin.com)，客服电话：400-9210-107

- 本基金基金合同、托管协议、招募说明书
- 本基金定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 本基金基金份额净值
- 相关基金销售机构及联系方式
- 其他重要资料

## 六、其他情况说明

无。