

兴银上证科创板综合价格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 05 日

送出日期：2025 年 09 月 22 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	兴银上证科创板综合价格 ETF	基金代码	589580
基金管理人	兴银基金管理有限责任公司	基金托管人	招商证券股份有限公司
基金合同生效日	2025 年 05 月 27 日	上市交易所及上市日期	上海证券交易所 2025 年 06 月 11 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	刘帆	开始担任本基金基金经理的日期	2025 年 05 月 27 日
		证券从业日期	2016 年 07 月 06 日

注：本基金场内简称为：科综价格；扩位简称为：科创综指 ETF 兴银；认购代码为：589583。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，基金管理人应当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，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。

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的最小化。
投资范围	本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）。 为更好地实现基金的投资目标，本基金可能少量投资于国内依法发行上市的非成份股（包括创业板、科创板及其他经中国证监会注册或核准上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、央行票据、地方政府债券、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、超

	短期融资券、中期票据等)、债券回购、资产支持证券、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、同业存单、货币市场工具、金融衍生工具(包括股指期货、股票期权等)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。 本基金可以按照法律法规和监管部门的有关规定进行融资以及参与转融通证券出借等相关业务。 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。 基金的投资组合比例为:本基金投资于标的指数成份股、备选成份股(均含存托凭证)的资产比例不低于基金资产净值的90%,且不低于非现金基金资产的80%;股指期货、股票期权及其他金融工具的投资比例按照法律法规或监管机构的规定执行。 如果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。
主要投资策略	1、股票(含存托凭证)投资策略;2、债券投资策略;3、股指期货投资策略;4、股票期权投资策略;5、资产支持证券投资策略;6、融资及转融通证券出借投资策略;7、存托凭证投资策略;8、可转换债券、可交换债券投资策略。
业绩比较基准	上证科创板综合价格指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金,理论上其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金,主要采用最优抽样复制标的指数,具有与标的指数相似的风险收益特征。 本基金投资于科创板股票,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,包括流动性风险、退市风险和投资集中风险等。

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

注:无。

(三) 自基金合同生效以来/最近十年(孰短)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：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	备注
认购费	S<50 万份	0.50%	
	50 万份≤S<100 万份	0.30%	
	S≥100 万份	1000.00 元/笔	

认购费：

基金管理人办理网下现金认购时按照上表所示费率收取认购费用；基金管理人办理网下股票认购时不收取认购费用。投资者可多次网下现金认购，须按每笔认购申请所对应的费率档次分别计费。发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购、网下股票认购时可参照上述费率结构按照不高于 0.5% 的标准收取一定的费用。

申购费：

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。

赎回费：

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

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	0.15%	基金管理人
托管费	0.05%	基金托管人
审计费用	36,000.00	会计师事务所
信息披露费	150,000.00	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。	相关服务机构

注：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。年金额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

注：本基金成立于 2025 年 5 月 27 日。

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。

基金业绩受证券市场价格波动的影响，投资者持有本基金可能盈利，也可能亏损。

本基金属于股票型基金，适合能正确认识和对待本基金可能出现的投资风险的投资者。本基金投资过程中面临的主要风险有：市场风险、流动性风险、信用风险、管理风险、其他风险、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及本基金的特有风险。

本基金特有风险包括：

（1）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。

（2）标的指数波动的风险

标的指数成份股的价格可能受到政治因素、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，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

（3）基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

①由于标的指数调整成份股或变更编制方法，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度与跟踪误差。

②由于标的指数成份股发生配股、增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差。

③标的指数成份股派发现金红利将导致基金收益率偏离标的指数收益率，从而产生跟踪偏离度。

④由于成份股停牌、摘牌或流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生跟踪偏离度和跟踪误差。

⑤由于基金投资过程中的证券交易成本，以及基金管理费和托管费的存在，使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差。

⑥在本基金指数化投资过程中，基金管理人的管理能力，例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对标的指数的跟踪程度。

⑦其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同；因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大；因基金申购与赎回带来的现金变动；因指数发布机构指数编制错误等，由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

⑧本基金采用最优化抽样复制策略，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份股和备选成份股，基金投资组合与标的指数构成可能存在差异，从而可能导致基金实际收益率与标的指数收益率产生偏离。

（4）标的指数变更的风险

尽管可能性很小，但根据基金合同规定，如出现变更标的指数的情形，本基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资政策将会改变，投资组合将随之调整，基金的收益风险特征将与新的标的指数保持一致，投资者须承担此项调整带来的风险与成本。

（5）跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 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。

（6）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，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。投资人将面临转换运作方式，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。

（7）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如下风险：

①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。

②停牌成份股可能因其权重占比、市场复牌预期、现金替代标识等因素影响本基金二级市场价格的折溢价水平。

③若成份股停牌时间较长，在约定时间内仍未能及时买入或卖出的，则该部分款项将按照约定方式进行结算（具体见招募说明书“第十部分 基金份额的申购与赎回”之“七、申购赎回清单的内容与格式”相关约定），由此可能影响投资者的投资损益并使基金产生跟踪偏离度和跟踪误差。

④在极端情况下，标的指数成份股可能大面积停牌，基金可能无法及时卖出成份股以获取足额的符合要求的赎回对价，由此基金管理人可能在申购赎回清单中设置较低的赎回份额上限或者采取暂停赎回的措施，投资者将面临无法赎回全部或部分 ETF 份额的风险。

本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整，由此可能影响投资者的投资损益并使基金产生跟踪偏离度和跟踪误差。

（8）基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

尽管本基金将通过有效的套利机制使基金份额二级市场交易价格的折溢价控制在一定范围内，但基金份额在证券交易所的交易价格受诸多因素影响，存在不同于基金份额净值的情形，即存在价格折溢价的风险。

（9）参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险

基金管理人或基金管理人委托的指数服务机构在开市后根据申购赎回清单和组合证券内各只证

券的实时成交数据计算，并通过上海证券交易所发布基金份额参考净值（IOPV），供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。IOPV 与实时的基金份额净值可能存在差异，IOPV 计算可能出现错误，投资者若参考 IOPV 进行投资决策可能导致损失，需投资者自行承担。

（10）退市风险

因本基金不再符合证券交易所上市条件被终止上市，或被基金份额持有人大会决议提前终止上市，导致基金份额不能继续进行二级市场交易的风险。

（11）投资者申购失败的风险

本基金的申购赎回清单中，可能仅允许对部分成份股使用现金替代，且设置了现金替代比例上限。因此，投资者在进行申购时，可能存在因个别成份股涨停、临时停牌等原因而无法买入申购所需的足够的成份股，导致申购失败的风险。

（12）投资者赎回失败的风险

在投资者提交赎回申请时，如本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，可能导致出现赎回失败的情形。

另外，基金管理人可能根据成份股市值规模变化等因素调整最小申购赎回单位，由此可能导致投资者按原最小申购赎回单位申购并持有的基金份额，可能无法按照新的最小申购赎回单位全部赎回，而只能在二级市场卖出全部或部分基金份额。

（13）赎回对价的变现风险

本基金赎回对价主要为组合证券，在组合证券变现过程中，由于市场变化、部分成份股流动性差等因素，导致投资者变现后的价值与赎回时赎回对价的价值有差异，存在变现风险。

（14）套利风险

由于证券市场的交易机制和技术约束，完成套利需要一定的时间，因此套利存在一定风险。同时，买卖一篮子股票和 ETF 存在冲击成本和交易成本，所以折溢价在一定范围之内也不能形成套利。另外，当一篮子股票中存在涨停或临时停牌的情况时，也会由于买不到成份股而影响溢价套利，或卖不掉成份股而影响折价套利。

（15）申购赎回清单差错风险

如果基金管理人提供的当日申购赎回清单内容出现差错，包括组合证券名单、数量、现金替代标志、现金替代比率、替代金额等出错，将会使投资人利益受损或影响申购赎回的正常进行。

（16）第三方机构服务的风险

本基金的多项服务委托第三方机构办理，存在以下风险：

① 申购赎回代理券商因多种原因，导致代理申购、赎回业务受到限制、暂停或终止，由此影响对投资者申购赎回服务的风险。

② 登记机构可能调整结算制度，如对投资者基金份额、组合证券及资金的结算方式发生变化，制度调整可能给投资者带来理解偏差的风险。同样的风险还可能来自于证券交易所及其他代理机构。

③ 第三方机构可能违约，导致基金或投资者利益受损的风险。

（17）本基金投资特定品种的特有风险

① 本基金投资范围包括股指期货、股票期权等金融衍生品，股指期货、股票期权等金融衍生

品投资可能给本基金带来额外风险，包括杠杆风险、期货或期权价格与基金投资品种价格的相关度降低带来的风险等，由此可能增加本基金净值的波动性。

② 本基金的投资范围包括资产支持证券，资产支持证券存在一定的信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险，由此可能给基金净值带来不利影响或损失。

③ 本基金可参与融资业务。融资业务存在信用风险、投资风险和合规风险等风险。具体而言，信用风险是指本基金在融资业务中，因交易对手方违约无法按期偿付本金、利息等证券相关权益，导致基金资产损失的风险。投资风险是指本基金在融资业务中，因投资策略失败、对投资标的预判失误等导致基金资产损失的风险。合规风险是指由于违反相关监管法规，从而受到监管部门处罚的风险，主要包括业务超出监管机关规定范围、风险控制指标超过监管部门规定阈值等。

④ 本基金可参与转融通证券出借业务，面临的的风险包括但不限于：1）流动性风险：面临大额赎回时，可能因证券出借原因发生无法及时变现支付赎回款项的风险；2）信用风险：证券出借对手方可能无法及时归还证券、无法支付相应权益补偿及借券费用的风险；3）市场风险：证券出借后可能面临出借期间无法及时处置证券的市场风险。

⑤ 本基金投资于科创板股票，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，包括流动性风险、退市风险和投资集中风险等。

⑥ 本基金可投资国内依法发行上市的存托凭证，基金净值可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响，与存托凭证的境外基础证券、境外基础证券的发行人及境内外交易机制相关的风险可能直接或间接成为本基金风险。

（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。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[www.hffunds.cn]、客服电话[40000-96326]

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

六、其他情况说明

无。