

融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF) (AB 类份额)

基金产品资料概要更新 (2023 年第 4 号)

编制日期: 2023 年 11 月 16 日

送出日期: 2023 年 11 月 17 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	融通巨潮 100 指数 (LOF)	基金代码	161607	
下属基金简称	融通巨潮 100 指数 A/B	下属基金交易代码	161607	
下属基金前端交易代码	161607	下属基金后端交易代码	161657	
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	2005 年 5 月 12 日	上市交易所及上市日期	深圳证券交易所	2005 年 6 月 16 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	蔡志伟	开始担任本基金基金经理的日期	2015 年 2 月 11 日	
		证券从业日期	2011 年 6 月 15 日	
基金经理	熊俊杰	开始担任本基金基金经理的日期	2023 年 10 月 17 日	
		证券从业日期	2018 年 12 月 5 日	
其他	本基金场内扩位简称: 巨潮 100LOF			

二、基金投资与净值表现

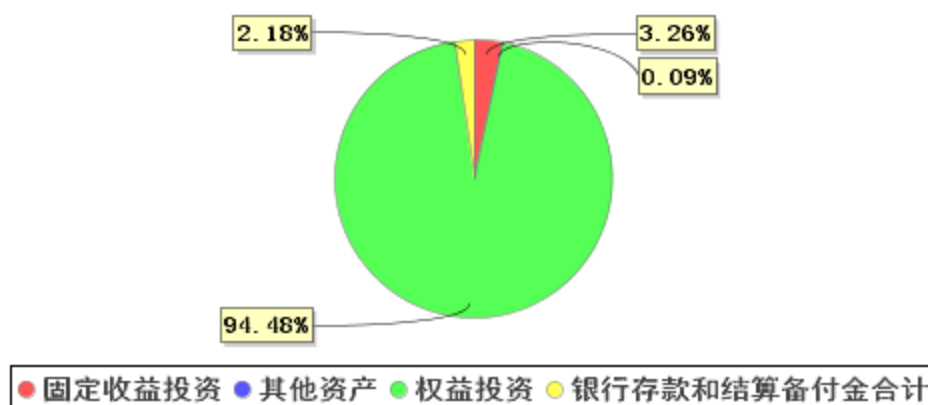
(一) 投资目标与投资策略

投资目标	本基金为增强型指数基金。在控制股票投资组合相对巨潮 100 目标指数跟踪误差的基础上, 力求获得超越巨潮 100 目标指数的投资收益, 追求长期的资本增值。本基金谋求分享中国经济的持续、稳定增长和中国证券市场发展的成果, 实现基金财产的长期增长, 为投资者带来稳定的回报。
投资范围	本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括投资于国内依法公开发行、上市的股票 (含存托凭证) 和债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的股票投资部分主要投资于目标指数的成份股票, 包括巨潮 100 指数的成份股和预期将要被选入巨潮 100 指数的股票, 本基金还可适当投资一级市场的股票 (包括新股与增发)。非成份股的投资比例控制在基金资产净值的 10% 以内, 但成份股更换期因指数成份股调整而进行的非成份股投资不在此比例限制范围之内。

主要投资策略	本基金为增强型指数基金，在控制股票投资组合相对目标指数偏离风险的基础上，力争获得超越目标指数的投资收益。基金以指数化分散投资为主要投资策略，在此基础上进行适度的主动调整，在数量化投资技术与基本面深入研究的结合中谋求基金投资组合在偏离风险及超额收益间的最佳匹配。为控制基金偏离目标指数的风险，本基金力求将基金份额净值增长率与目标指数增长率间的日跟踪误差控制 0.5%。
业绩比较基准	巨潮 100 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%
风险收益特征	风险和预期收益率接近市场平均水平

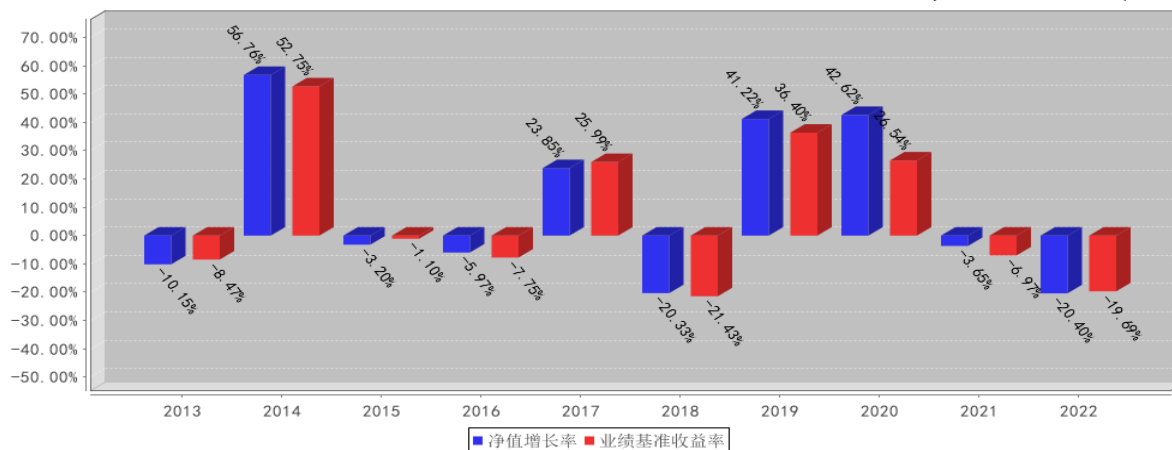
(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表 (2023年9月30日)



(三) 最近十年基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

融通巨潮100指数A/B基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图 (2022年12月31日)



注：基金的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

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
认购费	M<100 万元	1.2%

	100 万元 \leq M<1000 万元	1.0%
	1000 万元 \leq M<2000 万元	0.5%
	M \geq 2000 万元	2,000 元/笔
申购费 (前收费)	M<100 万元	1.5%
	100 万元 \leq M<1000 万元	1.2%
	1000 万元 \leq M<2000 万元	0.6%
	M \geq 2000 万元	2,000 元/笔
申购费 (后收费)	N<1 年	1.8%
	1 年 \leq N<2 年	1.35%
	2 年 \leq N<3 年	0.9%
	3 年 \leq N<4 年	0.45%
	N \geq 4 年	0.0
赎回费	N<7 日	1.5%
	7 日 \leq N<1 年	0.5%
	1 年 \leq N<3 年	0.25%
	N \geq 3 年	0.0

认购费

本基金 A 类基金份额场内外认购费率相同。

申购费

基金管理人可以对养老金客户开展申购费率优惠活动, 详见基金管理人发布的相关公告。

赎回费

(1) 投资者场内赎回 A 类基金份额的具体费率如下: 当持有期限 (N): N<7 日, A 类基金份额的场内赎回费率为 1.50%; 当持有期限 (N): N \geq 7 日, A 类基金份额的场内赎回费率为 0.50%。

(2) 基金管理人可以对养老金客户开展赎回费率优惠活动, 详见基金管理人发布的相关公告。

(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
管理费	1.2%
托管费	0.2%

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。

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、购买力风险)、信用风险、流动性风险、管理风险、操作或技术风险、合规性风险、与目标指数偏离风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、指数编制机构停止服务的风险、成份股停牌的风险、上市交易的风险、如投资科创板可能存在的风险、本基金投资存托凭证的风险及其他风险。其中, 本基金特有风险包括:

1、与目标指数偏离风险

本基金采用的增强性投资策略将产生跟踪误差,基金增强部分的风险收益特征可能有别于指数本身。为控制基金偏离目标指数的风险,本基金力求将基金份额净值增长率与目标指数增长率间的日跟踪误差控制在 0.5%以内,但由于各种原因可能造成两者间偏离度增加的风险。

2、跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力求将基金份额净值增长率与目标指数增长率间的日跟踪误差控制在 0.5%,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。

3、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。

4、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、市场复牌预期等因素影响本基金二级市场价格折溢价水平。

5、上市交易的风险

本基金在深圳证券交易所挂牌上市,由于上市期间可能因信息披露导致基金停牌,投资者在停牌期间不能买卖基金,产生风险;同时,可能因交易对手不足导致基金流动性风险;另外,当基金份额持有人将份额转向场外交易后导致场内的基金份额或持有人数不满足上市条件时,本基金存在暂停上市或终止上市的可能。

6、如投资科创板可能存在的风险

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。

7、本基金投资存托凭证的风险

本基金的投资范围包括存托凭证,可能面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险,以及与存托凭证发行机制相关的风险,包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险;存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险;存托协议自动约束存托凭证持有人的风险;因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险;存托凭证持有人权益被摊薄的风险;存托凭证退市的风险;已在境外上市的基础证券发行人,在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险;境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

(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。

本基金标的指数为巨潮 100 指数。有关标的指数具体编制方案详见招募说明书“二十六、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,除经友好协商可以解决的,则任何一方有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据提交仲裁时该会的仲裁规则进行仲裁。

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