

招商上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (A 类份额) 基金产品资料概要更新

编制日期：2024 年 12 月 2 日

送出日期：2024 年 12 月 6 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 | 招商上证消费 80ETF 联接 | 基金代码 | 217017 |
| 下属基金简称 | 招商上证消费 80ETF 联接 A | 下属基金代码 | 217017 |
| 基金管理人 | 招商基金管理有限公司 | 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2010 年 12 月 8 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 | 许荣漫 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2021 年 4 月 22 日 |
| | | 证券从业日期 | 2015 年 6 月 11 日 |
| 其他 | - | | |

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

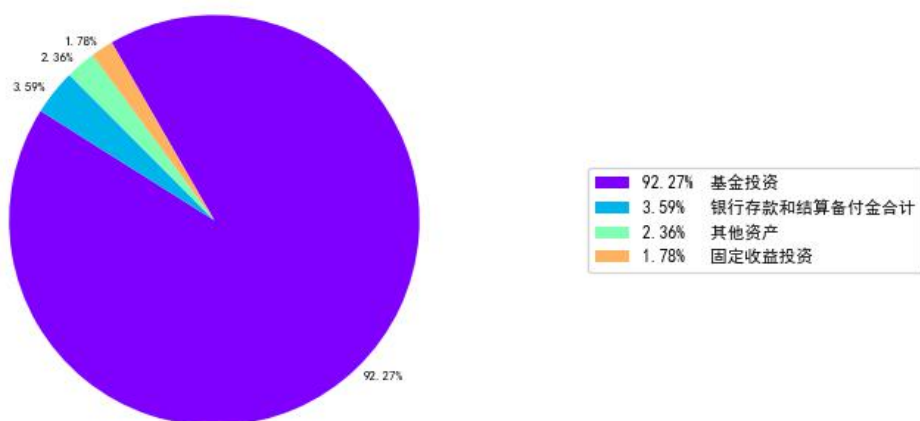
投资者可阅读本基金《招募说明书》“基金的投资”章节了解详细情况。

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 通过主要投资于上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金，密切跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 |
| 投资范围 | 本基金主要投资于上证消费 80ETF、上证消费 80 指数成份券和备选成份券。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于新股、存托凭证、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中投资于上证消费 80ETF 的比例不少于基金资产净值的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 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。 |
| 主要投资策略 | 本基金为上证消费 80ETF 的联接基金，主要通过投资于上证消费 80ETF，实现对业绩基准的紧密跟踪，力争将日均跟踪偏离度的控制在 0.3% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。 |

| | |
|--------|--|
| | 本基金主要投资策略包括：1、资产配置策略；2、目标 ETF 投资策略；3、股票投资策略；4、债券投资策略；5、其他金融工具投资策略；6、跟踪误差、跟踪偏离度控制策略；7、存托凭证投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 上证消费 80 指数收益率*95%+商业银行活期存款利率(税后)*5% |
| 风险收益特征 | 本基金为上证消费 80ETF 的联接基金，属于股票型基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金，在证券投资基金中属于较高风险、较高收益的投资品种；并且本基金为被动式投资的指数基金，跟踪上证消费 80 指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。根据 2017 年 7 月 1 日施行的《证券期货投资者适当性管理办法》，基金管理人和销售机构已对本基金重新进行风险评级，风险评级行为不改变本基金的实质性风险收益特征，但由于风险等级分类标准的变化，本基金的风险等级表述可能有相应变化，具体风险评级结果应以基金管理人和销售机构最新的评级结果为准。 |

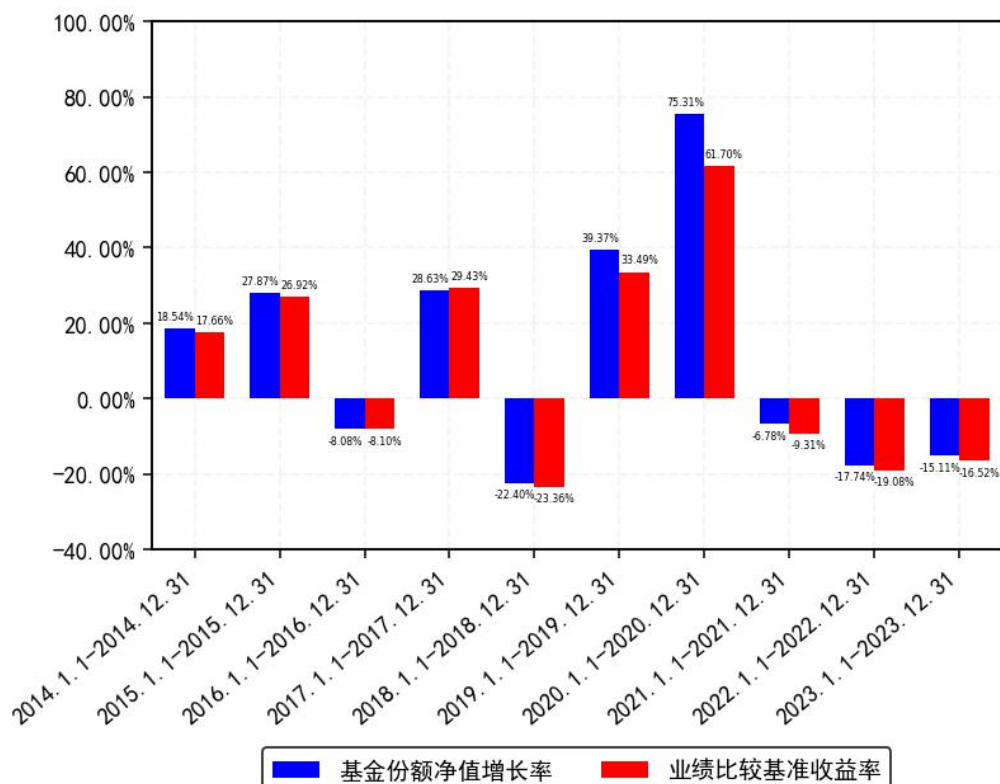
(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图（2024年9月30日）



(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

招商上证消费80ETF联接A每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



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 |
|----------|-------------------------|-----------|----|
| 申购费(前收费) | M < 100 万元 | 1.5% | - |
| | 100 万元 ≤ M < 500 万元 | 0.8% | - |
| | 500 万元 ≤ M < 1000 万元 | 0.4% | - |
| | 1000 万元 ≤ M | 每笔 1000 元 | - |
| 赎回费 | N < 7 天 | 1.5% | - |
| | 7 天 ≤ N < 365 天 | 0.5% | - |
| | 365 天 ≤ N < 730 天 | 0.25% | - |
| | 730 天 ≤ N | 0% | - |

注：基金管理人可以针对特定投资人（如养老金客户等）开展费率优惠活动，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/年费率或金额 | 收取方 |
|------|-------------|-----|
|------|-------------|-----|

| | | |
|---------|---|------------|
| 管理费 | 年费率：0.50% | 基金管理人和销售机构 |
| 托管费 | 年费率：0.10% | 基金托管人 |
| 销售服务费 | - | 销售机构 |
| 审计费用 | 年费用金额：20,000.00 元 | 会计师事务所 |
| 信息披露费 | 年费用金额：120,000.00 元 | 规定披露报刊 |
| 指数许可使用费 | - | 指数编制公司 |
| 其他费用 | 《基金合同》生效后与基金相关的律师费、基金份额持有人大会费用、基金的证券交易费用、基金的银行汇划费用、基金相关账户的开户及维护费用等费用，以及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。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、审计费用、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。

3、支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后的剩余部分的基金资产净值（若为负数，则取 0） $\times 0.50\%$ 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

4、支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后的剩余部分的基金资产净值（若为负数，则取 0） $\times 0.10\%$ 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

（三）基金运作综合费用测算

若投资者申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

| 基金运作综合费率（年化） |
|--------------|
| 0.67% |

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。

一) 本基金特定风险如下：

1、目标 ETF 的风险

本基金属于 ETF 联接基金，主要投资于目标 ETF，因此目标 ETF 面临的风险可能直接或间接成为本基金的风险。

本基金为目标 ETF 的联接基金，但是本基金在投资限制、运作机制和投资策略等方面与目标 ETF 并不完全相同，不能保证本基金的表现与目标 ETF 的表现完全一致。

2、标的指数的风险

(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相应股票市场,标的指数成份券的平均回报率与相应股票市场的平均回报率可能存在偏离。

(2) 标的指数变更的风险

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。

(3) 标的指数波动的风险

标的指数成份券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

以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离:

(1) 本基金 90%以上的净资产投资于目标 ETF,目标 ETF 回报与标的指数回报的偏离会造成本基金与标的指数的跟踪偏离;

(2) 本基金有投资成本、各种费用及税收,而指数编制不考虑费用和税收,这将导致本基金收益率落后于标的指数收益率,产生负的跟踪偏离度;

(3) 受市场流动性风险的影响,本基金在实际管理过程中,由于投资者申购而增加的资金可能不能及时地转化为目标 ETF 份额和指数成份券、或在面临投资者赎回时无法以赎回价格将目标 ETF 份额和指数成份券及时地转化为现金,使得本基金在跟踪标的指数时存在一定的跟踪偏离风险;

(4) 在本基金实行指数化投资过程中,基金管理人对于指数基金的管理能力,例如跟踪标的指数的水平、技术手段、买入卖出证券的时机选择等,都会对本基金的收益产生影响,从而影响本基金相对于对标的指数的偏离程度。

4、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 0.3% 以内,年化跟踪误差控制在 4% 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。

5、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,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。

6、成份券停牌的风险

标的指数成份券可能因各种原因临时或长期停牌,发生成份券停牌时,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。

7、存托凭证的投资风险

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) 本基金面临的其他风险如下:

1、证券市场风险,主要包括:(1)政策风险;(2)经济周期风险;(3)利率风险;(4)上市公司经营风险;(5)购买力风险;

2、流动性风险,主要包括:(1)基金申购、赎回安排;(2)拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估;(3)巨额赎回情形下的流动性风险管理措施;(4)实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响;

3、管理风险;

4、其他风险,主要包括:(1)操作风险;(2)技术风险;(3)法律风险;(4)其他风险;

5、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。

具体内容详见本基金《招募说明书》。

(二) 重要提示

中国证监会对本基金募集的核准,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。

各方当事人同意,因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议,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,仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力,仲裁费由败诉方承担。

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.cmfchina.com 客服电话:400-887-9555

- 《招商上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》、
- 《招商上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》、
- 《招商上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》
- 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

