

富国创业板指数分级证券投资基金

基金产品资料概要更新

2020年08月28日（信息截至：2020年08月27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	富国创业板指数分级	基金代码	161022
分级 A 简称	富国创业板指数分级 A	分级 A 代码	150152
分级 B 简称	富国创业板指数分级 B	分级 B 代码	150153
场内简称	创业分级		
上市交易所	深圳证券交易所	上市日期	2013年9月30日
基金管理人	富国基金管理有限公司	基金托管人	中国建设银行股份有限公司
基金合同生效日	2013年09月12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		
基金经理	王保合	任职日期	2013-09-12
		证券从业日期	2006-07-01

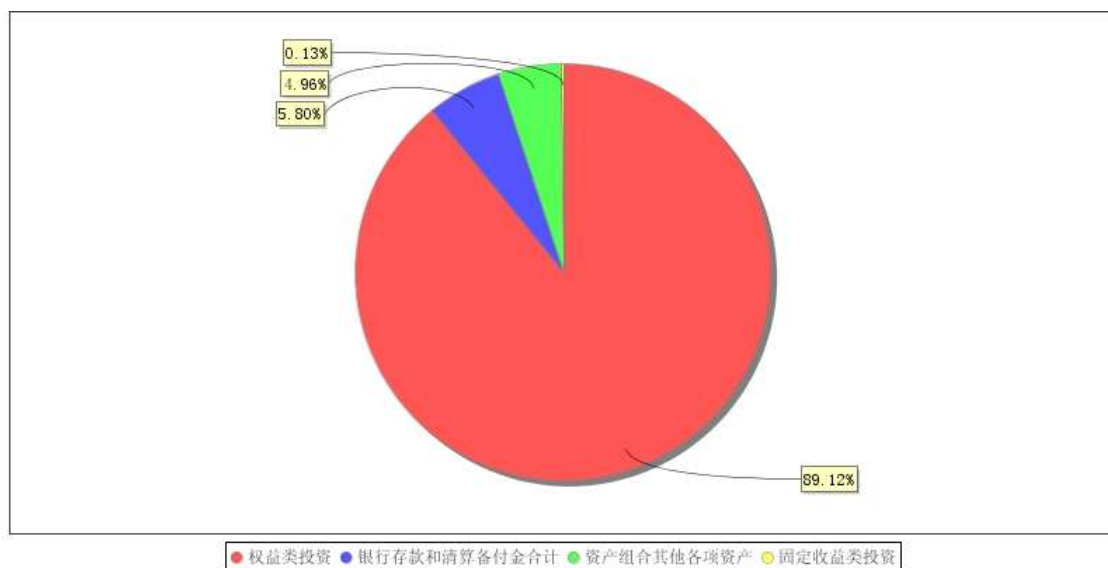
二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪创业板指数。在正常市场情况下，力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。
投资范围	本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括创业板指数的成份股、备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、固定收益产品、货币市场工具、权证及法律法规或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的相关规定）。 本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于创业板指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 80%。
主要投资策略	本基金主要采用完全复制法进行投资，依托富国量化投资平台，利用长期稳定的风险模型和交易成本模型，按照成份股在创业板指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合、跟踪创业板指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。本基金的资产配置策略、股票投资组合构建策略、债券、金融衍生工具投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	95%×创业板指数收益率 + 5%×银行人民币活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基金份额来看，富国创业板 A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征；富国创业板 B 份额具有高风险、高预期收益的特征。

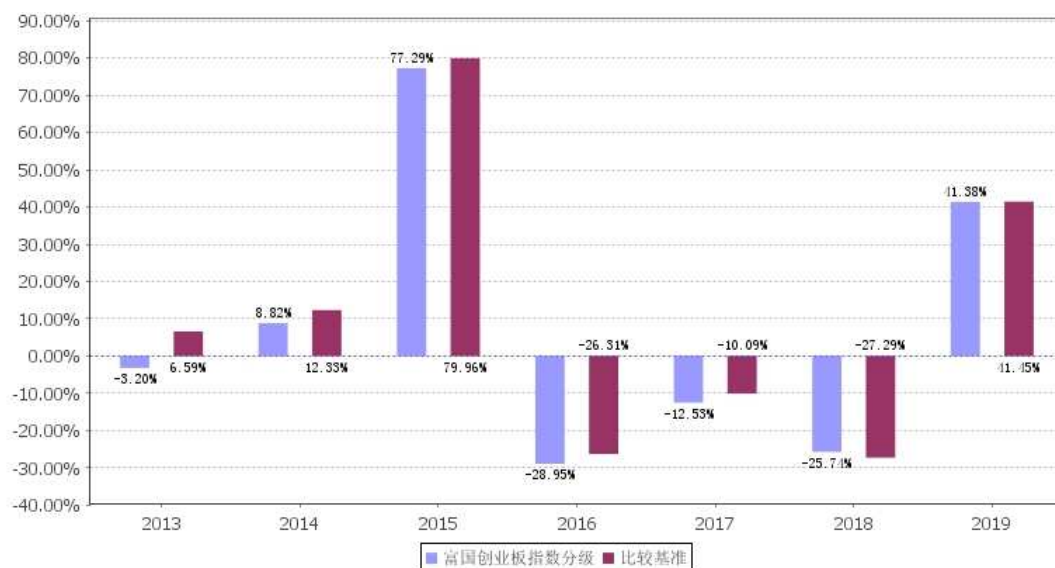
注：详情请阅读《招募说明书》中“基金的投资”章节的相关内容。

（二）投资组合资产配置图表



注：截止日期 2020 年 06 月 30 日。

（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 2013 年 09 月 12 日。业绩表现截止日期 2019 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

费用类型	金额 (M) / 持有期限 (N)	费率 (普通客户)	费率 (特定客户)
申购费 (前端)	M < 100 万	1.2%	0.12%
	100 万 ≤ M < 500 万	0.8%	0.08%
	M ≥ 500 万	1000 元/笔	1000 元/笔
赎回费	N < 7 天	1.5%	
	N ≥ 7 天	0.5%	

注：以上费用在投资者申购/赎回基金过程中收取，特定客户的具体含义请见《招募说明书》相关内容。场内交易费用以证券公司实际收取为准。场内申购费率由基金代销机构比照以上场外申购费率执行，场内赎回费率与以上场外赎回费率一致。

（二）基金运作相关费用

费用类别	年费率/收费方式
管理费	1.00%
托管费	0.22%
指数许可使用费	0.02%

注：以上费用将从基金资产中扣除；本基金交易证券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。

本基金投资中的风险包括：指数投资风险、流动性风险、信用风险、市场风险、合规性风险、交易风险、各项相关业务的操作风险、业务运作的技术系统风险、本基金运作的特有风险等。

本基金的特定风险包括：

1、杠杆机制风险

本基金为复制指数的股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基金份额来看，富国创业板 A 份额具有低风险、收益相对稳定的特征；富国创业板 B 份额具有高风险、高预期收益的特征。由于富国创业板 B 份额内含杠杆机制的设计，富国创业板 B 份额的净值的变动幅度将大于富国创业板份额和富国创业板 A 份额的净值的变动幅度，即富国创业板 B 份额的净值变动的波动性要高于其他两类份额。富国创业板 A 份额和富国创业板 B 份额上市交易后，由于受到市场供求关系的影响，基金份额的交易价格与基金份额净值可能出现偏离并出现折/溢价风险。尽管份额配对转换套利机制的设计已将富国创业板 A 份额和富国创业板 B 份额的折/溢价风险降至较低水平，但是该制度不能完全规避该风险的存在。

2、风险收益特征变化风险

由于基金份额折算的设计，在富国创业板份额净值达到 1.500 元后，本基金将进行份额不定期份额折算。原富国创业板 B 份额持有人将会获得一定比例的富国创业板份额，因此原富国创业板 B 份额持有人所持有的部分基金份额的风险收益特征将会发生改变。

由于基金份额折算的设计，在富国创业板 B 份额的净值达到 0.250 元后，本基金将进行份额不定期份额折算。原富国创业板 A 份额持有人将会获得一定比例的富国创业板份额，因此，原富国创业板 A 份额持有人所持有的部分基金份额的风险收益特征将会发生改变。

3、份额折算风险

①在基金份额折算过程中由于尾差处理而可能给投资人带来损失。

②份额折算后新增份额有可能面临无法赎回的风险。

除以上风险外，本基金还可能存在指数投资风险、上市交易风险、份额配对转换业务中存在的风险、基金折算新增份额的收益风险等基金运作的特定风险。

（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北京的中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁，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