

易米国证消费100指数增强型发起式证券投资基金

基金产品资料概要更新

编制日期：2024年6月27日

送出日期：2024年6月28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	易米国证消费100指数增强发起	基金代码	013926
基金简称A	易米国证消费100指数增强发起A	基金代码A	013926
基金简称C	易米国证消费100指数增强发起C	基金代码C	013927
基金管理人	易米基金管理有限公司	基金托管人	兴业银行股份有限公司
基金合同生效日	2021年11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	王磊	开始担任本基金基金经理的日期	2021年11月11日
		证券从业日期	2007年6月25日
	贺文奇	开始担任本基金基金经理的日期	2023年6月1日
		证券从业日期	2014年10月1日
其他	基金合同生效满三年之日（指自然日），若基金规模低于2亿元的，基金合同应当终止，无需召开基金份额持有人大会审议决定即可按照基金合同约定的程序进行清算，并不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。		

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及其更新“第九部分基金的投资”了解详细情况。

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对国证消费100指数进行有效跟踪的基础上，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年化跟踪误差不超过8%。
投资范围	本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国证消费100指数的成份股和备选成份股（均含存托凭证）、其他股票（包括创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、固定收益资产（国债、金融债、企业债、公司债、证券公司短期公司债券、次级债、可转换债券、公募可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、货币市场工具、银行存款（包括银行定期存款、银行协议存款、银行通知存款等）等）、股指期货、国债期货等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)。

本基金将按照法律法规相关规定参与融资与转融通证券出借业务。

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:本基金的股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产的80%,其中投资于国证消费100指数成份股和备选成份股(均含存托凭证)的资产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。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计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。

本基金跟踪的标的指数为国证消费100指数(399364.SZ)。

主要投资策略

本基金以国证消费100指数为标的指数,在有效复制标的指数、控制投资组合与业绩比较基准跟踪误差的基础上,结合定性和定量的选股方式对投资组合进行积极的管理与风险控制,力争获得超越业绩比较基准的收益。

业绩比较基准

国证消费100指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%

风险收益特征

本基金属于采用指数化操作的股票型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。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

数据截止日:2024年03月31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

基金的过往业绩不代表未来表现，数据截止日：2023年12月31日
单位%



基金的过往业绩不代表未来表现，数据截止日：2023年12月31日
单位%



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：

易米国证消费100指数增强发起A

费用类型	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	1.20%	
	100万元≤M<200万元	0.60%	
	200万≤M<500万元	0.40%	
	500万元≤M	1000.00元/笔	
赎回费	N<7天	1.50%	

7天≤N<360天	0.50%
360天≤N<720天	0.25%
720天≤N	0.00%

易米国证消费100指数增强发起C

费用类型	金额 (M) /持有期限 (N)	收费方式/费率	备注
申购费 (前收费)			C类份额不收取申购费
赎回费	N<7天	1.50%	
	7天≤N<30天	0.50%	
	30天≤N	0.00%	

(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	收取方
管理费	1.20%	基金管理人和销售机构
托管费	0.05%	基金托管人
销售服务费C	0.40%	销售机构
审计费用	20,000.00	会计师事务所
信息披露费	0.00	规定披露报刊
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用、会计师费、审计费、律师费、仲裁费和诉讼费等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。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。

(三) 基金运作综合费用测算

若投资者认购/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：

易米国证消费100指数增强发起A

基金运作综合费用测算明细的类别	基金运作综合费率 (年化)
持有期间运作费	1.36%

注：基金管理费率、托管费率为基金现行费率，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。

易米国证消费100指数增强发起C

基金运作综合费用测算明细的类别	基金运作综合费率 (年化)
持有期间运作费	1.76%

注：基金管理费率、托管费率为基金现行费率，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、启用侧袋机制的风险、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等风险。

其中，本基金的特定风险主要为：

1、指数化投资风险

本基金主要投资标的指数的成份股和备选成份股，本基金的资产净值会随标的指数的波动而波动。

2、主动增强投资的风险

本基金采用指数增强投资策略，在参考标的指数成份股的构成及其权重的基础上根据量化模型对个股选择及个股权重进行主动调整，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。这种基于对宏观经济、基本面等深度研究、通过基金管理人开发的量化选股模型做出优化调整投资组合的决策，最终结果仍然存在一定的不确定性，其投资收益率可能高于标的指数收益率但也有可能低于标的指数收益率，存在与标的指数的收益率发生偏离的风险。

3、采用量化投资策略的风险

本基金在参考标的指数成份股的构成及其权重的基础上根据量化模型对个股选择及个股权重进行主动调整，运用数量化的策略体系构建投资组合，所带来的特定风险包括但不限于：

（1）模型失效风险。本基金的投资运用各种量化模型，存在量化模型失效导致基金业绩收益不佳的风险。一方面，面对不断变换的市场环境，量化投资策略所遵循的模型理论均处于不断发展和完善的过程中，当前使用的理论和工具有可能存在适用性问题；另一方面，在量化模型的实际运用中，核心参数假定的变动均可能影响整体效果的稳定性。

（2）数据准确性不可靠的风险。本基金建立量化模型的数据来源包括宏观数据、行业信息、上市公司基本财务数据、证券及期货市场交易行情数据、卖方分析师预期及评级数据等多种数据，广泛涵盖各类信息源，相关数据来源于不同数据提供商，且按不同的需求和规范进行预处理。量化模型对相关数据的准确性和可靠性依赖较高，个别研究报告或其它材料的数据是否准确可靠，对本基金的业绩表现有所影响。

（3）数据传输处理系统崩溃的风险。量化模型获取市场、交易等多维度数据依赖于数据传输系统，对数据进行运算分析依赖于计算机处理系统，在数据传输处理系统崩溃的极端情况下，量化模型无法正常运作并指导投资，将对本基金的收益产生影响。

4、跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年化跟踪误差不超过8.00%，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发布、管理和维护，本基金将根据基金合同的约定自相关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) 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款项, 由此基金管理人可能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基金份额的风险。

7、成份股退市的风险

指数成份股发生明显负面事件面临退市风险, 且指数编制机构暂未作出调整的, 基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则, 根据相关法律法规、监管部门要求, 履行内部决策程序后及时调整。

8、本基金基金合同生效之日起三年后的对应日(该对应日如为非工作日, 则自动顺延至下一个工作日), 如基金资产规模低于2亿元时, 基金合同自动终止, 届时投资者将面临基金资产变现及其清算等带来的不确定性风险。

投资者可阅读本基金招募说明书及其更新“风险揭示”了解风险提示详细情况。

(二) 重要提示

易米国证消费100指数增强型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经2021年9月30日中国证监会证监许可(2021)3183号文准予募集注册。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.yimifund.com, 客服电话: 4006-046-899

- 本基金基金合同、托管协议、招募说明书及其更新
- 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