

## 西藏东财中证沪港深互联网指数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06月26日

送出日期：2024年06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    | 东财沪港深互联网指数   | 基金代码           | 012371     |
| 基金简称A   | 东财沪港深互联网指数A  | 基金代码A          | 012371     |
| 基金简称C   | 东财沪港深互联网指数C  | 基金代码C          | 012372     |
| 基金简称E   | 东财沪港深互联网指数E  | 基金代码E          | 021358     |
| 基金管理人   | 西藏东财基金管理有限<br>公司   | 基金托管人          | 广发证券股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2021年06月01日  | 上市交易所及上<br>市日期 | 未上市        |
| 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    | 开始担任本基金基金经理的日期   | 证券从业日期         |            |
| 吴逸      | 2021年06月01日  | 2010年06月28日    |            |
| 其他      | 发起式基金运作风险提示：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），若基金资产净值低于2亿元人民币的，本基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。若届时的法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充时，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。 |                |            |

## 二、基金投资与净值表现

## (一) 投资目标与投资策略

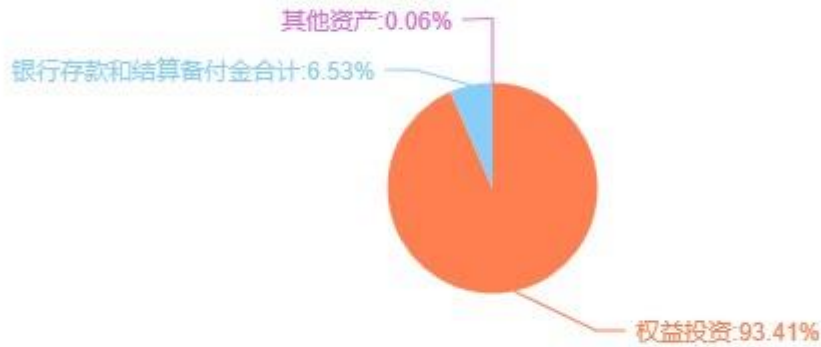
投资者可阅读本基金招募说明书“第九部分基金的投资”了解详细情况

|      |  |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争获取与标的指数表现相一致的长期投资收益。  |
| 投资范围 | 本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，基金还可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，包括主板、创业板及其他经中国证监会核准上市或注册上市的股票、港股通标的股票、存托凭证）、债券（包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、证券公司短期公司债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券（包括分离交易可转债）、 |

|        |   |
|--------|---|
|        | <p>可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括定期存款、协议存款等）、货币市场工具、股指期货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（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。</p> <p>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。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%且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。</p> <p>本基金通过港股通机制投资标的指数的成份股、备选成份股，未来如果港股通业务规则发生变化或出现法律法规或监管部门允许投资的其他模式，基金管理人可在履行适当程序后相应调整。</p> <p>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。</p> <p>本基金跟踪的标的指数为中证沪港深互联网指数（930625.CSI）。</p> |
| 主要投资策略 | <p>本基金原则上采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。本基金主要按照标的指数的成份股及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以达到复制和跟踪标的指数的目的。本基金在控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。在正常市场情况下，本基金力争将基金份额净值的增长率与业绩比较基准的收益率的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。</p>  |
| 业绩比较基准 | <p>中证沪港深互联网指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%</p>  |
| 风险收益特征 | <p>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、混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。</p> <p>本基金还可投资港股通标的股票。本基金投资港股通标的股票的，除了需要承担与内地证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>  |

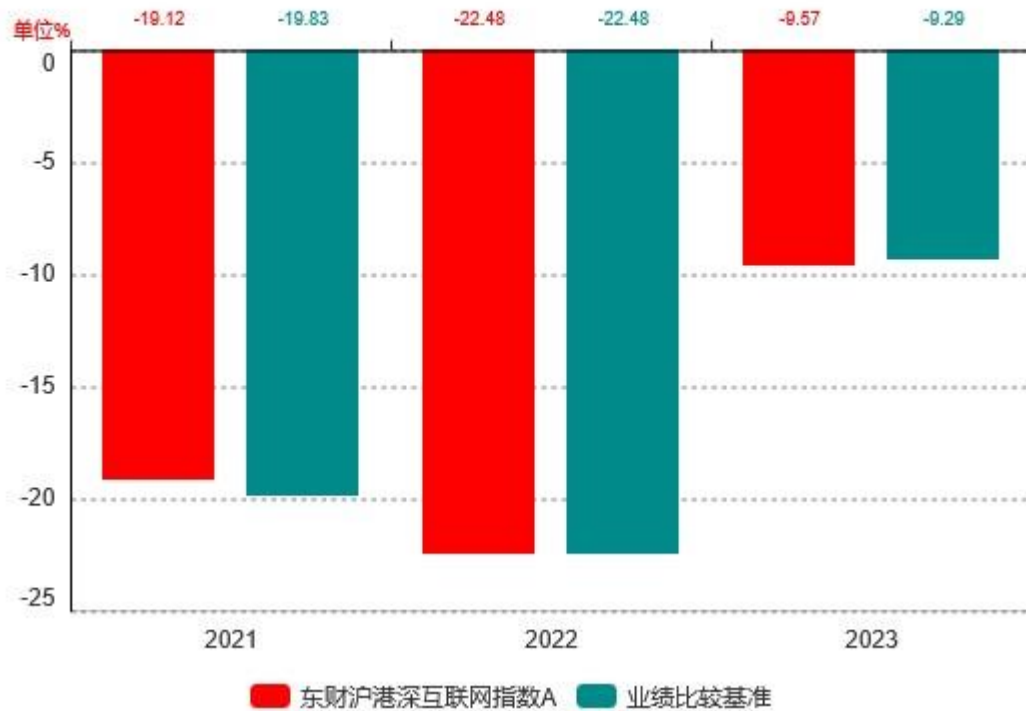
## （二）投资组合资产配置图表 / 区域配置图表

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



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



### 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：

东财沪港深互联网指数A

| 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                  | 1.20%      |    |
|           | 100万 ≤ M < 200万           | 0.60%      |    |
|           | 200万 ≤ M < 500万           | 0.40%      |    |
|           | M ≥ 500万                  | 1000.00元/笔 |    |
| 赎回费       | N < 7天                    | 1.50%      |    |
|           | 7天 ≤ N < 30天              | 0.10%      |    |
|           | N ≥ 30天                   | 0.00       |    |

东财沪港深互联网指数C

| 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) |                           |         | C类份额不收取申购费 |
| 赎回费       | N < 7天                    | 1.50%   |            |

|  |                     |       |  |
|--|---------------------|-------|--|
|  | 7天 $\leq$ N $<$ 30天 | 0.10% |  |
|  | N $\geq$ 30天        | 0.00  |  |

## 东财沪港深互联网指数E

| 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) |                     |         | E类份额不收取申购费 |
| 赎回费      | N $<$ 7天            | 1.50%   |            |
|          | N $\geq$ 7天         | 0.00    |            |

注：投资者可阅读本基金招募说明书“第八部分基金份额的申购与赎回”了解基金费用详细情况。

## (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    | 1.00%  | 基金管理人和销售机构 |
| 托管费    | 0.10%  | 基金托管人      |
| 销售服务费A | A类份额不收取销售服务费   | 销售机构       |
| 销售服务费C | 0.40%  | 销售机构       |
| 销售服务费E | 0.40%  | 销售机构       |
| 审计费用   | 18,000.00  | 会计师事务所     |
| 信息披露费  | 80,000.00  | 规定披露报刊     |
| 其他费用   | 《基金合同》生效后与基金相关的律师费、仲裁费和诉讼费，基金份额持有人大会费用，基金的证券、期货交易和结算费用，基金的银行汇划费用，基金的相关账户开户及维护费用，因投资港股通标的股票而产生的各项费用，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 | 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。

- 3、本基金管理费、托管费、销售服务费收费方式均为每日计提，按月支付。
- 4、投资者可阅读本基金招募说明书“第十四部分基金费用与税收”了解基金费用详细情况。

### （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：

东财沪港深互联网指数A

|     | 基金运作综合费率（年化） |
|-----|--------------|
| 持有期 | 1.19%        |

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。

东财沪港深互联网指数C

|     | 基金运作综合费率（年化） |
|-----|--------------|
| 持有期 | 1.59%        |

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。

东财沪港深互联网指数E

|     | 基金运作综合费率（年化） |
|-----|--------------|
| 持有期 | 1.59%        |

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；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；投资股指期货的特定风险；参与融资及转融通证券出借业务的特定风险；投资流通受限证券的特定风险；投资证券公司短期公司债的特定风险；投资存托凭证的特定风险；基金管理人职责终止风险；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；其他风险。

其中，本基金的特定风险主要为：

1、指数化投资风险。2、跟踪偏离风险。3、跟踪误差控制未达约定目标的风险。4、指数编制机构停止服务的风险。5、成份股停牌的风险。6、成份股退市的风险。

7、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。

8、港股交易失败风险：港股通业务存在每日额度。在香港联合交易所开市前阶段，当日额度使用完毕的，新增的买单申报将面临失败的风险；在香港联合交易所持续交易时段，当日额度使用完毕的，当日本基金将面临不能通过港股通进行买入交易的风险。

9、汇率风险：本基金将投资港股通标的股票，在交易时间内提交订单依据的港币买入参考汇率和卖出参考汇率，并不等于最终结算汇率。港股通交易日日终，中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）进行净额换汇，将换汇成本按成交金额分摊至每笔交易，确定交易实际适用的结算汇率。故本基金投资面临汇率风险，汇率波动可能对基金的投资收益造成损失。

#### 10、境外市场的风险：

（1）本基金将通过港股通机制投资于香港市场，在市场进入、投资额度、可投资对象、税务政策等方面都有一定的限制，而且此类限制可能会不断调整，这些限制因素的变化可能对本基金进入或退出当地市场造成障碍，从而对投资收益以及正常的申购赎回产生直接或间接的影响。

（2）香港市场交易规则有别于内地A股市场规则，此外，在港股通机制下参与香港股票投资还将面临包括但不限于如下特殊风险：

1）港股市场实行T+0回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比A股更为剧烈的股价波动；

2）只有境内、香港两地均为交易日且能够满足结算安排、开通港股通交易的交易日才为港股通交易日，在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险；

3）香港出现台风、黑色暴雨或者香港联合交易所规定的其他情形时，香港联合交易所将可能停市，投资者将面临在停市期间无法进行港股通交易的风险；出现内地证券交易服务公司认定的交易异常情况时，内地证券交易服务公司可能暂停提供部分或者全部港股通服务，投资者将面临在暂停服务期间无法进行港股通交易的风险；

4）投资者因港股通股票权益分派、转换、上市公司被收购等情形或者异常情况，所取得的港股通股票以外的香港联合交易所上市证券，只能通过港股通卖出，但不得买入，证券交易所另有规定的除外；因港股通股票权益分派或者转换等情形取得的香港联合交易所上市股票的认购权利在香港联合交易所上市的，可以通过港股通卖出，但不得行权；因港股通股票权益分派、转换或者上市公司被收购等所取得的非香港联合交易所上市证券，可以享有相关权益，但不得通过港股通买入或卖出；

5）代理投票。由于中国结算是汇总投资者意愿后再向香港中央结算有限公司（以下简称“香港结算”）提交投票意愿，中国结算对投资者设定的意愿征集期比香港结算的征集期稍早结束；投票没有权益登记日的，以投票截止日的持有作为计算基准；投票数量超出持有数量的，按照比例分配持有基数。以上所述因素可能会给本基金投资带来特殊交易风险。

投资者可阅读本基金招募说明书“第十八部分风险揭示”了解风险提示详细情况。

## （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。

与本基金、本基金基金合同相关的争议解决方式为仲裁。因本基金产生的或与本基金基金合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会根据该会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为上海市。

## 五、 其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站：[www.dongcaijijin.com](http://www.dongcaijijin.com)，客服电话：400-9210-107

- 本基金基金合同、托管协议、招募说明书
- 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

## 六、 其他情况说明

无。