

浙商创业板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2月29日

送出日期：2024年3月1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	浙商创业板指数增强	基金代码	010749
下属分级基金的基金简称	浙商创业板指数增强A		浙商创业板指数增强C
下属分级基金的基金代码	010749		010750
基金管理人	浙商基金管理有限公司	基金托管人	招商银行股份有限公司
基金合同生效日	2021-03-19	上市交易所及上市日期	-
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	胡羿	开始担任本基金基金经理的日期	2021-08-03
		证券从业日期	2015-06-30

注：《基金合同》生效之日起满三年后的对应日，若基金资产规模低于2亿元，基金合同应当终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。中国证监会规定的特殊情形，从其规定。若届时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，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。

《基金合同》生效满三年后继续存续的，在基金存续期内，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并于六个月内召集基金份额持有人大会。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

二、基金投资与净值表现

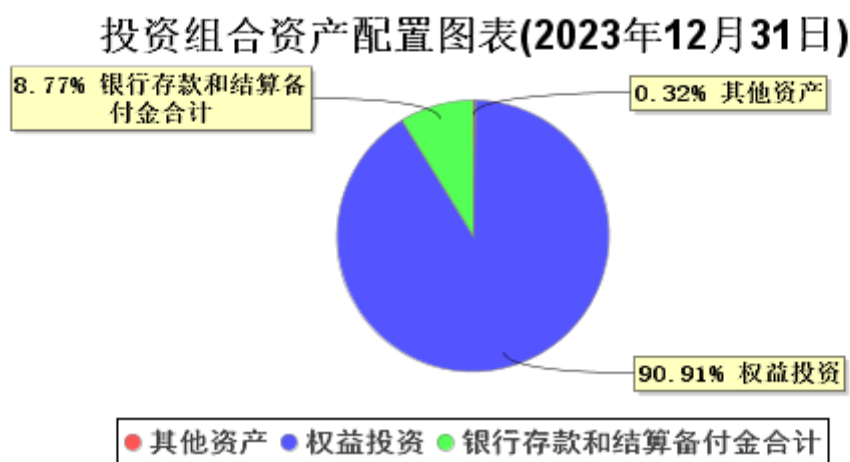
（一）投资目标与投资策略

投资者可阅读《浙商创业板指数增强型发起式证券投资基金招募说明书更新》第九部分“基金的投资”了解详细情况。

投资目标	本基金在指数化投资的基础上通过量化模型进行投资组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过8%。
------	--

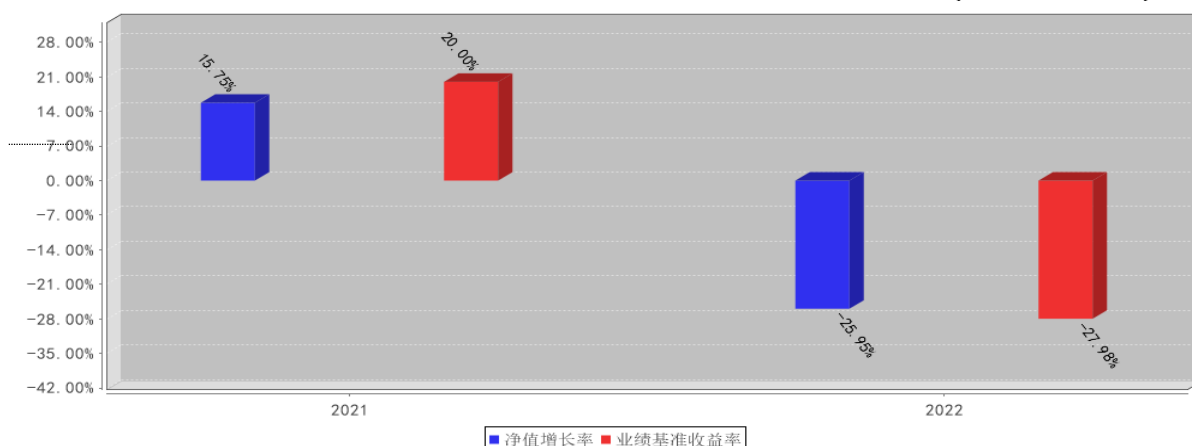
投资范围	<p>本基金主要投资于标的指数的成份股及备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金的投资范围还可包括国内依法发行上市的其他股票（含主板、中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、证券公司短期公司债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款等）、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。</p> <p>本基金可参与融资业务。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金可以将其纳入投资范围。</p>
主要投资策略	<p>1、股票（含存托凭证）投资策略；2、风险预估和控制；3、债券投资策略；4、可转换债券投资策略；5、可交换债券投资策略；6、资产支持证券投资策略；7、证券公司短期公司债券投资策略；8、衍生产品投资策略9、为了更好地实现投资目标，在综合考虑预期风险、收益、流动性等因素的基础上，本基金可参与融资业务。</p>
业绩比较基准	<p>创业板指数收益率×95%+中债综合指数收益率×5%</p>
风险收益特征	<p>本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金。本基金为指数型基金，采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金将投资于港股通标的股票，需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

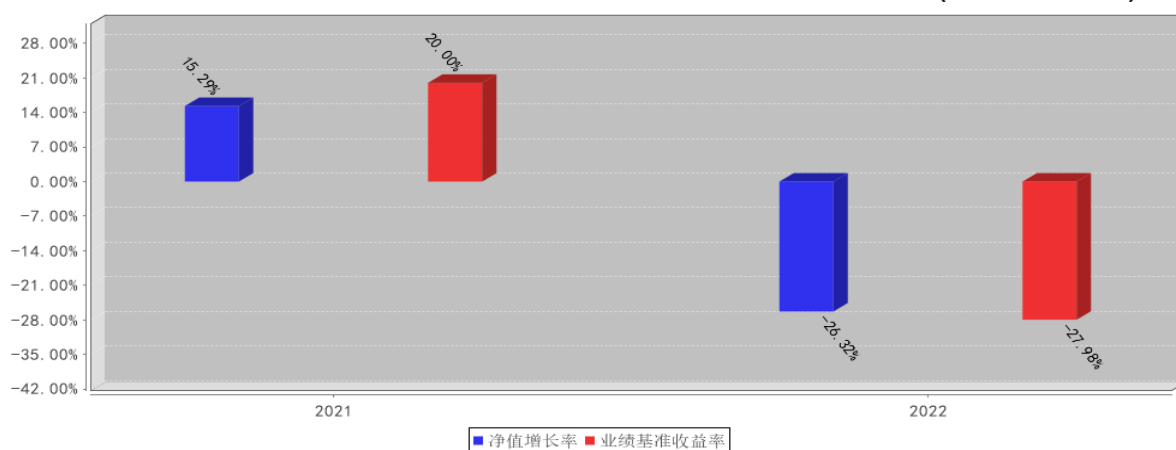


（三）自基金合同生效以来/最近十年（孰短）基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

浙商创业板指数增强A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)



浙商创业板指数增强C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:业绩表现截止日期2022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

以下费用在申购/赎回基金过程中收取:

浙商创业板指数增强 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<1,000,000	1.20%	-
	1,000,000=<M<3,000,000	0.80%	-
	3,000,000=<M<5,000,000	0.40%	-
	M>=5,000,000	1000元/每笔	-
赎回费	N<7日	1.50%	100%计入基金财产
	7日=<N<30日	0.75%	100%计入基金财产
	30日=<N<90日	0.50%	75%计入基金财产
	90日=<N<180日	0.50%	50%计入基金财产
	N>=180日	0%	-

浙商创业板指数增强 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
------	---------------------	---------	----

赎回费	N<7日	1.50%	100%计入基金财产
	7日≤N<30日	0.50%	100%计入基金财产
	N≥30日	0%	-

申购费：本基金A类基金份额的申购费用由A类基金份额的基金投资人承担，不列入基金财产，用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。本基金C类基金份额无申购费。

（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	-	0.80%
托管费	-	0.20%
销售服务费	浙商创业板指数增强A	-
	浙商创业板指数增强C	0.50%
	-	-
标的指数许可使用基点费	-	0.02%

注：指数许可使用费的收取下限为每季度人民币8000元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

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。

本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金。本基金为指数型基金，采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金将投资于港股通标的股票，需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。本基金投资运作过程中面临的主要风险有：市场风险、管理风险、流动性风险、操作或技术风险、合规性风险、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、本基金特定的风险及其他风险。

本基金特定的风险：

1、本基金为股票型基金，投资于股票资产占基金资产的比例不低于80%（其中，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0%-50%），投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%；无法完全规避股票市场整体下跌的系统性风险，在市场大幅上涨时也不能保证基金净值能够完全跟随或超越市场上涨幅度；

2、金融衍生品投资风险

3、投资于存托凭证的风险

4、资产支持证券投资风险

5、港股投资风险

（1）港股通投资限制

（2）汇率风险

（3）香港市场交易规则有别于内地A股市场规则，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) 只有内地和香港两地均为交易日且能够满足结算安排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、黑色暴雨或者联交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交易的风险；出现境内证券交易服务公司认定的交易异常情况时，境内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，可以通过港股通卖出，但不得买入，交易所另有规定的除外；因港股通股票发行人供股、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，但不得买入，其行权等事宜按照中国证监会、中国登记结算有限责任公司的相关规定处理；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，不得通过港股通买入或卖出。

5) 代理投票。

6、证券公司短期公司债券投资风险

7、融资业务风险

8、跟踪误差控制未达约定目标的风险

9、指数编制机构停止服务的风险

（二）重要提示

浙商创业板指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）由浙商基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）依照有关法律、法规发起，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2020年11月10日《关于准予浙商创业板指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》（证监许可【2020】2962号）准予注册。

中国证监会对本基金募集申请的注册，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资产，但不保证本基金一定盈利，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。各方当事人因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议应尽量通过协商、调解途径解决，如经友好协商未能解决的最终将通过仲裁方式处理，详见《基金合同》。

本产品资料概要有关财务数据和净值表现截止日如上图所示。本基金托管人招商银行股份有限公司已经复核了本次更新的产品资料概要。

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

以下资料详见浙商基金官方网站 [http://www.zsfund.com/] [客服电话：400-067-9908]

- 1、《浙商创业板指数增强型发起式证券投资基金基金合同》、
《浙商创业板指数增强型发起式证券投资基金托管协议》、
《浙商创业板指数增强型发起式证券投资基金招募说明书更新》
- 2、定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 3、基金发售公告
- 4、基金销售机构及联系方式
- 5、其他重要资料

六、其他情况说明

无