

# 富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金 基金产品资料概要更新

2024年06月06日（信息截至：2024年06月05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	富国中证价值 ETF	基金代码	512040
场内简称	价值 100ETF(国信价值)		
上市交易所	上海证券交易所	上市日期	2018年11月29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	2018年11月07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	曹璐迪	任职日期	2020年05月20日
		证券从业日期	2016年07月21日

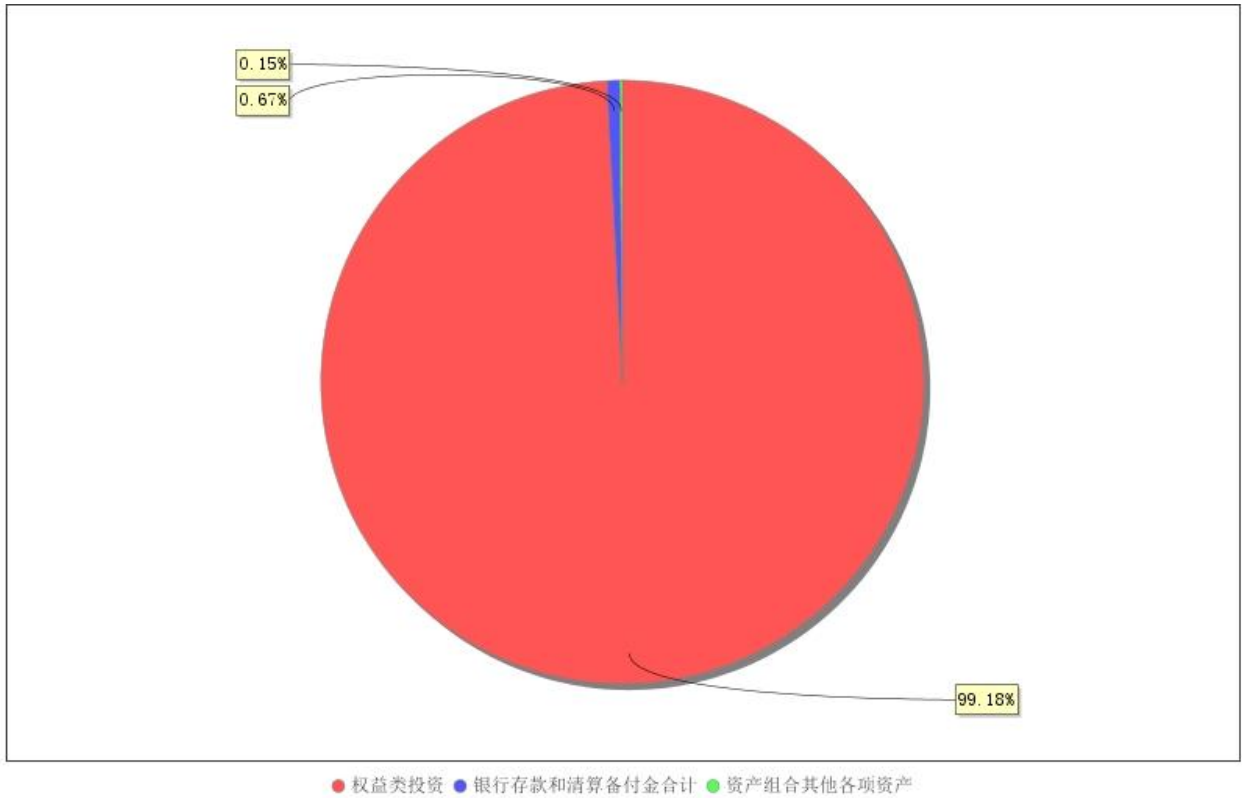
## 二、基金投资与净值表现

### （一）投资目标与投资策略

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资范围	本基金的投资范围主要为中证国信价值指数成份股及备选成份股。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、存托凭证、债券（国家债券、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据、中小企业私募债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生工具（权证、股指期货、国债期货等）、现金资产以及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）。 本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%。
主要投资策略	本基金主要采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年跟踪误差不超过2%。本基金的资产配置策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、存托凭证投资策略、衍生品投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中证国信价值指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

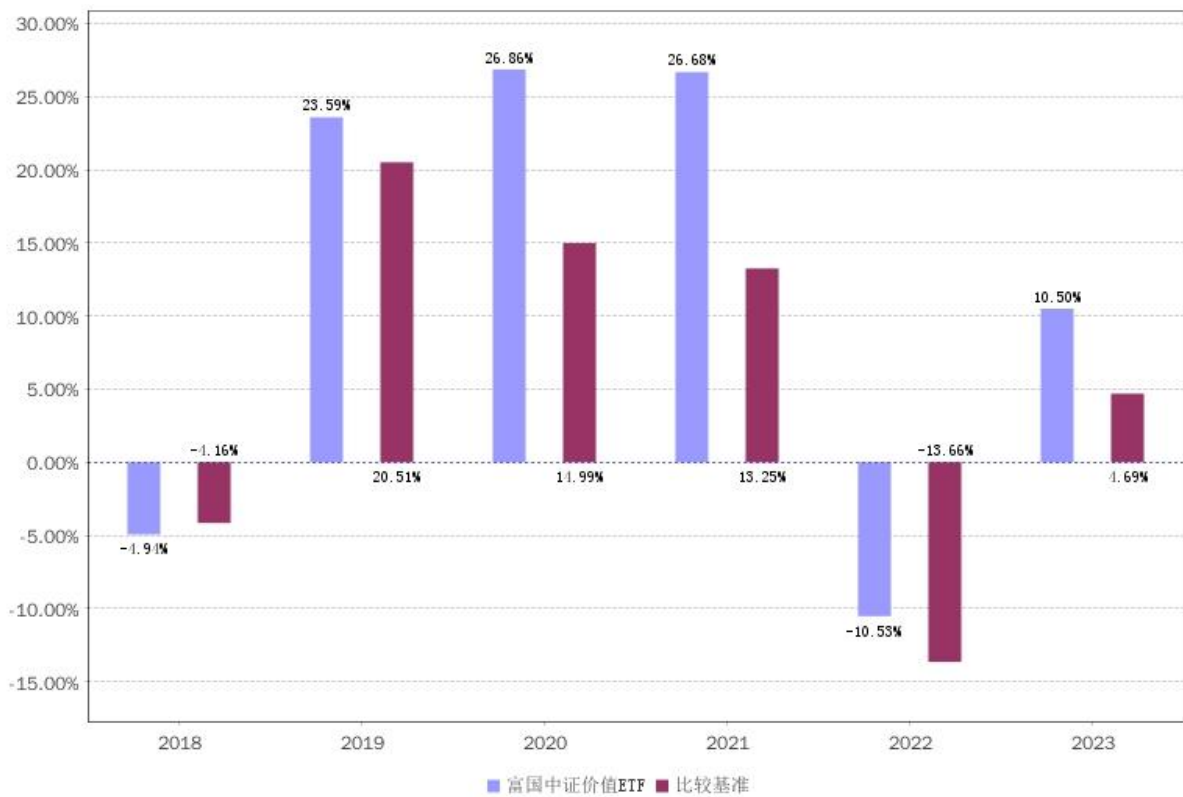
注：详情请阅读《招募说明书》中“基金的投资”章节的相关内容。

### （二）投资组合资产配置图表



注：截止日期 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



注：本基金合同生效日 2018 年 11 月 07 日。业绩表现截止日期 2023 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

注：投资者在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过 0.5% 的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记机构等收取的相关费用。

## （二）基金运作相关费用

费用类别	年费率/收费方式	收取方
管理费	0.60%	基金管理人、销售机构
托管费	0.10%	基金托管人
审计费用	38,000.00 元/年	会计师事务所
信息披露费	120,000.00 元/年	规定披露报刊
指数许可使用费	本基金指数许可使用费年费率为 0.03%。就每个计费季度而言，如当季度日均基金资产净值（日均基金资产净值=基金当季存续日的基金资产净值之和/基金当季存续天数，下同）大于人民币 5000 万元的，指数许可使用费的收取下限金额为每季度人民币 35,000 元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算；如当季度日均基金资产净值小于或等于人民币 5000 万元的，指数许可使用费不设下限。	指数编制公司

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。审计费用、信息披露费为基金整体承担的年费用金额，非单个份额类别费用。年费用金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。除上述费用外的其他运作费用，详见《招募说明书》中的“基金费用与税收”章节。

## （三）基金运作综合费用测算

基金运作综合费率（年化）
0.84%

注：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上表所示。基金管理费率、托管费率、指数许可使用费为基金现行费率，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。

本基金投资中的风险包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险等。

本基金的特定风险包括：（1）指数化投资的风险

本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，业绩表现将会随着标的指数的波动而波动；同时本基金在多数情况下将维持较高的股票仓位，在股票市场下跌的过程中，可能面临基金净值与标的指数同步下跌的风险。

（2）标的指数的风险

- 1) 标的指数波动的风险
- 2) 标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险
- 3) 标的指数值计算出错的风险
- 4) 标的指数编制方案带来的风险

- 5) 标的指数变更的风险
- 6) 成份股停牌的风险
- 7) 指数编制机构停止服务的风险

(3) 跟踪误差控制未达约定目标的风险

在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的，基金管理人将采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。

(4) 基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

尽管本基金将通过有效的套利机制使基金份额二级市场交易价格的折溢价控制在一定范围内，但基金份额在证券交易所的交易价格受诸多因素影响，存在不同于基金份额净值的情形，即存在价格折溢价的风险。

(5) 参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险

中证指数有限公司在开市后根据申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据，计算基金份额参考净值（IOPV），并将计算结果向上海证券交易所发送，由上海证券交易所对外发布，仅供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。IOPV 与实时的基金份额净值可能存在差异，IOPV 计算可能出现错误，投资者若参考 IOPV 进行投资决策可能导致损失，需投资者自行承担。

(6) 退补现金替代方式的风险

本基金在申购赎回环节新增了“退补现金替代”方式，该方式不同于现有其他现金替代方式，可能给申购和赎回投资者带来价格的不确定性，从而间接影响本基金二级市场价格的折溢价水平。极端情况下，如果使用“退补现金替代”证券的权重增加，该方式带来的不确定性可能导致本基金的二级市场价格折溢价处于相对较高水平。

(7) 基金份额赎回对价的变现风险

本基金赎回对价主要为组合证券，在组合证券变现过程中，由于市场变化、部分成份股流动性差等因素，导致投资者变现后的价值与赎回时赎回对价的价值有差异，存在变现风险。

(8) 套利风险

由于证券市场的交易机制和技术约束，完成套利需要一定的时间，因此套利存在一定风险。同时，买卖一篮子股票和 ETF 存在冲击成本和交易成本，所以折溢价在一定范围之内也不能形成套利。另外，当一篮子股票中存在涨停或临时停牌的情况时，也会由于买不到成份股而影响溢价套利，或卖不掉成份股而影响折价套利。

除以上风险外，本基金还可能存在退市风险、投资者申购失败的风险、投资者赎回失败的风险、基金份额赎回对价的变现风险、申购赎回清单差错风险、第三方机构服务的风险、中小企业私募债的投资风险、资产支持证券的投资风险、股指期货、国债期货等金融衍生品投资风险、科创板股票投资风险、基金投资存托凭证的风险。

## （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](http://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