

## 西藏东财中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(C类份额)基金产品资料概要更新

编制日期：2022年10月10日

送出日期：2022年10月11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    | 东财中证新能源车ETF发起式联接                                                                                                                                                          | 基金代码       | 010805      |
| 基金简称C   | 东财中证新能源车ETF发起式联接C                                                                                                                                                         | 基金代码C      | 010806      |
| 基金管理人   | 西藏东财基金管理有限公司                                                                                                                                                              | 基金托管人      | 广发证券股份有限公司  |
| 基金合同生效日 | 2020年12月16日                                                                                                                                                               | 上市交易所及上市日期 | 未上市         |
| 基金类型    | 基金中基金                                                                                                                                                                     | 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      | 2022年10月11日                                                                                                                                                               |            | 2010年06月28日 |
| 姚楠燕     | 2022年10月11日                                                                                                                                                               |            | 2017年06月12日 |
| 其他      | 发起式基金运作风险提示：基金合同生效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，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。 |            |             |

注：西藏东财中证新能源汽车指数型发起式证券投资基金自2022年10月11日起转型为西藏东财中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金，本次更新主要更新了基金名称、基金简称、基金经理任职日期、投资目标与投资策略、风险揭示与重要提示等部分。

### 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“第八部分基金的投资”了解详细情况

|      |                                                                     |
|------|---------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 本基金主要通过投资于目标ETF，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 | 本基金主要投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股及其备选成份股。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 |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>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）、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：本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%，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>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新能源汽车指数（399976.SZ）。</p>                                                                                                               |
| 主要投资策略 | <p>本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标ETF、标的指数成份股及其备选成份股进行被动式指数化投资，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。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> <p>1、资产配置策略</p> <p>为实现紧密跟踪标的指数的投资目标，本基金将以不低于基金资产净值90%的资产投资于目标ETF。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非标的指数成份股及其备选成份股、债券、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、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）。</p> <p>2、目标ETF投资策略</p> <p>本基金投资目标ETF的两种方式如下：</p> <p>（1）申购和赎回：以申购/赎回对价进行申购赎回目标ETF或者按照目标ETF法律文件的约定以其他方式申购赎回目标ETF。</p> <p>（2）二级市场方式：在二级市场进行目标ETF基金份额的交易。</p> <p>在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申购赎回的方式或二级市场买卖的方式投资于目标ETF。当目标ETF申购、赎回或交易模式进行了变更或调整，本基金也将作相应的变更或调整。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>基金可投资于标的指数成份股及其备选成份股，以更好的跟踪标的指数。同时，还可通过买入标的指数成份股及其备选成份股来构建组合以申购目标E</p> |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>TF。因此对标的指数成份股及其备选成份股的投资，主要采取复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金投资组合，并根据标的指数组成及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的个券时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，包括通过投资其他股票进行替代，以降低跟踪误差，优化投资组合的配置结构。</p> <p>4、存托凭证投资策略</p> <p>本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p>本基金的投资策略还包括：债券投资策略、可转换债券和可交换债券投资策略、证券公司短期公司债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略和融资及转融通证券出借业务投资策略等。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证新能源汽车指数收益率 $\times 95\%$ + 银行活期存款利率（税后） $\times 5\%$                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 风险收益特征 | <p>本基金为ETF联接基金，且目标ETF为采用指数化操作的股票型基金，因此本基金的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。本基金主要通过投资于目标ETF实现对标的指数的紧密跟踪，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。</p>                                                                                                                                                                                                                          |

## （二）投资组合资产配置图表 / 区域配置图表

注：西藏东财中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金无历史数据。

## （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：西藏东财中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金无历史数据。

## 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：

| 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%   |            |
|          | $7 \text{天} \leq N < 30$ 天 | 0.10%   |            |
|          | $N \geq 30$ 天              | 0.00    |            |

注：投资者可阅读本基金招募说明书“第七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 |
|------|----------|
| 管理费  | 0.50%    |
| 托管费  | 0.05%    |

|        |                                                                                                                                                     |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 销售服务费C | 0.40%                                                                                                                                               |
| 其他费用   | 除法律法规、中国证监会另有规定外，《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，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，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。 |

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、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。

3、本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费。

4、本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取托管费。

5、投资者可阅读本基金招募说明书“第十一部分基金费用与税收”了解基金费用详细情况。

#### 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；本基金的特有风险；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，本基金的特有风险主要为：

##### 1、投资于目标ETF基金带来的风险

由于主要投资于目标ETF，在多数情况下将维持较高的目标ETF投资比例，基金净值可能会随目标ETF的净值波动而波动，目标ETF的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。所以本基金会面临诸如目标ETF的管理风险与操作风险、目标ETF基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、目标ETF的技术风险等风险。

##### 2、跟踪偏离风险

本基金主要投资于目标ETF基金份额，追求跟踪标的指数，获得与指数收益相似的回报。以下因素可能会影响到基金的投资组合与跟踪基准之间产生偏离：

- （1）目标ETF与标的指数的偏离。
- （2）基金买卖目标ETF时所产生的价格差异、交易成本和交易冲击。
- （3）基金调整资产配置结构时所产生的跟踪误差。
- （4）基金申购、赎回因素所产生的跟踪误差。
- （5）基金现金资产拖累所产生的跟踪误差。
- （6）基金的管理费和托管费所产生的跟踪误差。
- （7）其他因素所产生的偏差。

##### 3、与目标ETF业绩差异的风险

本基金为目标ETF的联接基金，但由于投资方法、交易方式等方面与目标ETF不同，本基金的业绩表现与目标ETF的业绩表现可能出现差异。

#### 4、其他投资于目标ETF的风险

如目标ETF参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险、目标ETF退市风险、申购赎回失败风险等。

5、标的指数波动的风险：标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

6、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险：标的指数并不能完全代表整个股票市场。标的指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

#### 7、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，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。

#### 8、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。

#### 9、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。

#### 10、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进行调整。

11、本基金基金合同生效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“第十六部分风险揭示”了解风险提示详细情况。

## （二）重要提示

中国证监会接受西藏东财中证新能源汽车指数型发起式证券投资基金转型为本基金的备案，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。