

永赢深证创新 100 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 年第 1 号)

编制日期：2024-05-31

送出日期：2024-06-27

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	深创龙头 ETF	基金代码	159721
基金管理人	永赢基金管理 有限公司	基金托管人	中国银行股份有限公司
基金合同生效日	2021-06-17	上市交易所及上市日期	深圳证券交易所/2021-06-25
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	刘庭宇	开始担任本基金基金经理的 日期	2023-08-14
		证券从业日期	2018-07-02

其他

《基金合同》生效后，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 5000 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，基金管理人应当在十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，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决。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

投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。
为更好地实现基金的投资目标，本基金还可投资于非成份股（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据）、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相关规定）。

本基金可根据法律法规的规定参与融资业务以及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：本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于非现金资产的 80%且不低于基金资产净值的 90%；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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如果法律法规对该比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述比例。

本基金的标的指数为深证创新 100 指数。

主要投资策略

本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。主要投资策略有：股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、可转换债券和可交换债券投资策略、股指期货投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略和存托凭证投资策略。

业绩比较基准

深证创新 100 指数收益率

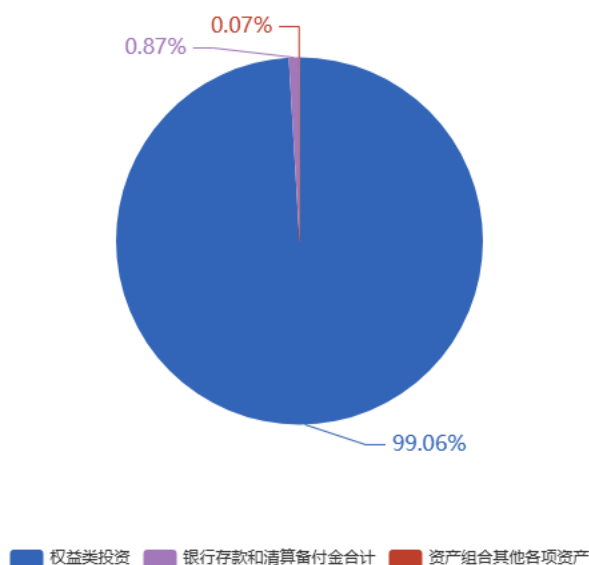
风险收益特征

本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。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：详见本基金招募说明书（更新）第十一部分“基金的投资”。

（二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

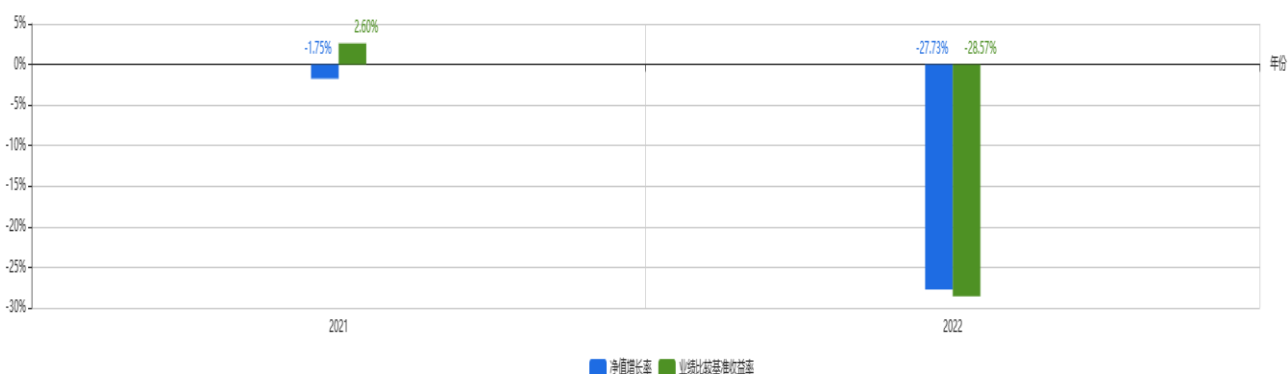
投资组合资产配置图表截止日为2023-09-30



注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

（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

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：1、数据截止日期：2022-12-31，基金的过往业绩不代表未来表现。

2、图中列示的 2021 年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期 06 月 17 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止计算。

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(Y)	收费方式/费率	备注
认购费	S < 50 万份	0.3%	
	50 万份 ≤ S < 100 万份	0.15%	
	100 万份 ≤ S	100 元/笔	

注：1、场内交易费用以证券公司实际收取为准；2、发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购、网下股票认购时可参照上述认购费率结构收取一定的佣金。

申购费：投资者在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理机构可按照不超过申购或赎回份额 0.80% 的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。

赎回费：投资者在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理机构可按照不超过申购或赎回份额 0.80% 的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。

（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	0.15%	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	-	销售机构
审计费用	20,000.00 元	会计师事务所
信息披露费	80,000.00 元	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、基金份额持有人大会费用等可以在基金财产中列支的其他费	-

用。费用类别详见本基金基金合同及招募说明书或其更新。

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、所披露相应费用为年金额的，该金额为基金整体承担费用，非单个份额类别（若有）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：

基金运作综合费率（年化）

0.37%

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的《招募说明书》等销售文件。

本基金的主要风险包括：投资组合的风险、流动性风险、管理风险、操作风险、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、本基金特有的风险及其他风险。本基金特有的风险有：

1、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。

2、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、投资人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。

3、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

由于标的指数调整成份股或变更编制方法、标的指数成份股发生配股或增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化、成份股派发现金红利、新股市值配售、成份股摘牌、流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合以及与基金运作相关的费用等因素使本基金产生跟踪偏离度和跟踪误差。

4、跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.2%以内，年化跟踪误差控制在2%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。

5、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。

6、IOPV 计算错误的风险

证券交易所发布的由基金管理人或其委托的机构计算的基金份额参考净值

(IOPV), 供投资人交易、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 计算也可能出现错误。投资人若参考 IOPV 进行投资决策可能导致损失, 需投资人自行承担后果。

7、退市风险

因本基金不再符合证券交易所上市条件被终止上市, 或被基金份额持有人大会决议提前终止上市, 导致基金份额不能继续进行二级市场交易的风险。

8、投资者申购失败的风险

本基金的申购、赎回清单中, 可能仅允许对部分成份股使用现金替代, 且设置现金替代比例上限。因此, 投资者在进行申购时, 可能存在因个别成份股涨停、临时停牌等原因而无法买入申购所需的足够的成份股, 导致申购失败的风险。

投资者申购当日未卖出的基金份额在交收成功后方可卖出和赎回。因此为投资者办理申购业务的申购赎回代理机构如发生交收违约, 将导致投资者不能及时、足额获得申购当日未卖出的基金份额, 投资者的利益可能受到影响。

9、投资者赎回失败的风险

基金管理人可能根据成份股市值规模变化等因素调整最小申购、赎回单位, 由此可能导致投资者按原最小申购、赎回单位申购并持有的基金份额, 可能无法按照新的最小申购、赎回单位全部赎回, 而只能在二级市场卖出全部或部分基金份额。

10、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。

11、申购赎回清单标识设置风险

基金管理人在进行申购赎回清单的现金替代标识设置时, 将充分考虑由此引发的市场套利等行为对基金持有人可能造成的利益损害。但基金管理人不能保证极端情况下申购赎回清单标识设置的完全合理性。

12、股指期货投资风险

金融衍生品是一种金融合约, 其价值取决于一种或多种基础资产或指数, 其评价主要源自于对挂钩资产的价格与价格波动的预期。投资于衍生品需承受市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和法律风险等。由于衍生品通常具有杠杆效应, 价格波动比标的工具更为剧烈, 有时候比投资标的资产要承担更高的风险。并且由于衍生品定价相当复杂, 不适当的估值有可能使基金资产面临损失风险。

本基金参与股指期货交易。股指期货交易采用保证金交易制度, 由于保证金交易具有杠杆性, 当出现不利行情时, 股指期货标的指数微小的变动就可能使投资人权益遭受较大损失。股指期货采用每日无负债结算制度, 如果没有在规定的时间内补足保证金, 按规定将被强制平仓, 可能给投资带来重大损失。此外, 交易所对股指期货的交易限制与规定会对基金投资股指期货的策略执行产生影响, 从而对基金收益产生不利影响。

13、资产支持证券投资风险

本基金拟投资资产支持证券, 除了面临债券所需要面临的信用风险、市场风险和流动性风险外, 还面临资产支持证券的特有风险: 提前赎回或延期支付风险, 可能造成基金财产损失。

14、基金收益分配后基金份额净值低于面值的风险

本基金收益分配原则为使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不以弥补亏损为前提，收益分配后可能存在基金份额净值低于面值的风险。

15、标的指数变更的风险

根据基金合同规定，如出现变更标的指数的情形，本基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资政策可能改变，投资组合需随之调整，基金的收益风险特征将与新的标的指数保持一致，投资者须承担此项调整带来的风险与成本。

16、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管理和维护，本基金将根据基金合同的约定自该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。

17、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) 停牌成份股可能因其权重占比、市场复牌预期、现金替代标识等因素影响本基金二级市场价格的折溢价水平。

(3) 若成份股停牌时间较长，在约定时间内仍未能及时买入或卖出的，则该部分款项将按照约定方式进行结算（具体见招募说明书“第十部分 基金份额的申购与赎回”之“七、申购、赎回清单的内容与格式”相关约定），由此可能影响投资者的投资损益并使基金产生跟踪偏离度和跟踪误差。

(4) 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对价，由此基金管理人可能在申购赎回清单中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ETF份额的风险。

18、第三方机构服务的风险

本基金的多项服务委托第三方机构办理，存在以下风险：

(1) 申购赎回代理机构因多种原因，导致代理申购、赎回业务受到限制、暂停或终止，由此影响对投资者申购赎回服务的风险。

(2) 登记结算机构可能调整结算制度，对投资者基金份额、组合证券及资金的结算方式发生变化，制度调整可能给投资者带来理解偏差的风险。同样的风险还可能来自于证券、期货交易所及其他代理机构。

(3) 证券、期货交易所、登记结算机构、基金托管人及其他代理机构可能

违约，导致基金或投资者利益受损。

19、存托凭证投资风险

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外证券交易机制、法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

20、参与转融通证券出借业务的风险

本基金可参与转融通证券出借业务，面临的风险包括但不限于：（1）流动性风险，指面临大额赎回时，可能因证券出借原因发生无法及时变现兑付赎回对价的风险；（2）信用风险，指证券出借对手方可能无法及时归还证券、无法支付相应权益补偿及借券费用的风险；（3）市场风险，指证券出借后可能面临出借期间无法及时处置证券的市场风险；（4）其他风险，如宏观政策变化、证券市场剧烈波动、个别证券出现重大事件、交易对手方违约、业务规则调整、信息技术不能正常运行等风险。

（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。

各方当事人同意，因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交上海国际经济贸易仲裁委员会（上海国际仲裁中心），根据提交仲裁时该会的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。

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[本公司网站：www.maxwealthfund.com][客服电话：400-805-8888]

- 基金合同、托管协议、招募说明书
- 定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 基金份额净值
- 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。